

【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26年2月4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】 山部 努  
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26年2月5日から平成27年2月3日まで）  
各ファンドについて、3兆円を上限とし、合計で9兆円を上限  
とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

## 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。

消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、2.16%となります。

- ・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）

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26年2月5日から平成27年2月3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てします。

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。この時刻を過ぎで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〉

単体型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単体型投信	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。

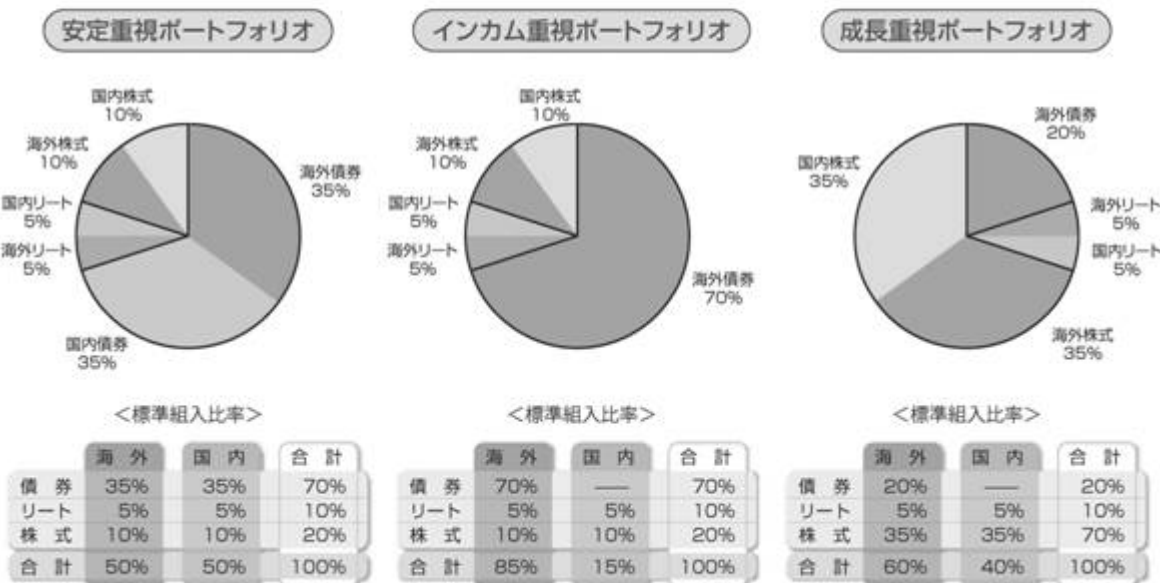
#### < ファンドの特色 >

## 1 内外の債券、リートおよび株式に投資します<sup>(注)</sup>。

(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<sup>※1</sup>、国債以外の格付けは、取得時においてAA格相当以上<sup>※2</sup>とすることを基本とします。

## 債券の格付けについて

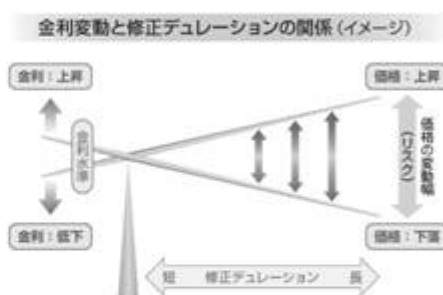


債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ（Moody's）やスタンダード・アンド・プアーズ（S&P）といった格付会社が各債券の格付けを行なっています。付与された格付けは、随時見直しが行なわれ、発行体の財務状況の変化などによって格上げや格下げが行なわれることがあります。

- 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。

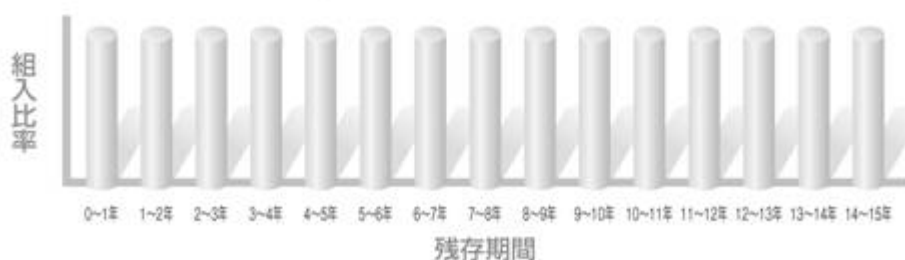


- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

## 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&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- ・米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- ・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。

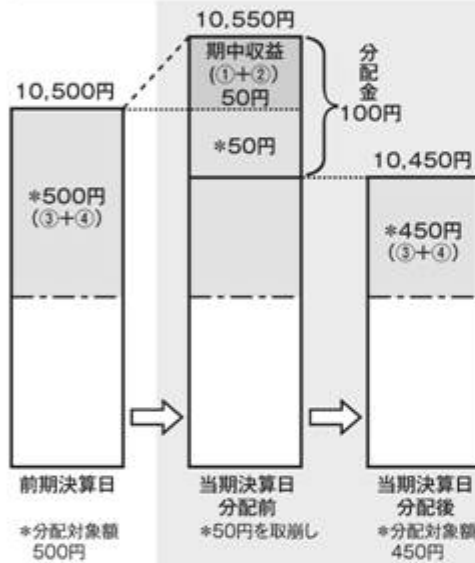
投資信託で分配金が  
支払われるイメージ



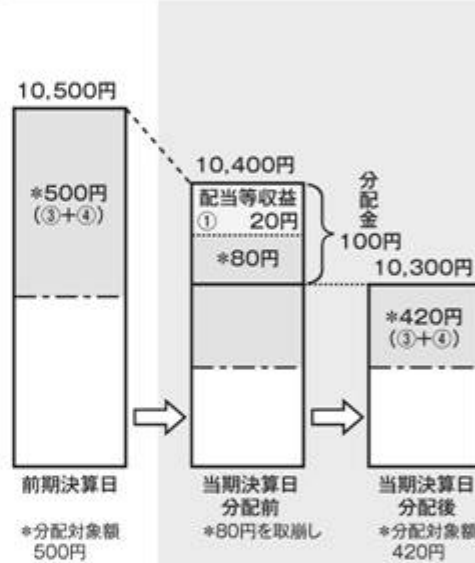
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

（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）

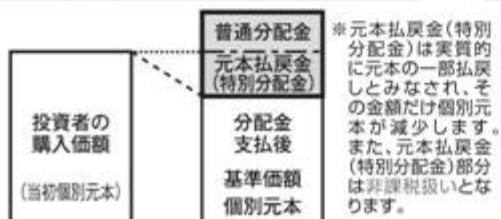


（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

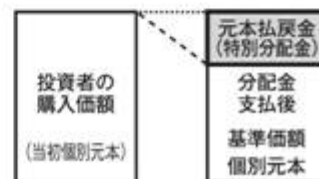
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがいさか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	販売会社	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。 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	
1	収益分配金、償還金など お申込金(5)		
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	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。 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	
運用指図	2	損益 信託金(5)	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。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。 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	
		損益 投資	
投資対象	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。 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)。 ・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経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

< 委託会社の概況（平成25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

## &lt;安定重視ポートフォリオ&gt;

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ないません。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ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

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。

## &lt;インカム重視ポートフォリオ&gt;

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ないません。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）

## &lt;成長重視ポートフォリオ&gt;

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ないません。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%

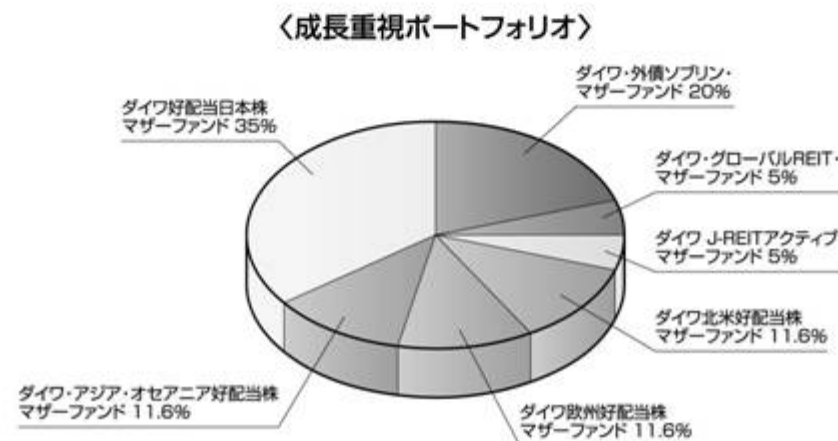
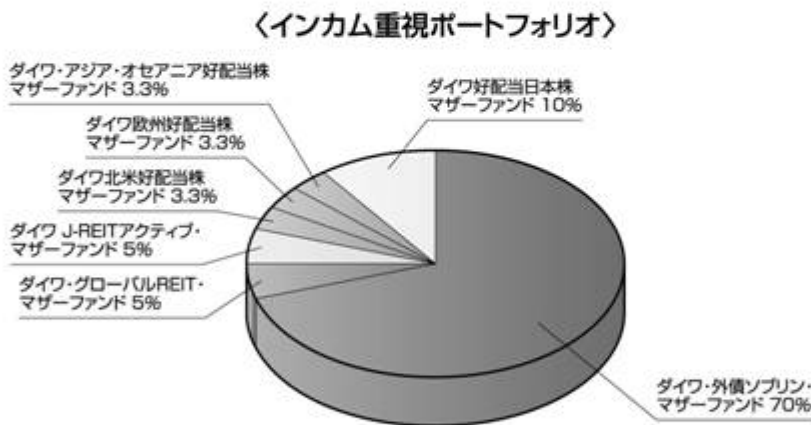
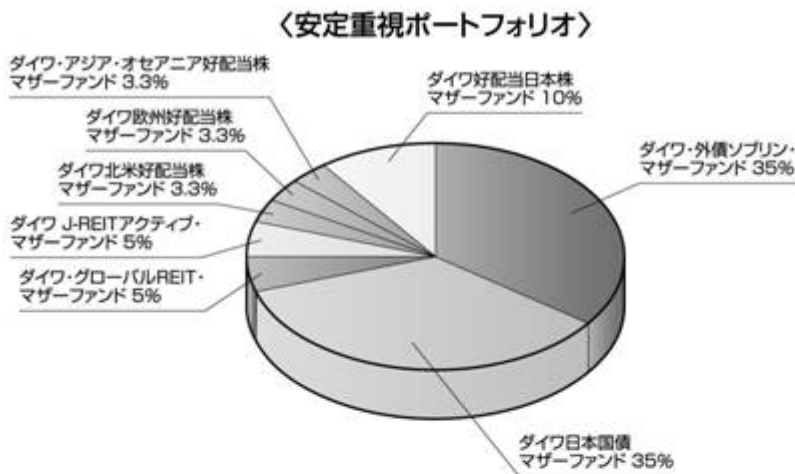
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の11.6%

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。）

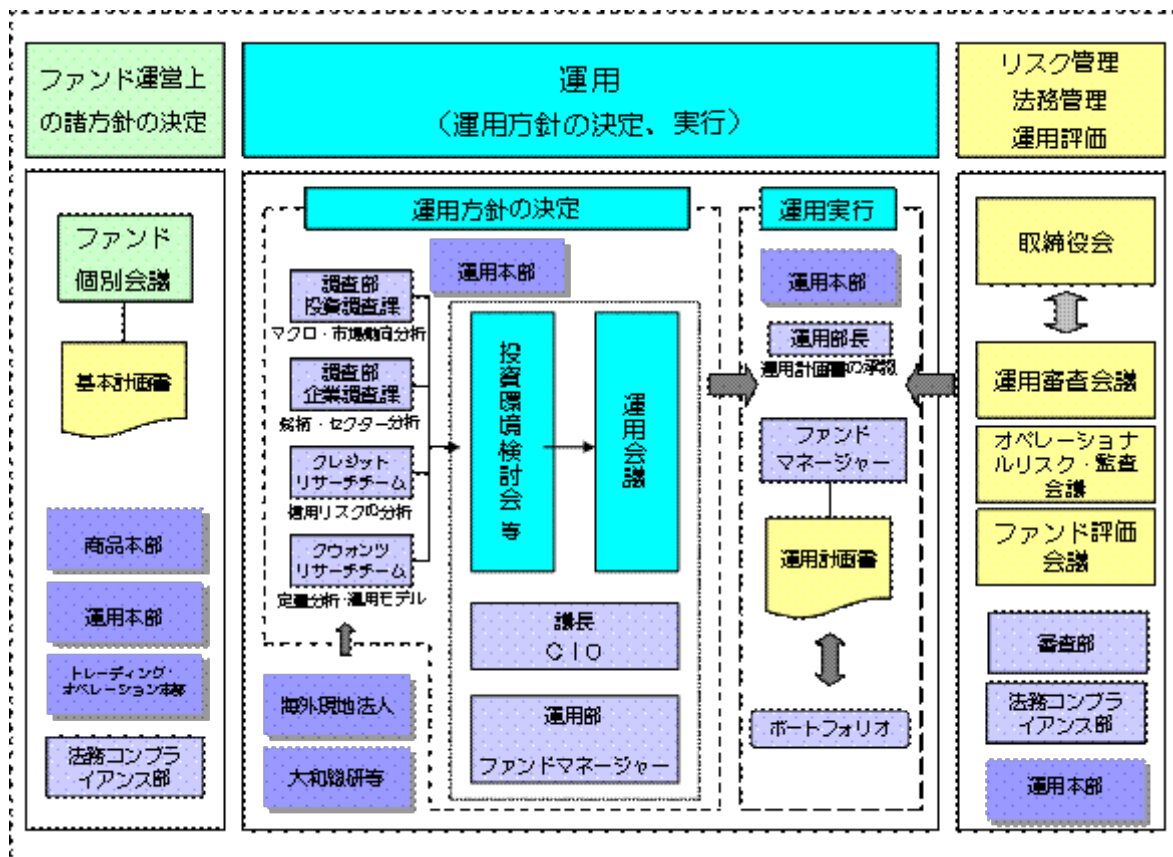
3. コール・ローン

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CIO (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

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

#### 職務権限

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

#### イ．CIO (Chief Investment Officer) (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．Deputy-CIO（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．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．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オペレーショナルリスク・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オペレーショナルリスク・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。

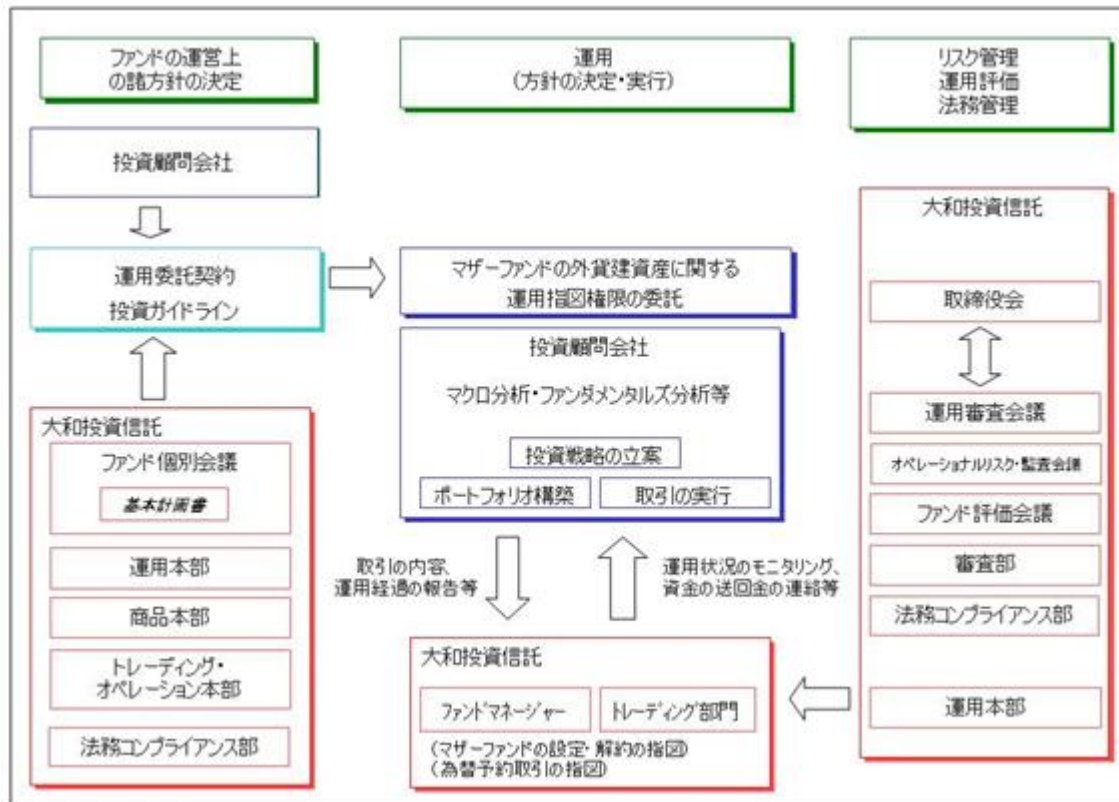
これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

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みます。）



#### イ．ファンド運営上の諸方針の決定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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25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AA格相当以上（ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上）とすることを基本とします。

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

ニ．金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建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ます。

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。

二．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、コーペン&ステアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

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



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

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

#### <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ます。

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

イ．有価証券

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

#### 八．約束手形

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．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

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

12．外国の者の発行する証券または証書で、前1.または前5.の証券または証書の性質を有するハイブリッド優先証券

13．前12.以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

15．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

16．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

17．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

20．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

## 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

## 20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

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

（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

### (3) 主な投資制限

#### <各ファンド共通>

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

- 1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売り約と合わせて、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

## &lt;ダイワ北米好配当株マザーファンド&gt;

（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）

## &lt;ダイワ欧州好配当株マザーファンド&gt;

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）

## &lt;ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド&gt;

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、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 〈基準価額の主な変動要因〉

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

○当ファンドの各資産の組入比率は標準組入比率を目標に決定されます。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があります。

#### 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〉

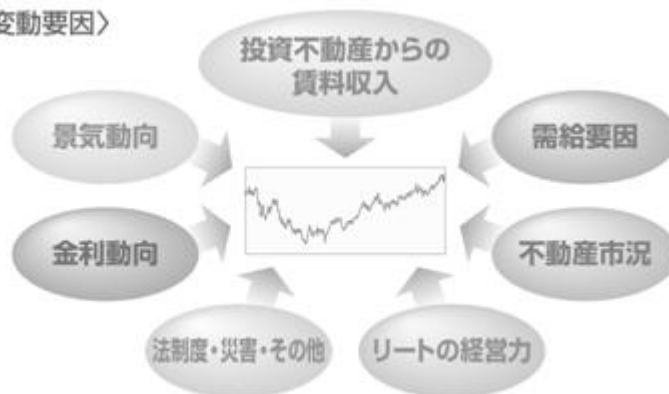


※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

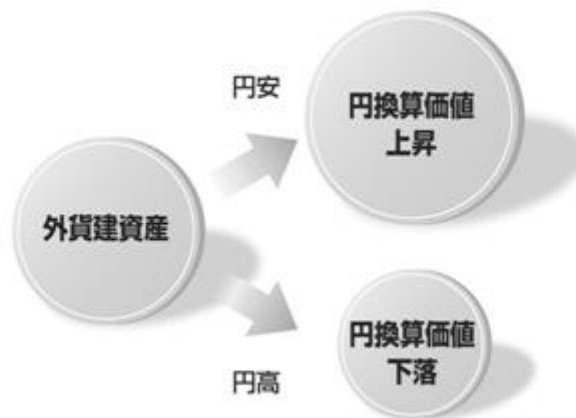
- ・リーートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リーートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リーートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリーートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リーートの価格が大幅に下落することも想定されます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カンントリー・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

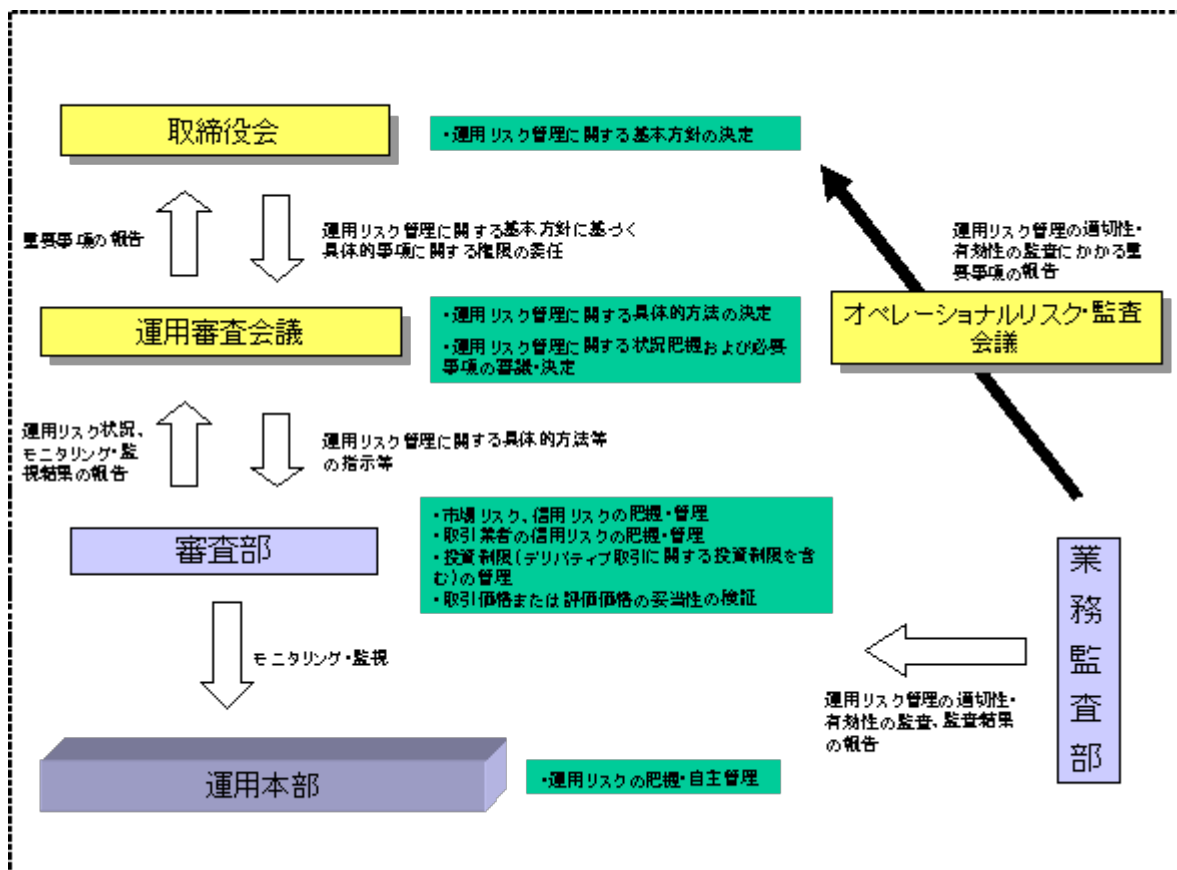
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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け付けを中止することがあります。ご換金の申込み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け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。

消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、2.16%となります。

- ・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）

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%）

消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、それぞれ年率1.296%、年率1.377%、年率1.458%となります。

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

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

## 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1.20%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.60% （税抜）	年率0.05% （税抜）
100億円超 200億円以下の部分		年率0.65% （税抜）	
200億円超 500億円以下の部分		年率0.70% （税抜）	
500億円超 1,000億円以下の部分		年率0.75% （税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.80% （税抜）	

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

## 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1.35%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.70% （税抜）	年率0.05% （税抜）
100億円超 200億円以下の部分		年率0.75% （税抜）	
200億円超 500億円以下の部分		年率0.80% （税抜）	
500億円超 1,000億円以下の部分		年率0.85% （税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.90% （税抜）	

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

## イ．ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

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

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

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

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

#### (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、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、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、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

#### ハ．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。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、平成26年1月1日以降の少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

#### 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、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、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。

なお、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26年1月1日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 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25年11月29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	1,816,465,914	99.11
内 日本	1,816,465,914	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	16,307,195	0.89
純資産総額	1,832,773,109	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25年11月29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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	418,151,217	1.4649 612,549,779	1.5274 638,684,168	34.85
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	538,106,545	1.1841 637,171,968	1.1840 637,118,149	34.76
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	97,687,641	1.7786 173,747,239	1.8649 182,177,681	9.94
4	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	64,773,833	1.3400 86,803,413	1.3715 88,837,311	4.85
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	51,427,300	1.6221 83,420,223	1.6672 85,739,594	4.68
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	36,128,899	1.6854 60,891,646	1.7373 62,766,736	3.42
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	44,825,906	1.2938 57,995,758	1.3729 61,541,486	3.36
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	39,757,714	1.4195 56,436,076	1.4991 59,600,789	3.25

(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	99.11%
合計	99.11%

(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)	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
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
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
平成24年11月末日	2,343,951,910	-	0.7752	-
12月末日	2,392,287,457	-	0.8080	-
平成25年1月末日	2,447,524,299	-	0.8374	-
2月末日	2,406,110,229	-	0.8482	-

3月末日	2,152,964,452	-	0.8728	-
4月末日	2,147,346,837	-	0.9119	-
第15特定期間末 (平成25年5月10日)	2,142,721,022	2,154,379,012	0.9190	0.9240
5月末日	2,028,924,226	-	0.8949	-
6月末日	1,914,120,574	-	0.8650	-
7月末日	1,861,370,283	-	0.8647	-
8月末日	1,863,315,100	-	0.8555	-
9月末日	1,880,478,055	-	0.8784	-
10月末日	1,857,553,026	-	0.8929	-
第16特定期間末 (平成25年11月11日)	1,828,381,467	1,838,763,868	0.8805	0.8855
11月末日	1,832,773,109	-	0.9035	-

## 【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
第15特定期間	0.0170
第16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	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
第15特定期間	24.6
第16特定期間	2.6

## (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
第15特定期間	29,124,357	749,254,227
第16特定期間	67,499,016	322,616,895

(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25年11月29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	62,514,041,325	87.71
内 ユーロ	19,896,160,337	27.92
内 ノルウェー	142,175,405	0.20
内 スウェーデン	146,740,148	0.21
内 デンマーク	1,698,494,820	2.38
内 イギリス	7,270,822,909	10.20
内 ポーランド	5,371,123,041	7.54
内 チェコ	1,354,957,186	1.90
内 カナダ	6,428,817,932	9.02
内 アメリカ	16,397,183,697	23.01
内 オーストラリア	3,807,565,850	5.34
特殊債券	6,134,234,773	8.61
内 ノルウェー	123,298,944	0.17
内 カナダ	5,806,197,061	8.15
内 オーストラリア	204,738,768	0.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,622,925,221	3.68

純資産総額	71,271,201,319	100.00
-------	----------------	--------

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	186,100,000	0.26
内 日本	186,100,000	0.26

(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25年11月29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	数 種類 は	株数、口 また 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	40,000,000	136.36 5,586,418,116	135.95 5,569,886,376	8.125000 2019/08/15	7.82
2	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	35,000,000	137.19 4,918,059,891	137.14 4,916,057,580	9.000000 2018/11/15	6.90
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	17,000,000	152.85 3,623,801,159	154.92 3,673,064,009	8.500000 2023/04/25	5.15
4	BELGIUM GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	25,000,000	98.36 3,429,642,158	99.12 3,456,132,585	2.250000 2023/06/22	4.85
5	BELGIUM GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	19,000,000	115.66 3,064,787,603	116.70 3,092,485,056	4.250000 2022/09/28	4.34
6	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	30,000,000	103.54 2,891,391,510	102.50 2,862,237,924	4.750000 2027/04/21	4.02
7	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	75,000,000	104.43 2,601,090,225	104.60 2,605,324,500	5.000000 2016/04/25	3.66
8	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	18,000,000	137.59 2,536,623,337	137.97 2,543,670,345	7.125000 2023/02/15	3.57
9	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	12,200,000	115.77 2,364,630,034	115.30 2,355,030,172	5.000000 2018/03/07	3.30
10	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	20,000,000	114.74 2,221,004,220	115.80 2,241,444,156	4.000000 2041/06/01	3.14
11	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	9,500,000	140.95 2,241,795,655	139.80 2,223,505,020	8.000000 2021/06/07	3.12
12	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	15,000,000	141.39 2,172,297,474	141.75 2,177,812,791	7.625000 2022/11/15	3.06
13	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	20,000,000	109.29 2,115,417,240	109.99 2,128,985,796	4.100000 2018/12/15	2.99
14	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	20,000,000	103.58 2,004,928,353	103.69 2,007,062,352	2.750000 2016/06/15	2.82
15	BELGIUM GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	10,800,000	128.98 1,942,704,297	130.40 1,964,058,133	5.500000 2028/03/28	2.76
16	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	11,400,000	163.04 1,798,862,441	163.26 1,801,267,617	9.000000 2025/06/01	2.53

17	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	8,500,000	150.65 1,785,849,451	151.49 1,795,848,733	6.500000 2027/07/04	2.52
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	8,500,000	149.11 1,767,564,851	150.40 1,782,856,640	8.250000 2022/04/25	2.50
19	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	40,000,000	100.82 1,339,339,374	100.37 1,333,315,080	3.750000 2018/04/25	1.87
20	BELGIUM GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	8,000,000	113.85 1,270,246,307	114.49 1,277,364,345	4.000000 2019/03/28	1.79
21	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	8,200,000	142.26 1,194,804,066	141.66 1,189,756,604	8.125000 2021/05/15	1.67
22	Czech Republic Government Bond	チェコ	国債証券	172,000,000	130.65 1,143,814,620	132.33 1,158,540,193	5.700000 2024/05/25	1.63
23	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	5,700,000	117.08 1,117,287,415	117.62 1,122,440,602	4.500000 2042/12/07	1.57
24	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	50,000,000	113.42 1,060,505,050	114.26 1,068,340,350	4.000000 2017/11/15	1.50
25	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	5,000,000	120.03 1,004,812,985	120.37 1,007,617,270	5.000000 2025/03/07	1.41
26	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,000,000	142.94 996,755,485	144.15 1,005,192,815	6.250000 2027/07/15	1.41
27	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	7,000,000	146.77 994,341,915	146.71 993,915,115	8.000000 2023/06/01	1.39
28	EUROPEAN INVESTMENT BANK	カナダ	特殊債券	10,000,000	100.69 974,487,498	101.60 983,333,190	2.625000 2018/09/24	1.38
29	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	12,000,000	85.39 953,827,992	84.63 945,327,926	3.250000 2029/04/21	1.33
30	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	5,300,000	158.66 813,841,601	158.80 814,539,192	8.000000 2027/06/01	1.14

(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	87.71%
特殊債券	8.61%
合計	96.32%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル売/円買 2013年12月	売建	2,000,000	185,889,400	186,100,000	0.26%

(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25年11月29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	305,620,081,489	99.38
内 日本	305,620,081,489	99.38
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,902,776,721	0.62
純資産総額	307,522,858,210	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25年11月29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	数 種類 は	株数、口 また 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	44 20年国債	日本	国債証券	10,435,000,000	114.78 11,977,406,320	113.86 11,882,230,150	2.500000 2020/03/20	3.86
2	40 20年国債	日本	国債証券	10,242,000,000	111.27 11,396,347,946	110.13 11,280,026,700	2.300000 2018/09/20	3.67
3	33 利付国債20年	日本	国債証券	10,124,000,000	112.79 11,419,616,460	110.32 11,168,796,800	3.800000 2016/09/20	3.63
4	27 利付国債20年	日本	国債証券	10,696,000,000	107.08 11,453,446,400	103.94 11,118,064,160	5.000000 2014/09/22	3.62
5	43 20年国債	日本	国債証券	9,572,000,000	117.20 11,218,514,100	115.40 11,046,758,040	2.900000 2019/09/20	3.59
6	70 20年国債	日本	国債証券	9,088,000,000	117.35 10,664,962,000	117.91 10,715,660,800	2.400000 2024/06/20	3.48
7	37利付国債20年	日本	国債証券	9,123,000,000	113.11 10,319,042,440	111.22 10,146,783,060	3.100000 2017/09/20	3.30
8	29 利付国債20年	日本	国債証券	9,400,000,000	110.33 10,371,867,499	107.40 10,096,069,999	4.200000 2015/09/21	3.28
9	64 20年国債	日本	国債証券	8,935,000,000	111.96 10,003,693,000	112.28 10,033,022,150	1.900000 2023/09/20	3.26
10	28 利付国債20年	日本	国債証券	9,088,000,000	110.00 9,997,435,810	106.35 9,665,542,400	5.000000 2015/03/20	3.14
11	42 20年国債	日本	国債証券	8,168,000,000	114.46 9,349,609,500	112.62 9,199,536,720	2.600000 2019/03/20	2.99
12	95 20年国債	日本	国債証券	7,755,000,000	115.94 8,991,860,750	117.89 9,143,067,450	2.300000 2027/06/20	2.97
13	34 利付国債20年	日本	国債証券	8,169,000,000	113.57 9,278,110,300	111.10 9,076,167,450	3.500000 2017/03/20	2.95
14	32 利付国債20年	日本	国債証券	8,193,000,000	110.94 9,089,667,750	108.28 8,871,626,190	3.700000 2016/03/21	2.88



15	38 利付国債20年	日本	国債証券	7,876,000,000	112.44 8,856,272,880	110.87 8,732,672,520	2.700000 2018/03/20	2.84
16	102 20年国債	日本	国債証券	7,320,000,000	115.60 8,462,110,200	118.90 8,704,138,800	2.400000 2028/06/20	2.83
17	24 利付国債20年	日本	国債証券	8,474,000,000	104.66 8,868,973,750	101.35 8,588,737,960	4.700000 2014/03/20	2.79
18	47 20年国債	日本	国債証券	7,630,000,000	113.40 8,652,965,700	112.54 8,587,488,700	2.200000 2020/09/21	2.79
19	80 20年国債	日本	国債証券	7,323,000,000	113.08 8,281,379,400	115.44 8,454,183,810	2.100000 2025/06/20	2.75
20	58 20年国債	日本	国債証券	7,275,000,000	111.41 8,105,580,700	111.84 8,136,651,000	1.900000 2022/09/20	2.65
21	52 20年国債	日本	国債証券	6,818,000,000	113.07 7,709,636,300	112.64 7,680,136,100	2.100000 2021/09/21	2.50
22	63 20年国債	日本	国債証券	6,758,000,000	110.97 7,499,755,160	111.23 7,517,261,300	1.800000 2023/06/20	2.44
23	68 20年国債	日本	国債証券	5,905,000,000	115.22 6,804,114,800	115.67 6,830,844,950	2.200000 2024/03/20	2.22
24	101 20年国債	日本	国債証券	5,410,000,000	120.32 6,509,543,000	118.99 6,437,683,600	2.400000 2028/03/20	2.09
25	88 20年国債	日本	国債証券	5,260,000,000	117.04 6,156,724,500	117.97 6,205,485,000	2.300000 2026/06/20	2.02
26	48 20年国債	日本	国債証券	5,351,000,000	115.41 6,176,078,160	114.90 6,148,780,590	2.500000 2020/12/21	2.00
27	91 20年国債	日本	国債証券	5,200,000,000	116.12 6,038,634,500	118.02 6,137,508,000	2.300000 2026/09/20	2.00
28	97 20年国債	日本	国債証券	5,240,000,000	114.79 6,015,058,800	116.52 6,106,014,800	2.200000 2027/09/20	1.99
29	106 20年国債	日本	国債証券	4,660,000,000	115.83 5,398,032,300	116.06 5,408,675,600	2.200000 2028/09/20	1.76
30	82 20年国債	日本	国債証券	4,585,000,000	114.21 5,236,986,900	115.50 5,296,041,800	2.100000 2025/09/20	1.72

(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	99.38%
合計	99.38%

(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25年11月29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	172,292,655,847	98.12
内 香港	4,170,069,286	2.37
内 シンガポール	8,537,432,214	4.86
内 イギリス	22,690,763,858	12.92
内 オランダ	4,571,093,716	2.60
内 フランス	15,259,317,506	8.69
内 ドイツ	960,394,323	0.55
内 カナダ	3,935,291,104	2.24
内 アメリカ	82,333,331,729	46.89
内 オーストラリア	29,834,962,111	16.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,293,323,520	1.88
純資産総額	175,585,979,367	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)	485,242,826	0.28
内 日本	485,242,826	0.28
為替予約取引(売建)	1,204,165,315	0.69
内 日本	1,204,165,315	0.69

(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25年11月29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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	596,376	15,538.34 9,266,695,529	15,540.18 9,267,794,324	5.28
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	325,278	24,816.90 8,072,393,875	26,846.05 8,732,429,452	4.97
3	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	5,316,356	1,555.33 8,268,697,547	1,597.18 8,491,213,627	4.84
4	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	36,168,538	157.30 5,689,499,104	155.44 5,622,167,753	3.20
5	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	12,162,383	440.26 5,354,712,904	454.23 5,524,524,095	3.15
6	KLEPIERRE	フランス	投資証券	975,235	4,327.44 4,220,274,654	4,776.50 4,658,214,854	2.65

7	DEXUS PROPERTY GROUP	オーストラリア	投資証券	47,736,772	96.24 4,594,827,807	97.26 4,643,288,981	2.64
8	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	463,801	8,742.57 4,054,813,265	9,131.76 4,235,322,759	2.41
9	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	1,034,033	3,822.31 3,952,399,226	3,942.14 4,076,308,848	2.32
10	FEDERATION CENTRES	オーストラリア	投資証券	18,594,442	206.63 3,842,310,868	218.73 4,067,311,054	2.32
11	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	4,434,719	853.67 3,785,903,466	857.19 3,801,398,553	2.16
12	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	投資証券	3,885,479	1,020.15 3,963,797,823	971.75 3,775,734,423	2.15
13	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	オーストラリア	投資証券	19,566,298	188.67 3,693,245,876	190.81 3,733,523,587	2.13
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	556,263	6,476.01 3,602,368,422	5,903.48 3,283,892,390	1.87
15	LINK REIT	香港	投資証券	6,390,420	476.88 3,047,469,880	499.33 3,190,979,542	1.82
16	CAPITAMALL TRUST	シンガポール	投資証券	19,693,884	159.12 3,133,690,822	157.89 3,109,585,508	1.77
17	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	578,612	5,613.64 3,248,119,583	5,326.86 3,082,187,548	1.76
18	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	293,381	10,843.71 3,181,349,269	10,407.92 3,053,486,095	1.74
19	CORIO NV	オランダ	投資証券	661,937	4,307.22 2,851,109,675	4,488.52 2,971,117,529	1.69
20	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	5,282,613	520.50 2,749,646,450	559.01 2,953,061,912	1.68
21	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	1,138,149	2,945.59 3,352,530,784	2,594.29 2,952,698,357	1.68
22	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	293,165	9,301.78 2,726,957,624	9,389.86 2,752,779,949	1.57
23	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	161,739	16,141.39 2,610,692,601	15,792.13 2,554,204,899	1.45
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	913,399	2,465.24 2,251,756,337	2,427.35 2,217,142,716	1.26
25	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	イギリス	投資証券	2,111,411	913.27 1,928,301,203	985.26 2,080,302,947	1.18
26	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	アメリカ	投資証券	1,622,876	1,066.19 1,730,297,733	1,168.61 1,896,512,693	1.08
27	FONCIERE DES REGIONS	フランス	投資証券	214,321	8,196.06 1,756,588,675	8,719.03 1,868,673,200	1.06
28	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	167,568	10,301.40 1,726,185,598	10,744.88 1,800,498,420	1.03
29	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	293,697	6,433.00 1,889,352,860	5,814.38 1,707,666,961	0.97
30	SUNTEC REIT	シンガポール	投資証券	13,488,555	130.39 1,758,878,004	126.07 1,700,529,106	0.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 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	98.12%
合計	98.12%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2013年12月	買建	4,738,237	483,629,074	485,242,826	0.28%
		豪ドル売/円買 2013年12月	売建	729,190	67,792,756	67,851,091	0.04%
		米ドル売/円買 2013年12月	売建	7,000,000	715,007,900	716,870,000	0.41%
		英ポンド売/円買 2013年12月	売建	2,505,491	415,836,318	419,444,224	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) 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25年11月29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	25,882,900,000	97.96
内 日本	25,882,900,000	97.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	538,434,149	2.04
純資産総額	26,421,334,149	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25年11月29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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	2,500	1,185,000.00 2,962,500,000	1,204,000.00 3,010,000,000	11.39
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	2,000	1,082,000.00 2,164,000,000	1,082,000.00 2,164,000,000	8.19

3	日本リートファンド	日本	投資証券	8,200	195,400.00 1,602,280,000	202,000.00 1,656,400,000	6.27
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	11,000	145,200.00 1,597,200,000	146,900.00 1,615,900,000	6.12
5	森ヒルズリート	日本	投資証券	1,700	659,000.00 1,120,300,000	700,000.00 1,190,000,000	4.50
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	1,163	926,410.19 1,077,415,056	990,000.00 1,151,370,000	4.36
7	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	4,800	219,000.00 1,051,200,000	222,100.00 1,066,080,000	4.03
8	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	1,000	948,000.00 948,000,000	958,000.00 958,000,000	3.63
9	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	18,000	45,150.00 812,700,000	48,200.00 867,600,000	3.28
10	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	800	1,004,000.00 803,200,000	997,000.00 797,600,000	3.02
11	GLP投資法人	日本	投資証券	7,600	98,300.00 747,080,000	102,500.00 779,000,000	2.95
12	産業ファンド	日本	投資証券	800	884,000.00 707,200,000	900,000.00 720,000,000	2.73
13	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	1,500	441,718.45 662,577,680	477,000.00 715,500,000	2.71
14	森トラスト総合リート	日本	投資証券	800	856,460.50 685,168,407	858,000.00 686,400,000	2.60
15	NMF投資法人	日本	投資証券	6,500	99,900.00 649,350,000	100,600.00 653,900,000	2.47
16	API投資法人	日本	投資証券	800	790,000.00 632,000,000	793,000.00 634,400,000	2.40
17	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	1,600	329,000.00 526,400,000	343,000.00 548,800,000	2.08
18	トップリート投資法人	日本	投資証券	1,000	437,500.00 437,500,000	452,000.00 452,000,000	1.71
19	大和ハウズリート	日本	投資証券	600	744,000.00 446,400,000	749,000.00 449,400,000	1.70
20	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	1,000	417,000.00 417,000,000	422,000.00 422,000,000	1.60
21	オリックス不動産投資	日本	投資証券	3,300	120,700.00 398,310,000	127,700.00 421,410,000	1.59
22	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	600	692,000.00 415,200,000	699,000.00 419,400,000	1.59
23	福岡リート投資法人	日本	投資証券	500	781,000.00 390,500,000	811,000.00 405,500,000	1.53
24	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	600	567,680.86 340,608,518	658,000.00 394,800,000	1.49
25	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	900	407,000.00 366,300,000	405,500.00 364,950,000	1.38
26	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	600	604,000.00 362,400,000	606,000.00 363,600,000	1.38
27	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	700	484,500.00 339,150,000	485,500.00 339,850,000	1.29

28	阪急リート投資法人	日本	投資証券	600	556,000.00 333,600,000	543,000.00 325,800,000	1.23
29	ケネディクスレジデンシャル	日本	投資証券	1,500	209,500.00 314,250,000	217,000.00 325,500,000	1.23
30	東急リアル・エステート	日本	投資証券	500	592,000.00 296,000,000	612,000.00 306,000,000	1.16

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.96%
合計	97.96%

(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25年11月29日現在）

###### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,784,941,943	73.03
内 カナダ	87,574,479	3.58
内 アメリカ	1,697,367,464	69.44
ハイブリッド優先証券	553,475,073	22.64
内 アメリカ	553,475,073	22.64
投資証券	53,897,742	2.21
内 アメリカ	53,897,742	2.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	51,965,972	2.13
純資産総額	2,444,280,730	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25年11月29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	数業種は	株数、口 また 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	1,195	50,804.41 60,711,278	55,917.22 66,821,082	2.73
2	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	4,700	12,144.96 57,081,329	12,538.25 58,929,805	2.41
3	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	8,100	5,398.55 43,728,321	5,887.10 47,685,523	1.95
4	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	16,600	2,496.99 41,450,193	2,747.92 45,615,615	1.87
5	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,294	9,476.92 40,694,184	10,344.42 44,418,939	1.82
6	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	4,534	8,971.99 40,679,012	9,606.99 43,558,120	1.78
7	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	アメリカ	株式	金融	4,400	8,220.22 36,169,008	9,144.05 40,233,853	1.65
8	CVS CAREMARK CORP	アメリカ	株式	生活必需品	5,575	6,113.44 34,082,483	6,837.55 38,119,393	1.56
9	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	11,283	3,006.02 33,917,003	3,265.14 36,840,683	1.51
10	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サービス	3,500	9,254.67 32,391,349	10,502.14 36,757,514	1.50
11	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	9,400	3,528.36 33,166,669	3,850.99 36,199,325	1.48
12	FORD MOTOR CO	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	19,800	1,759.57 34,839,597	1,744.21 34,535,409	1.41
13	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	7,226	4,276.03 30,898,629	4,534.13 32,763,648	1.34
14	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	生活必需品	3,900	7,648.72 29,830,030	8,288.85 32,326,517	1.32
15	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	8,700	3,474.08 30,224,552	3,626.69 31,552,222	1.29
16	AMERIPRISE FINANCIAL INC	アメリカ	株式	金融	2,800	9,682.78 27,111,803	11,115.64 31,123,799	1.27
17	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	14,200	2,390.48 33,944,856	2,178.47 30,934,322	1.27
18	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	アメリカ	株式	エネルギー	3,100	9,802.61 30,388,116	9,750.38 30,226,190	1.24
19	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	アメリカ	株式	金融	8,000	3,398.29 27,186,365	3,692.24 29,537,928	1.21
20	HEWLETT-PACKARD CO	アメリカ	株式	情報技術	10,300	2,374.19 24,454,619	2,802.21 28,862,775	1.18
21	MARATHON PETROLEUM CORP	アメリカ	株式	エネルギー	3,300	6,931.06 22,872,555	8,638.10 28,505,739	1.17
22	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	3,200	8,305.23 26,576,761	8,646.29 27,668,148	1.13
23	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	17,000	1,469.72 24,985,359	1,621.30 27,562,246	1.13

24	PNC FINANCIAL SERVICES VAR	アメリカ	ハイブリッド 優先証券	-	10,500	2,570.74 26,992,791	2,611.71 27,422,955	1.12
25	US BANCORP VAR	アメリカ	ハイブリッド 優先証券	-	10,000	2,678.28 26,782,830	2,740.75 27,407,592	1.12
26	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	2,697	9,701.22 26,164,197	9,940.88 26,810,567	1.10
27	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,500	7,652.82 26,784,878	7,615.95 26,655,829	1.09
28	WALT DISNEY CO	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	3,500	6,844.72 23,956,550	7,248.26 25,368,922	1.04
29	WELLS FARGO & COMPANY 8	アメリカ	ハイブリッド 優先証券	-	8,100	2,896.43 23,461,145	2,906.67 23,544,105	0.96
30	QUALCOMM INC	アメリカ	株式	情報技術	3,100	6,938.95 21,510,761	7,534.01 23,355,447	0.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	73.03%
ハイブリッド優先証券	22.64%
投資証券	2.21%
合計	97.87%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	10.06%
素材	3.20%
資本財・サービス	7.35%
一般消費財・サービス	7.15%
生活必需品	6.13%
ヘルスケア	8.48%
金融	13.84%
情報技術	13.59%
電気通信サービス	2.00%
公益事業	1.22%
合計	73.03%

(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25年11月29日現在）



## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		2,069,818,746	97.61
	内 ノルウェー	40,810,139	1.92
	内 スウェーデン	165,946,855	7.83
	内 イギリス	674,855,851	31.83
	内 オランダ	135,123,447	6.37
	内 フランス	275,267,400	12.98
	内 ドイツ	355,984,854	16.79
	内 スイス	289,411,009	13.65
	内 スペイン	80,236,351	3.78
	内 オーストリア	52,182,840	2.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		50,688,902	2.39
純資産総額		2,120,507,648	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)		11,068,183	0.52
	内 日本	11,068,183	0.52
為替予約取引(売建)		11,066,848	0.52
	内 日本	11,066,848	0.52

(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25年11月29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	数 業種 は	株数、口 また 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	13,075	6,975.69 91,207,245	7,490.53 97,938,680	4.62
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	イギリス	株式	エネルギー	26,418	3,385.23 89,431,070	3,429.59 90,603,138	4.27
3	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	78,881	1,154.86 91,096,763	1,141.80 90,066,673	4.25
4	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信 サービス	203,269	370.83 75,379,323	382.55 77,761,510	3.67
5	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	11,648	6,084.63 70,873,884	6,214.33 72,384,604	3.41
6	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	6,435	10,208.47 65,691,517	10,957.37 70,510,690	3.33
7	BAYER AG	ドイツ	株式	ヘルスケア	5,126	12,128.83 62,172,414	13,551.32 69,464,108	3.28

8	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	8,402	7,694.20 64,646,668	8,056.28 67,688,865	3.19
9	BASF SE	ドイツ	株式	素材	5,780	9,964.41 57,594,330	10,902.98 63,019,241	2.97
10	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	11,418	5,411.01 61,782,962	5,441.98 62,136,609	2.93
11	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	3,475	16,735.20 58,154,820	17,822.98 61,934,883	2.92
12	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	7,959	7,489.00 59,604,967	7,698.19 61,269,910	2.89
13	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	21,484	2,625.98 56,416,614	2,697.97 57,963,258	2.73
14	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	26,369	1,980.57 52,225,877	2,178.13 57,435,221	2.71
15	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	4,838	11,244.65 54,401,664	11,816.44 57,167,965	2.70
16	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	電気通信サービス	34,196	1,598.90 54,676,290	1,625.40 55,582,394	2.62
17	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	資本財・サービス	14,435	3,355.40 48,435,309	3,654.54 52,753,418	2.49
18	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	40,276	1,256.48 50,606,274	1,299.17 52,325,741	2.47
19	OESTERREICHISCHE POST AG	オーストリア	株式	資本財・サービス	10,621	4,469.69 47,472,609	4,913.17 52,182,840	2.46
20	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	3,562	12,724.33 45,324,065	13,704.73 48,816,263	2.30
21	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	スウェーデン	株式	生活必需品	15,835	2,497.79 39,552,631	3,007.07 47,617,001	2.25
22	ENAGAS	スペイン	株式	公益事業	17,266	2,591.86 44,751,126	2,702.03 46,653,379	2.20
23	SCHNEIDER ELECTRIC SA	フランス	株式	資本財・サービス	5,336	8,677.20 46,301,546	8,679.99 46,316,429	2.18
24	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	イギリス	株式	生活必需品	5,586	7,272.72 40,625,441	8,216.97 45,900,015	2.16
25	SWEDBANK AB - A SHARES	スウェーデン	株式	金融	16,865	2,466.45 41,596,814	2,640.39 44,530,262	2.10
26	REXAM PLC	イギリス	株式	素材	51,807	800.26 41,459,464	845.47 43,801,316	2.07
27	ATLAS COPCO AB-B SHS	スウェーデン	株式	資本財・サービス	16,053	2,701.50 43,367,308	2,645.09 42,461,726	2.00
28	KONINKLIJKE AHOLD NV	オランダ	株式	生活必需品	22,636	1,820.65 41,212,242	1,865.27 42,222,421	1.99
29	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	293	137,477.25 40,280,834	143,134.75 41,938,482	1.98
30	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	1,459	26,646.82 38,877,718	28,706.15 41,882,280	1.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.61%

合計	97.61%
----	--------

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	11.07%
素材	10.79%
資本財・サービス	12.63%
一般消費財・サービス	5.74%
生活必需品	13.95%
ヘルスケア	12.53%
金融	18.77%
電気通信サービス	7.46%
公益事業	4.67%
その他	0.01%
合計	97.61%

(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 2013年12月	買建	79,370	11,069,113	11,068,183	0.52%
		スイス・フラン売/円買 2013年12月	売建	20,838	2,357,815	2,357,606	0.11%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2013年12月	売建	40,699	685,366	684,959	0.03%
		英ポンド売/円買 2013年12月	売建	39,991	6,695,293	6,694,493	0.32%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2013年12月	売建	84,916	1,330,639	1,329,790	0.06%

(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25年11月29日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,788,826,473	93.08
内 韓国	410,281,873	21.35
内 中国	32,873,085	1.71
内 台湾	305,705,450	15.91
内 香港	174,803,440	9.10
内 シンガポール	151,015,488	7.86

	内 アメリカ	17,833,500	0.93
	内 オーストラリア	696,313,637	36.23
投資証券		18,257,642	0.95
	内 オーストラリア	18,257,642	0.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		114,818,500	5.97
純資産総額		1,921,902,615	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25年11月29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	数 業種 は	株数、口 また 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	900	139,342.20 125,407,980	144,768.60 130,291,740	6.78
2	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	25,000	3,066.98 76,674,650	3,071.64 76,791,000	4.00
3	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	台湾	株式	情報技術	115,000	560.52 64,459,800	610.69 70,229,350	3.65
4	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	株式	素材	20,000	3,263.38 65,267,696	3,461.64 69,232,904	3.60
5	WINS TECHNET CO LTD	韓国	株式	情報技術	37,703	1,724.82 65,030,888	1,778.11 67,040,270	3.49
6	TSMC	台湾	株式	情報技術	180,000	363.30 65,394,000	363.30 65,394,000	3.40
7	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	18,000	3,268.22 58,828,603	3,214.98 57,869,698	3.01
8	RIO TINTO LTD	オーストラリア	株式	素材	8,000	5,738.38 45,907,056	5,996.21 47,969,709	2.50
9	HYUNDAI MOTOR CO	韓国	株式	一般消費 財・サービス	1,800	25,387.80 45,698,040	24,709.50 44,477,100	2.31
10	SUNCORP GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	35,000	1,189.56 41,634,684	1,238.89 43,361,318	2.26
11	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	生活必需品	9,876	3,873.61 38,255,880	4,005.23 39,555,675	2.06
12	TELSTRA CORP LTD	オーストラリア	株式	電気通信 サービス	80,000	458.88 36,710,752	471.91 37,753,248	1.96
13	PRIMARY HEALTH CARE LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	80,000	447.71 35,817,184	464.46 37,157,536	1.93
14	HANG SENG BANK LTD	香港	株式	金融	22,000	1,686.91 37,112,174	1,672.38 36,792,492	1.91
15	DUET GROUP	オーストラリア	株式	公益事業	185,000	199.19 36,850,372	197.32 36,505,976	1.90
16	UNITED OVERSEAS BANK LTD	シンガポール	株式	金融	20,000	1,680.96 33,619,200	1,729.10 34,582,080	1.80

17	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	22,000	1,343.13 29,548,992	1,398.62 30,769,728	1.60
18	SK TELECOM	韓国	株式	電気通信サービス	1,300	22,141.65 28,784,145	21,996.30 28,595,190	1.49
19	GWA GROUP LTD	オーストラリア	株式	資本財・サービス	100,000	285.38 28,544,591	283.89 28,389,400	1.48
20	LOTTE SHOPPING CO	韓国	株式	一般消費財・サービス	750	38,671.59 29,003,695	37,839.45 28,379,588	1.48
21	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	台湾	株式	金融	407,456	69.37 28,266,445	66.95 27,279,587	1.42
22	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	6,000	4,583.72 27,502,765	4,524.61 27,147,713	1.41
23	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	18,000	1,392.48 25,064,818	1,505.10 27,091,800	1.41
24	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	オーストラリア	株式	金融	9,000	2,898.51 26,086,601	2,982.28 26,840,549	1.40
25	CATHAY FINANCIAL HOLDING	台湾	株式	金融	165,816	150.93 25,027,047	161.23 26,735,509	1.39
26	M1 LTD	シンガポール	株式	電気通信サービス	100,000	282.33 28,233,600	266.01 26,601,600	1.38
27	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	4,000	6,082.77 24,331,112	6,426.24 25,704,973	1.34
28	COMMONWEALTH BANK	オーストラリア	株式	金融	3,500	6,750.16 23,625,566	7,262.10 25,417,356	1.32
29	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	5,000	4,443.63 22,218,196	5,055.17 25,275,874	1.32
30	IOOF HOLDINGS LTD	オーストラリア	株式	金融	28,000	775.35 21,709,979	813.51 22,778,538	1.19

(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
株式	93.08%
投資証券	0.95%
合計	94.03%

(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

業種	投資比率
エネルギー	0.38%
素材	7.07%
資本財・サービス	7.05%
一般消費財・サービス	7.51%
生活必需品	2.59%
ヘルスケア	4.32%
金融	31.74%
情報技術	22.84%
電気通信サービス	7.00%
公益事業	2.59%
合計	93.08%

(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25年11月29日現在）

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		40,824,317,400	94.18
	内 日本	40,824,317,400	94.18
投資証券		1,442,739,000	3.33
	内 日本	1,442,739,000	3.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,080,024,971	2.49
純資産総額		43,347,081,371	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25年11月29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	数 業種 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	-	26,085	45,486.76 1,186,522,228	48,200.00 1,257,297,000	2.90
2	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	180,000	6,390.00 1,150,200,000	6,380.00 1,148,400,000	2.65
3	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	216,000	4,850.45 1,047,699,000	5,070.00 1,095,120,000	2.53
4	昭和シェル石油	日本	株式	石油・石炭製品	830,000	1,069.43 887,633,971	1,138.00 944,540,000	2.18
5	日鉄住金物産	日本	株式	卸売業	2,414,000	355.65 858,540,002	378.00 912,492,000	2.11
6	日本トリム	日本	株式	電気機器	104,200	7,050.00 734,610,000	8,400.00 875,280,000	2.02
7	東洋ゴム	日本	株式	ゴム製品	1,386,000	604.82 838,281,796	605.00 838,530,000	1.93
8	セイコーエプソン	日本	株式	電気機器	337,800	1,830.50 618,346,319	2,476.00 836,392,800	1.93
9	KDDI	日本	株式	情報・通信業	119,200	5,464.26 651,340,425	6,430.00 766,456,000	1.77

10	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,080,000	633.00 683,640,000	659.00 711,720,000	1.64
11	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	246,000	2,800.13 688,832,225	2,892.00 711,432,000	1.64
12	伊藤忠	日本	株式	卸売業	538,000	1,244.86 669,736,439	1,292.00 695,096,000	1.60
13	日本ヒューム	日本	株式	ガラス・土石製品	718,000	893.72 641,695,846	917.00 658,406,000	1.52
14	本田技研	日本	株式	輸送用機器	152,000	4,310.34 655,172,540	4,330.00 658,160,000	1.52
15	東ソー	日本	株式	化学	1,400,000	399.00 558,600,000	460.00 644,000,000	1.49
16	セブテーニHLDGS	日本	株式	サービス業	547,000	1,021.00 558,487,000	1,129.00 617,563,000	1.42
17	三菱商事	日本	株式	卸売業	304,000	1,990.88 605,231,120	2,015.00 612,560,000	1.41
18	テイ・エス テック	日本	株式	輸送用機器	156,000	3,850.82 600,728,000	3,590.00 560,040,000	1.29
19	アコーディア・ゴルフ	日本	株式	サービス業	380,000	1,153.22 438,224,960	1,198.00 455,240,000	1.05
20	ニホンフラッシュ	日本	株式	その他製品	172,200	2,810.00 483,882,000	2,590.00 445,998,000	1.03
21	バリューコマース	日本	株式	サービス業	303,200	1,473.79 446,855,610	1,455.00 441,156,000	1.02
22	あおぞら銀行	日本	株式	銀行業	1,470,000	293.00 430,710,000	295.00 433,650,000	1.00
23	加藤製作所	日本	株式	機械	650,000	625.11 406,322,503	640.00 416,000,000	0.96
24	レオン自動機	日本	株式	機械	741,000	443.52 328,648,366	558.00 413,478,000	0.95
25	ビジョン	日本	株式	その他製品	84,000	5,005.21 420,438,000	4,905.00 412,020,000	0.95
26	三社電機製作所	日本	株式	電気機器	684,000	546.00 373,464,000	589.00 402,876,000	0.93
27	極東証券	日本	株式	証券、商品 先物取引 業	211,500	1,710.96 361,870,000	1,878.00 397,197,000	0.92
28	小野薬品	日本	株式	医薬品	49,000	7,768.94 380,678,125	7,760.00 380,240,000	0.88
29	コメ兵	日本	株式	小売業	250,700	1,320.00 330,924,000	1,453.00 364,267,100	0.84
30	アートネイチャー	日本	株式	その他製品	150,000	2,010.00 301,500,000	2,422.00 363,300,000	0.84

(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。

#### □ . 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	94.18%
投資証券	3.33%
合計	97.51%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	3.46%
食料品	2.22%
繊維製品	0.12%
パルプ・紙	0.46%
化学	4.37%
医薬品	1.61%
石油・石炭製品	2.37%
ゴム製品	2.86%
ガラス・土石製品	4.43%
鉄鋼	0.90%
非鉄金属	0.84%
金属製品	3.97%
機械	6.91%
電気機器	7.93%
輸送用機器	9.55%
精密機器	0.84%
その他製品	4.79%
陸運業	0.84%
海運業	0.58%
倉庫・運輸関連業	0.88%
情報・通信業	5.61%
卸売業	11.88%
小売業	0.91%
銀行業	6.51%
証券、商品先物取引業	1.44%
その他金融業	0.48%
不動産業	1.72%
サービス業	5.70%
合計	94.18%

(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25年11月29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	2,059,198,595	99.17
内 日本	2,059,198,595	99.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,305,290	0.83



純資産総額	2,076,503,885	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25年11月29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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	950,257,396	1.4649 1,392,032,063	1.5274 1,451,423,146	69.90
2	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	109,146,942	1.7786 194,128,752	1.8649 203,548,132	9.80
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	73,810,821	1.3401 98,913,881	1.3715 101,231,541	4.88
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	59,525,904	1.6221 96,556,969	1.6672 99,241,587	4.78
5	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	50,042,631	1.2938 64,745,156	1.3729 68,703,528	3.31
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	39,318,292	1.6853 66,267,049	1.7373 68,307,668	3.29
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	44,522,042	1.4195 63,199,039	1.4991 66,742,993	3.21

(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	99.17%
合計	99.17%

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

#### 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
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
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
平成24年11月末日	2,286,953,041	-	0.6815	-
12月末日	2,383,943,676	-	0.7266	-
平成25年1月末日	2,452,199,322	-	0.7625	-
2月末日	2,396,551,432	-	0.7714	-
3月末日	2,414,500,028	-	0.7958	-
4月末日	2,463,692,256	-	0.8490	-
第15特定期間末 (平成25年5月10日)	2,478,019,937	2,492,374,885	0.8631	0.8681
5月末日	2,327,493,729	-	0.8354	-
6月末日	2,169,800,847	-	0.7904	-
7月末日	2,113,366,208	-	0.7891	-
8月末日	2,055,265,352	-	0.7760	-
9月末日	2,079,242,662	-	0.8006	-
10月末日	2,087,048,895	-	0.8186	-
第16特定期間末 (平成25年11月11日)	2,037,542,941	2,050,246,699	0.8019	0.8069
11月末日	2,076,503,885	-	0.8349	-

## 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
第15特定期間	0.0150
第16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
第15特定期間	35.0
第16特定期間	5.4

## (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	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
第15特定期間	15,840,309	555,898,540
第16特定期間	15,453,145	345,691,091

(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25年11月29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	9,431,536,036	99.16
内 日本	9,431,536,036	99.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	79,532,392	0.84
純資産総額	9,511,068,428	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25年11月29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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,768,088,655	1.7786 3,144,722,557	1.8649 3,297,308,532	34.67
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	1,237,727,254	1.4649 1,813,146,656	1.5274 1,890,504,607	19.88
3	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	747,161,218	1.4195 1,060,595,399	1.4991 1,120,069,381	11.78
4	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	637,919,628	1.6854 1,075,149,741	1.7373 1,108,257,769	11.65
5	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	799,223,739	1.2938 1,034,035,826	1.3729 1,097,254,271	11.54
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	275,716,594	1.6221 447,239,887	1.6672 459,674,705	4.83
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	334,281,277	1.3401 447,970,339	1.3715 458,466,771	4.82

(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
親投資信託受益証券	99.16%
合計	99.16%

(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
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
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
平成24年11月末日	8,540,679,257	-	0.6147	-
12月末日	8,989,929,100	-	0.6595	-
平成25年1月末日	9,647,916,155	-	0.7156	-
2月末日	9,710,500,759	-	0.7322	-
3月末日	10,067,757,071	-	0.7750	-
4月末日	10,688,992,996	-	0.8425	-
第15特定期間末 (平成25年5月10日)	10,860,474,430	10,910,648,846	0.8658	0.8698
5月末日	10,227,964,808	-	0.8315	-

6月末日	9,546,997,652	-	0.7865	-
7月末日	9,417,369,162	-	0.7962	-
8月末日	9,110,647,397	-	0.7802	-
9月末日	9,478,683,636	-	0.8271	-
10月末日	9,497,501,828	-	0.8472	-
第16特定期間末 (平成25年11月11日)	9,327,922,637	9,372,482,501	0.8373	0.8413
11月末日	9,511,068,428	-	0.8744	-

## 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
第15特定期間	0.0120
第16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
第15特定期間	50.7
第16特定期間	1.9

## (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
第15特定期間	68,212,204	1,642,058,854
第16特定期間	42,879,794	1,446,517,832

(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）

2013年11月29日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	9,035円
純資産総額	18億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.8%
3カ月間	6.8%
6カ月間	2.7%
1年間	20.9%
3年間	31.8%
5年間	45.6%
設定来	29.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。  
※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

## 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額： 320円 設定来分配金合計額： 3,090円

決算期	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期	第47期	第48期
	12年1月	12年3月	12年5月	12年7月	12年9月	12年11月	13年1月	13年3月	13年5月	13年7月	13年9月	13年11月
分配金	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	50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。

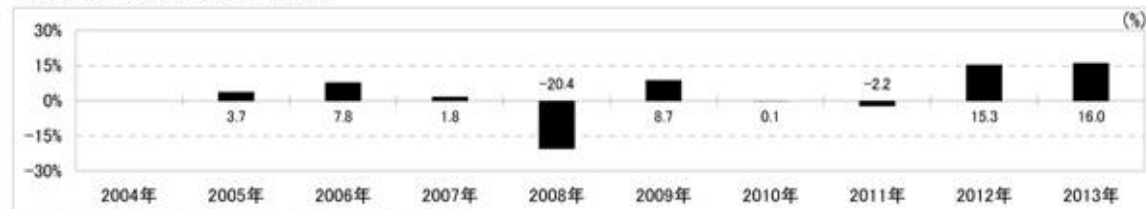
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内債券	49	34.5%	日本円	50.4%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.3%
外国債券	47	33.6%	米ドル	13.7%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.3%
国内株式	175	9.4%	ユーロ	12.0%	修正デュレーション	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.2%
外国株式	185	8.8%	カナダドル	6.3%	残存年数	昭和シェル石油	日本	0.2%
外国リート等	152	5.6%	英ポンド	5.6%	債券格付別構成	日鉄住金物産	日本	0.2%
国内リート	41	4.9%	豪ドル	4.2%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.5%
			ポーランド・ズロチ	2.7%	AA	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	0.4%
			デンマーク・クローネ	0.9%	A	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			韓国ウォン	0.7%	BBB	日本リテールファンド	日本	0.3%
コール・ローン、その他		3.2%	その他	3.3%	BB	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.3%
合計	649	100.0%	合計	100.0%	合計	合計		3.1%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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、2013年は11月29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）

2013年11月29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	8,349円
純資産総額	20億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	2.6%
3か月間	8.9%
6か月間	1.8%
1年間	27.2%
3年間	42.0%
5年間	57.3%
設定来	35.3%



※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: 300円 設定来分配金合計額: 3,955円

決算期	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期	第47期	第48期
	12年1月	12年3月	12年5月	12年7月	12年9月	12年11月	13年1月	13年3月	13年5月	13年7月	13年9月	13年11月
分配金	75円	75円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円

※分配金は、収益配分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。

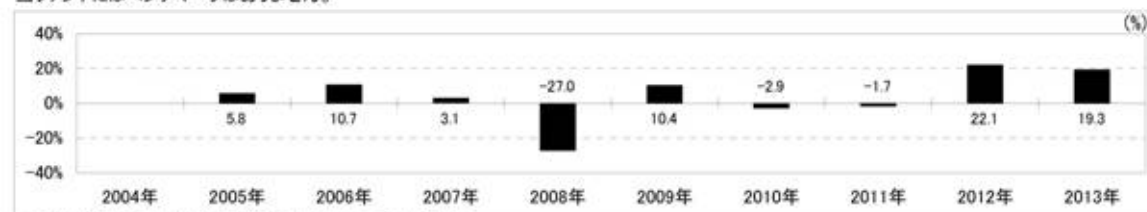
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特徴値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
外国債券	47	67.3%	米ドル	22.0%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.3%
国内株式	175	9.2%	ユーロ	22.0%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.2%
外国株式	185	8.6%	日本円	15.6%	修正デュレーション	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.2%
外国リート等	152	5.6%	カナダ・ドル	12.5%	残存年数	昭和シェル石油	日本	0.2%
国内リート	41	5.0%	英ポンド	9.8%	債券格付別構成	日鉄住金物産	日本	0.2%
			豪ドル	6.2%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.5%
			ポーランド・ズロチ	5.4%	AA	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	0.4%
			デンマーク・クローネ	1.8%	A	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			チェコ・コルナ	1.4%	BBB	日本リテールファンド	日本	0.3%
コール・ローン、その他		4.2%	その他	3.5%	BB	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.3%
合計	600	100.0%	合計	100.0%	合計	合計		3.1%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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、2013年は11月29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)

2013年11月29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	8,744円
純資産総額	95億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	3.7%
3か月間	13.2%
6か月間	6.7%
1年間	46.6%
3年間	61.2%
5年間	90.0%
設定来	37.6%



※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: 240円 設定来分配金合計額: 3,970円

決算期	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期	第47期	第48期
	12年1月	12年3月	12年5月	12年7月	12年9月	12年11月	13年1月	13年3月	13年5月	13年7月	13年9月	13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、収益配分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。

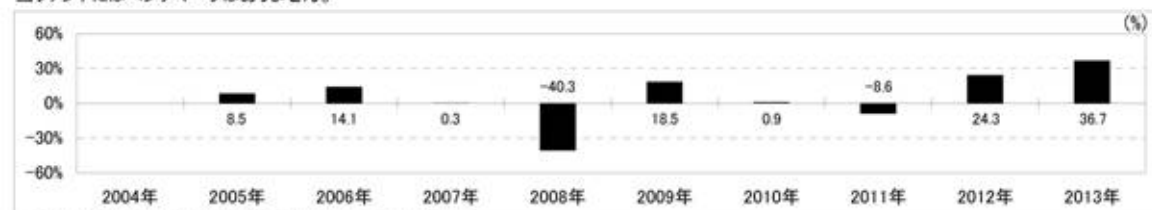
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特徴値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式	175	32.7%	日本円	40.7%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.9%	
外国株式	185	30.7%	米ドル	18.3%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.9%	
外国債券	47	19.1%	ユーロ	11.3%	修正デュレーション	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.8%	
外国リート等	152	7.8%	豪ドル	6.6%	残存年数	昭和シェル石油	日本	0.8%	
国内リート	41	5.9%	英ポンド	6.6%	債券格付別構成	日鉄住金物産	日本	0.7%	
			カナダドル	4.0%	AAA	66.1%	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	1.2%
			韓国ウォン	2.5%	AA	26.0%	日本ビルファンド	日本	0.6%
			台湾ドル	2.0%	A	7.8%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			香港ドル	1.6%	BBB	-	日本リテールファンド	日本	0.3%
コール・ローン、その他		3.8%	その他	6.4%	BB	-	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.3%
合計	600	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.8%	

※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、2013年は11月29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ないません。

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ないません。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ないません。

### 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(LIFFE)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たものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

**(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要**

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

**(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要**

- ・ わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・ 海外の金融商品取引所上場の株式およびハイブリッド優先証券：原則として当該取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・ 海外の店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券：原則として海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・ わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・ 海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・ 公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または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。

- ・ お電話によるお問い合わせ先（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ます。

#### (5) 【その他】

##### 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、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、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られ



たる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 運用報告書

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、)に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 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25年5月11日から平成25年11月11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25年5月10日現在	当 期 平成25年11月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	33,702,396	32,694,783
親投資信託受益証券	2,124,286,260	1,811,007,831
未収入金	8,000,000	-
流動資産合計	2,165,988,656	1,843,702,614
資産合計	2,165,988,656	1,843,702,614
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	11,657,990	10,382,401
未払解約金	6,961,548	860,472
未払受託者報酬	189,914	166,727
未払委託者報酬	4,368,344	3,835,200
その他未払費用	89,838	76,347
流動負債合計	23,267,634	15,321,147
負債合計	23,267,634	15,321,147
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 2,331,598,187	<sup>1</sup> 2,076,480,308
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 188,877,165	<sup>2</sup> 248,098,841
（分配準備積立金）	54,528,632	38,343,243
元本等合計	2,142,721,022	1,828,381,467
純資産合計	2,142,721,022	1,828,381,467
負債純資産合計	2,165,988,656	1,843,702,614

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成24年11月13日 至 平成25年5月10日		自 平成25年5月11日 至 平成25年11月11日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		8,255		7,571
有価証券売買等損益		530,367,424		43,778,429
営業収益合計		530,375,679		43,770,858
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		599,509		509,533
委託者報酬	<sup>1</sup>	13,789,665	<sup>1</sup>	11,720,534
その他費用		89,838		76,347
営業費用合計		14,479,012		12,306,414
営業利益又は営業損失（ ）		515,896,667		56,077,272
経常利益又は経常損失（ ）		515,896,667		56,077,272
当期純利益又は当期純損失（ ）		515,896,667		56,077,272
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（ ）		15,850,883		2,787,452
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		759,280,270		188,877,165
剰余金増加額又は欠損金減少額		121,628,120		35,302,953
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		121,628,120		35,302,953
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,940,499		9,014,689
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,940,499		9,014,689
分配金	<sup>2</sup>	46,330,300	<sup>2</sup>	32,220,120
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		188,877,165		248,098,841

## (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25年5月11日	至 平成25年11月11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25年11月10日が休日のため、当特定期間末日を平成25年11月11日としております。このため、当特定期間は185日となっております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首元本額	3,051,728,057円	2,331,598,187円
期中追加設定元本額	29,124,357円	67,499,016円
期中一部解約元本額	749,254,227円	322,616,895円
2. 特定期間末日における受益権の総数	2,331,598,187口	2,076,480,308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188,877,165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248,098,841円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成24年11月13日 至 平成25年5月10日	自 平成25年5月11日 至 平成25年11月11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	629,178円	518,950円

## 2. 2 分配金の計算過程

（自平成24年11月13日 至平成25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（12,446,444円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（407,384円）及び分配準備積立金（76,837,707円）より分配対象額は89,691,535円（1万口当たり303.58円）であり、うち20,681,215円（1万口当たり70円）を分配金額としております。

（自平成25年1月11日 至平成25年3月11日）  
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,497,908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（643,465円）及び分配準備積立金（64,725,045円）より分配対象額は77,866,418円（1万口当たり278.27円）であり、うち13,991,095円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年3月12日 至平成25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（13,696,627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（743,010円）及び分配準備積立金（52,489,995円）より分配対象額は66,929,632円（1万口当たり287.05円）であり、うち11,657,990円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年5月11日 至平成25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（6,686,857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（771,277円）及び分配準備積立金（51,354,985円）より分配対象額は58,813,119円（1万口当たり267.48円）であり、うち10,993,973円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年7月11日 至平成25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（6,536,122円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,940,107円）及び分配準備積立金（45,277,525円）より分配対象額は53,753,754円（1万口当たり247.86円）であり、うち10,843,746円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年9月11日 至平成25年11月11日）  
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,706,203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（2,078,630円）及び分配準備積立金（39,019,441円）より分配対象額は50,804,274円（1万口当たり244.67円）であり、うち10,382,401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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	平成25年11月11日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	129,945,654	40,402,597
合計	129,945,654	40,402,597

## （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25年5月10日現在	平成25年11月11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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年5月10日現在	当 期 平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9190円 (9,190円)	0.8805円 (8,805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	433,463,249	634,980,313	
	ダイワ日本国債マザーファンド	540,643,617	640,176,106	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	66,986,712	89,768,892	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	100,390,338	178,554,255	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	43,199,020	61,321,008	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	47,839,997	61,895,388	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	36,128,899	60,891,646	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	51,427,300	83,420,223	
親投資信託受益証券 合計			1,811,007,831	
合計			1,811,007,831	

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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	927,323,485	1,310,688,410
コール・ローン	92,448,513	172,219,128
国債証券	72,526,477,836	58,889,988,240
特殊債券	7,428,128,487	5,634,617,534
派生商品評価勘定	32,511,701	300,000
未収入金	3,298,793,172	11,136,323,789
未収利息	1,040,686,160	669,234,040
前払費用	300,412,188	611,599,145
流動資産合計	85,646,781,542	78,424,970,286
資産合計	85,646,781,542	78,424,970,286
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	51,069,864	14,655,448
未払金	2,868,621,626	8,927,424,887
未払解約金	92,200,000	204,137,000
流動負債合計	3,011,891,490	9,146,217,335
負債合計	3,011,891,490	9,146,217,335
純資産の部		
元本等		
元本	1	52,910,297,177
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		29,724,592,875
元本等合計		82,634,890,052
純資産合計		69,278,752,951
負債純資産合計		85,646,781,542

## 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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首	平成24年11月13日	平成25年5月11日
期首元本額	59,697,533,342円	52,910,297,177円
期中追加設定元本額	59,384,614円	94,065,696円
期中一部解約元本額	6,846,620,779円	5,711,805,914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）	5,888,769,121円	4,850,923,672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）	1,269,047,824円	1,150,801,117円
北海道応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	1,921,381,693円	1,846,066,022円
福島応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	509,296,996円	426,965,766円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	2,568,688,996円	2,193,335,251円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	85,104,460円	83,342,954円
新潟県応援ファンド（外債バランス・毎月分配型）	682,756,647円	546,862,944円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	481,340,379円	433,463,249円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,107,448,363円	970,954,740円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,320,290,299円	1,261,660,270円
FITネット・三県応援ファンド（毎月分配型）	583,166,637円	523,790,661円
長野応援ファンド（毎月分配型）	561,141,329円	538,046,661円
栃木応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	650,588,104円	569,948,688円
京都応援バランスファンド（隔月分配型）	546,191,161円	572,229,122円
北東北三県応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	631,954,008円	512,493,082円
6資産バランスファンド（分配型）	2,626,792,036円	2,437,500,527円
6資産バランスファンド（成長型）	234,110,538円	225,017,794円

ダイワ海外ソブリン・ファンド (毎月分配型)	21,906,629,682円	19,753,755,213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)	547,602,272円	543,503,603円
奈良応援ファンド(外債バラン ス・毎月分配型)	178,063,303円	172,990,325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)	590,943,905円	612,184,825円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	253,224,042円	223,689,857円
ダイワ外債ソブリン・ファンド (毎月分配型)	2,461,584,063円	2,209,047,275円
兵庫応援バランスファンド(毎 月分配型)	238,619,095円	209,506,297円
『しがぎん』SRI三資産バラ ンス・オープン(奇数月分配 型)	66,700,733円	64,866,535円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	749,193,982円	673,381,816円
紀陽地域株式・外債バラン スファンド(隔月分配型)	271,906,322円	268,521,998円
愛媛県応援ファンド(外債バラ ンス・毎月分配型)	269,781,838円	192,810,411円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	3,472,840,973円	3,015,913,019円
地球環境株・外債バラン ス・ファンド	229,617,127円	201,443,592円
ダイワ海外ソブリン・ファンド (1年決算型)	5,521,249円	7,539,673円
計	52,910,297,177円	47,292,556,959円
2. 期末日における受益権の総数	52,910,297,177口	47,292,556,959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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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	97,489,951	7,911,202
特殊債券	72,429,362	8,387,783
合計	25,060,589	476,581

(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25年4月11日から平成25年5月10日まで、及び平成25年10月11日から平成25年11月11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25年5月10日 現在				平成25年11月11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	3,733,116,400	-	3,783,050,000	49,933,600	4,551,983,500	-	4,555,260,000	3,276,500
アメリカ・ドル	2,293,430,000	-	2,321,850,000	28,420,000	986,700,000	-	989,600,000	2,900,000
オーストラリア・ ドル	402,886,400	-	406,600,000	3,713,600	1,392,900,000	-	1,392,600,000	300,000
カナダ・ドル	-	-	-	-	140,983,500	-	141,660,000	676,500
デンマーク・ クローネ	698,400,000	-	706,000,000	7,600,000	709,200,000	-	709,200,000	0
ノルウェー・ クローネ	338,400,000	-	348,600,000	10,200,000	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	1,322,200,000	-	1,322,200,000	0
買 建	3,531,730,000	-	3,563,105,437	31,375,437	4,411,000,000	-	4,399,921,052	11,078,948

アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,392,900,000	-	1,392,202,431	697,569
イギリス・ポンド	495,650,000	-	501,484,510	5,834,510	2,031,400,000	-	2,028,143,578	3,256,422
オーストラリア・ドル	495,650,000	-	498,873,938	3,223,938	986,700,000	-	979,575,043	7,124,957
カナダ・ドル	1,302,130,000	-	1,308,656,204	6,526,204	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	201,500,000	-	204,058,176	2,558,176	-	-	-	-
ユーロ	1,036,800,000	-	1,050,032,609	13,232,609	-	-	-	-
合計	7,264,846,400	-	7,346,155,437	18,558,163	8,962,983,500	-	8,955,181,052	14,355,448

## (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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5618円 (15,618円)	1.4649円 (14,649円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	アメリカ・ドル 21,000,000.000	アメリカ・ドル 23,917,740.000	
		9.25% U.S. TREASURY BOND 20160215	70,000,000.000	83,980,400.000	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	40,000,000.000	54,259,200.000	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	8,200,000.000	11,593,324.000	
		7.625% U.S. TREASURY BOND 20221115	5,000,000.000	7,074,600.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 180,825,264.000 (17,896,276,378)	
	イギリス・ポンド	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	イギリス・ポンド 9,500,000.000	イギリス・ポンド 13,270,550.000	

	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	5,000,000.000	6,009,000.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	12,200,000.000	14,054,400.000	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	3,000,000.000	3,350,400.000	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 36,684,350.000 (5,814,469,475)	
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	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	26,000,000.000	28,954,640.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	40,000,000.000	41,522,400.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 70,477,040.000 (6,544,497,934)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	11.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,800,000.000	2,081,070.000	
	10.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210315	2,500,000.000	3,894,825.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	7,000,000.000	10,225,600.000	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	11,400,000.000	18,519,528.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	5,300,000.000	8,368,594.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 43,089,617.000 (4,069,814,326)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	10,000,000.000	10,277,300.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 10,277,300.000 (154,056,727)	
チェコ・コルナ		チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	
	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	40,000,000.000	37,727,200.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	172,000,000.000	225,423,200.000	
チェコ・コルナ 小計			チェコ・コルナ 263,150,400.000 (1,292,068,464)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	10,000,000.000	15,191,800.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	50,000,000.000	57,059,500.000	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	15,000,000.000	20,284,050.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 92,535,350.000 (1,640,651,756)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	7,800,000.000	8,400,600.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 8,400,600.000	

				(135,081,648)
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	10,000,000.000		11,065,700.000
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20160425	75,000,000.000		78,615,000.000
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	7,500,000.000		8,280,750.000
	4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025	70,000,000.000		68,241,600.000
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20180425	40,000,000.000		40,380,400.000
ポーランド・ズロチ	小計			ポーランド・ズロチ 206,583,450.000 (6,534,234,524)
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	6,000,000.000		9,054,300.000
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	900,000.000		1,357,920.000
	8.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	8,500,000.000		12,756,970.000
	8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	17,000,000.000		26,284,720.000
	6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,500,000.000		4,739,805.000
	5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	2,000,000.000		2,715,340.000
	5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	8,300,000.000		10,712,810.000
	4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	15,500,000.000		17,962,795.000
	6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	15,000,000.000		21,558,750.000
	4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	4,000,000.000		4,858,080.000
ユーロ	小計			ユーロ 112,001,490.000 (14,808,837,008)
国債証券	合計			58,889,988,240 [58,889,988,240]
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	
	6.5% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20190807	2,000,000.000		2,213,920.000
オーストラリア・ドル	小計			オーストラリア・ドル 2,213,920.000 (205,584,611)
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% CANADA HOUSING TRUST 20160615	30,000,000.000		31,065,900.000
	3.15% CANADA HOUSING TRUST 20230915	15,000,000.000		15,071,850.000
	2.625% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20180924	10,000,000.000		10,094,600.000
カナダ・ドル	小計			カナダ・ドル 56,232,350.000 (5,311,145,458)
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	
	5% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20150515	7,000,000.000		7,331,310.000
ノルウェー・クローネ	小計			ノルウェー・クローネ



			7,331,310.000 (117,887,465)
特殊債券	合計		5,634,617,534 [5,634,617,534]
合計			64,524,605,774 [64,524,605,774]

- (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%	27.8%
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	100%	9.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄 特殊債券 1銘柄	100%	10.5%
カナダ・ドル	国債証券 5銘柄 特殊債券 3銘柄	100%	14.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	100%	0.2%
チェコ・コルナ	国債証券 2銘柄	100%	2.0%
デンマーク・クローネ	国債証券 3銘柄	100%	2.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄 特殊債券 1銘柄	100%	0.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券 5銘柄	100%	10.1%
ユーロ	国債証券 10銘柄	100%	23.0%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

「ダイワ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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,308,361,243	406,689,825
国債証券	312,392,831,118	302,233,961,060
未収入金	-	320,468,400
未収利息	1,381,301,616	1,379,371,542
前払費用	100,552,781	105,504,429
流動資産合計	315,183,046,758	304,445,995,256
資産合計	315,183,046,758	304,445,995,256
負債の部		
流動負債		
未払金	1,188,057,500	-
未払解約金	111	320,410,009
流動負債合計	1,188,057,611	320,410,009
負債合計	1,188,057,611	320,410,009
純資産の部		
元本等		
元本	1 268,631,068,921	256,843,706,776
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	45,363,920,226	47,281,878,471
元本等合計	313,994,989,147	304,125,585,247
純資産合計	313,994,989,147	304,125,585,247
負債純資産合計	315,183,046,758	304,445,995,256

## 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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首	平成24年11月13日	平成25年5月11日
期首元本額	256,655,052,686円	268,631,068,921円
期中追加設定元本額	29,169,982,623円	11,670,437,234円
期中一部解約元本額	17,193,966,388円	23,457,799,379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	21,066,152円	16,526,287円
（適格機関投資家専用）		

ダイワ・スマートアロケーション・ファンド（適格機関投資家専用）	8,288,793円	- 円
ダイワ日本国債ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	- 円	3,385,926,681円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	628,202,114円	540,643,617円
6資産バランスファンド（分配型）	612,238,940円	594,337,234円
6資産バランスファンド（成長型）	304,873,837円	270,625,054円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	265,916,400,253円	250,782,809,215円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	316,249,443円	276,797,258円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	128,162,216円	118,785,783円
スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジあり）	8,420,516円	- 円
ダイワ日本国債ファンド（年1回決算型）	- 円	95,525,000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）	687,166,657円	761,730,647円
計	268,631,068,921円	256,843,706,776円
2. 期末日における受益権の総数	268,631,068,921口	256,843,706,776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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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	2,344,585,541	1,482,135,019
合計	2,344,585,541	1,482,135,019

（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25年3月12日から平成25年5月10日まで、及び平成25年3月12日から平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1689円 (11,689円)	1.1841円 (11,841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 4 利付国債2 0年	8,474,000,000	8,610,177,180	
	2 5 利付国債2 0年	218,000,000	221,047,640	
	2 7 利付国債2 0年	10,696,000,000	11,146,943,360	
	2 8 利付国債2 0年	9,488,000,000	10,116,485,120	
	2 9 利付国債2 0年	8,980,000,000	9,664,276,000	
	3 0 利付国債2 0年	190,000,000	202,718,600	
	3 2 利付国債2 0年	8,493,000,000	9,211,083,150	
	3 3 利付国債2 0年	9,794,000,000	10,821,488,540	
	3 4 利付国債2 0年	9,169,000,000	10,195,561,240	
	3 6 利付国債2 0年	670,000,000	743,130,500	
	3 7 利付国債2 0年	8,193,000,000	9,118,645,140	
	3 8 利付国債2 0年	11,376,000,000	12,618,145,440	
	4 0 2 0年国債	6,792,000,000	7,480,980,480	
	4 2 2 0年国債	8,168,000,000	9,202,803,920	
	4 3 2 0年国債	9,572,000,000	11,050,874,000	
	4 4 2 0年国債	11,235,000,000	12,806,551,800	
	4 7 2 0年国債	6,530,000,000	7,355,914,400	
	4 8 2 0年国債	7,351,000,000	8,452,326,820	
	4 9 2 0年国債	3,218,000,000	3,615,229,920	
	5 1 2 0年国債	3,100,000,000	3,465,955,000	

5 2	2 0 年国債	4,168,000,000	4,700,420,320	
5 4	2 0 年国債	4,387,000,000	4,996,836,870	
5 5	2 0 年国債	4,694,000,000	5,279,529,560	
5 6	2 0 年国債	3,920,000,000	4,417,565,600	
5 8	2 0 年国債	4,975,000,000	5,572,497,500	
5 9	2 0 年国債	3,095,000,000	3,415,332,500	
6 3	2 0 年国債	6,758,000,000	7,531,655,840	
6 4	2 0 年国債	8,235,000,000	9,260,916,300	
6 5	2 0 年国債	1,227,000,000	1,382,865,810	
6 8	2 0 年国債	6,905,000,000	8,000,892,550	
7 0	2 0 年国債	9,088,000,000	10,734,291,200	
7 4	2 0 年国債	1,615,000,000	1,864,210,650	
7 5	2 0 年国債	3,974,000,000	4,590,248,180	
7 7	2 0 年国債	136,000,000	155,649,280	
8 0	2 0 年国債	7,323,000,000	8,468,317,200	
8 2	2 0 年国債	4,335,000,000	5,015,638,350	
8 3	2 0 年国債	3,160,000,000	3,659,659,200	
8 6	2 0 年国債	4,350,000,000	5,141,004,000	
8 8	2 0 年国債	5,260,000,000	6,216,425,800	
9 1	2 0 年国債	4,470,000,000	5,282,154,300	
9 2	2 0 年国債	3,920,000,000	4,535,048,000	
9 4	2 0 年国債	2,500,000,000	2,890,200,000	
9 5	2 0 年国債	7,755,000,000	9,153,691,800	
9 7	2 0 年国債	3,210,000,000	3,744,721,800	
9 9	2 0 年国債	300,000,000	345,480,000	
1 0 1	2 0 年国債	8,410,000,000	10,012,946,000	
1 0 2	2 0 年国債	7,320,000,000	8,708,750,400	
1 0 6	2 0 年国債	910,000,000	1,056,673,800	
国債証券 合計			302,233,961,060	
合計			302,233,961,060	

## 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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,369,022,062	860,709,970
コール・ローン	1,658,006,655	1,151,469,985
投資証券	222,371,159,144	172,903,322,028
派生商品評価勘定	3,515,244	10,285,836
未収入金	1,584,172,626	1,049,701,003
未収配当金	1,017,039,107	279,329,733
流動資産合計	230,002,914,838	176,254,818,555
資産合計	230,002,914,838	176,254,818,555
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,034,523	4,473,904
未払金	2,082,701,385	-
未払解約金	933,000,000	457,500,000
流動負債合計	3,018,735,908	461,973,904
負債合計	3,018,735,908	461,973,904
純資産の部		
元本等		
元本	1 153,582,143,556	131,180,804,436
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	73,402,035,374	44,612,040,215
元本等合計	226,984,178,930	175,792,844,651
純資産合計	226,984,178,930	175,792,844,651
負債純資産合計	230,002,914,838	176,254,818,555

## 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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首	平成24年11月13日	平成25年5月11日
期首元本額	201,964,652,128円	153,582,143,556円
期中追加設定元本額	2,183,031,581円	2,373,684,930円
期中一部解約元本額	50,565,540,153円	24,775,024,050円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREIT・	135,884,753,400円	116,661,064,770円
オープン（毎月分配型）		
ダイワ・バランス3資産（外	93,774,827円	92,701,520円
債・海外リート・好配当日本		
株）		
安定重視ポートフォリオ（奇数	71,596,988円	66,986,712円
月分配型）		
インカム重視ポートフォリオ	84,298,438円	73,810,821円
（奇数月分配型）		
成長重視ポートフォリオ（奇数	379,077,001円	334,281,277円
月分配型）		
6資産バランスファンド（分配	560,815,698円	521,318,705円
型）		
6資産バランスファンド（成長	1,066,248,525円	996,138,405円
型）		
ダイワ三資産分散ファンド（イン	63,836,198円	63,836,198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・	7,468,538,033円	6,203,033,793円
ファンド		
世界6資産均等分散ファンド	273,660,304円	243,073,022円
（毎月分配型）		
『しがぎん』SRI三資産バラ	18,431,777円	17,681,118円
ンス・オープン（奇数月分配		
型）		
常陽3分法ファンド	1,150,484,186円	1,034,300,354円
ダイワ資産分散インカムオー	266,827,244円	230,215,559円
ン（奇数月決算型）		
ダイワ・海外株式&REIT	72,240,834円	68,014,932円
ファンド（毎月分配型）		
スマート・インカム・バランス	- 円	194,561円
ワールドアセット（安定コー	- 円	135,894円
ス）		

ワールドアセット(分散コース)	- 円	152,098円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	175,111,859円	186,902,856円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	194,625,999円	220,951,058円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	193,045,733円	207,138,568円
ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用)	4,408,999,222円	2,509,414,118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)	1,155,777,290円	1,449,084,193円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(部分為替ヘッジあり)	- 円	186,952円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)	- 円	186,952円
計	153,582,143,556円	131,180,804,436円
2. 期末日における受益権の総数	153,582,143,556口	131,180,804,436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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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	14,666,709,821	3,487,437,049
合計	14,666,709,821	3,487,437,049

（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25年3月16日から平成25年5月10日まで、及び平成25年9月18日から平成25年11月11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25年5月10日 現在				平成25年11月11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	1,285,919,265	-	1,288,417,654	2,498,389	1,551,062,115	-	1,553,619,573	2,557,458
アメリカ・ドル	985,354,284	-	985,272,683	81,601	392,912,000	-	395,840,000	2,928,000
イギリス・ポンド	-	-	-	-	158,133,300	-	158,490,000	356,700
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	869,882,321	-	868,809,711	1,072,610
シンガポール・ドル	163,048,165	-	165,558,155	2,509,990	130,134,494	-	130,479,862	345,368
ユーロ	131,450,000	-	131,520,000	70,000	-	-	-	-
香港・ドル	6,066,816	-	6,066,816	0	-	-	-	-
買 建	346,805,265	-	349,784,375	2,979,110	1,000,016,815	-	1,008,386,205	8,369,390
アメリカ・ドル	169,114,981	-	172,536,448	3,421,467	1,000,016,815	-	1,008,386,205	8,369,390
イギリス・ポンド	177,690,284	-	177,247,927	442,357	-	-	-	-
合計	1,632,724,530	-	1,638,202,029	480,721	2,551,078,930	-	2,562,005,778	5,811,932

（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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4779円 (14,779円)	1.3401円 (13,401円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	576,309	88,181,040.090	
		BOSTON PROPERTIES INC	293,381	29,434,915.730	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	1,138,149	30,160,948.500	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	1,123,219	22,992,292.930	
		VORNADO REALTY TRUST	463,801	40,851,592.080	
		EQUITY RESIDENTIAL	578,612	29,914,240.400	
		LASALLE HOTEL 7.5 H	187,000	4,609,550.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	754,583	14,035,243.800	
		KIMCO REALTY 6.90% H	292,615	7,271,482.750	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	55,474	3,832,698.660	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	312,834	9,991,917.960	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST	415,236	5,609,838.360	
		VENTAS INC	556,263	34,249,112.910	
		EQUITY LIFESTYLE 6.75 C	212,929	5,046,417.300	
		PROLOGIS INC	1,034,033	40,275,585.350	
		BRE PROPERTIES-CL A	176,566	9,527,501.360	
		COUSINS PROPERTIES INC	407,278	4,296,782.900	
		DDR CORP	543,729	8,792,097.930	
		DUKE REALTY CORP	903,561	14,158,800.870	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	167,568	17,599,667.040	
		GLIMCHER REALTY TRUST	992,000	9,642,240.000	
		HEALTH CARE REIT INC	348,946	21,079,827.860	
		HCP INC	431,692	17,107,953.960	
		HOME PROPERTIES INC	222,203	12,150,060.040	
		KILROY REALTY CORP	171,000	8,707,320.000	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIE	241,092	7,821,024.480	
		REALTY INCOME CORP	217,121	8,697,867.260	
		CORPORATE OFFICE PROPERTI	554,702	13,046,591.040	
		PARKWAY PROPERTIES INC	357,124	6,199,672.640	
		PUBLIC STORAGE	161,739	25,863,683.490	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	124,338	9,791,617.500	
		REGENCY CENTERS CORP	260,743	12,617,353.770	
		RAMCO-GERSHENSON PROPERTI	632,299	9,895,479.350	
		SL GREEN REALTY CORP	293,165	26,765,964.500	
		UDR INC	913,399	21,684,092.260	
		WEINGARTEN REALTY INVESTO	446,396	13,351,704.360	
		DDR CORP 7.375 H	100,523	2,495,986.090	
		DUKE REALTY CORP 6.5% K	185,626	4,380,773.600	
		CUBESMART	563,167	9,562,575.660	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS	992,700	12,895,173.000	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	156,938	7,189,329.780
	EXTRA SPACE STORAGE INC	298,008	12,683,220.480
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,617,058	9,007,013.060
	CBL&ASSOC PROP 7.375% D	387,166	9,640,433.400
	VORNADO RLTY TST 6.625% G	270,714	6,402,386.100
	EDUCATION REALTY TRUST	953,312	8,293,814.400
	DIAMONDRock HOSPITALITY	1,622,876	18,273,583.760
	DUKE REALTY CORP 6.60% L	435,113	10,381,796.180
	DOUGLAS EMMETT	392,533	9,295,181.440
	LASALLE HOTEL G	31,900	780,274.000
	WEINGARTEN RLTY F	112,126	2,710,085.420
	DUPONT FABROS 7.625 B	350,000	8,575,000.000
	COMMONWEALTH REIT 7.25 E	500,000	11,225,000.000
	ALEXANDRIA RE EQ 6.45 E	250,000	5,750,000.000
	RETAIL PROPERTIES OF AME-	590,258	8,216,391.360
	TAUBMAN CENTERS 6.5 J	99,300	2,200,488.000
	GLIMCHER REALTY 7.5 H	84,315	1,971,284.700
	COMMONWEALTH REIT 6.5% D	776,860	16,321,828.600
	PEBBLEBROOK HOTEL 7.875 A	237,950	6,067,725.000
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 829,573,523.460 (82,102,891,617)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES PLC	6,405,970	62,458,207.500
	SEGRE PLC	5,541,662	17,910,651.580
	HAMMERSON PLC	4,434,719	22,971,844.420
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	2,111,411	11,961,143.310
	INTU PROPERTIES PLC	2,520,282	8,400,099.900
	DERWENT LONDON PLC	359,325	8,825,022.000
	BIG YELLOW GROUP PLC	1,607,348	7,565,787.030
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	5,633,985	7,239,670.720
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 147,332,426.460 (23,352,189,594)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	CROMWELL PROPERTY GROUP	15,393,399	15,470,365.990
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	11,930,708	24,100,030.160
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	8,905,714	10,597,799.660
	DEXUS PROPERTY GROUP	47,736,772	50,600,978.320
	MIRVAC GROUP	36,168,538	63,837,469.570
	STOCKLAND	4,295,780	17,354,951.200
	WESTFIELD GROUP	5,605,944	60,768,432.960
	GOODMAN GROUP	12,162,383	61,541,657.980
	FEDERATION CENTRES	18,594,442	46,300,160.580
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 350,571,846.420 (32,554,101,659)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	CAN REAL ESTATE INVEST TR	334,700	13,869,968.000
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-	480,100	10,029,289.000
	ALLIED PROPERTIES REAL ES	502,100	16,373,481.000
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 40,272,738.000 (3,803,760,104)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	7,902,500	18,491,850.000
	CAPITAMALL TRUST	19,693,884	39,387,768.000
	SUNTEC REIT	15,663,530	25,844,824.500

	FRASERS CENTREPOINT TRUST	6,039,000	11,021,175.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 94,745,617.500 (7,521,854,573)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT	740,327	6,913,173.520
	CORIO NV	661,937	21,562,597.770
	UNIBAIL-RODAMCO SE	325,278	62,176,889.700
	KLEPIERRE	975,235	32,958,066.820
	FONCIERE DES REGIONS	214,321	13,731,546.470
ユーロ 小計			ユーロ 137,342,274.280 (18,159,395,506)
香港・ドル	FORTUNE REIT	16,969,070	106,735,450.300
	LINK REIT	6,390,420	242,516,439.000
	CHAMPION REIT	21,176,376	74,329,079.760
香港・ドル 小計			香港・ドル 423,580,969.060 (5,409,128,975)
投資証券 合計			172,903,322,028 [172,903,322,028]
合計			172,903,322,028 [172,903,322,028]

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 59銘柄	100%	47.5%
イギリス・ポンド	投資証券 8銘柄	100%	13.5%
オーストラリア・ドル	投資証券 9銘柄	100%	18.8%
カナダ・ドル	投資証券 3銘柄	100%	2.2%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	4.4%
ユーロ	投資証券 5銘柄	100%	10.5%
香港・ドル	投資証券 3銘柄	100%	3.1%

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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	433,492,717	481,689,557
投資証券	18,114,438,400	24,710,019,000
未収配当金	136,921,800	161,848,450
流動資産合計	18,684,852,917	25,353,557,007
資産合計	18,684,852,917	25,353,557,007
負債の部		
流動負債		
未払金	175,305,707	40,277,028
未払解約金	20,220,000	9,850,000
流動負債合計	195,525,707	50,127,028
負債合計	195,525,707	50,127,028
純資産の部		
元本等		
元本	1 11,291,269,523	15,598,817,897
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,198,057,687	9,704,612,082
元本等合計	18,489,327,210	25,303,429,979
純資産合計	18,489,327,210	25,303,429,979
負債純資産合計	18,684,852,917	25,353,557,007

## 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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1期首	平成24年11月13日	平成25年5月11日
期首元本額	10,397,059,411円	11,291,269,523円
期中追加設定元本額	3,103,626,014円	5,029,336,132円
期中一部解約元本額	2,209,415,902円	721,787,758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)	54,301,002円	51,427,300円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	67,510,973円	61,341,006円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	304,167,062円	275,716,594円
6資産バランスファンド(分配型)	454,859,038円	419,713,936円
6資産バランスファンド(成長型)	816,385,828円	813,518,829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)	48,156,891円	51,620,935円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	207,693,712円	197,321,726円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	7,298,950円	7,364,195円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	199,785,802円	188,802,517円
ワールドアセット(安定コース)	-円	111,308円
ワールドアセット(分散コース)	-円	124,302円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	133,659,652円	153,965,675円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	148,666,799円	179,924,203円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	152,803,172円	169,641,761円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	257,998,874円	289,753,177円
ダイワファンドラップJ-REITセレクト	7,532,852,397円	11,395,400,759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)	180,730,251円	328,408,599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)	62,297,480円	113,373,884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)	296,064,194円	494,469,474円
ダイワJリート・ファンド	366,037,446円	406,817,717円
計	11,291,269,523円	15,598,817,897円
2. 期末日における受益権の総数	11,291,269,523口	15,598,817,897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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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	5,083,301,279	180,153,705
合計	5,083,301,279	180,153,705

(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11月13日から平成25年5月10日まで、及び平成25年5月11日から平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6375円 (16,375円)	1.6221円 (16,221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	415,200,000	
	M I Dリート投資法人	1,300	292,370,000	
	森ヒルズリート	1,700	1,120,300,000	
	野村不レジデンシャル	400	224,000,000	

産業ファンド	800	707,200,000	
大和ハウスリート	600	446,400,000	
アドバンス・レジデンス	4,800	1,051,200,000	
ケネディクスレジデンシャル	1,500	314,250,000	
A P I 投資法人	800	632,000,000	
G L P 投資法人	7,600	747,080,000	
コンフォリア・レジデンシャル	400	274,400,000	
日本プロロジスリート	1,100	1,019,700,000	
NMF 投資法人	6,500	649,350,000	
S I A 不動産投資	200	80,200,000	
日本ビルファンド	2,500	2,962,500,000	
ジャパンリアルエステイト	2,000	2,164,000,000	
日本リテールファンド	8,200	1,602,280,000	
オリックス不動産投資	3,300	398,310,000	
日本プライムリアルティ	1,600	526,400,000	
プレミアム投資法人	100	40,000,000	
東急リアル・エステート	500	296,000,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	300	167,100,000	
野村不動産オフィスF	756	366,282,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	11,000	1,597,200,000	
森トラスト総合リート	600	517,200,000	
フロンティア不動産投資	1,000	948,000,000	
平和不動産リート	1,500	115,350,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	800	803,200,000	
福岡リート投資法人	500	390,500,000	
ケネディクス不動産投資法人	1,251	546,687,000	
積水ハウス・S I 投資法人	300	145,950,000	
いちご不動産投資法人	1,500	91,050,000	
大和証券オフィス投資法人	1,000	417,000,000	
阪急リート投資法人	700	389,200,000	
スターツプロシード投資法人	300	51,240,000	
トップリート投資法人	1,000	437,500,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	900	366,300,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	18,000	812,700,000	
日本賃貸住宅投資法人	3,400	222,020,000	
ジャパンエクセレント投資法人	600	362,400,000	
投資証券 合計		24,710,019,000	
合計		24,710,019,000	

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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	32,090,679	15,571,428
コール・ローン	20,710,401	24,260,605
株式	1,957,322,057	1,775,423,520
ハイブリッド優先証券	582,822,673	529,486,710
投資証券	58,710,273	52,068,259
未収入金	61,154,467	-
未収配当金	3,398,576	2,459,858
未収利息	316,472	924,915
流動資産合計	2,716,525,598	2,400,195,295
資産合計	2,716,525,598	2,400,195,295
負債の部		
流動負債		
未払金	39,088,110	-
未払解約金	1,000,000	2,000,000
流動負債合計	40,088,110	2,000,000
負債合計	40,088,110	2,000,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,927,059,861
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	749,377,627	708,754,982
元本等合計	2,676,437,488	2,398,195,295
純資産合計	2,676,437,488	2,398,195,295
負債純資産合計	2,716,525,598	2,400,195,295

## 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25年5月11日 至 平成25年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)ハイブリッド優先証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として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</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息</p> <p>ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</p>
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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首	平成24年11月13日	平成25年5月11日
期首元本額	2,053,305,510円	1,927,059,861円
期中追加設定元本額	50,959,602円	49,390,099円
期中一部解約元本額	177,205,251円	287,009,647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ファンド(毎月分配型)	164,963,378円	163,973,427円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	54,281,148円	43,199,020円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	59,997,550円	46,590,723円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	928,942,655円	772,665,475円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	164,576,540円	135,968,669円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	189,597,762円	150,573,275円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	77,158,738円	76,395,065円

DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 6分散コース）	128,646,289円	137,510,828円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 成長コース）	158,895,801円	162,563,831円
計	1,927,059,861円	1,689,440,313円
2. 期末日における受益権の総数	1,927,059,861口	1,689,440,313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25年5月11日 至 平成25年11月11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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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	47,116,789	59,921,526
ハイブリッド優先証 券	10,987,912	5,145,688
投資証券	1,058,068	144,158
合計	59,162,769	64,923,056

（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25年4月16日から平成25年5月10日まで、及び平成25年10月16日から平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3889円 (13,889円)	1.4195円 (14,195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	
	AETNA INC	2,600	63.350	164,710.000	
	CONSOL ENERGY INC	4,800	36.410	174,768.000	
	CITIGROUP INC	3,600	49.940	179,784.000	
	COVIDIEN PLC	2,900	63.840	185,136.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	1,700	52.220	88,774.000	
	APPLE INC	1,225	520.600	637,735.000	
	BROADCOM CORP-CL A	4,700	26.500	124,550.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	8,100	53.960	437,076.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,200	103.120	329,984.000	
	CISCO SYSTEMS	15,800	23.510	371,458.000	
	MORGAN STANLEY	6,200	29.440	182,528.000	
	DOW CHEMICAL	4,000	39.670	158,680.000	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	4,000	44.370	177,480.000	
	HANESBRANDS INC	2,800	66.620	186,536.000	
	EAGLE MATERIALS INC	2,000	76.220	152,440.000	
	EXXON MOBIL CORP	4,734	92.730	438,983.820	
	L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	1,900	101.500	192,850.000	
	FORD MOTOR CO	19,800	16.850	333,630.000	
	NEXTERA ENERGY INC	2,462	87.120	214,489.440	
	GENERAL ELECTRIC CO	17,300	27.050	467,965.000	
	GENERAL MOTORS CO	2,500	36.660	91,650.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	1,000	87.200	87,200.000	
	OWENS CORNING	5,800	35.800	207,640.000	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	20,100	9.020	181,302.000	
	HELMERICH & PAYNE	1,700	78.020	132,634.000	
	HEWLETT-PACKARD CO	9,100	25.940	236,054.000	
	INT'L BUSINESS MACHINES	1,600	179.990	287,984.000	
	PROASSURANCE CORP	2,000	46.650	93,300.000	
	JOHNSON & JOHNSON	1,900	94.050	178,695.000	
	ABBVIE INC	4,400	48.030	211,332.000	
	MCDONALD'S CORP	2,697	97.010	261,635.970	
MONSANTO CO	1,200	107.220	128,664.000		
MERCK & CO INC	3,500	46.800	163,800.000		
NETAPP INC	3,900	39.910	155,649.000		
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,400	85.620	205,488.000		
NEWMONT MINIG CORP	2,900	27.570	79,953.000		
PHILIP MORRIS INTERNATION	2,528	89.410	226,028.480		
OCCIDENTAL PETROLEUM	3,100	96.330	298,623.000		
PFIZER INC	11,883	31.320	372,175.560		

PROCTER & GAMBLE CO	1,100	82.510	90,761.000
PEPSICO INC	3,200	85.850	274,720.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,900	86.900	425,810.000
ACCENTURE LTD-CL A	1,000	75.240	75,240.000
PENTAIR LTD-REGISTERED	1,400	67.360	94,304.000
QUALCOMM INC	3,800	67.450	256,310.000
REPUBLIC SERVICES INC	5,500	34.320	188,760.000
ROSS STORES INC	1,500	78.090	117,135.000
CHEVRON CORP	4,700	121.190	569,593.000
SANDISK CORP	2,100	68.050	142,905.000
SCHLUMBERGER LTD	1,125	93.790	105,513.750
AT&T INC	8,700	35.170	305,979.000
TIME WARNER CABLE	800	121.080	96,864.000
MARATHON PETROLEUM CORP	3,800	71.650	272,270.000
UNITED PARCEL SERVICE-B	3,800	99.620	378,556.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	4,100	70.500	289,050.000
UNIVERSAL HEALTH SVC-B	2,400	80.000	192,000.000
THE WALT DISNEY CO.	3,500	68.580	240,030.000
WELLS FARGO & CO	8,326	42.710	355,603.460
WAL-MART STORES	4,700	77.960	366,412.000
WESTAR ENERGY INC	2,600	31.630	82,238.000
VISA INC-CLASS A SHS	500	198.290	99,145.000
TYSON FOODS INC-CL A	6,200	28.000	173,600.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC	4,694	98.170	460,809.980
BANK OF AMERICA CORP	17,000	14.320	243,440.000
NORDSTROM INC	3,100	61.020	189,162.000
AMERICAN EXPRESS CO	1,200	81.780	98,136.000
ANADARKO PETROLEUM CORP	1,400	90.970	127,358.000
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	1,800	69.590	125,262.000
INTEL CORP	11,000	24.090	264,990.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS	8,000	34.300	274,400.000
MICROSOFT CORP	11,400	37.780	430,692.000
CVS CAREMARK CORP	5,575	63.780	355,573.500
BLACKROCK INC-CLASS A	600	301.590	180,954.000
EMC CORP/MASS	6,500	23.950	155,675.000
CARNIVAL CORP	2,600	36.270	94,302.000
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 16,992,918.960 (1,681,789,189)
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
SUNCOR ENERGY INC	5,900	36.870	217,533.000
TRANSCANADA CORP	3,900	47.230	184,197.000
POTASH CORP OF SASKATCHEW	6,600	34.150	225,390.000
ROGERS COMMUNICATIONS-B	3,800	47.070	178,866.000
POWER CORP OF CANADA	5,900	31.420	185,378.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 991,364.000 (93,634,331)
合計			1,775,423,520 [1,775,423,520]

## (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	
		FIRST NIAGARA FIN VAR	5,535.000	157,138.650	
		TELEPHONE & DATA 6.875	3,917.000	94,830.570	
		SEASPAN CORPORATION 9.5	3,796.000	102,074.440	
		ALLY FINANCIAL 7.375	4,700.000	118,910.000	
		MONTPELIER RE 8.875	4,000.000	109,200.000	

		AXIS CAPITAL HLDG 6.875	4,000.000	97,120.000
		FIRST REPUBLIC BANK 6.2	3,000.000	67,650.000
		ASPEN INSURANCE 7.25	3,300.000	82,434.000
		PRUDENTIAL FIN 5.75	2,000.000	44,240.000
		REGIONS FINANCIAL 6.375	7,000.000	158,970.000
		AFFILIATED MGRS 6.375	6,500.000	149,435.000
		TEEKAY OFFSHORE A	8,000.000	199,680.000
		HANOVER INSURANCE 6.35	4,000.000	87,600.000
		GOLDMAN SACHS J VAR	2,152.000	48,635.200
		CITIGROUP INC K 6.875	3,000.000	74,700.000
		PARTNERRE LTD E 7.25	4,000.000	102,480.000
		COUNTRYWIDE CAP IV 6.75	8,804.000	220,540.200
		METLIFE B 6.500	3,900.000	96,603.000
		PINCIPAL FINL GRP 6.518	4,000.000	99,360.000
		MORGAN S CP TR VII 6.60	5,299.000	130,408.390
		COUNTRYWIDE CAP V 7.00%	8,928.000	223,021.440
		CITIGROUP CAP XVII 6.35	5,500.000	137,720.000
		QWEST CORP 6.125	2,860.000	59,974.200
		JPMCHASE CAP XXIX 6.7	3,500.000	89,740.000
		PRIVATEBANCORP 7.125	6,302.000	155,596.380
		WELLS F CAP J 8.0	8,100.000	231,741.000
		CITIGROUP CAP XIII 7.875	2,500.000	68,300.000
		AMER FINL GROUP 7.0	2,169.000	55,591.470
		GMAC CAP TRUST I VAR	3,000.000	80,340.000
		US BANCORP VAR	10,000.000	266,700.000
		RAYMOND JAMES 6.9	4,962.000	125,885.940
		PNC FINANCIAL VAR	10,500.000	262,080.000
		BB&T CORPORATION D	500.000	10,845.000
		INTEGRYS ENERGY VAR	2,375.000	57,071.250
		AMER FINL GROUP 6.375	3,300.000	80,124.000
		QWEST CORPORATION 7.0 B	6,700.000	163,681.000
		ALLSTATE CORP B VAR	1,189.000	29,011.600
		MORGAN STANLEY E VAR	2,737.000	70,915.670
		US BANCORP G VAR	1,543.000	41,830.730
		NUSTAR LOGISTICS LP VAR	4,500.000	114,480.000
		RGA 6.2	4,000.000	99,160.000
		CAPITAL ONE FINANCIAL 6	3,500.000	76,020.000
		WELLS FARGO Q VAR	1,800.000	42,768.000
		HARTFORD FINL SVCS VAR	7,500.000	214,875.000
		PPL CAPITAL FDG B 5.9	2,112.000	44,647.680
		ASTORIA FINANCIAL C 6.5	6,500.000	143,325.000
		PARTNERRE LTD F 5.875	2,900.000	61,277.000
		ENDURANCE SPECIALTY 7.5	4,000.000	101,240.000
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 5,349,971.810 (529,486,710)
	ハイブリッド優先証券	合計		529,486,710 [529,486,710]
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル
		EPR PROPERRIES 9 E	2,000	58,620.000
		STAG INDUSTRIAL 9.0 A	1,485	40,243.500
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY	2,288	56,513.600
		RETAIL PROPERTIES 7.0 A	2,500	55,575.000
		SUMMIT HOTEL 7.125	2,600	58,500.000
		CORP OFF PROP TR 7.375 L	3,898	94,721.400
		CHESAPEAKE LODG 7.75	3,494	85,637.940
		EXCEL TRUST B	3,000	76,290.000
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 526,101.440 (52,068,259)

投資証券 合計		52,068,259 [52,068,259]
合計		581,554,969 [581,554,969]

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 75銘柄 ハイブリッド 優先証券 48銘柄 投資証券 8銘柄	74.3%	23.4%	2.3%	96.0%
カナダ・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	-%	4.0%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

	平成25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	35,302,972	-
コール・ローン	17,662,083	25,014,263
株式	2,346,990,904	2,018,364,959
派生商品評価勘定	1,593	34,824
未収入金	21,268,892	36,813,387
未収配当金	12,981,552	1,540,187
流動資産合計	2,434,207,996	2,081,767,620
資産合計	2,434,207,996	2,081,767,620
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	250,890	5,640
前受金	-	9,535,761
未払解約金	22,000,000	2,000,000
流動負債合計	22,250,890	11,541,401
負債合計	22,250,890	11,541,401
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,600,100,426
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	425,410,573	470,125,793
元本等合計	2,411,957,106	2,070,226,219
純資産合計	2,411,957,106	2,070,226,219
負債純資産合計	2,434,207,996	2,081,767,620

## 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25年5月11日 至 平成25年11月11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



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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首	平成24年11月13日	平成25年5月11日
期首元本額	2,217,154,794円	1,986,546,533円
期中追加設定元本額	29,457,490円	22,911,241円
期中一部解約元本額	260,065,751円	409,357,348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	193,461,815円	177,834,279円
ファンド(毎月分配型)		
安定重視ポートフォリオ(奇数	57,837,373円	47,839,997円
月分配型)		
インカム重視ポートフォリオ	66,328,442円	52,315,014円
(奇数月分配型)		
成長重視ポートフォリオ(奇数	1,066,365,292円	830,699,532円
月分配型)		
ダイワ・株/債券/コモディ	188,895,581円	145,012,480円
ティ・バランスファンド		
ダイワ資産分散インカムオーブ	214,535,530円	161,965,142円
ン(奇数月決算型)		
DCダイワ・ワールドアセット	40,734,899円	39,195,963円
(六つの羽/安定コース)		
DCダイワ・ワールドアセット	70,800,529円	65,796,171円
(六つの羽/6分散コース)		
DCダイワ・ワールドアセット	87,587,072円	79,441,848円
(六つの羽/成長コース)		
計	1,986,546,533円	1,600,100,426円
2. 期末日における受益権の総数	1,986,546,533口	1,600,100,426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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	平成25年11月11日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
	株式	87,778,597
合計	87,778,597	87,042,395

(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25年4月16日から平成25年5月10日まで、及び平成25年10月16日から平成25年11月11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25年5月10日 現在				平成25年11月11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	41,570,442	-	41,794,849	224,407	7,404,573	-	7,403,104	1,469

イギリス・ポンド	16,360,922	-	16,427,249	66,327	2,073,157	-	2,078,797	5,640
スウェーデン・クローナ	1,672,880	-	1,694,000	21,120	5,331,416	-	5,324,307	7,109
ユーロ	23,536,640	-	23,673,600	136,960	-	-	-	-
買建	11,750,702	-	11,725,812	24,890	7,404,573	-	7,432,288	27,715
ユーロ	11,750,702	-	11,725,812	24,890	7,404,573	-	7,432,288	27,715
合計	53,321,144	-	53,520,661	249,297	14,809,146	-	14,835,392	29,184

## (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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2141円 (12,141円)	1.2938円 (12,938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	48,737	4.776	232,767.910	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	12,491	12.100	151,141.100	
	ROLLS-ROYCE HLDS-PRF C2	1,097,704	0.000	1,097.700	
	REXAM PLC	51,807	5.255	272,245.780	
	PRUDENTIAL PLC	27,098	12.610	341,705.780	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	23,666	16.480	390,015.680	
	VODAFONE GROUP PLC	208,887	2.287	477,724.560	
	KINGFISHER PLC	53,879	3.800	204,740.200	
	RECKITT BENCKISER PLC	5,740	48.150	276,381.000	
	NATIONAL GRID PLC	40,704	7.740	315,048.960	
	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	11,733	34.260	401,972.580	
	HSBC HOLDINGS PLC	79,719	6.954	554,365.920	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	26,699	20.550	548,664.450	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 4,167,871.620 (660,607,652)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	

	NESTLE SA-REGISTERED	13,436	66.200	889,463.200
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,474	249.900	368,352.600
	NOVARTIS AG-REG SHS	8,491	70.950	602,436.450
	GIVAUDAN REG	301	1,302.000	391,902.000
	HOLCIM LTD-REG	5,445	68.100	370,804.500
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 2,622,958.750 (281,653,311)
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
	SWEDBANK AB	17,044	166.800	2,842,939.200
	HENNES & MAURITZ AB-B	9,170	270.500	2,480,485.000
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	16,273	187.300	3,047,932.900
	ATLAS COPCO AB-B SHS	16,224	162.200	2,631,532.800
スウェーデン・クローナ	小計			スウェーデン・クローナ 11,002,889.900 (164,933,320)
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	22,660	105.000	2,379,300.000
ノルウェー・クローネ	小計			ノルウェー・クローネ 2,379,300.000 (38,259,143)
ユーロ	株		ユーロ	ユーロ
	BAYER AG	5,413	93.800	507,739.400
	SIEMENS AG	3,660	95.620	349,969.200
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	5,156	81.770	421,606.120
	BASF SE	5,939	75.680	449,463.520
	ALLIANZ SE-REG	3,572	124.250	443,821.000
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	35,141	11.345	398,674.640
	PHILIPS ELECTRONICS NV	14,588	26.195	382,132.660
	AHOLD (KONINKLIJKE) NV	22,877	13.930	318,676.610
	KONINKLIJKE DSM NV	5,019	58.420	293,209.980
	TOTAL SA	11,772	43.800	515,613.600
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	5,992	61.720	369,826.240
	BNP PARIBAS	8,815	53.100	468,076.500
	ORANGE	19,093	9.692	185,049.350
	SANOFI	6,907	78.020	538,884.140
	REPSOL SA	12,835	18.880	242,324.800
	ENAGAS	17,449	19.565	341,389.680
	OESTERREICHISCHE POST	10,621	35.355	375,505.450
ユーロ	小計			ユーロ 6,601,962.890 (872,911,533)
合計				2,018,364,959 [2,018,364,959]

- (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 13銘柄	100%	32.7%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	14.0%
スウェーデン・クローナ	株式 4銘柄	100%	8.2%

ノルウェー・クローネ	株式	1銘柄	100%	1.9%
ユーロ	株式	17銘柄	100%	43.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[次へ](#)

## 「ダイワ・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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	115,734,928	76,615,516
コール・ローン	8,987,918	34,333,580
株式	2,015,238,127	1,777,267,250
投資証券	50,194,332	18,184,309
未収入金	480,763	25,366,016
未収配当金	5,408,360	5,586,458
流動資産合計	2,196,044,428	1,937,353,129
資産合計	2,196,044,428	1,937,353,129
負債の部		
流動負債		
未払金	-	19,955,795
未払解約金	-	33,000,000
その他未払費用	130	70,701
流動負債合計	130	53,026,496
負債合計	130	53,026,496
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,118,048,266
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	951,239,503	766,278,367
元本等合計	2,196,044,298	1,884,326,633
純資産合計	2,196,044,298	1,884,326,633
負債純資産合計	2,196,044,428	1,937,353,129

## 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25年5月11日 至 平成25年11月11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。</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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>平成24年11月13日 1,458,867,598円 12,803,075円 226,865,878円</p>	<p>平成25年5月11日 1,244,804,795円 20,594,329円 147,350,858円</p>
<p>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 ファンド(毎月分配型) 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) ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型) DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)</p>	<p>130,517,386円 45,937,586円 48,633,259円 710,640,031円 128,881,583円 150,737,697円 5,455,607円 10,582,383円 13,419,263円</p>	<p>135,253,061円 36,128,899円 41,091,866円 637,919,628円 113,068,242円 125,082,023円 6,130,727円 10,582,383円 12,791,437円</p>
計	1,244,804,795円	1,118,048,266円
2. 期末日における受益権の総数	1,244,804,795口	1,118,048,266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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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	82,218,828	28,108,139
投資証券	92,664	50,585
合計	82,126,164	28,057,554

（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25年4月16日から平成25年5月10日まで、及び平成25年10月16日から平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7642円 (17,642円)	1.6854円 (16,854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	20,000	37.950	759,000.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	18,000	34.780	626,040.000	
	WESTPAC BANKING	25,000	33.180	829,500.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	20,000	32.710	654,200.000	
	RIO TINTO LTD	8,000	65.250	522,000.000	
	METCASH LTD	36,000	3.310	119,160.000	
	PRIMARY HEALTH CARE LTD	80,000	5.010	400,800.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	3,500	79.100	276,850.000	
	ORICA LIMITED	5,000	19.540	97,700.000	
	QBE INSURANCE	5,000	14.950	74,750.000	
	TELSTRA CORPORATION	80,000	5.180	414,400.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	5,000	54.560	272,800.000	
	CSL LIMITED	4,000	67.750	271,000.000	
	WESFARMERS LIMITED	10,000	43.500	435,000.000	
	SUNCORP GROUP LTD	35,000	13.350	467,250.000	
	TRANSURBAN GROUP	30,000	7.070	212,100.000	
	DUET GROUP	185,000	2.170	401,450.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROU	4,000	50.100	200,400.000	
	IOOF HOLDINGS LTD	28,000	9.070	253,960.000	
SPARK INFRASTRUCTURE GROU	200,000	1.655	331,000.000		
IINET LTD	20,000	6.410	128,200.000		
SIRTEX MEDICAL LTD	18,032	12.170	219,449.440		
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 7,967,009.440 (739,816,498)	
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	20,000	20.860	417,200.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	22,000	16.880	371,360.000	
	KEPPEL CORP	20,000	10.910	218,200.000	
	SINGAPORE TELECOM LTD	70,000	3.800	266,000.000	
	AMARA HOLDINGS LTD	135,000	0.560	75,600.000	
	M1 LTD	100,000	3.400	340,000.000	
HYFLUX LTD	138,000	1.210	166,980.000		
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 1,855,340.000 (147,295,444)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	KIA MOTORS CORPORATION	3,500	62,800.000	219,800,000.000	
	SK HYNIX INC	3,000	32,250.000	96,750,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	1,800	248,500.000	447,300,000.000	
	POSCO	200	325,000.000	65,000,000.000	
	S-OIL CORPORATION	1,000	75,300.000	75,300,000.000	
	WINS TECHNET CO LTD	37,703	18,700.000	705,046,100.000	
	LOTTE SHOPPING CO	750	383,000.000	287,250,000.000	
	NAVER CORP	200	560,000.000	112,000,000.000	
	KB FINANCIL GROUP INC	3,000	39,450.000	118,350,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS	900	1,410,000.000	1,269,000,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,300	223,500.000	290,550,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	5,000	38,950.000	194,750,000.000		
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン	

				3,881,096,100.000 (360,553,828)
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	15,000	102.000	1,530,000.000
	CHEUNG KONG	10,000	120.400	1,204,000.000
	WHARF HOLDINGS	15,000	63.950	959,250.000
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	100,000	14.920	1,492,000.000
	HUTCHISON WHAMPOA	15,000	94.450	1,416,750.000
	HANG SENG BANK	22,000	126.100	2,774,200.000
	NEW WORLD DEVELOPMENT	60,000	10.600	636,000.000
	IND & COMM BK OF CHINA-H	200,000	5.220	1,044,000.000
	TRULY INTL HLDGS	64,000	4.690	300,160.000
	SAMSONITE INTERNATIONAL	60,000	21.400	1,284,000.000
	BANK OF CHINA HONG KONG	50,000	24.650	1,232,500.000
	LENOVO GROUP LTD	280,000	8.530	2,388,400.000
香港・ドル 小計				香港・ドル 16,261,260.000 (207,656,291)
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル
	ORIENTAL UNION CHEMICAL	110,000	30.000	3,300,000.000
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	60,298	51.600	3,111,376.800
	MEDIATEK INC	10,000	428.000	4,280,000.000
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	115,000	177.000	20,355,000.000
	FUBON FINANCIAL HOLDING	73,495	41.000	3,013,295.000
	CATHAY FINANCIAL HOLDING	165,816	43.000	7,130,088.000
	YUANTA FINANCIAL HOLDING	350,000	15.650	5,477,500.000
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO	407,456	18.900	7,700,918.400
	FAR EASTONE TELECOMM CO L	40,000	65.300	2,612,000.000
	SPORTON INTERNATIONAL INC	58,500	113.000	6,610,500.000
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS	30,000	109.500	3,285,000.000
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	180,000	106.000	19,080,000.000
	HON HAI PRECISION INDUS	100,000	73.900	7,390,000.000
	FAR EASTERN NEW CENTURY	76,276	32.400	2,471,342.400
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 95,817,020.600 (321,945,189)
合計				1,777,267,250 [1,777,267,250]

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	オーストラリア・ドル	WESTFIELD RETAIL TRUST	35,000	106,050.000	
		ARDENT LEISURE LTD	45,000	89,775.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 195,825.000 (18,184,309)	
投資証券 合計				18,184,309 [18,184,309]	
合計				18,184,309 [18,184,309]	

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 投資証券 22銘柄 2銘柄	97.6%	2.4%	42.2%
シンガポール・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	8.2%
韓国・ウォン	株式 12銘柄	100%	-%	20.1%
香港・ドル	株式 12銘柄	100%	-%	11.6%
台湾・ドル	株式 14銘柄	100%	-%	17.9%

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  
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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,135,902,162	2,093,835,467
株式	35,330,172,200	39,421,457,600
投資証券	-	1,380,724,000
派生商品評価勘定	38,880,610	-
未収入金	130,868,106	872,741,684
未収配当金	360,345,820	338,854,600
前払金	-	5,600,000
差入委託証拠金	33,810,000	10,200,000
流動資産合計	38,029,978,898	44,123,413,351
資産合計	38,029,978,898	44,123,413,351
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,901,031
前受金	13,765,000	-
未払金	618,406,252	1,510,693,618
未払解約金	81,000,000	1,000,000
流動負債合計	713,171,252	1,513,594,649
負債合計	713,171,252	1,513,594,649
純資産の部		
元本等		
元本	1 21,000,328,468	23,956,433,348
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	16,316,479,178	18,653,385,354
元本等合計	37,316,807,646	42,609,818,702
純資産合計	37,316,807,646	42,609,818,702
負債純資産合計	38,029,978,898	44,123,413,351

## 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25年5月11日 至 平成25年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>

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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首	平成24年11月13日	平成25年5月11日
期首元本額	21,305,208,852円	21,000,328,468円
期中追加設定元本額	3,292,205,341円	6,377,360,847円
期中一部解約元本額	3,597,085,725円	3,421,255,967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)	7,241,900,600円	7,800,589,495円
ダイワ好配当日本株投信(季節 点描)	9,994,012,892円	12,917,880,091円
ダイワ・バランス3資産(外 債・海外リート・好配当日本 株)	80,631,119円	69,216,549円
安定重視ポートフォリオ(奇数 月分配型)	122,024,648円	100,390,338円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	135,893,893円	110,773,020円
成長重視ポートフォリオ(奇数 月分配型)	2,144,948,421円	1,832,120,792円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	381,342,827円	318,863,988円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	431,542,512円	347,030,293円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	98,289,658円	94,685,861円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	164,211,320円	167,931,852円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	205,530,578円	196,951,069円
計	21,000,328,468円	23,956,433,348円
2. 期末日における受益権の総数	21,000,328,468口	23,956,433,348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25年5月11日 至 平成25年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成25年11月11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25年5月10日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	平成25年11月11日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
	株式	3,298,506,111
投資証券	-	6,532,756
合計	3,298,506,111	169,886,626

(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25年4月16日から平成25年5月10日まで、及び平成25年10月16日から平成25年11月11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25年5月10日 現在				平成25年11月11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	1,148,515,000	-	1,187,760,000	39,245,000	287,400,000	-	285,600,000	1,800,000
合計	1,148,515,000	-	1,187,760,000	39,245,000	287,400,000	-	285,600,000	1,800,000

## (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25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7770円 (17,770円)	1.7786円 (17,786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	
ウエストホールディングス	89,000	1,614	143,646,000	
安藤・間	880,000	364	320,320,000	
西松建設	36,000	336	12,096,000	
田辺工業	104,900	646	67,765,400	
矢作建設	128,800	791	101,880,800	
大東建託	36,000	9,750	351,000,000	
東亜道路	170,000	552	93,840,000	
大林道路	411,000	582	239,202,000	
積水ハウス	88,000	1,336	117,568,000	
日本リーテック	59,000	725	42,775,000	
NEC ネットズエスアイ	90,000	2,586	232,740,000	
アコーディア・ゴルフ	412,000	1,126	463,912,000	
江崎グリコ	292,000	1,051	306,892,000	
寿スピリッツ	12,400	1,356	16,814,400	
S Foods	253,000	982	248,446,000	
バリューコマース	208,700	1,481	309,084,700	
プロックリー	237,000	484	114,708,000	
エレマテック	50,200	1,489	74,747,800	
キタムラ	132,700	598	79,354,600	
コメ兵	250,700	1,300	325,910,000	
横浜冷凍	210,000	770	161,700,000	
日本たばこ産業	96,000	3,510	336,960,000	
アルコニクス	32,100	2,005	64,360,500	
あいホールディングス	246,700	1,191	293,819,700	
アークランドサービス	11,600	2,251	26,111,600	
サイボー	99,900	511	51,048,900	
常和ホールディングス	68,000	2,822	191,896,000	
クリヤマホールディングス	222,000	1,310	290,820,000	
旭化成	280,000	768	215,040,000	
ケー・エフ・シー	5,000	608	3,040,000	
コーエーテクモHD	110,000	1,181	129,910,000	

日本製紙	108,000	1,701	183,708,000
東ソー	1,460,000	420	613,200,000
伊勢化学工業	48,000	834	40,032,000
日本ピグメント	419,000	218	91,342,000
三菱瓦斯化学	240,000	787	188,880,000
セブテーニHLDGS	547,000	1,026	561,222,000
テイクアンドギヴニーズ	127,000	1,814	230,378,000
三菱電機	112,900	1,070	120,803,000
中外製薬	40,000	2,285	91,400,000
小野薬品	17,000	8,050	136,850,000
日水製薬	104,000	1,074	111,696,000
第一三共	60,000	1,894	113,640,000
ダイト	106,000	1,395	147,870,000
太陽ホールディングス	21,400	3,120	66,768,000
サカタインクス	215,000	980	210,700,000
T & K TOKA	59,000	2,007	118,413,000
イマジニア	189,300	1,090	206,337,000
秀英予備校	74,900	325	24,342,500
マイスターエンジニアリング	29,700	520	15,444,000
トレンドマイクロ	36,000	3,560	128,160,000
リソー教育	218,000	630	137,340,000
アルファシステムズ	43,600	1,361	59,339,600
フューチャーアーキテクト	387,000	551	213,237,000
ソフトバンク・テクノ	26,900	1,653	44,465,700
日本ハウズイング	5,800	2,224	12,899,200
昭和シエル石油	940,000	1,028	966,320,000
東洋ゴム	1,460,000	580	846,800,000
西川ゴム工業	90,000	1,780	160,200,000
フコク	154,800	853	132,044,400
クリエートメディック	56,500	933	52,714,500
バンドー化学	270,000	393	106,110,000
住友大阪セメント	620,000	401	248,620,000
ノザワ	434,000	387	167,958,000
日本ヒューム	535,000	861	460,635,000
日本コンクリート	92,000	577	53,084,000
ジオスター	135,000	483	65,205,000
ジャパンパイル	403,800	981	396,127,800
TOTO	130,000	1,344	174,720,000
日本碍子	140,000	1,679	235,060,000
クニミネ工業	120,000	615	73,800,000
モリ工業	598,000	411	245,778,000
メタルアート	1,000	404	404,000
日本精線	374,000	424	158,576,000
三菱マテリアル	220,000	369	81,180,000
オーナンバ	328,200	588	192,981,600
アーレステイ	3,900	740	2,886,000
アルインコ	165,000	926	152,790,000
日東精工	310,000	334	103,540,000
岡部	250,000	1,255	313,750,000
ジーテクト	68,400	3,345	228,798,000
トーアミ	78,900	688	54,283,200
東プレ	202,100	1,349	272,632,900
パイオラックス	38,500	3,210	123,585,000
スーパーツール	34,000	456	15,504,000
アイダエンジニア	104,000	925	96,200,000



DMG森精機	80,000	1,607	128,560,000
やまびこ	41,600	2,838	118,060,800
レオン自動機	531,000	504	267,624,000
日精エーエスビー	62,800	1,929	121,141,200
オカダアイヨン	344,000	699	240,456,000
シンニッタン	341,200	366	124,879,200
鶴見製作所	28,000	995	27,860,000
加藤製作所	240,000	628	150,720,000
フジテック	216,000	1,218	263,088,000
キトー	88,000	1,559	137,192,000
福島工業	226,500	1,530	346,545,000
新晃工業	152,400	808	123,139,200
T P R	92,000	1,785	164,220,000
ニチダイ	53,400	466	24,884,400
イーグル工業	170,000	1,622	275,740,000
山洋電気	168,000	613	102,984,000
日本電産	18,700	9,150	171,105,000
愛知電機	788,000	297	234,036,000
セイコーエプソン	495,000	2,239	1,108,305,000
サン電子	75,100	2,926	219,742,600
日本トリム	104,200	8,540	889,868,000
T O A	145,000	829	120,205,000
リオン	6,000	1,473	8,838,000
日本フェンオール	48,700	1,265	61,605,500
三社電機製作所	684,000	584	399,456,000
千代田インテグレ	17,300	1,899	32,852,700
芝浦電子	83,200	1,285	106,912,000
村田製作所	23,000	7,930	182,390,000
名村造船所	245,000	1,139	279,055,000
全国保証	44,400	4,215	187,146,000
トヨタ自動車	268,000	6,250	1,675,000,000
日信工業	45,500	1,818	82,719,000
大同メタル工業	62,000	976	60,512,000
カルソニックカンセイ	308,000	520	160,160,000
太平洋工業	484,000	672	325,248,000
富士重工業	250,000	2,640	660,000,000
村上開明堂	77,000	1,430	110,110,000
フジオーゼックス	180,000	481	86,580,000
テイ・エス テック	156,000	3,540	552,240,000
小野建	190,000	1,190	226,100,000
アドヴァン	79,900	1,186	94,761,400
萩原電気	9,600	1,288	12,364,800
ヒマラヤ	15,500	1,282	19,871,000
アルゴグラフィックス	102,000	1,577	160,854,000
川澄化学工業	126,000	596	75,096,000
国際計測器	13,900	996	13,844,400
ニホンフラッシュ	172,200	2,648	455,985,600
前田工織	270,500	1,067	288,623,500
アートネイチャー	176,000	2,250	396,000,000
バンダイナムコHLDGS	122,000	1,970	240,340,000
萩原工業	67,300	1,314	88,432,200
きもと	292,800	915	267,912,000
ニッピ	189,000	1,122	212,058,000
ピジヨン	74,000	4,750	351,500,000
伊藤忠	210,000	1,240	260,400,000

丸 紅	220,000	716	157,520,000
三菱商事	388,000	1,975	766,300,000
三谷商事	61,600	2,068	127,388,800
フルサト工業	66,000	1,034	68,244,000
稲畑産業	254,000	1,038	263,652,000
ワ キ タ	170,000	1,249	212,330,000
サンワ テクノス	62,100	856	53,157,600
東陽テクニカ	103,500	1,101	113,953,500
加賀電子	22,000	1,036	22,792,000
あおぞら銀行	1,470,000	283	416,010,000
三菱UFJフィナンシャルG	1,130,000	613	692,690,000
三井住友フィナンシャルG	207,000	4,770	987,390,000
ふくおかフィナンシャルG	450,000	440	198,000,000
大分銀行	672,000	370	248,640,000
宮崎銀行	563,000	283	159,329,000
東日本銀行	780,000	216	168,480,000
いちよし証券	109,000	1,354	147,586,000
極東証券	185,500	1,677	311,083,500
MS & AD	77,100	2,485	191,593,500
マネースクウェア・ジャパン	80,000	1,283	102,640,000
スターツコーポレーション	218,000	1,068	232,824,000
フジ住宅	13,100	650	8,515,000
日本エスリード	37,100	1,026	38,064,600
エリアリンク	516,500	112	57,848,000
エフ・ジェー・ネクスト	237,400	553	131,282,200
アルプス物流	47,200	969	45,736,800
ヒューテックノオリン	219,500	995	218,402,500
センコー	200,000	523	104,600,000
NSユニテッド海運	615,000	265	162,975,000
川崎近海汽船	248,000	317	78,616,000
日本航空	45,000	5,370	241,650,000
住友倉庫	268,000	553	148,204,000
東陽倉庫	495,000	255	126,225,000
KDDI	99,000	5,680	562,320,000
NTTドコモ	245,000	1,564	383,180,000
エムティーアイ	42,300	1,611	68,145,300
北海道電力	80,000	1,203	96,240,000
東京瓦斯	400,000	503	201,200,000
セレスポ	85,000	343	29,155,000
三協フロンテア	108,000	722	77,976,000
DTS	82,000	1,738	142,516,000
スクウェア・エニックス・HD	102,000	1,735	176,970,000
シーイーシー	208,500	616	128,436,000
西尾レントオール	112,000	2,573	288,176,000
丸紅建材リース	473,000	214	101,222,000
ステップ	153,000	825	126,225,000
日鉄住金物産	777,000	297	230,769,000
JKホールディングス	256,000	620	158,720,000
日立機材	306,800	950	291,460,000
バイテック	130,000	901	117,130,000
東 テ ク	280,300	600	168,180,000
ジェコス	132,000	729	96,228,000
合計			39,421,457,600

## (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	日本ロジスティクスファンド投資法人	206	206,824,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	26,000	1,173,900,000	
投資証券 合計			1,380,724,000	
合計			1,380,724,000	

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  
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成25年5月11日から平成25年11月11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25年5月10日現在	当 期 平成25年11月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	41,005,847	35,897,721
親投資信託受益証券	2,455,888,932	2,020,864,543
未収入金	14,000,000	2,000,000
流動資産合計	2,510,894,779	2,058,762,264
資産合計	2,510,894,779	2,058,762,264
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	14,354,948	12,703,758
未払解約金	12,993,379	3,690,615
未払受託者報酬	213,074	185,824
未払委託者報酬	5,220,623	4,552,989
その他未払費用	92,818	86,137
流動負債合計	32,874,842	21,219,323
負債合計	32,874,842	21,219,323
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 2,870,989,690	<sup>1</sup> 2,540,751,744
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 392,969,753	<sup>2</sup> 503,208,803
（分配準備積立金）	37,647,427	27,367,523
元本等合計	2,478,019,937	2,037,542,941
純資産合計	2,478,019,937	2,037,542,941
負債純資産合計	2,510,894,779	2,058,762,264

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成24年11月13日 至 平成25年5月10日		自 平成25年5月11日 至 平成25年11月11日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		8,402		8,156
有価証券売買等損益		738,724,942		117,024,389
営業収益合計		738,733,344		117,016,233
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		619,336		574,810
委託者報酬	<sup>1</sup>	15,174,511	<sup>1</sup>	14,083,567
その他費用		92,818		86,137
営業費用合計		15,886,665		14,744,514
営業利益又は営業損失（ ）		722,846,679		131,760,747
経常利益又は経常損失（ ）		722,846,679		131,760,747
当期純利益又は当期純損失（ ）		722,846,679		131,760,747
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（ ）		20,541,842		2,413,184
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,191,939,019		392,969,753
剰余金増加額又は欠損金減少額		146,678,248		61,755,857
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		146,678,248		61,755,857
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,842,167		3,062,316
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,842,167		3,062,316
分配金	<sup>2</sup>	46,171,652	<sup>2</sup>	39,585,028
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		392,969,753		503,208,803

## (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25年5月11日	至 平成25年11月11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25年11月10日が休日のため、当特定期間末日を平成25年11月11日としております。このため、当特定期間は185日となっております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首元本額	3,411,047,921円	2,870,989,690円
期中追加設定元本額	15,840,309円	15,453,145円
期中一部解約元本額	555,898,540円	345,691,091円
2. 特定期間末日における受益権の総数	2,870,989,690口	2,540,751,744口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は392,969,753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503,208,803円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成24年11月13日 至 平成25年5月10日	自 平成25年5月11日 至 平成25年11月11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	627,110円	582,046円

## 2. 2 分配金の計算過程

（自平成24年11月13日 至平成25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（14,962,371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（439,011円）及び分配準備積立金（39,226,973円）より分配対象額は54,628,355円（1万口当たり167.04円）であり、うち16,351,974円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年1月11日 至平成25年3月11日）  
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,528,507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（461,991円）及び分配準備積立金（35,739,416円）より分配対象額は51,729,914円（1万口当たり167.25円）であり、うち15,464,730円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年3月12日 至平成25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（18,852,674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（521,148円）及び分配準備積立金（33,149,701円）より分配対象額は52,523,523円（1万口当たり182.95円）であり、うち14,354,948円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年5月11日 至平成25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（10,347,609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（542,563円）及び分配準備積立金（35,914,664円）より分配対象額は46,804,836円（1万口当たり170.69円）であり、うち13,710,397円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年7月11日 至平成25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（9,608,070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（615,813円）及び分配準備積立金（31,182,356円）より分配対象額は41,406,239円（1万口当たり157.19円）であり、うち13,170,873円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成25年9月11日 至平成25年11月11日）  
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,477,674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（645,973円）及び分配準備積立金（26,593,607円）より分配対象額は40,717,254円（1万口当たり160.26円）であり、うち12,703,758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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	平成25年11月11日現在 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	211,922,511	49,019,293
合計	211,922,511	49,019,293

## （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25年5月10日現在	平成25年11月11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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年5月10日現在	当 期 平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8631円 (8,631円)	0.8019円 (8,019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	970,954,740	1,422,351,598	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	73,810,821	98,913,881	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	110,773,020	197,020,893	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	46,590,723	66,135,531	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	52,315,014	67,685,165	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	41,091,866	69,256,230	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	61,341,006	99,501,245	
親投資信託受益証券 合計			2,020,864,543	
合計			2,020,864,543	

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J-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

## 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成25年5月11日から平成25年11月11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25年5月10日現在	当 期 平成25年11月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	165,616,207	128,934,864
親投資信託受益証券	10,770,507,891	9,248,733,831
未収入金	33,000,000	34,000,000
流動資産合計	10,969,124,098	9,411,668,695
資産合計	10,969,124,098	9,411,668,695
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	50,174,416	44,559,864
未払解約金	33,885,584	16,001,543
未払受託者報酬	896,996	844,436
未払委託者報酬	23,323,051	21,955,547
その他未払費用	369,621	384,668
流動負債合計	108,649,668	83,746,058
負債合計	108,649,668	83,746,058
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 12,543,604,194	<sup>1</sup> 11,139,966,156
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 1,683,129,764	<sup>2</sup> 1,812,043,519
（分配準備積立金）	642,923,466	552,131,561
元本等合計	10,860,474,430	9,327,922,637
純資産合計	10,860,474,430	9,327,922,637
負債純資産合計	10,969,124,098	9,411,668,695

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成24年11月13日 至 平成25年5月10日		自 平成25年5月11日 至 平成25年11月11日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		32,700		35,485
有価証券売買等損益		4,004,800,906		170,774,060
営業収益合計		4,004,833,606		170,738,575
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		2,464,628		2,565,005
委託者報酬	<sup>1</sup>	64,082,451	<sup>1</sup>	66,691,326
その他費用		369,621		384,668
営業費用合計		66,916,700		69,640,999
営業利益又は営業損失（ ）		3,937,916,906		240,379,574
経常利益又は経常損失（ ）		3,937,916,906		240,379,574
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,937,916,906		240,379,574
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（ ）		72,578,547		16,700,486
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,895,261,234		1,683,129,764
剰余金増加額又は欠損金減少額		524,280,114		240,952,886
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		524,280,114		240,952,886
剰余金減少額又は欠損金増加額		20,300,941		7,383,152
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		20,300,941		7,383,152
分配金	<sup>2</sup>	157,186,062	<sup>2</sup>	138,804,401
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,683,129,764		1,812,043,519

## (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25年5月11日	至 平成25年11月11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25年11月10日が休日のため、当特定期間末日を平成25年11月11日としております。このため、当特定期間は185日となっております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成25年5月10日現在	平成25年11月11日現在
1. 1 期首元本額	14,117,450,844円	12,543,604,194円
期中追加設定元本額	68,212,204円	42,879,794円
期中一部解約元本額	1,642,058,854円	1,446,517,832円
2. 特定期間末日における受益権の総数	12,543,604,194口	11,139,966,156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1,683,129,764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1,812,043,519円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成24年11月13日 至 平成25年5月10日	自 平成25年5月11日 至 平成25年11月11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	6,413,992円	6,767,211円

## 2. 2 分配金の計算過程

<p>（自平成24年11月13日 至平成25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（35,359,323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（574,271,142円）及び分配準備積立金（690,190,325円）より分配対象額は1,299,820,790円（1万口当たり956.45円）であり、うち54,360,456円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成25年5月11日 至平成25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（22,140,782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（509,517,332円）及び分配準備積立金（613,025,602円）より分配対象額は1,144,683,716円（1万口当たり955.45円）であり、うち47,922,108円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成25年7月11日 至平成25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（20,682,951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（493,028,498円）及び分配準備積立金（567,126,800円）より分配対象額は1,080,838,249円（1万口当たり933.32円）であり、うち46,322,429円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成25年1月11日 至平成25年3月11日）          計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（39,261,628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（557,367,002円）及び分配準備積立金（648,937,034円）より分配対象額は1,245,565,664円（1万口当たり946.28円）であり、うち52,651,190円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成25年3月12日 至平成25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（88,642,790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（532,363,242円）及び分配準備積立金（604,455,092円）より分配対象額は1,225,461,124円（1万口当たり976.96円）であり、うち50,174,416円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成25年9月11日 至平成25年11月11日）          計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（54,053,801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（452,537,072円）及び分配準備積立金（542,637,624円）より分配対象額は1,049,228,497円（1万口当たり941.86円）であり、うち44,559,864円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項



区 分	当 期
	自 平成25年5月11日 至 平成25年11月11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25年11月11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25年5月10日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	平成25年11月11日現在 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	1,270,781,148	366,114,071
合計	1,270,781,148	366,114,071

## （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25年5月10日現在	平成25年11月11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25年5月11日 至 平成25年11月11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25年5月10日現在	当 期 平成25年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8658円 (8,658円)	0.8373円 (8,373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	1,261,660,270	1,848,206,129	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	334,281,277	447,970,339	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	1,832,120,792	3,258,610,040	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	772,665,475	1,096,798,641	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	830,699,532	1,074,759,054	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	637,919,628	1,075,149,741	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	275,716,594	447,239,887	
親投資信託受益証券 合計			9,248,733,831	
合計			9,248,733,831	

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J-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

## 2 【ファンドの現況】

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25年11月29日

資産総額	1,840,531,101円
負債総額	7,757,992円
純資産総額（ - ）	1,832,773,109円
発行済数量	2,028,433,790口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9035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25年11月29日

資産総額	71,495,967,019円
負債総額	224,765,700円
純資産総額（ - ）	71,271,201,319円
発行済数量	46,661,314,433口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5274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25年11月29日

資産総額	310,414,899,201円
負債総額	2,892,040,991円
純資産総額（ - ）	307,522,858,210円
発行済数量	259,732,858,585口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1840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25年11月29日

資産総額	176,994,260,905円
負債総額	1,408,281,538円
純資産総額（ - ）	175,585,979,367円
発行済数量	128,023,485,350口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3715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25年11月29日

資産総額	26,563,588,972円
負債総額	142,254,823円
純資産総額（ - ）	26,421,334,149円
発行済数量	15,848,067,397口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.6672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25年11月29日

資産総額	2,477,622,356円
負債総額	33,341,626円
純資産総額（ - ）	2,444,280,730円
発行済数量	1,630,548,577口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4991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25年11月29日

資産総額	2,138,510,468円
負債総額	18,002,820円
純資産総額（ - ）	2,120,507,648円
発行済数量	1,544,565,465口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3729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25年11月29日

資産総額	1,940,054,907円
負債総額	18,152,292円
純資産総額（ - ）	1,921,902,615円
発行済数量	1,106,233,623口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.7373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25年11月29日

資産総額	44,095,543,016円
負債総額	748,461,645円

純資産総額（ - ）	43,347,081,371円
発行済数量	23,243,696,797口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.8649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25年11月29日

資産総額	2,081,997,848円
負債総額	5,493,963円
純資産総額（ - ）	2,076,503,885円
発行済数量	2,487,034,711口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8349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25年11月29日

資産総額	9,545,658,873円
負債総額	34,590,445円
純資産総額（ - ）	9,511,068,428円
発行済数量	10,877,005,266口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8744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、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25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CIO (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

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

## ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・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オペレーショナルリスク・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25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	84,524
追加型株式投資信託	490	9,428,403
株式投資信託 合計	495	9,512,927
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	3,146,086
公社債投資信託 合計	17	3,146,086
総合計	512	12,659,013

## 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8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期事業年度（平成24年4月1日から平成25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55期事業年度に係る中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,745,233	14,380,327
有価証券	19,655,070	9,427,636
前払金	314	207
前払費用	90,562	142,919
未収入金	11,931	521,825
未収委託者報酬	6,516,540	7,183,011
未収収益	55,102	106,914
貯蔵品	11,888	9,551
繰延税金資産	630,508	491,727
その他	190,450	8,445
流動資産計	30,907,602	32,272,567
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	1,003,450	254,258
器具備品（純額）	513,162	26,257
リース資産（純額）	484,571	222,274
リース資産（純額）	-	5,726
建設仮勘定	5,715	-
無形固定資産	2,870,849	3,194,512
ソフトウェア	2,173,517	3,132,238
ソフトウェア仮勘定	684,878	50,423
電話加入権	11,850	11,850

商標権		132		-
その他		471		-
投資その他の資産		16,375,520		15,113,434
投資有価証券		10,034,136		8,342,934
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		136,315		136,315
従業員に対する長期貸付金		112,674		92,527
差入保証金		542,920		1,000,820
長期前払費用		8,478		7,376
投資不動産（純額）	1	409,876	1	402,340
貸倒引当金		9,950		9,950
固定資産計		20,249,820		18,562,205
資産合計		51,157,423		50,834,773

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務	-	1,227
預り金	55,551	56,491
未払金	7,194,946	6,795,899
未払収益分配金	17,954	10,333
未払償還金	88,334	113,002
未払手数料	3,386,380	3,764,501
その他未払金	2	2,908,061
未払費用	3,313,011	3,383,551
未払法人税等	963,539	588,040
未払消費税等	229,365	189,139
賞与引当金	307,000	841,300
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	12,789,375	11,855,648
<b>固定負債</b>		
リース債務	-	4,494
退職給付引当金	1,670,344	1,935,442
役員退職慰労引当金	68,068	67,410
繰延税金負債	1,782,558	1,740,407
固定負債計	3,520,970	3,747,753
負債合計	16,310,345	15,603,402
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計	8,089,414	8,097,020
株主資本合計	34,759,414	34,767,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益	53,783	-
評価・換算差額等合計	87,663	464,350
純資産合計	34,847,077	35,231,371
負債・純資産合計	51,157,423	50,834,773

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,931,048	73,498,726
その他営業収益	401,212	526,465
営業収益計	73,332,260	74,025,191
営業費用		
支払手数料	41,050,089	41,213,272
広告宣伝費	709,853	604,864
公告費	699	949
受益証券発行費	74	-
調査費	7,993,144	8,116,701
調査費	878,635	824,915
委託調査費	7,114,509	7,291,786
委託計算費	733,156	807,090
営業雑経費	1,651,996	1,280,599
通信費	205,421	206,564
印刷費	472,511	404,023
協会費	52,117	53,643
諸会費	11,971	11,281
その他営業雑経費	909,973	605,086
営業費用計	52,139,015	52,023,478
一般管理費		
給料	4,452,711	5,264,128
役員報酬	209,630	249,180
給料・手当	3,646,155	3,782,533
賞与	289,926	391,114
賞与引当金繰入額	307,000	841,300
福利厚生費	728,342	809,254
交際費	71,356	55,806
寄付金	591	636
旅費交通費	215,939	196,147
租税公課	171,533	206,178
不動産賃借料	727,939	887,968
退職給付費用	422,030	469,713
役員退職慰労引当金繰入額	27,988	38,970
固定資産減価償却費	1,107,222	1,181,438
諸経費	1,077,041	1,094,627
一般管理費計	9,002,696	10,204,869
営業利益	12,190,548	11,796,843

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
<b>営業外収益</b>				
受取配当金	1	74,753	1	257,704
有価証券利息		13,537		11,102
受取利息		2,771		10,598
時効成立分配金・償還金		42,189		21,305
投資有価証券売却益		117,695		279,443
有価証券償還益		68,106		101,052
その他		54,685		44,912
営業外収益計		373,739		726,118
<b>営業外費用</b>				
時効成立後支払分配金・償還金		2,182		19,392
投資有価証券売却損		95,389		36,469
有価証券償還損		67,873		33,338
投資不動産管理費用		16,454		16,271
その他		49,191		23,111
営業外費用計		231,091		128,584
経常利益		12,333,196		12,394,377
<b>特別利益</b>				
投資有価証券売却益		-		39,827
固定資産売却益		-		31
その他		-		16,466
特別利益計		-		56,325
<b>特別損失</b>				
固定資産除却損	2	4,871	2	129,816
減損損失	3	76,217	3	-
有価証券評価損		211,376		-
本社移転関連費用		346,425		1,099,913
その他		19,547		14,428
特別損失計		658,438		1,244,158
税引前当期純利益		11,674,757		11,206,544
法人税、住民税及び事業税		5,254,642		4,286,691
法人税等調整額		602,832		109,902
法人税等合計		4,651,809		4,176,789
当期純利益		7,022,948		7,029,755



## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25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		
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,874,176	7,715,116
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計		
当期首残高	10,248,473	8,089,414
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	8,089,414	8,097,020

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）	当事業年度 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）
株主資本合計		
当期首残高	36,918,473	34,759,414
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	34,759,414	34,767,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	104,040	33,879
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	137,920	430,470
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	137,920	430,470
当期末残高	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	85,902	53,783
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	32,119	53,783
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	32,119	53,783
当期末残高	53,783	-
評価・換算差額等合計		
当期首残高	18,137	87,663
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	105,800	376,686
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	105,800	376,686
当期末残高	87,663	464,350
純資産合計		
当期首残高	36,900,336	34,847,077
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	105,800	376,686
当期変動額合計	2,053,258	384,293

当期末残高

34,847,077

35,231,371

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社及び関連会社株式

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とおりであります。

建物 6～47年

器具備品 3～20年

## (会計上の見積も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、当事業年度より、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、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

## (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）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

### 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

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

#### （３）退職給付引当金

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

また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

#### （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

前事業年度において、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、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計を終了しております。

#### （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)

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「時効成立後支払分配金・償還金」及び「投資不動産管理費用」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、「営業外費用」の「その他」に表示していた67,829千円は、「時効成立後支払分配金・償還金」2,182千円、「投資不動産管理費用」16,454千円、「その他」49,191千円として組替えております。

### (貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
建物	986,089千円	15,528千円
器具備品	2,234,738千円	250,072千円
リース資産	-	409千円
投資建物	712,587千円	724,130千円
投資器具備品	22,398千円	23,691千円

#### 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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
未払金	3,577,654千円	2,883,398千円

#### 3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,591,590千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23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
受取配当金	-	185,280千円

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23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
建物	-	546千円
器具備品	4,812千円	128,892千円
無形固定資産（その他）	-	377千円
投資不動産	59千円	-
計	4,871千円	129,816千円

3 減損損失に関する注記

前事業年度（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つのグループリ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。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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とお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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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

(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25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とおり提案しております。

剰余金の配当の総額	7,027百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,694円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25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はりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。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はいたしましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。

## （ ）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。

当事業年度（平成25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	14,380,327	14,380,327	-
(2) 未収委託者報酬	7,183,011	7,183,011	-
(3) 未収入金	521,825	521,825	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,711,401	16,711,401	-
資産計	38,796,567	38,796,567	-
(1) 未払手数料	3,764,501	3,764,501	-
(2) その他未払金	2,908,061	2,908,061	-
(3) 未払費用(*1)	2,782,587	2,782,587	-
負債計	9,455,149	9,455,149	-

(\*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。

<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、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収入金

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。

(4) 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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,163,689	1,059,169
(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	542,920	1,000,820

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	-

当事業年度(平成25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	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
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	-	1,434,397	4,840,276	-
合計	21,563,339	1,434,397	4,840,276	-

(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。

当事業年度(平成25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。

当事業年度（平成25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			
(1) 株式	93,459	55,101	38,357
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	6,224,312	5,440,857	783,455
小計	6,317,771	5,495,959	821,812
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	10,393,629	10,493,953	100,323
小計	10,393,629	10,493,953	100,323
合計	16,711,401	15,989,912	721,489

(注) 非上場株式（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。

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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)
(1) 株式	141,128	39,827	-
(2) その他 証券投資信託の受益証券	28,114,625	279,443	36,469
合計	28,255,753	319,271	36,469

#### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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す。

当事業年度において、その他有価証券(非上場株式)について3,220千円の減損処理を行っております。

#### (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。

当事業年度(平成25年3月31日現在)

該当事項はありません。

##### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
退職給付債務	1,670,344千円	1,935,442千円
退職給付引当金	1,670,344千円	1,935,442千円

## 3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
勤務費用	261,341千円	301,777千円
その他	160,689千円	167,935千円
退職給付費用	442,030千円	469,713千円

(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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	838,826	837,121
退職給付引当金	599,247	693,199
賞与引当金	116,690	280,855
連結法人間取引(譲渡損)	258,256	264,269
繰延資産	12	157,330
未払事業税	212,753	154,219
投資有価証券評価損	191,138	128,953
出資金評価損	114,425	114,425
未払社会保険料	14,071	43,411
器具備品	33,365	33,316
役員退職慰労引当金	25,804	24,920
本社移転関連費用引当金	131,676	-
資産除去債務	110,989	-
有価証券評価損	80,344	-
その他有価証券評価差額金	27,099	-
その他	27,474	29,627
繰延税金資産小計	2,782,177	2,761,651
評価性引当額	1,379,241	1,323,069
繰延税金資産合計	1,402,935	1,438,582
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428,233	2,428,233
建物(資産除去債務)	76,837	-
繰延ヘッジ損益	29,783	-
その他有価証券評価差額金	18,241	257,138

その他	1,888	1,888
繰延税金負債合計	2,554,985	2,687,261
繰延税金負債の純額	1,152,049	1,248,679

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

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

### （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

旧日本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

前事業年度において、移転までの使用見込期間を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23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
期首残高	-	292,000
見積りの変更に伴う増加額	292,000	-
資産除去債務の履行による減少額	-	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

前事業年度において、本社移転計画に基づく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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

### 1. 関連当事者との取引

#### (ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 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。

## 当事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25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)	1,591,590	-	-

## 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。

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25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	20,510,864	未払手数料	2,758,584
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	1,205,721	未払費用	82,519
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	1,194,567	長期差入保証金 未収入金	971,157 511,559

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

2. 親会社に関する注記

(株)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23年４月１日 至 平成24年３月31日)		当事業年度 (自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日)	
1株当たり純資産額	13,358.92円	1株当たり純資産額	13,506.24円
1株当たり当期純利益	2,692.30円	1株当たり当期純利益	2,694.91円

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

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

	前事業年度 (自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日)	当事業年度 (自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日)
当期純利益(千円)	7,022,948	7,029,755
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。

[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 (平成25年9月30日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		565,010
有価証券		21,111,923
未収委託者報酬		8,007,008
貯蔵品		11,855
繰延税金資産		610,353
その他		460,696
流動資産計		30,766,848
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	258,610
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		2,759,986
その他		95,853
無形固定資産合計		2,855,839
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		13,716,293
その他	1	1,627,256
貸倒引当金		9,950
投資その他の資産合計		15,333,600
固定資産計		18,448,051
資産合計		49,214,899

(単位:千円)

		当中間会計期間 (平成25年9月30日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務		1,227
未払金		6,519,299
未払費用		3,233,085
未払法人税等		1,115,633
賞与引当金		879,500
その他	3	443,391
流動負債計		12,192,137
<b>固定負債</b>		
リース債務		3,885
退職給付引当金		1,983,018

役員退職慰労引当金	86,895
繰延税金負債	1,699,959
固定負債計	3,773,758
負債合計	15,965,895
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	5,812,608
利益剰余金合計	6,186,905
株主資本合計	32,856,905
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	392,098
評価・換算差額等合計	392,098
純資産合計	33,249,004
負債・純資産合計	49,214,899

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		42,527,881
その他営業収益		392,427
営業収益計		42,920,308
営業費用		
支払手数料		23,860,060
その他営業費用		5,551,085
営業費用計		29,411,146
一般管理費	1	5,464,561
営業利益		8,044,600
営業外収益	2	189,595
営業外費用	1, 3	40,337
経常利益		8,193,859
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		8,193,859
法人税、住民税及び事業税		3,195,671

法人税等調整額	119,063
中間純利益	5,117,251

## (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25年4月1日 至 平成25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	7,722,723
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,027,366
中間純利益	5,117,251
当中間期変動額合計	1,910,115
当中間期末残高	5,812,608

(単位:千円)

当中間会計期間  
(自 平成25年4月1日  
至 平成25年9月30日)

利益剰余金合計	
当期首残高	8,097,020
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,027,366
中間純利益	5,117,251
当中間期変動額合計	1,910,115
当中間期末残高	6,186,905
株主資本合計	
当期首残高	34,767,020
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,027,366
中間純利益	5,117,251
当中間期変動額合計	1,910,115
当中間期末残高	32,856,905
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	464,350
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）	72,252
当中間期変動額合計	72,252
当中間期末残高	392,098
評価・換算差額等合計	
当期首残高	464,350
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）	72,252
当中間期変動額合計	72,252
当中間期末残高	392,098
純資産合計	
当期首残高	35,231,371
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,027,366
中間純利益	5,117,251
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	72,252
当中間期変動額合計	1,982,367
当中間期末残高	33,249,004

## 注記事項

(重要な会計方針)

	当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
--	--

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。</p> <p>(2) 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。</p> <p>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. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く） 定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="590 604 1133 683"> <tr> <td>建物</td> <td>6～47年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3～20年</td> </tr> </table> <p>（会計上の見積も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、当中間会計期間より有形固定資産（投資不動産を含む）の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。 この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。 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す。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 長期前払費用 定額法によっております。</p> <p>(4) リース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>	建物	6～47年	器具備品	3～20年
建物	6～47年				
器具備品	3～20年				
<p>3. 引当金の計上基準</p>	<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 役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額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>				



4. 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	(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。 (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。
------------------------------	---

## (中間貸借対照表関係)

当中間会計期間 (平成25年9月30日)	
1. 減価償却累計額	
有形固定資産	279,239千円
投資その他の資産	750,645千円
2. 債務保証	
子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,633,380千円に対して保証を行っております。	
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。	

## (中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	13,229千円
無形固定資産	467,147千円
投資その他の資産	3,475千円
2. 営業外収益の主要項目	
受取配当金	66,775千円
投資有価証券売却益	62,800千円
有価証券償還益	23,635千円
3. 営業外費用の主要項目	
有価証券償還損	18,420千円
投資不動産管理費用	9,067千円
貯蔵品廃棄損	4,963千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25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25年6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

(金融商品関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成25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	565,010	565,010	-
(2) 未収委託者報酬	8,007,008	8,007,008	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	28,627,978	28,627,978	-
資産計	37,199,997	37,199,997	-
(1) 未払金	6,519,299	6,519,299	-
(2) 未払費用(*1)	2,812,213	2,812,213	-
負債計	9,331,512	9,331,512	-

(\*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。

## &lt;注1&gt;金融商品の時価の算定方法

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。

<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	1,001,278

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。

（有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25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			
株式	109,770	55,101	54,669
証券投資信託の受益証券	5,692,625	5,093,365	599,259
小計	5,802,396	5,148,467	653,928
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
証券投資信託の受益証券	22,825,582	22,870,284	44,702
小計	22,825,582	22,870,284	44,702
合計	28,627,978	28,018,751	609,226

（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。

（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25年4月1日 至 平成25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25年 4月 1日 至 平成25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

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25年 4月 1日 至 平成25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25年 4月 1日 至 平成25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25年 4月 1日 至 平成25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25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日 )	
1 株当たり純資産額	12,746.28円
1 株当たり中間純利益金額	1,961.74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)	5,117,251
普通株式に係る中間純利益(千円)	5,117,251
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。)

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成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25年3月末日現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 (平成25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	21,729	
株式会社きらやか銀行	22,700	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	25,602	(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	13,233	
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)	1,494,234	

(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 470千米ドル（約40百万円）（平成24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118百万円）（平成24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25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、使用する場合があります。

(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25年12月13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 貞廣 篤典 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 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25年5月11日から平成25年11月11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25年11月11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25年12月13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 貞廣 篤典 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 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25年5月11日から平成25年11月11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25年11月11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25年12月13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 貞廣 篤典 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 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25年5月11日から平成25年11月11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25年11月11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）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年 5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25年3月31日現在の財政状態並びに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25年11月27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	高 波 博 之	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25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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な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25年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了す

る中間会計期間(平成25年4月1日から平成25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。