

【表紙】
【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長 殿
【提出日】 平成21年4月6日提出
【計算期間】 第3計算期間
（自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日）
【ファンド名】 DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）
【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 石橋 俊朗
【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【事務連絡者氏名】 長谷川 英男
【連絡場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【電話番号】 03-5695-2111
【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部 【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】

当ファンドは、安定した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。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。

1. DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）
2. DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）
3. DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

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1回
	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

（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1回」…目論見書等において、年1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・属性区分の定義について、くわしくは、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。

※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
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	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）	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）	成長コース

<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1,000億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>



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。

◇各資産への投資は、それぞれ次のマザーファンドを通じて行ないます。

海 外 債 券	外国債券インデックスマザーファンド
国 内 債 券	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)
海 外 リ ー ト	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
国 内 リ ー ト	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
海 外（北米）株式	ダイワ北米好配当株マザーファンド
海 外（欧州）株式	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
海外（アジア・オセアニア）株式	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
国 内 株 式	ダイワ好配当日本株マザーファンド

（注）各マザーファンドの詳細については、後掲の「各マザーファンドの投資態度等」をご参照下さい。

【マザーファンド方式について】

当ファンドは、マザーファンド方式で運用を行ないます。

マザーファンド方式とは、受益者からの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しくみです。

2

標準組入比率の異なる3つのコース(安定コース／6分散コース／成長コース)があります。

◇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。

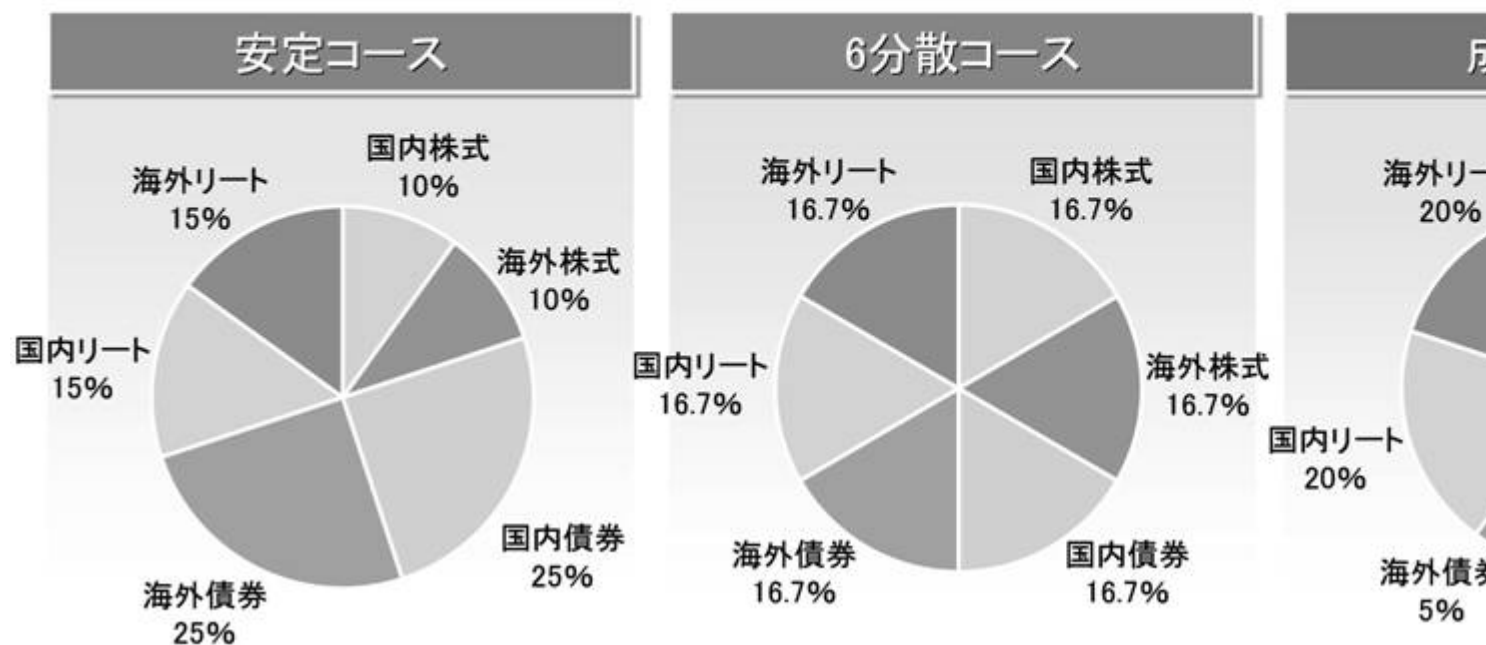
	安 定 コース	6分散 コース	成 長 コース
外国債券インデックスマザーファンド	25%	16.7%	5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	25%	16.7%	5%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	15%	16.7%	20%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	15%	16.7%	20%
ダイワ北米好配当株マザーファンド(※)	合計で 10%	合計で 16.7%	合計で 25%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(※)			
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(※)			
ダイワ好配当日本株マザーファンド	10%	16.7%	25%

(※) 上記3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

- 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、上記の運用が行なわれないことがあります。

[次へ](#)

[各コースの実質的な資産配分イメージ]



安定コース

		資産別比率		
		株式 20%	債券 50%	リート 30%
内外比率	国内 50%	国内株式 10%	国内債券 25%	国内リート 15%
	海外 50%	海外株式 10%	海外債券 25%	海外リート 15%

6分散コース

		資産別比率		
		株式 33.3%	債券 33.3%	リート 33.3%
内外比率	国内 50%	国内株式 16.7%	国内債券 16.7%	国内リート 16.7%
	海外 50%	海外株式 16.7%	海外債券 16.7%	海外リート 16.7%

成長コース

		資産別比率		
		株式 50%	債券 10%	リート 40%
内外比率	国内 50%	国内株式 25%	国内債券 5%	国内リート 20%
	海外 50%	海外株式 25%	海外債券 5%	海外リート 20%

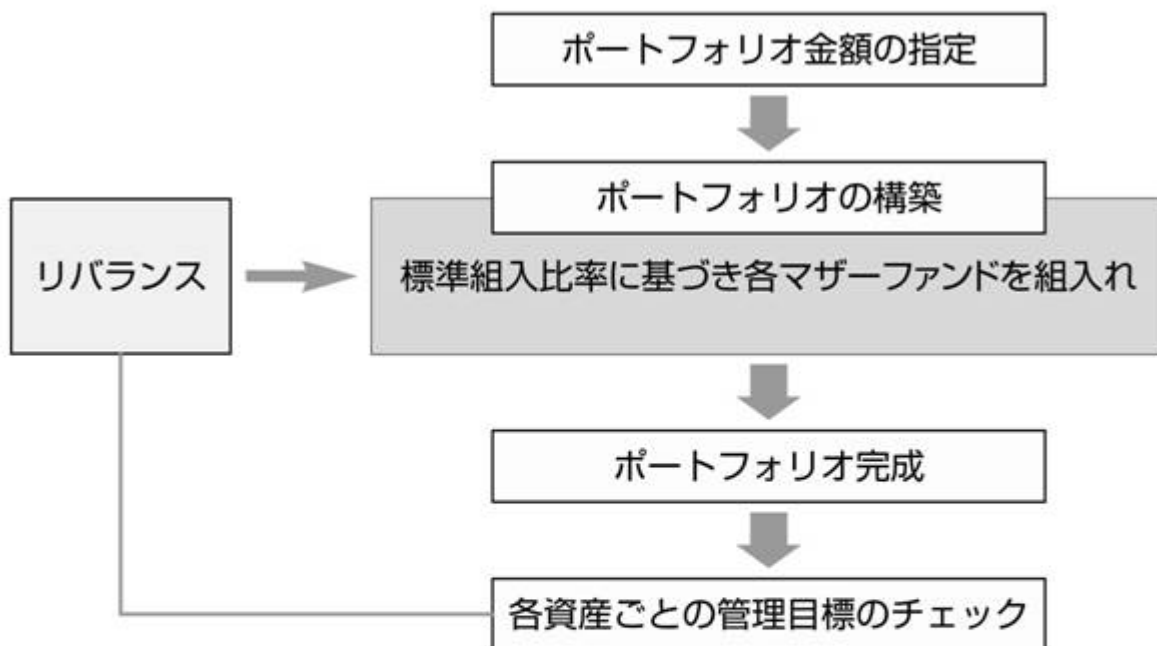
（注1）各資産への投資は、マザーファンドを通じて行ないます。

（注2）上記は、「投資態度」に規定されている「各マザーファンドの標準組入比率」をもとに作成した資産イメージであり、実際の組入比率とは異なります。

（注3）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。

[次へ](#)

【運用プロセス】



- ◇標準組入比率に従って、各資産のマザーファンド受益証券へ投資し、ポートフォリオを構築します。
- ◇各資産ごとのウェイトが標準組入比率から乖離しないよう管理目標を設定し、各資産の比率をその範囲内に維持するように運用を行ないます。
- ◇各資産の価格変動により、各資産の組入比率が管理目標を超えた場合は、標準組入比率に近づける方向へリバランスを行ないます。

3

毎計算期末に、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。収益分配金は、自動的に再投資されます。

4

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合に限り取得できます。

5

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます(前4.の前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合を除きます。)

各マザーファンドの投資態度等

1. 外国債券インデックスマザーファンド

- ①主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ②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。

シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)とは…

シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。

【運用プロセス】

シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、各通貨別にリスクモデル^(注)を用いて、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とマザーファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようポートフォリオを構築します。また、リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とマザーファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行ないます。

(注) リスクモデルでは、個別債券をキャッシュフロー(利金と償還金)ごとに分解し、ポートフォリオをキャッシュフローの集合体として分析するなどの手法を採用することで、イールドカーブの変化などの債券価格変動要因がポートフォリオの価値に与える影響の測定・管理やポートフォリオの効率的な複製を行なうことなどができます。

2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

- ①主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ②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。

NOMURA-BPI総合指数とは…

NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

【運用プロセス】

NOMURA-BPI総合指数に連動する投資成果をあげることがめざして運用を行ないます。ポートフォリオの構築にあたっては、金利リスクや信用リスクなどのリスク特性がベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）と同程度となるように、リスクモデル^(注1)を用いて最適化を図ります。これに加えて、層化抽出法^(注2)と呼ばれる手法を併用し、残存期間構成、セクター構成等をベンチマーク構成比に合わせることで、同指数との連動をめざします。また、NOMURA-BPI総合指数の構成銘柄変更等に対しても、リスクモデルによる最適化法と層化抽出法を使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

（注1）リスクモデルとは…

債券のリターンを、国債イールドカーブの変化、種別スプレッドの変化、個別銘柄独自の変化など、リターンに共通の影響を与える複数の要素に分解して説明可能とする計量モデルです。当ファンドでは、NOMURA-BPI総合指数に連動するポートフォリオの構築と、ポートフォリオのリスク特性の管理に用いています。

（注2）層化抽出法とは…

ポートフォリオを残存期間やセクターなどの特性値で分類し、各グループの構成比をベンチマークの構成比に近づけることを目指す手法です。

3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

- ①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。
- ②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。
 - イ. 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。
 - ロ. 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。
- ③外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- ④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。
- ⑤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。

〈コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- ・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。
- ・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。
- ・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。
- ・所在地：アメリカ合衆国、ニューヨーク州、ニューヨーク

4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

- ①わが国の金融商品取引所の上場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。
- ②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。
 - イ. 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。
 - ロ. 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。
- ③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。

5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

- ①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。
- ②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。
- ③外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク(前3.ご参照)に運用の指図にかかる権限を委託します。
- ④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。
- ⑤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。

※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。

6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

- ①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。
- ②(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)
- ③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。
- ④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。
- ⑤(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

〈パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドについて〉

- 欧州を基盤とした運用グループである「パイオニア・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

7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

- ①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。
- ②(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)
- ③(ダイワ欧州好配当株マザーファンドの④と同規定)
- ④(ダイワ北米好配当株マザーファンドの⑤と同規定)

8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

- ①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。
- ②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。
- ③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。
- ④J-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。

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) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者
お取扱窓口	収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金（※5） 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。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③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
	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。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④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	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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②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 マザ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・アンド・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・アンド・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）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21年2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。

・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】

① 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. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券
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

② 投資態度

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（信託財産の純資産総額に対する比率とします。）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。

	安 定 コース	6 分散 コース	成 長 コース
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	25%	16.7%	5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）の受益証券	25%	16.7%	5%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券	15%	16.7%	20%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券	15%	16.7%	20%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券	10% (注)	16.7% (注)	25% (注)
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券			
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券			
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券	10%	16.7%	25%

(注) 3ファンドの合計（各地域の時価総額に応じて配分します。）

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。

ニ. 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】

<各ファンド共通>

① 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

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

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。）

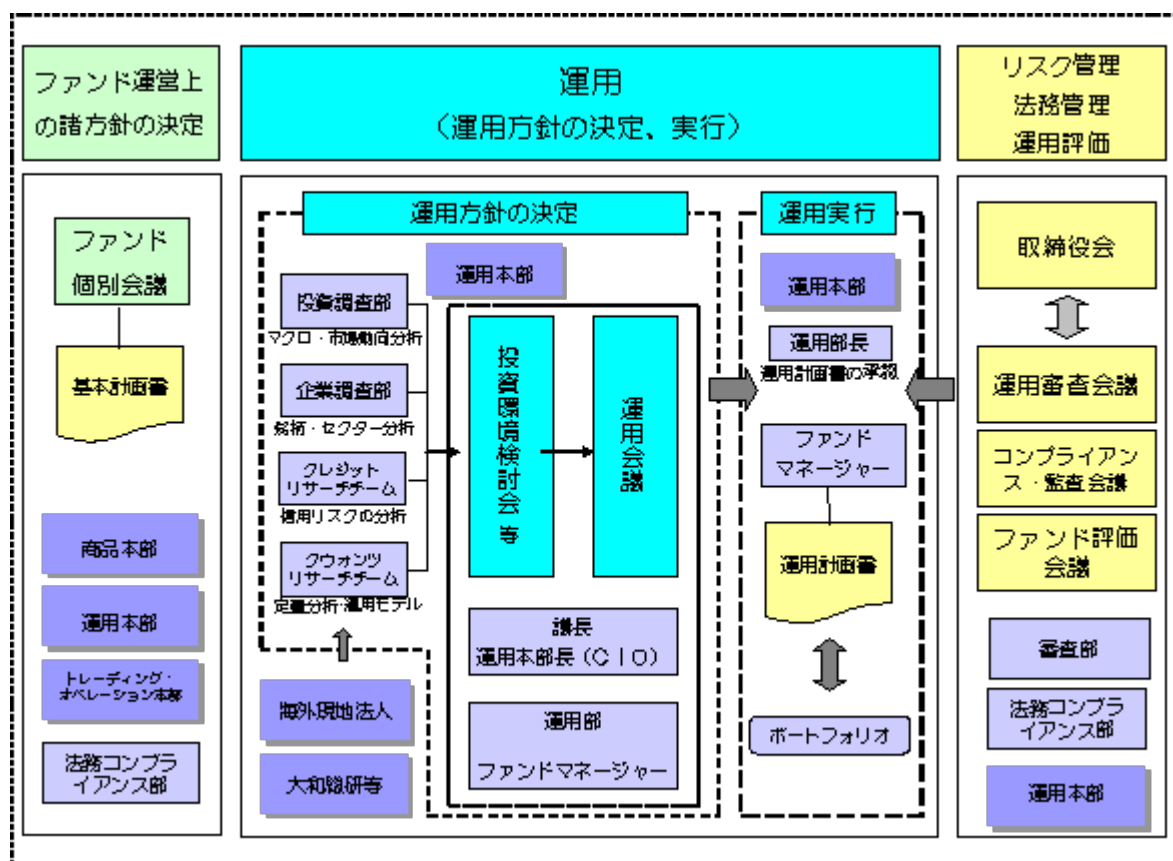
③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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】

① 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。



② 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運用本部長（CIO）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 基本的な運用方針の決定

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

ニ. 運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限（委託会社）

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

イ. 運用本部長（C I O）（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. 運用副本部長（1～5名程度）

C I Oを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ. 運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ. ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

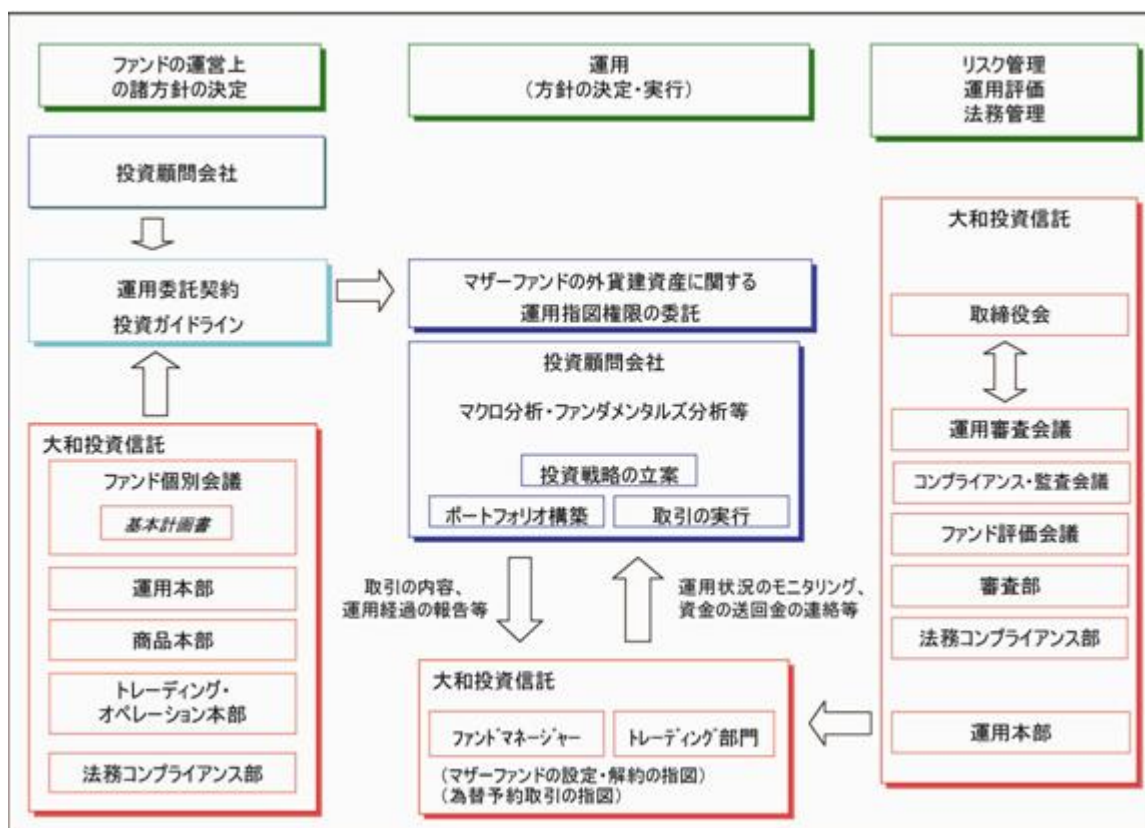
これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は15～25名程度です。

⑤ 受託会社に対する管理体制

信託財産の管理業務を通じて、受託会社の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を総合的に検証しています。また、年次で受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受けています。

※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④に同じ。)

※ 上記の運用体制は平成21年2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】

＜各ファンド共通＞

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

<各ファンド共通>

① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

- イ. 主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ. 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。
- ハ. 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

- ① 委託会社は、信託金を、主として、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します。
 - 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、）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. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
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

② 委託会社は、信託金を、前①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

① 株式

- イ. 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します。
- ロ. 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

② 同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④ 先物取引等

- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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、信託財産の効率的な運用に資するため、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。

⑤ 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合計額が、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合計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たときは、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。

⑥ 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合計額が、信託財産にかかる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の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計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合計額が、信託財産にかかる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の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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たときは、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. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）

を主要投資対象とします。

② 投資態度

- イ. 主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA－BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ. 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。
- ハ. 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生じたとき、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

- ① 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)④、⑤および⑥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

- ② 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。

- ③ 委託会社は、信託金を、前②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

① 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券

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。

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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。）における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引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、信託財産の効率的な運用に資するため、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。

⑤ 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たときは、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。

⑥ 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たときは、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

① 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。

② 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・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

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

ホ. 外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

① 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

② 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。

③ 委託会社は、信託金を、前②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

- ① 株式への直接投資は、行ないません。
- ② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ③ 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。
- ④ 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

- ① 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ものに委託します。

コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク
280 パーク・アベニュー、ニューヨーク、ニューヨーク州 10017

- ② 前①の規定にかかわらず、前①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

① 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。

② 投資態度

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

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

(2) 投資対象

- ① 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）

- ② 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。

- ③（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

- ①～③（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）
- ④ 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>

① 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。

② 投資態度

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

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

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

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

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

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>

① 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。

② 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>

① 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。

② 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>

① 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)③、④および⑤に定めるものに限りします。）

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

② 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。

③ 委託会社は、信託金を、前②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＞

- ①（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）
- ② 委託会社は、信託金を、次の有価証券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。
- ③（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＞

- ① 株式
株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 外貨建資産
外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ③ 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)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額、以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

④ 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たときは、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。

⑤ 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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(4) 運用指図権限の委託

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

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）

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

① 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

②（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

① 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。

② 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

① 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)③、④および⑤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

② 委託会社は、信託金を、次の有価証券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。

③（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

① 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

③ 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)③1.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)③1.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。

④ 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。

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たときは、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。

⑤ 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たときは、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、すべて受益者に帰属します。

投資家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。

① 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。

② 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。

③ 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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。

④ リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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. リートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

ニ. 組入リー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。

⑤ 外国証券への投資に伴うリスク

イ. 為替リスク

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。

⑥ その他

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

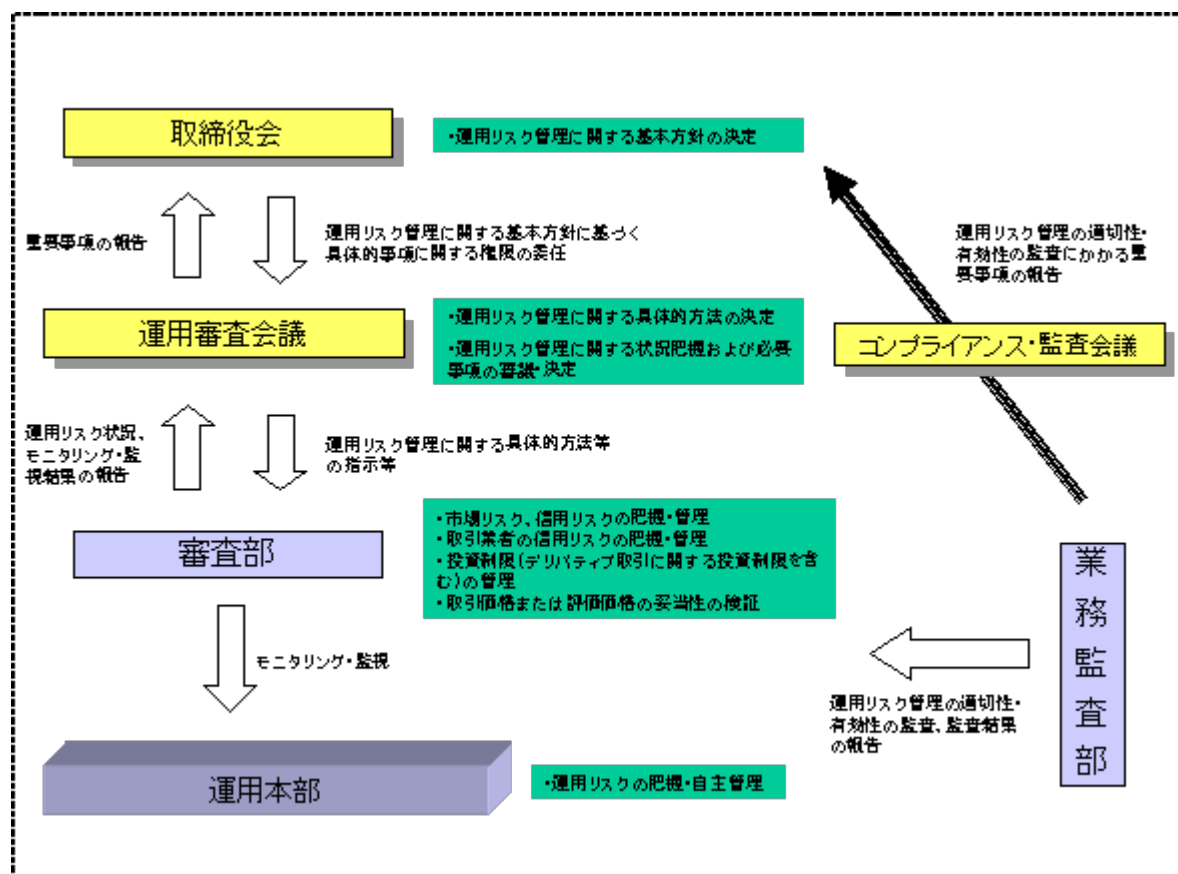
ロ. ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受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付けたものとして取扱います。

(3) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

- ① 取得申込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。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせることで知ることができます。

- ・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、半休日は9:00～12:00）

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 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】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

- ① 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、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日と

します。)および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。

安定コース	年0.945%（税抜0.9%）
6分散コース	年1.1025%（税抜1.05%）
成長コース	年1.26%（税抜1.2%）

- ② 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。
- ③ 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。

	委託会社	販売会社	受託会社
安定コース	年0.4725% （税抜0.45%）	年0.42% （税抜0.4%）	年0.0525% （税抜0.05%）
6分散コース	年0.5565% （税抜0.53%）	年0.4935% （税抜0.47%）	
成長コース	年0.6405% （税抜0.61%）	年0.567% （税抜0.54%）	

- ④ 前③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。
- ⑤ 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、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、

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。

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

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0.5%の率を乗じて得た額とします。

(4) 【その他の手数料等】

- ① 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。
- ② 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、）、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。
- ③ 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。
- ④ 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。

<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、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】

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

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、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21年1月1日から平成22年12月31日までの2年間は特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。平成21年および平成22年において、1年間に受取る普通分配金など上場株式等の配当等の金額の合計額が100万円（年間の支払金額が1万円以下のものは除外されます。）を超える場合には、確定申告が必要となります。この場合申告分離課税または総合課税を選択することができ、申告分離課税を選択した場合は、その超える部分については20%（所得税15%および地方税5%）の税率が適用されます。

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21年1月1日から平成22年12月31日までの2年間は特例措置として、1年間の上場株式等の譲渡所得等の金額の合計額が500万円までは、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用され、源泉徴収選択口座においては申告不要の特例があります。なお、当該合計額が500万円を超える場合には、確定申告が必要となります。この場合、その超える部分については、20%（所得税15%および地方税5%）の税率が適用されます。

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。

<注1>個別元本について

- ① 受益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。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ② 受益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、当該受益者が追加信託を行なうつと当該受益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。

- ③ 受益者が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特別分配金を控除した額が、その後の当該受益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

- ① 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「特別分配金」（受益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。
- ② 受益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受益者の個別元本と同額の場合または当該受益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受益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特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

（※）税法または確定拠出年金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】

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)

(1) 【投資状況】（平成21年2月27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	280,785,815	98.56
内 日本	280,785,815	98.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,100,687	1.44
純資産総額	284,886,502	100.00

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	81,044,765,332	97.80
内 オーストラリア	348,092,585	0.42
内 カナダ	1,928,055,005	2.33
内 スイス	645,426,453	0.78
内 デンマーク	740,603,965	0.89
内 ユーロ	41,091,026,249	49.58
内 英国	7,502,129,537	9.05
内 マレーシア	446,599,846	0.54
内 ノルウェー	244,075,665	0.29
内 ポーランド	673,228,208	0.81
内 スウェーデン	499,821,368	0.60
内 シンガポール	382,577,949	0.46
内 米国	26,543,128,504	32.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,826,251,137	2.20
純資産総額	82,871,016,469	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）	713,912,952	0.86
内 日本	713,912,952	0.86

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	6,042,344,950	62.09
内 日本	6,042,344,950	62.09
地方債証券	917,566,267	9.43
内 日本	917,566,267	9.43
特殊債券	1,426,284,698	14.66

	内 日本	1,426,284,698	14.66
社債券		1,226,201,152	12.60
	内 日本	1,226,201,152	12.60
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		119,810,535	1.23
純資産総額		9,732,207,602	100.00

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
投資証券		52,155,093,292	91.57
	内 オーストラリア	9,254,715,856	16.25
	内 カナダ	1,412,849,208	2.48
	内 ユーロ	6,788,849,040	11.92
	内 英国	4,545,312,088	7.98
	内 香港	1,793,942,161	3.15
	内 ニュージーランド	384,122,045	0.67
	内 シンガポール	761,897,137	1.34
	内 米国	27,213,405,757	47.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,799,351,052	8.43
純資産総額		56,954,444,344	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）		49,406,967	0.09
	内 日本	49,406,967	0.09
為替予約取引（売建）		49,729,843	△0.09
	内 日本	49,729,843	△0.09

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
投資証券		12,926,122,000	95.35
	内 日本	12,926,122,000	95.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		629,931,064	4.65
純資産総額		13,556,053,064	100.00

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（％）
株式		2,002,956,249	68.49
	内 カナダ	174,831,910	5.98
	内 米国	1,828,124,339	62.51
優先証券		650,612,047	22.25
	内 米国	650,612,047	22.25
投資証券		58,357,618	2.00

内 米国	58,357,618	2.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	212,736,041	7.26
純資産総額	2,924,661,955	100.00

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	2,517,964,523	92.76
内 スイス	377,661,680	13.91
内 ユーロ	1,300,342,204	47.90
内 英国	653,655,713	24.08
内 ノルウェー	24,823,832	0.91
内 スウェーデン	161,481,094	5.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	196,621,171	7.24
純資産総額	2,714,585,694	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）	19,680,264	0.72
内 日本	19,680,264	0.72
為替予約取引（売建）	19,682,626	△0.73
内 日本	19,682,626	△0.73

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	2,425,562,070	90.15
内 オーストラリア	902,564,116	33.55
内 香港	439,764,923	16.34
内 韓国	417,798,895	15.53
内 シンガポール	206,809,139	7.69
内 台湾	458,624,997	17.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	265,013,150	9.85
純資産総額	2,690,575,220	100.00

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	22,942,458,830	93.01
内 日本	22,942,458,830	93.01
投資証券	776,680,500	3.15
内 日本	776,680,500	3.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	947,352,956	3.84
純資産総額	24,666,492,286	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。

（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21年2月27日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	外国債券インデックスマザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	41,597,330	1.74163 72,447,496	1.8216 75,773,696	— —	26.60%
2	ダイワ日本債券インデックス マザーファンド（BPI） 日本	親投資信託受 益証券 —	65,770,839	1.06310 69,920,978	1.0620 69,848,631	— —	24.52%
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 —	91,233,195	0.52450 47,852,094	0.4577 41,757,433	— —	14.66%
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 —	56,086,976	0.72998 40,942,767	0.6830 38,307,404	— —	13.45%
5	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 —	32,600,198	0.88785 28,944,216	0.8387 27,341,786	— —	9.60%
6	ダイワ北米好配当株マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	26,024,114	0.68794 17,903,251	0.6496 16,905,264	— —	5.93%
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 —	15,821,796	0.64605 10,221,701	0.5977 9,456,687	— —	3.32%
8	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 —	2,068,072	0.68190 1,410,228	0.6745 1,394,914	— —	0.49%

（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	98.56%
合計	98.56%

（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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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）外国債券インデックスマザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	364,844,160	138.30 504,601,613	141.49 516,218,002	8.000000 21/06/07	0.62%
2	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	432,320,200	109.17 471,973,851	106.59 460,823,071	3.750000 18/11/15	0.56%
3	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	413,188,980	107.43 443,903,481	109.16 451,049,486	5.000000 12/01/04	0.54%
4	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	446,404,840	101.21 451,826,662	100.82 450,083,216	1.500000 10/10/31	0.54%
5	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	410,410,760	110.89 455,104,492	109.46 449,268,451	4.000000 15/02/15	0.54%
6	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	437,504,130	99.97 437,387,767	99.70 436,204,743	0.875000 10/12/31	0.53%
7	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	384,002,060	112.23 430,980,872	110.57 424,591,078	4.250000 15/08/15	0.51%
8	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	393,059,520	108.23 425,425,290	107.78 423,639,551	4.750000 38/12/07	0.51%
9	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	295,875,250	143.28 423,933,017	142.55 421,782,004	8.000000 21/11/15	0.51%
10	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	387,349,140	111.30 431,127,340	106.17 411,271,823	6.000000 31/05/01	0.50%
11	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	364,615,050	108.10 394,159,808	109.86 400,580,679	5.000000 12/07/04	0.48%
12	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	356,291,640	117.31 417,994,226	111.91 398,750,915	6.500000 27/11/01	0.48%
13	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	362,679,480	111.87 405,753,008	109.71 397,895,658	4.125000 15/05/15	0.48%
14	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	374,180,760	103.63 387,793,456	105.81 395,939,371	5.000000 12/02/01	0.48%
15	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	374,202,720	103.32 386,626,250	105.51 394,821,290	4.250000 11/03/07	0.48%
16	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	375,492,590	105.31 395,468,282	104.61 392,829,083	3.500000 18/02/15	0.47%
17	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	372,317,310	102.98 383,412,567	105.25 391,897,477	4.750000 13/02/01	0.47%
18	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	394,875,360	96.34 380,454,811	97.34 384,371,675	4.250000 32/06/07	0.46%
19	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	338,724,000	109.53 371,004,397	112.33 380,488,669	5.000000 18/03/07	0.46%
20	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	344,614,020	106.93 368,519,895	108.81 374,984,854	4.500000 13/01/04	0.45%

21	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	342,495,360	106.71 365,481,101	108.94 373,114,445	5.000000 12/03/07	0.45%
22	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	363,461,960	102.07 371,000,161	101.67 369,535,409	2.000000 10/09/30	0.45%
23	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	337,532,910	107.49 362,837,752	109.26 368,788,457	4.250000 14/07/04	0.45%
24	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	345,708,000	102.68 355,007,308	105.35 364,203,378	4.000000 16/09/07	0.44%
25	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	327,097,590	106.76 349,238,826	108.12 353,670,998	5.000000 11/07/04	0.43%
26	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	343,410,910	102.62 352,425,446	102.18 350,921,307	2.375000 10/08/31	0.42%
27	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	325,358,370	105.74 344,033,940	107.26 349,002,163	4.000000 16/07/04	0.42%
28	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	336,414,840	101.46 341,350,046	103.01 346,554,383	4.250000 14/08/01	0.42%
29	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	309,670,560	107.34 332,428,846	110.19 341,225,990	4.750000 15/09/07	0.41%
30	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	328,445,980	103.28 339,248,568	102.66 337,195,781	2.750000 10/07/31	0.41%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.80%
合計	97.80%

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 2009年3月	買建	3,430,815	326,947,558	335,533,701	0.40%
		シンガポールの買/円売 2009年3月	買建	238,425	15,131,134	15,113,729	0.02%
		スウェーデンクローナ買/円売 2009年3月	買建	708,150	7,864,002	7,690,506	0.01%
		ユーロ買/円売 2009年3月	買建	2,684,725	327,638,478	333,469,700	0.40%
		スイスフラン買/円売 2009年3月	買建	10,188	851,826	854,556	0.00%
		オーストラリアドル買/円売 2009年3月	買建	336,512	21,282,224	21,250,760	0.03%

(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) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	2 8 9 1 0年国債 日本	国債証券 —	145,000,000	101.66 147,410,000	102.91 149,232,550	1.500000 17/12/20	1.53%
2	2 6 9 2年国債 日本	国債証券 —	144,000,000	100.66 144,962,310	100.68 144,992,160	0.900000 10/06/15	1.49%
3	2 8 8 1 0年国債 日本	国債証券 —	133,000,000	103.59 137,783,520	104.85 139,451,830	1.700000 17/09/20	1.43%
4	3 9 0 東北電力 日本	社債券 —	130,000,000	103.50 134,556,240	103.76 134,891,510	2.250000 11/09/22	1.39%
5	2 9 6 1 0年国債 日本	国債証券 —	120,000,000	100.86 121,032,990	102.17 122,611,200	1.500000 18/09/20	1.26%
6	5 政保中部空港 日本	特殊債券 —	121,000,000	100.33 121,407,145	100.34 121,416,240	0.800000 13/03/28	1.25%
7	3 7 8 東北電力 日本	社債券 —	100,000,000	116.95 116,951,000	118.46 118,464,200	3.850000 16/04/25	1.22%
8	2 7 2 1 0年国債 日本	国債証券 —	107,000,000	103.06 110,283,830	103.73 110,994,310	1.400000 15/09/20	1.14%
9	2 8 6 1 0年国債 日本	国債証券 —	103,000,000	104.56 107,704,010	105.96 109,143,950	1.800000 17/06/20	1.12%
10	1 4 4 神奈川県公債 日本	地方債証券 —	100,000,000	104.66 104,661,000	104.56 104,566,300	1.830000 16/12/20	1.07%
11	2 6 公営企業 日本	特殊債券 —	100,000,000	103.07 103,070,000	103.58 103,589,100	1.780000 17/03/24	1.06%
12	1 8 共同発行地方 日本	地方債証券 —	100,000,000	102.47 102,478,400	103.09 103,099,400	1.600000 14/09/25	1.06%
13	2 成田国際空港 日本	特殊債券 —	100,000,000	102.06 102,061,600	102.30 102,300,700	1.660000 15/12/18	1.05%
14	1 2－こ 名古屋市債 日本	地方債証券 —	100,000,000	101.51 101,513,700	102.09 102,098,700	1.400000 12/05/21	1.05%
15	7 9 3 政保公営企業 日本	特殊債券 —	100,000,000	102.00 102,000,700	102.05 102,057,900	1.800000 10/09/22	1.05%
16	4 国際協力銀行 日本	特殊債券 —	100,000,000	101.45 101,456,400	101.99 101,993,600	1.520000 12/03/20	1.05%
17	1 3 首都高速道路 日本	特殊債券 —	100,000,000	101.03 101,032,000	101.97 101,975,000	1.480000 15/03/20	1.05%
18	5 7 6 東京都公債 日本	地方債証券 —	100,000,000	101.56 101,563,210	101.83 101,839,000	1.400000 11/08/25	1.05%
19	1 公営企業 日本	特殊債券 —	100,000,000	101.28 101,283,500	101.81 101,817,500	1.420000 11/12/26	1.05%
20	2 1 東京瓦斯 日本	社債券 —	100,000,000	101.13 101,131,400	101.67 101,670,700	1.390000 11/11/15	1.04%
21	4 8 2 東京電力 日本	社債券 —	100,000,000	101.14 101,141,600	101.57 101,575,800	1.450000 11/05/25	1.04%
22	1 7－9 千葉県5年 日本	地方債証券 —	100,500,000	100.58 101,092,447	100.97 101,482,287	1.100000 11/03/25	1.04%
23	4 1 三菱電機 日本	社債券 —	100,000,000	100.39 100,393,200	101.16 101,165,500	1.400000 12/12/07	1.04%

24	4 みずほコーポレート 日本	社債券 —	100,000,000	100.23 100,236,300	100.77 100,779,800	1.400000 12/01/27	1.04%
25	い 6 8 8 利付商工債 日本	特殊債券 —	100,000,000	100.05 100,050,100	100.66 100,660,400	1.350000 12/09/27	1.03%
26	2 8 トヨタファイナンス 日本	社債券 —	100,000,000	100.28 100,288,800	100.65 100,650,400	1.250000 10/09/17	1.03%
27	1 2 三菱UFJファイナシ ヤ 日本	社債券 —	100,000,000	100.07 100,071,200	100.40 100,409,200	1.210000 11/03/16	1.03%
28	1 6 ソニー 日本	社債券 —	100,000,000	99.85 99,859,200	100.35 100,350,000	1.160000 12/09/20	1.03%
29	1 9 3 しんきん中金 日本	特殊債券 —	100,000,000	99.74 99,745,900	99.99 99,991,000	0.950000 10/12/27	1.03%
30	3 1 7 政保道路債 日本	特殊債券 —	100,000,000	98.01 98,018,300	98.97 98,973,200	0.500000 13/06/24	1.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	62.09%
地方債証券	9.43%
特殊債券	14.66%
社債券	12.60%
合計	98.77%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資証券 —	9,085,725	971 8,825,579,613	647 5,882,938,795	— —	10.33%
2	UNIBAIL-RODAMCO ユーロ	投資証券 —	326,966	17,424 5,697,323,632	12,329 4,031,434,378	— —	7.08%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC 米国	投資証券 —	639,012	7,642 4,883,487,580	3,268 2,088,808,944	— —	3.67%
4	LAND SECURITIES PLC 英国	投資証券 —	2,429,199	1,746 4,241,648,748	758 1,842,456,104	— —	3.23%
5	LINK REIT 香港	投資証券 —	8,081,756	221 1,790,339,282	188 1,524,587,710	— —	2.68%
6	BOSTON PROPERTIES INC 米国	投資証券 —	405,540	7,495 3,039,807,517	3,645 1,478,346,878	— —	2.60%

7	LIBERTY PROPERTY TRUST 米国	投資証券 —	695,157	3,359 2,335,549,759	1,833 1,274,874,491	— —	2.24%
8	BRITISH LAND CO PLC 英国	投資証券 —	1,913,529	1,011 1,934,733,011	630 1,206,777,014	— —	2.12%
9	EQUITY RESIDENTIAL 米国	投資証券 —	621,569	3,824 2,377,445,218	1,770 1,100,401,516	— —	1.93%
10	CORIO NV ユーロ	投資証券 —	273,930	6,173 1,691,232,940	4,000 1,095,776,430	— —	1.92%
11	VORNADO REALTY TRUST 米国	投資証券 —	291,776	7,704 2,248,108,359	3,406 993,999,806	— —	1.75%
12	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券 —	19,344,187	75 1,457,204,650	44 855,380,605	— —	1.50%
13	PUBLIC STORAGE 米国	投資証券 —	163,000	7,277 1,186,279,566	5,128 835,893,063	— —	1.47%
14	MACK-CALI REALTY CORP 米国	投資証券 —	465,181	3,119 1,451,193,139	1,709 795,328,701	— —	1.40%
15	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 —	4,614,979	286 1,320,994,949	171 790,041,485	— —	1.39%
16	VENTAS INC 米国	投資証券 —	357,164	3,629 1,296,449,972	2,158 770,998,033	— —	1.35%
17	HOST HOTELS&RESORTS INC 米国	投資証券 —	1,844,781	1,412 2,605,525,148	374 691,077,653	— —	1.21%
18	HCP INC 米国	投資証券 —	355,387	2,195 780,295,913	1,845 655,928,795	— —	1.15%
19	REGENCY CENTERS CORP 米国	投資証券 —	245,863	5,695 1,400,325,638	2,643 650,013,657	— —	1.14%
20	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA カナダ	投資証券 —	888,663	1,340 1,191,546,988	722 641,815,257	— —	1.13%
21	CFS RETAIL PROPERTY TRUST オーストラリア	投資証券 —	5,788,002	132 769,006,689	108 628,880,309	— —	1.10%
22	MACERICH CO/THE 米国	投資証券 —	523,750	5,168 2,707,259,535	1,128 591,170,976	— —	1.04%
23	AVALONBAY COMMUNITIES INC 米国	投資証券 —	142,847	8,825 1,260,751,184	4,099 585,560,865	— —	1.03%
24	ICADE ユーロ	投資証券 —	82,547	7,798 643,739,788	7,015 579,089,336	— —	1.02%
25	CAN REAL ESTATE INVEST TR カナダ	投資証券 —	349,974	2,298 804,360,993	1,580 553,236,764	— —	0.97%
26	UDR INC 米国	投資証券 —	696,390	1,751 1,219,906,102	786 547,635,803	— —	0.96%
27	SOVRAN SELF STORAGE INC 米国	投資証券 —	262,388	3,839 1,007,318,683	2,054 539,204,218	— —	0.95%
28	FEDERAL REALTY INVS TRUST 米国	投資証券 —	129,000	5,513 711,270,332	4,127 532,458,078	— —	0.93%
29	AMB PROPERTY CORP 米国	投資証券 —	424,174	2,060 874,045,981	1,217 516,531,314	— —	0.91%
30	PUBLIC STORAGE INC L 米国	投資証券 —	270,000	1,887 509,687,910	1,693 457,134,597	— —	0.80%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	91.57%
合計	91.57%

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2009年3月	売建	508,485	49,734,928	49,729,843	△0.09%
		英ポンド買/円売 2009年3月	買建	92,995	13,023,363	12,988,550	0.02%
		ユーロ買/円売 2009年3月	買建	108,348	13,531,921	13,457,856	0.02%
		オーストラリアドル買/円売 2009年3月	買建	363,588	23,179,644	22,960,561	0.04%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	日本ビルファンド 日本	投資証券 —	3,200	898,000 2,873,600,000	800,000 2,560,000,000	— —	18.88%
2	ジャパンリアルエステイト 日本	投資証券 —	2,800	819,629 2,294,961,216	735,000 2,058,000,000	— —	15.18%
3	野村不動産オフィスF 日本	投資証券 —	1,800	558,000 1,004,400,000	500,000 900,000,000	— —	6.64%
4	森トラスト総合リート 日本	投資証券 —	1,200	724,000 868,800,000	679,000 814,800,000	— —	6.01%
5	日本リテールファンド 日本	投資証券 —	2,050	312,210 640,031,500	321,000 658,050,000	— —	4.85%
6	フロンティア不動産投資 日本	投資証券 —	1,294	471,000 609,474,000	471,000 609,474,000	— —	4.50%
7	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券 —	1,059	579,835 614,045,772	491,000 519,969,000	— —	3.84%
8	東急リアル・エステート 日本	投資証券 —	1,000	520,000 520,000,000	517,000 517,000,000	— —	3.81%
9	オリックス不動産投資 日本	投資証券 —	1,700	442,000 751,400,000	295,100 501,670,000	— —	3.70%
10	グローバル・ワン不動産投資 法人 日本	投資証券 —	800	770,000 616,000,000	611,000 488,800,000	— —	3.61%
11	ユナイテッド・アーバン投資 法人 日本	投資証券 —	1,200	311,000 373,200,000	356,000 427,200,000	— —	3.15%
12	日本プライムリアルティ 日本	投資証券 —	2,550	165,052 420,884,954	158,300 403,665,000	— —	2.98%

13	トップリート投資法人 日本	投資証券 —	950	256,000 243,200,000	321,000 304,950,000	— —	2.25%
14	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券 —	800	297,000 237,600,000	343,000 274,400,000	— —	2.02%
15	プレミアム投資法人 日本	投資証券 —	841	171,600 144,315,600	279,000 234,639,000	— —	1.73%
16	阪急リート投資法人 日本	投資証券 —	585	397,000 232,245,000	372,000 217,620,000	— —	1.61%
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券 —	541	418,000 226,138,000	371,000 200,711,000	— —	1.48%
18	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券 —	1,250	149,000 186,250,000	160,500 200,625,000	— —	1.48%
19	野村不レジデンシャル 日本	投資証券 —	606	355,000 215,130,000	322,000 195,132,000	— —	1.44%
20	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券 —	550	250,771 137,924,428	325,000 178,750,000	— —	1.32%
21	福岡リート投資法人 日本	投資証券 —	474	356,000 168,744,000	343,000 162,582,000	— —	1.20%
22	ジョイントリート投資法人 日本	投資証券 —	1,175	107,016 125,744,822	117,000 137,475,000	— —	1.01%
23	DAオフィス投資法人 日本	投資証券 —	700	174,100 121,870,000	129,300 90,510,000	— —	0.67%
24	森ヒルズリート 日本	投資証券 —	360	256,500 92,340,000	241,000 86,760,000	— —	0.64%
25	M I D リート投資法人 日本	投資証券 —	500	130,100 65,050,000	160,300 80,150,000	— —	0.59%
26	産業ファンド 日本	投資証券 —	254	226,300 57,480,354	190,000 48,260,000	— —	0.36%
27	ビ・ライフ投資法人 日本	投資証券 —	150	143,100 21,465,000	198,300 29,745,000	— —	0.22%
28	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人 日本	投資証券 —	150	114,400 17,160,000	98,900 14,835,000	— —	0.11%
29	ラサールジャパン投資法人 日本	投資証券 —	150	103,000 15,450,000	69,000 10,350,000	— —	0.08%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	95.35%
合計	95.35%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	ABBOTT LABS 米国	株式 医薬品	16,200	5,358 86,800,115	4,947 80,145,123	— —	2.74%
2	EXXON MOBIL CORP 米国	株式 石油・石炭製 品	11,000	7,087 77,960,439	6,939 76,335,815	— —	2.61%
3	PROCTER & GAMBLE CO 米国	株式 化学	14,700	6,180 90,855,722	4,789 70,409,409	— —	2.41%
4	JOHNSON & JOHNSON 米国	株式 医薬品	13,300	6,259 83,255,872	5,129 68,217,780	— —	2.33%
5	MCDONALD'S CORP 米国	株式 サービス業	11,800	5,491 64,798,343	5,105 60,247,048	— —	2.06%
6	MEDTRONIC INC 米国	株式 その他製造	18,400	4,004 73,686,605	3,110 57,230,587	— —	1.96%
7	FPL GROUP INC 米国	株式 電力	11,900	4,173 49,660,093	4,496 53,506,276	— —	1.83%
8	BECTON DICKINSON & CO 米国	株式 その他製造	8,400	7,091 59,566,601	6,367 53,486,420	— —	1.83%
9	INT'L BUSINESS MACHINES 米国	株式 電気機器	6,100	8,964 54,685,657	8,702 53,083,150	— —	1.82%
10	ALTRIA GROUP INC 米国	株式 食料品	34,000	1,758 59,800,692	1,478 50,282,165	— —	1.72%
11	MICROSOFT CORP 米国	株式 サービス業	30,100	2,267 68,257,980	1,606 48,341,810	— —	1.65%
12	HARRIS CORP 米国	株式 電気機器	13,200	3,776 49,846,456	3,661 48,325,574	— —	1.65%
13	AT&T INC 米国	株式 情報・通信業	20,000	2,618 52,375,394	2,356 47,124,858	— —	1.61%
14	SHOPPERS DRUG MART CORP カナダ	株式 小売業	13,500	3,467 46,814,950	3,350 45,226,755	— —	1.55%
15	LOCKHEED MARTIN CORP 米国	株式 輸送用機器	6,700	9,367 62,760,667	6,742 45,171,690	— —	1.54%
16	CHEVRON CORP 米国	株式 石油・石炭製 品	6,900	6,769 46,712,503	6,178 42,632,738	— —	1.46%
17	KRAFT FOODS INC-A 米国	株式 食料品	18,652	2,694 50,258,143	2,236 41,722,933	— —	1.43%
18	H>FPC CAPITAL I 7.100 米国	優先証券 —	17,150	2,153 36,932,011	2,332 40,006,980	— —	1.37%
19	CORNING INC 米国	株式 電気機器	37,700	1,200 45,240,353	1,024 38,607,465	— —	1.32%
20	MARATHON OIL CORP 米国	株式 石油他	16,000	2,839 45,437,733	2,362 37,793,784	— —	1.29%
21	VERIZON COMMUNICATIONS 米国	株式 情報・通信業	13,300	2,831 37,660,273	2,785 37,048,863	— —	1.27%
22	WAL-MART STORES 米国	株式 小売業	7,800	5,275 41,149,156	4,719 36,810,794	— —	1.26%
23	H>XCEL ENERGY 7.6 米国	優先証券 —	15,000	2,248 33,726,906	2,422 36,341,306	— —	1.24%
24	H>WACHOVIA CAP X 7.850 米国	優先証券 —	22,400	2,010 45,042,238	1,594 35,712,387	— —	1.22%
25	QUALCOMM INC 米国	株式 電気機器	10,400	3,943 41,014,472	3,292 34,239,760	— —	1.17%

26	MICROCHIP TECHNOLOGY INC 米国	株式 電気機器	18,600	2,568 47,773,925	1,828 34,002,082	— —	1.16%
27	INTEL CORP 米国	株式 電気機器	26,600	1,558 41,445,814	1,243 33,068,192	— —	1.13%
28	SCHLUMBERGER LTD 米国	株式 サービス業	8,500	6,163 52,387,717	3,733 31,733,965	— —	1.09%
29	GENERAL DYNAMICS CORP 米国	株式 輸送用機器	7,100	5,952 42,265,661	4,467 31,722,522	— —	1.08%
30	HCC INSURANCE HOLDINGS IN 米国	株式 保険業	14,300	2,068 29,582,145	2,148 30,729,066	— —	1.05%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	68.49%
優先証券	22.25%
投資証券	2.00%
合計	92.74%

（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
水産・農林業	0.79%
鉱業	0.42%
食料品	3.67%
化学	3.65%
医薬品	5.95%
石油・石炭製品	4.93%
非鉄金属	0.12%
機械	1.40%
電気機器	10.70%
輸送用機器	2.63%
その他製品	0.16%
電気・ガス業	2.26%
陸運業	0.33%
情報・通信業	2.88%
小売業	3.85%
銀行業	2.94%
証券・商品先物取引業	0.25%
保険業	2.86%
その他金融業	1.40%
サービス業	6.15%
石油他	3.46%
電力	2.17%
その他製造	4.87%
新聞・出版	0.66%

合計	68.49%
----	--------

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食料品	43,078	3,658 157,584,835	3,177 136,891,252	— —	5.04%
2	TOTAL SA ユーロ	株式 石油・石炭製 品	25,959	4,876 126,594,338	4,738 122,997,174	— —	4.53%
3	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S 英国	株式 石油・石炭製 品	53,712	2,108 113,231,248	2,215 118,989,526	— —	4.38%
4	TELEFONICA S.A. ユーロ	株式 情報・通信業	61,200	1,948 119,247,863	1,838 112,522,565	— —	4.15%
5	VODAFONE GROUP PLC 英国	株式 情報・通信業	613,322	170 104,764,841	174 106,914,683	— —	3.94%
6	ENI SPA ユーロ	株式 石油・石炭製 品	48,361	2,004 96,944,117	1,980 95,765,719	— —	3.53%
7	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	24,691	4,558 112,546,976	3,828 94,535,409	— —	3.48%
8	NATIONAL GRID PLC 英国	株式 電気・ガス業	107,450	942 101,297,477	870 93,578,721	— —	3.45%
9	ROCHE HOLDING AG-GENUS スイス	株式 医薬品	8,276	13,672 113,151,747	11,157 92,338,394	— —	3.40%
10	OESTERREICHISCHE POST ユーロ	株式 サービス業	26,837	2,975 79,860,529	3,170 85,082,672	— —	3.13%
11	VIVENDI SA ユーロ	株式 コンク ^ロ マ リット	33,703	2,626 88,519,826	2,334 78,672,296	— —	2.90%
12	BP PLC 英国	株式 石油・石炭製 品	117,421	629 73,970,423	641 75,315,069	— —	2.77%
13	MUNCHENER RUECK AG-REG ユーロ	株式 保険業	5,940	12,621 74,973,370	12,201 72,479,111	— —	2.67%
14	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC 英国	株式 食料品	28,597	2,398 68,584,345	2,465 70,501,671	— —	2.60%
15	BASF SE ユーロ	株式 化学	24,240	3,172 76,895,598	2,810 68,116,402	— —	2.51%
16	BNP PARIBAS ユーロ	株式 銀行業	19,946	7,280 145,207,299	3,378 67,386,262	— —	2.48%
17	GLAXOSMITHKLINE PLC 英国	株式 医薬品	42,639	1,564 66,699,724	1,508 64,322,808	— —	2.37%

18	E.ON AG ユーロ	株式 電気・ガス業	24,392	3,698 90,207,336	2,546 62,119,472	— —	2.29%
19	REED ELSEVIER NV ユーロ	株式 新聞・出版	53,815	1,124 60,510,991	1,085 58,437,408	— —	2.15%
20	R.W.E. AG ユーロ	株式 電気・ガス業	8,922	7,480 66,738,213	6,374 56,870,981	— —	2.10%
21	GDF SUEZ ユーロ	株式 電気・ガス業	17,684	3,788 67,001,310	3,165 55,976,587	— —	2.06%
22	AKZO NOBEL ユーロ	株式 化学	15,438	3,648 56,323,610	3,528 54,467,302	— —	2.01%
23	CREDIT SUISSE GROUP AG スイス	株式 銀行業	22,670	4,168 94,504,089	2,377 53,896,624	— —	1.99%
24	ALLIANZ SE-REG ユーロ	株式 保険業	7,848	10,144 79,611,368	6,863 53,866,376	— —	1.98%
25	REXAM PLC 英国	株式 その他製造	143,318	444 63,664,610	366 52,548,978	— —	1.94%
26	ATLAS COPCO AB-B SHS スウェーデン	株式 機械	83,654	565 47,338,870	600 50,239,874	— —	1.85%
27	NORDEA AB スウェーデン	株式 銀行業	91,642	745 68,302,854	503 46,121,677	— —	1.70%
28	BANCO BILIBAO VIZCAYA ユーロ	株式 銀行業	49,884	1,329 66,314,687	752 37,554,361	— —	1.38%
29	OPAP SA ユーロ	株式 サービス業	14,005	2,539 35,562,353	2,472 34,622,839	— —	1.28%
30	BANCO SANTANDER SA ユーロ	株式 銀行業	53,363	1,019 54,420,188	638 34,074,527	— —	1.26%

（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	92.76%
合計	92.76%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	1.19%
建設業	0.65%
食料品	7.64%
化学	4.52%
医薬品	9.25%
石油・石炭製品	16.13%
機械	1.85%
輸送用機器	1.53%
電気・ガス業	9.89%
情報・通信業	10.14%
銀行業	11.39%
保険業	5.68%
サービス業	5.59%
水道	0.32%
コンク、ロマリット	2.90%

その他製造	1.94%
新聞・出版	2.15%
合計	92.76%

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	スウェーデン クローナ売/円買 2009年3月	売建	718,062	7,805,332	7,798,152	△0.29%
		英ポンド買/円売 2009年3月	買建	85,236	11,885,811	11,904,286	0.44%
		ユーロ売/円買 2009年3月	売建	95,681	11,885,811	11,884,474	△0.44%
		ユーロ買/円売 2009年3月	買建	62,603	7,805,332	7,775,978	0.29%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	BHP BILLITON LTD オーストラリア	株式 鉱業	84,000	1,973 165,778,785	1,806 151,759,608	— —	5.64%
2	SAMSUNG ELECTRONICS 韓国	株式 電気機器	3,500	33,404 116,914,118	30,671 107,348,850	— —	3.99%
3	WOOLWORTHS オーストラリア	株式 小売業	60,000	1,660 99,606,456	1,768 106,125,600	— —	3.94%
4	QBE INSURANCE オーストラリア	株式 保険業	80,000	1,624 129,983,745	1,264 101,122,536	— —	3.76%
5	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 電気機器	660,000	138 91,534,503	126 83,160,000	— —	3.09%
6	COMMONWEALTH BANK OF AUST オーストラリア	株式 銀行業	43,000	2,814 121,011,611	1,882 80,946,038	— —	3.01%
7	WESTPAC BANKING オーストラリア	株式 銀行業	74,000	1,436 106,299,949	1,051 77,831,757	— —	2.89%
8	CHUNGHWA TELECOM CO LTD 台湾	株式 情報・通信業	350,000	156 54,831,660	149 52,430,000	— —	1.95%
9	TELSTRA CORPORATION オーストラリア	株式 情報・通信業	220,000	264 58,091,132	232 51,142,432	— —	1.90%
10	CHINA LIFE INSURANCE CO-H 香港	株式 保険業	180,000	283 51,073,059	281 50,730,030	— —	1.89%
11	CLP HOLDINGS LIMITED 香港	株式 電気・ガス業	65,000	697 45,326,645	702 45,654,505	— —	1.70%

12	WOODSIDE PETROLEUM オーストラリア	株式 石油・石炭製品	20,000	2,465 49,312,330	2,272 45,457,132	— —	1.69%
13	AUSTRALIA & NZLAND BK オーストラリア	株式 銀行業	55,000	1,152 63,406,888	824 45,340,268	— —	1.69%
14	NATIONAL AUSTRALIA BANK オーストラリア	株式 銀行業	40,000	1,503 60,146,254	1,106 44,244,268	— —	1.64%
15	MEDIATEK INC 台湾	株式 電気機器	54,000	736 39,766,776	817 44,150,400	— —	1.64%
16	HUTCHISON WHAMPOA 香港	株式 コンク ^ロ マ リット	80,000	521 41,757,698	517 41,411,240	— —	1.54%
17	O.C.B.C. シンガポール	株式 銀行業	140,000	400 56,061,558	292 41,007,120	— —	1.52%
18	RIO TINTO LTD オーストラリア	株式 鉱業	14,000	3,881 54,342,036	2,924 40,946,794	— —	1.52%
19	SINGAPORE TELECOM シンガポール	株式 情報・通信業	250,000	183 45,965,000	163 40,893,000	— —	1.52%
20	CHEUNG KONG 香港	株式 不動産業	50,000	1,011 50,579,750	815 40,793,350	— —	1.52%
21	POSCO 韓国	株式 鉄鋼	2,000	25,040 50,080,123	20,061 40,123,200	— —	1.49%
22	HONG KONG EX & CL 香港	株式 その他金融業	50,000	1,166 58,321,250	784 39,217,100	— —	1.46%
23	CSL LIMITED オーストラリア	株式 医薬品	15,000	2,313 34,698,946	2,416 36,253,263	— —	1.35%
24	AU OPTRONICS CORP 台湾	株式 電気機器	480,000	69 33,267,811	71 34,204,800	— —	1.27%
25	CATHAY FINANCIAL HOLDING 台湾	株式 保険業	427,097	106 45,493,699	79 34,082,341	— —	1.27%
26	KT&G CORP 韓国	株式 食料品	6,500	5,754 37,406,525	5,143 33,436,000	— —	1.24%
27	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES 韓国	株式 機械	2,900	12,534 36,350,701	11,381 33,005,190	— —	1.23%
28	HANG SENG BANK 香港	株式 銀行業	30,000	1,484 44,525,910	1,086 32,609,460	— —	1.21%
29	AMP LIMITED オーストラリア	株式 保険業	105,000	389 40,924,685	308 32,434,637	— —	1.21%
30	QUANTA COMPUTER INC 台湾	株式 電気機器	309,720	96 29,962,313	100 31,176,415	— —	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
株式	90.15%
合計	90.15%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	7.16%
建設業	0.89%
食料品	2.57%

化学	1.81%
医薬品	1.35%
石油・石炭製品	1.69%
鉄鋼	2.30%
機械	1.23%
電気機器	13.29%
輸送用機器	1.06%
電気・ガス業	2.39%
陸運業	0.38%
海運業	0.11%
空運業	0.78%
情報・通信業	8.21%
卸売業	1.99%
小売業	5.24%
銀行業	14.88%
証券・商品先物取引業	0.88%
保険業	8.72%
その他金融業	3.05%
不動産業	3.28%
サービス業	1.36%
石油他	1.10%
建設資材	0.72%
コンク、ロマリット	2.36%
その他製造	1.10%
新聞・出版	0.25%
合計	90.15%

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	エス・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	5,170	150,400 777,568,000	153,900 795,663,000	— —	3.23%
2	住友商事 日本	株式 卸売業	903,000	825 745,494,347	832 751,296,000	— —	3.05%
3	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	232,000	3,456 801,807,136	3,180 737,760,000	— —	2.99%
4	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,233,800	516 637,608,311	454 560,145,200	— —	2.27%

5	本田技研 日本	株式 輸送用機器	231,000	2,259 522,046,361	2,390 552,090,000	— —	2.24%
6	武田薬品 日本	株式 医薬品	132,000	4,840 638,891,781	3,990 526,680,000	— —	2.14%
7	任 天 堂 日本	株式 その他製品	18,200	33,029 601,134,950	28,490 518,518,000	— —	2.10%
8	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	160,000	4,889 782,273,878	3,170 507,200,000	— —	2.06%
9	パナソニック 日本	株式 電気機器	426,000	1,414 602,508,279	1,154 491,604,000	— —	1.99%
10	エーザイ 日本	株式 医薬品	150,000	3,585 537,892,248	3,040 456,000,000	— —	1.85%
11	三井住友海上HD 日本	株式 保険業	188,300	2,373 446,907,027	2,370 446,271,000	— —	1.81%
12	第一三共 日本	株式 医薬品	260,800	2,096 546,815,602	1,591 414,932,800	— —	1.68%
13	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券 —	753	596,481 449,150,467	491,000 369,723,000	— —	1.50%
14	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	84,000	4,113 345,552,977	4,250 357,000,000	— —	1.45%
15	アインファーマシーズ 日本	株式 小売業	211,300	1,700 359,210,000	1,656 349,912,800	— —	1.42%
16	東北電力 日本	株式 電気・ガス業	137,900	2,150 296,485,000	2,300 317,170,000	— —	1.29%
17	セブン銀行 日本	株式 銀行業	1,143	280,300 320,382,900	269,000 307,467,000	— —	1.25%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	230,900	1,751 404,478,256	1,244 287,239,600	— —	1.16%
19	キャノン 日本	株式 電気機器	108,000	2,746 296,649,027	2,540 274,320,000	— —	1.11%
20	プレミアム投資法人 日本	投資証券 —	921	255,574 235,384,484	279,000 256,959,000	— —	1.04%
21	日本医療事務センター 日本	株式 サービス業	574,300	337 193,769,485	435 249,820,500	— —	1.01%
22	千葉銀行 日本	株式 銀行業	535,000	496 265,429,838	466 249,310,000	— —	1.01%
23	ダイコク電機 日本	株式 機械	181,600	1,062 192,864,120	1,370 248,792,000	— —	1.01%
24	新和海運 日本	株式 海運業	1,034,000	263 272,452,265	240 248,160,000	— —	1.01%
25	住友ゴム 日本	株式 ゴム製品	391,500	731 286,485,985	623 243,904,500	— —	0.99%
26	アクセル 日本	株式 電気機器	694	339,434 235,567,545	333,000 231,102,000	— —	0.94%
27	新日鉱ホールディングス 日本	株式 石油・石炭製 品	640,000	350 224,080,323	346 221,440,000	— —	0.90%
28	横浜ゴム 日本	株式 ゴム製品	655,000	334 219,048,062	338 221,390,000	— —	0.90%
29	ラウンドワン 日本	株式 サービス業	380,600	669 254,729,527	573 218,083,800	— —	0.88%
30	昭和シェル石油 日本	株式 石油・石炭製 品	263,000	850 223,550,000	819 215,397,000	— —	0.87%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.01%
投資証券	3.15%
合計	96.16%

（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

業種	投資比率
建設業	3.31%
食料品	2.00%
繊維製品	0.17%
パルプ・紙	0.45%
化学	2.29%
医薬品	5.67%
石油・石炭製品	2.12%
ゴム製品	2.42%
ガラス・土石製品	1.90%
鉄鋼	2.29%
非鉄金属	1.11%
金属製品	3.14%
機械	4.01%
電気機器	11.22%
輸送用機器	6.72%
精密機器	1.21%
その他製品	2.62%
電気・ガス業	2.07%
陸運業	1.31%
海運業	2.82%
倉庫・運輸関連業	1.11%
情報・通信業	7.96%
卸売業	6.65%
小売業	2.70%
銀行業	7.69%
証券・商品先物取引業	0.48%
保険業	2.45%
その他金融業	0.47%
不動産業	1.27%
サービス業	3.41%
合計	93.01%

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
設定時 (平成18年1月12日)	1,000,000	—	1.0000	—
第1計算期間末 (平成19年1月10日)	14,688,810	14,688,810	1.1278	1.1278
第2計算期間末 (平成20年1月10日)	206,340,469	206,340,469	1.0608	1.0608
平成20年2月末日	213,135,429	—	1.0344	—
3月末日	209,829,667	—	1.0008	—
4月末日	217,799,108	—	1.0369	—
5月末日	231,469,985	—	1.0469	—
6月末日	222,583,003	—	1.0149	—
7月末日	255,201,426	—	1.0159	—
8月末日	250,113,211	—	1.0023	—
9月末日	242,626,315	—	0.9248	—
10月末日	244,526,251	—	0.7999	—
11月末日	241,461,000	—	0.7767	—
12月末日	267,634,702	—	0.7916	—
第3計算期間末 (平成21年1月13日)	270,537,144	270,537,144	0.7673	0.7673
平成21年1月末日	277,716,583	—	0.7550	—
2月末日	284,886,502	—	0.7423	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	12.8
第2計算期間	△5.9
第3計算期間	△27.7

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／6分散コース)

(1) 投資状況（平成21年2月27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	360,921,600	98.58
内 日本	360,921,600	98.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,190,420	1.42
純資産総額	366,112,020	100.00

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（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「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

(2) 投資資産(平成21年2月27日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	外国債券インデックスマザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	35,460,776	1.74453 61,862,449	1.8216 64,595,349	— —	17.64%
2	ダイワ日本債券インデックス マザーファンド（ＢＰＩ） 日本	親投資信託受 益証券 —	57,819,008	1.06309 61,467,387	1.0620 61,403,786	— —	16.77%
3	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティ ブ・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	87,529,991	0.72544 63,498,122	0.6830 59,782,983	— —	16.33%
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 —	128,123,706	0.52577 67,364,110	0.4577 58,642,220	— —	16.02%

5	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 —	68,747,358	0.88890 61,109,966	0.8387 57,658,409	— —	15.75%
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 —	55,954,104	0.69002 38,609,789	0.6496 36,347,785	— —	9.93%
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 —	33,154,547	0.64968 21,539,965	0.5977 19,816,472	— —	5.41%
8	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 —	3,965,303	0.68720 2,724,962	0.6745 2,674,596	— —	0.73%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.58%
合計	98.58%

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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）外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（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「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

(3) 運用実績**① 純資産の推移**

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
設定時 (平成18年1月12日)	1,000,000	—	1.0000	—
第1計算期間末 (平成19年1月10日)	96,243,687	96,243,687	1.1468	1.1468
第2計算期間末 (平成20年1月10日)	400,756,895	400,756,895	1.0592	1.0592
平成20年2月末日	392,141,130	—	1.0243	—
3月末日	382,950,258	—	0.9810	—
4月末日	411,150,474	—	1.0291	—
5月末日	433,986,764	—	1.0449	—
6月末日	412,795,146	—	0.9990	—
7月末日	436,392,222	—	0.9970	—
8月末日	426,819,283	—	0.9807	—
9月末日	388,789,679	—	0.8878	—
10月末日	364,104,411	—	0.7466	—
11月末日	351,877,217	—	0.7184	—
12月末日	368,660,646	—	0.7320	—
第3計算期間末 (平成21年1月13日)	365,013,643	365,013,643	0.7082	0.7082
平成21年1月末日	371,293,437	—	0.6965	—
2月末日	366,112,020	—	0.6746	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金 (円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

③ 収益率の推移

	収益率 (%)
第1計算期間	14.7
第2計算期間	△7.6
第3計算期間	△33.1

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／成長コース)

(1) 投資状況（平成21年2月27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	221,665,715	98.60
内 日本	221,665,715	98.60
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,157,741	1.40
純資産総額	224,823,456	100.00

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（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「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

(2) 投資資産(平成21年2月27日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	ダイワ好配当日本株マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	65,817,366	0.88881 58,499,267	0.8387 55,201,024	— —	24.55%
2	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 —	95,115,841	0.53021 50,432,095	0.4577 43,534,520	— —	19.36%
3	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティ ブ・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	62,134,262	0.72940 45,320,730	0.6830 42,437,700	— —	18.88%
4	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 —	53,474,688	0.68925 36,857,469	0.6496 34,737,157	— —	15.45%

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 —	32,666,522	0.64720 21,142,070	0.5977 19,524,780	— —	8.68%
6	外国債券インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券 —	6,585,640	1.74294 11,478,419	1.8216 11,996,401	— —	5.34%
7	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） 日本	親投資信託受益証券 —	10,775,773	1.06310 11,455,724	1.0620 11,443,870	— —	5.09%
8	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 —	4,136,788	0.68463 2,832,200	0.6745 2,790,263	— —	1.24%

（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	98.60%
合計	98.60%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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）外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（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「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

(3) 運用実績**① 純資産の推移**

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
設定時 (平成18年1月12日)	1,000,000	—	1.0000	—
第1計算期間末 (平成19年1月10日)	19,314,601	19,314,601	1.1749	1.1749
第2計算期間末 (平成20年1月10日)	255,301,281	255,301,281	1.0414	1.0414
平成20年2月末日	252,106,889	—	0.9962	—
3月末日	242,891,493	—	0.9411	—
4月末日	268,207,477	—	1.0042	—
5月末日	285,468,025	—	1.0274	—
6月末日	267,720,566	—	0.9628	—
7月末日	278,682,729	—	0.9580	—
8月末日	272,040,229	—	0.9381	—
9月末日	240,404,024	—	0.8272	—
10月末日	210,060,763	—	0.6654	—
11月末日	215,505,772	—	0.6332	—
12月末日	231,302,404	—	0.6442	—
第3計算期間末 (平成21年1月13日)	228,328,716	228,328,716	0.6224	0.6224
平成21年1月末日	230,376,412	—	0.6114	—
2月末日	224,823,456	—	0.5788	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

③ 収益率の推移

	収益率（％）
第1計算期間	17.5
第2計算期間	△11.4
第3計算期間	△40.2

第二部 【ファンドの詳細情報】

第1 【ファンドの沿革】

平成18年1月12日 信託契約締結、当初自己設定、運用開始

第2 【手続等】

1 【申込（販売）手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、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。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

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、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（半休日においては午前11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す。

2 【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時（半休日においては午前11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。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。

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、半休日は9:00～12:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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。

第3 【管理及び運営】

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問い合わせ先（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、半休日は9:00～12:00）

- ・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)①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日から翌年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】

① 信託の終了

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

② 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。

③ 反対者の買取請求権

前①の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②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①の3.または前②の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。

④ 運用報告書

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

⑤ 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。

⑥ 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。

2 【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。

① 収益分配金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払込むことにより、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販売会社に支払われます。

販売会社は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みに応じるものとします。当該取得申込み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。

受託会社は、収益分配金について、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日までに、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収益分配金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

② 償還金にかかる請求権

受益者は、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。

償還金は、信託終了日後1か月以内の委託会社の指定する日（原則として信託終了日から起算して5営業日まで）から、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します。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社が当ファンドの償還をするのと引換えに、当該償還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。

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。

受託会社は、償還金について、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償還金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

受益者が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。

③ 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、「第2 手続等」の「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第4 【ファンドの経理状況】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

(1) 当ファンドの財務諸表は、「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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成19年1月11日から平成20年1月10日まで）及び第3期計算期間（平成20年1月11日から平成21年1月13日まで）の財務諸表について、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】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

(1) 【貸借対照表】

	第2期 平成20年1月10日現在	第3期 平成21年1月13日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,136,014	5,297,467
親投資信託受益証券	203,186,834	266,320,377
未収入金	—	1,200,000
流動資産合計	207,322,848	272,817,844
資産合計	207,322,848	272,817,844
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,710	1,078,868
未払受託者報酬	53,229	66,182
未払委託者報酬	905,539	1,125,822
その他未払費用	7,901	9,828
流動負債合計	982,379	2,280,700
負債合計	982,379	2,280,700
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	194,518,122	352,578,727
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	11,822,347	△82,041,583
（分配準備積立金）	336,188	291,529
元本等合計	206,340,469	270,537,144
純資産合計	206,340,469	270,537,144
負債純資産合計	207,322,848	272,817,844

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日 金 額 (円)	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日 金 額 (円)
営業収益		
受取利息	11,217	20,230
有価証券売買等損益	△21,527,206	△74,306,457
営業収益合計	△21,515,989	△74,286,227
営業費用		
受託者報酬	62,445	122,717
委託者報酬 ※1	1,062,800	2,087,544
その他費用	9,192	18,222
営業費用合計	1,134,437	2,228,483
営業損失 (△)	△22,650,426	△76,514,710
経常損失 (△)	△22,650,426	△76,514,710
当期純損失 (△)	△22,650,426	△76,514,710
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 (△)	△709,958	△2,603,890
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	1,664,687	11,822,347
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,455,928	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	35,455,928	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,357,800	19,953,110
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,357,800	1,513,080
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	18,440,030
分配金 ※2	—	—
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	11,822,347	△82,041,583

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13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。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	-----	計算期間末日の取扱い 平成21年1月10日、その翌日及びその翌々日が休日のため、当計算期間末日を平成21年1月13日としております。このため、当計算期間は369日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期 平成20年1月10日現在	第3期 平成21年1月13日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	13,024,123円 200,738,676円 19,244,677円	194,518,122円 191,806,441円 33,745,836円
2. 計算期間末日における受益権の総数	194,518,122口	352,578,727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82,041,583円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13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	132,657円	269,904円

2 ※2 分配金の計算過程

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（0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（11,486,159円）及び分配準備積立金（336,188円）より分配対象額は11,822,347円（1万口当たり607.78円）ですが、分配を行っておりません。

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（0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（12,345,876円）及び分配準備積立金（291,529円）より分配対象額は12,637,405円（1万口当たり358.43円）ですが、分配を行っておりません。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第2期 平成20年1月10日現在		第3期 平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	203,186,834	△21,461,876	266,320,377	△73,293,238
合計	203,186,834	△21,461,876	266,320,377	△73,293,238

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	第2期 平成20年1月10日現在	第3期 平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0608円 (10,608円)	0.7673円 (7,673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	外国債券インデックスマザーファンド	37,744,955	65,895,142	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	65,770,839	69,920,978	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	71,699,205	38,402,094	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	54,048,214	39,422,767	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	23,893,516	16,503,251	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	13,495,030	8,821,701	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	1,608,794	1,110,228	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	29,504,459	26,244,216	
親投資信託受益証券 合計		297,765,012	266,320,377	
合計		297,765,012	266,320,377	

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

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成20年1月10日現在 金 額（円）	平成21年1月13日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	170,958,257	1,182,766,917
コール・ローン	2,538,650,528	348,750,080
国債証券	62,487,929,858	76,086,882,001
派生商品評価勘定	7,182,787	—
未収入金	—	112,647
未収利息	850,645,947	1,023,028,514
前払費用	153,464,803	95,770,565
流動資産合計	66,208,832,180	78,737,310,724
資産合計	66,208,832,180	78,737,310,724
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,027,233	28,971,077
未払金	1,827,414,721	931,160,207
未払解約金	62,022,000	29,111,000
流動負債合計	1,930,463,954	989,242,284
負債合計	1,930,463,954	989,242,284
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	29,971,499,611	44,534,040,957
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	34,306,868,615	33,214,027,483
元本等合計	64,278,368,226	77,748,068,440
純資産合計	64,278,368,226	77,748,068,440
負債純資産合計	66,208,832,180	78,737,310,724

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19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 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）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,042,244,598円	29,971,499,611円
同期中における追加設定元本額	13,907,017,645円	19,408,333,012円
同期中における一部解約元本額	977,762,632円	4,845,791,666円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	3,040,532,210円	3,621,079,064円
ダイワ国内重視バランスファンド 3 0 V A (一般投資家私募)	100,827,392円	102,242,652円
ダイワ国内重視バランスファンド 5 0 V A (一般投資家私募)	874,259,909円	768,467,980円
ダイワ国際分散バランスファンド 3 0 V A (一般投資家私募)	219,394,519円	232,288,741円
ダイワ国際分散バランスファンド 5 0 V A (一般投資家私募)	2,453,013,080円	2,242,659,010円
DCダイワ外国債券インデックス	13,463,264,268円	17,794,409,894円
ダイワ・ライフ・バランス 3 0	324,633,254円	319,468,537円
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	56,921円	819,104円

ダイワ・ライフ・バランス70	61,172円	285,941円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース）	24,065,843円	37,744,955円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	31,605,962円	33,773,081円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	6,073,070円	6,002,073円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	－円	808,326円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	－円	186,457円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	－円	22,939円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	5,014,753,555円	3,647,876,179円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	386,760,458円	345,637,148円
ダイワ・バランスファンド35V A	1,408,311,549円	8,711,474,412円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	18,752,356円	1,999,998,276円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	35,160,668円	1,625,322,988円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	2,530,501,174円	2,999,829,281円
ダイワライフスタイル25	12,725,971円	15,319,715円
ダイワライフスタイル50	20,195,002円	22,033,933円
ダイワライフスタイル75	6,551,278円	6,290,271円
計	29,971,499,611円	44,534,040,957円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	29,971,499,611口	44,534,040,957口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年1月10日現在		平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	62,487,929,858	256,088,087	76,086,882,001	1,113,364,396
合計	62,487,929,858	256,088,087	76,086,882,001	1,113,364,396

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年12月1日から平成20年1月10日まで、及び平成20年12月2日から平成21年1月13日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左

2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成20年1月10日 現在				平成21年1月13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								
買 建	2,609,118,263	—	2,575,273,817	△33,844,446	570,446,514	—	541,475,437	△28,971,077
アメリカ・ドル	714,003,371	—	704,306,760	△9,696,611	179,363,805	—	174,147,405	△5,216,400
イギリス・ポンド	215,252,047	—	210,076,291	△5,175,756	—	—	—	—
オーストラリア・ドル	8,470,399	—	8,572,144	101,745	—	—	—	—
カナダ・ドル	68,558,778	—	66,300,374	△2,258,404	35,893,632	—	33,750,200	△2,143,432
シンガポール・ドル	9,614,539	—	9,666,074	51,535	—	—	—	—
スイス・フラン	21,404,163	—	21,350,380	△53,783	12,376,987	—	11,694,600	△682,387
スウェーデン・クローナ	24,240,502	—	23,979,267	△261,235	10,431,339	—	9,827,960	△603,379
デンマーク・クローネ	23,293,668	—	23,058,800	△234,868	14,811,927	—	13,893,900	△918,027
ノルウェー・クローネ	8,808,286	—	8,885,552	77,266	—	—	—	—
ポーランド・ズロチ	30,393,126	—	30,137,562	△255,564	14,817,824	—	13,813,920	△1,003,904
ユーロ	1,485,079,384	—	1,468,940,613	△16,138,771	302,751,000	—	284,347,452	△18,403,548
合計	2,609,118,263	—	2,575,273,817	△33,844,446	570,446,514	—	541,475,437	△28,971,077

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

- ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1446円 (21,446円)	1.7458円 (17,458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		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,436,670.000	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,469,454.000	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,112,660.000	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,237,528.370	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,119,521.550	
		9.125% U.S. TREASURY BOND 20180515	608,000.000	936,885.440	
		9% U.S. TREASURY BOND 20181115	405,000.000	624,582.900	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,385,380.000	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,329,732.300	
		8.5% U.S. TREASURY BOND 20200215	743,000.000	1,123,549.740	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20200515	602,000.000	929,144.860	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,136,184.800	
		7.875% U.S. TREASURY BOND 20210215	795,000.000	1,170,756.750	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	732,000.000	1,101,315.960	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	677,000.000	1,021,207.110	
		8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,545,516.250	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,102,318.080	
		7.625% U.S. TREASURY BOND 20221115	348,000.000	516,397.200	
		7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,292,109.560	

6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,240,236.880
7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,238,160.210
7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	1,088,572.110
6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,213,245.000
6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,166,134.500
6.75% U.S. TREASURY BOND 20260815	1,135,000.000	1,672,524.650
6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	906,210.900
6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	1,002,760.000
6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	1,089,520.650
6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	3,221,090.960
5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	1,067,184.450
5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,199,898.980
5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	1,906,017.900
6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	941,247.840
6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	1,955,453.370
5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	2,224,000.000	2,944,020.000
4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,862,911.690
4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,423,906.550
5% U.S. TREASURY BOND 20370515	1,890,000.000	2,594,025.000
4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	1,827,000.000	2,316,288.870
4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	1,603,000.000	2,073,881.250
6.5% U.S. TREASURY NOTE 20100215	2,141,000.000	2,281,492.420
5.75% U.S. TREASURY NOTE 20100815	2,267,000.000	2,459,332.280
5% U.S. TREASURY NOTE 20110215	2,359,000.000	2,573,881.310
5% U.S. TREASURY NOTE 20110815	2,202,000.000	2,447,985.420
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120215	1,872,000.000	2,089,470.240
4.375% U.S. TREASURY NOTE 20120815	1,316,000.000	1,477,407.400
4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,732,000.000	1,929,015.000
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20130215	1,539,000.000	1,716,692.940
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,951,430.000
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	3,003,023.400
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,503,503.290
4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,266,365.200
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	3,228,868.840
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	3,002,650.690
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,202,646.240
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20100115	1,015,000.000	1,048,454.400
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20100215	1,022,000.000	1,057,841.540
4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	4,196,000.000	4,804,420.000
4% U.S. TREASURY NOTE 20100315	1,004,000.000	1,047,995.280
4% U.S. TREASURY NOTE 20100415	1,237,000.000	1,294,879.230
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20100515	1,405,000.000	1,471,625.100
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,269,984.480
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20100615	1,737,000.000	1,815,703.470
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20100715	866,000.000	911,863.360
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20100815	1,062,000.000	1,124,636.760
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,567,037.280
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20100915	1,279,000.000	1,353,936.610
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20101015	1,252,000.000	1,336,009.200
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20101115	1,534,000.000	1,644,846.840
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,171,024.200
4.375% U.S. TREASURY NOTE 20101215	1,267,000.000	1,359,934.450
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20110115	1,088,000.000	1,169,338.880
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,153,529.620
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110228	1,067,000.000	1,152,936.180
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20110331	1,116,000.000	1,214,431.200
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110430	1,087,000.000	1,190,515.010

5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,356,479.200
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110531	1,286,000.000	1,412,182.320
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20110630	1,392,000.000	1,538,800.320
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110731	1,891,000.000	2,087,191.250
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,388,805.000
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20110831	1,160,000.000	1,273,819.200
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110930	1,261,000.000	1,381,576.820
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111031	1,150,000.000	1,267,875.000
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,757,204.160
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20111130	1,176,000.000	1,294,140.960
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111231	1,041,000.000	1,151,116.980
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120131	1,240,000.000	1,377,652.400
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20100215	1,437,000.000	1,504,467.150
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,407,284.180
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120229	1,375,000.000	1,524,531.250
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120331	1,923,000.000	2,134,222.320
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120430	1,650,000.000	1,834,453.500
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20100515	1,110,000.000	1,170,261.900
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,101,262.900
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120531	1,162,000.000	1,305,518.620
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120630	1,301,000.000	1,471,040.700
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120731	1,100,000.000	1,237,148.000
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,863,936.810
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20120831	1,187,000.000	1,317,475.040
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20120930	1,056,000.000	1,180,819.200
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,079,000.000	1,194,906.180
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,955,490.240
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,091,010.000
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20091231	2,000,000.000	2,054,360.000
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,392,950.070
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20100131	2,192,000.000	2,230,096.960
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,417,925.000
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,224,090.090
2% U.S. TREASURY NOTE 20100228	2,300,000.000	2,339,974.000
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,603,350.000
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20100331	2,660,000.000	2,702,586.600
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	2,003,834.700
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20100430	3,241,000.000	3,315,186.490
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,554,493.280
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,364,661.600
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20100531	3,276,000.000	3,374,280.000
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,608,083.040
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20100630	3,278,000.000	3,394,237.880
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,529,981.300
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20100731	3,358,000.000	3,477,477.640
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,640,516.480
4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,643,968.390
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20100831	3,511,000.000	3,616,575.770
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,704,875.000
2% U.S. TREASURY NOTE 20100930	3,716,000.000	3,810,051.960
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,838,647.840
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20101031	4,564,000.000	4,633,874.840
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,313,068.100
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20111115	2,083,000.000	2,126,930.470
3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	4,420,000.000	4,978,025.000
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20101130	3,334,000.000	3,370,707.340
2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,538,820.980

	1.125% U.S. TREASURY NOTE 20111215	2,476,000.000	2,484,888.840	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 236,429,000.000 (21,155,666,920)	アメリカ・ドル 273,878,105.650 (24,506,612,894)	
イギリス・ポンド	9% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110712	440,000.000	519,332.000	
	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,219,019.200	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	735,619.200	
	6.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20101125	479,000.000	525,654.600	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,016,600.000	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,911,000.000	2,766,936.900	
	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,868,000.000	2,377,030.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,653,000.000	1,705,896.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120307	2,452,000.000	2,663,852.800	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	1,285,000.000	1,440,870.500	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	1,868,586.600	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,458,209.600	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,265,281.400	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	1,587,000.000	1,834,572.000	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20100607	1,858,000.000	1,954,616.000	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	1,972,691.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	2,272,000.000	2,501,699.200	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	2,679,000.000	2,831,167.200	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	1,598,000.000	1,709,061.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,205,476.100	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,317,000.000	1,358,090.400	
	5.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120607	1,204,000.000	1,322,232.800	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	2,425,000.000	2,782,202.500	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	1,981,982.200	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,380,000.000	1,519,104.000	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,190,847.500	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	524,000.000	556,330.800	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	956,000.000	1,046,246.400	
	3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20111207	366,000.000	378,261.000	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	

		44,189,000.000 (5,842,669,580)	49,707,468.900 (6,572,321,538)	
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% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,036,000.000	1,163,169.000	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	892,000.000	1,017,914.720	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	570,000.000	648,756.900	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20100815	523,000.000	543,213.950	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	1,273,000.000	1,394,240.520	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	234,000.000	251,655.300	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 4,528,000.000 (274,759,040)	オーストラリア・ドル 5,018,950.390 (304,549,910)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	424,000.000	639,256.320	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	618,226.800	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	588,000.000	920,931.480	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,660,281.600	
	5.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100601	812,000.000	862,579.480	
	6% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110601	907,000.000	1,009,327.740	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	1,069,000.000	1,200,604.590	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	979,371.950	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	1,826,990.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	759,000.000	876,758.850	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,178,398.200	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100901	700,000.000	733,726.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,240,000.000	1,546,590.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,088,298.960	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	735,000.000	781,312.350	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	940,000.000	1,039,405.000	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	631,000.000	677,378.500	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100601	280,000.000	290,729.600	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	1,471,000.000	1,651,006.270	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,468,663.790	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20101201	868,000.000	895,585.040	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	432,000.000	462,503.520	

	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	384,000.000	404,332.800	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	606,000.000	652,425.660	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 20,122,000.000 (1,477,357,240)	カナダ・ドル 23,464,684.500 (1,722,777,136)	
シンガポール ・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	4.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20100701	404,000.000	426,716.920	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	206,000.000	213,302.700	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20120701	347,000.000	372,518.380	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20110701	456,000.000	485,380.080	
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	582,180.200	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20100401	302,000.000	308,961.100	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	486,000.000	536,505.120	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	557,710.440	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	406,000.000	437,554.320	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20110201	150,000.000	156,838.500	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	344,294.400	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20120401	223,000.000	232,602.380	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	297,000.000	310,498.650	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20121001	104,000.000	108,117.360	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	338,000.000	341,369.860	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 5,040,000.000 (302,450,400)	シンガポール・ドル 5,414,550.410 (324,927,170)	
スイス・ フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	2.75% SWISS GOVERNMENT BOND 20120610	1,240,000.000	1,313,060.800	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	974,000.000	1,082,678.920	
	3.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20100807	347,000.000	363,114.680	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	702,000.000	821,318.940	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	672,000.000	785,305.920	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20110610	1,462,000.000	1,574,091.540	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	350,000.000	365,844.500	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	150,000.000	175,747.500	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	765,000.000	820,233.000	
スイス・フラン 小計		スイス・フラン 6,662,000.000 (533,692,820)	スイス・フラン 7,301,395.800 (584,914,817)	
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	5,970,000.000	7,327,578.000	
	5.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20110315	4,765,000.000	5,149,583.150	

	5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	5,435,000.000	6,146,169.750	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	3,635,000.000	4,108,822.250	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,550,000.000	6,780,601.500	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,405,677.500	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	4,575,000.000	4,998,096.000	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	4,360,000.000	4,986,314.000	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 38,540,000.000 (427,408,600)	スウェーデン・クローナ 43,902,842.150 (486,882,519)	
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	2,323,000.000	3,090,821.190	
	6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	6,171,000.000	6,773,104.470	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,835,000.000	8,553,782.900	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20101115	4,740,000.000	4,877,554.800	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	5,529,000.000	5,788,531.260	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	5,381,000.000	5,650,265.240	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	8,083,000.000	8,974,150.750	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 40,062,000.000 (641,392,620)	デンマーク・クローネ 43,708,210.610 (699,768,453)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	6% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20110516	3,847,000.000	4,145,219.440	
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	5,232,000.000	5,982,059.520	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	4,004,000.000	4,363,278.920	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	2,321,000.000	2,424,632.650	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 15,404,000.000 (195,784,840)	ノルウェー・クローネ 16,915,190.530 (214,992,072)	
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% POLAND GOVERNMENT BOND 20131024	2,383,000.000	2,391,459.650	
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	2,385,000.000	2,547,657.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20101124	2,411,000.000	2,454,614.990	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20100324	2,594,000.000	2,609,615.880	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,401,706.350	
	4.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20110524	2,185,000.000	2,153,011.600	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,845,806.900	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20120425	2,697,000.000	2,688,962.940	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	1,624,000.000	1,654,385.040	
	0% POLAND GOVERNMENT BOND 20100725	1,267,000.000	1,176,574.210	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	524,000.000	545,117.200	

	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	785,000.000	792,912.800	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 24,019,000.000 (697,751,950)	ポーランド・ズロチ 24,261,824.560 (704,806,003)	
マレーシア・ リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.869% MALAYSIAN GOVERNMENT 20100413	1,755,000.000	1,772,760.600	
	3.756% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110428	1,822,000.000	1,853,903.220	
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	1,600,000.000	1,713,200.000	
	3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,324,702.640	
	3.833% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110928	2,582,000.000	2,639,526.960	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,264,540.080	
	3.718% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120615	1,356,000.000	1,387,947.360	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,046,871.000	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	1,532,000.000	1,494,726.440	
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 16,032,000.000 (399,838,080)	マレーシア・リンギット 16,498,178.300 (411,464,566)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6% HELLENIC REPUBLIC 20100519	692,000.000	718,683.520	
	6.5% HELLENIC REPUBLIC 20140111	250,000.000	267,280.000	
	4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,366,470.420	
	5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,603,012.850	
	5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	635,583.630	
	4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	998,000.000	1,067,810.100	
	5.35% HELLENIC REPUBLIC 20110518	913,000.000	941,859.930	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20100131	2,613,000.000	2,674,300.980	
	5.25% HELLENIC REPUBLIC 20120518	781,000.000	799,400.360	
	8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	478,068.260	
	4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	674,196.540	
	5.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20110223	352,000.000	378,417.600	
	5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20120615	380,000.000	402,028.600	
	5.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20100520	486,000.000	509,930.640	
	8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20121224	791,000.000	930,461.210	
	5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	797,993.000	
	4.6% HELLENIC REPUBLIC 20130520	552,000.000	546,971.280	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110730	1,145,000.000	1,223,592.800	
	6.5% HELLENIC REPUBLIC 20191022	823,000.000	900,748.810	
	5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110928	842,000.000	895,660.660	
	4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	559,193.580	
	5.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20130923	1,233,000.000	1,341,109.440	

4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	779,672.000	
5.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20100115	608,000.000	631,195.200	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	350,000.000	370,734.000	
5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120730	953,000.000	1,017,165.490	
5.9% HELLENIC REPUBLIC 20221022	583,000.000	596,146.650	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120928	910,000.000	974,409.800	
4% IRISH TREASURY 20111111	735,000.000	751,544.850	
2.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20100915	394,000.000	400,075.480	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,088,000.000	1,252,962.560	
5.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110615	580,000.000	613,350.000	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	911,930.400	
3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	403,109.270	
4.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20140616	604,000.000	631,910.840	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,926,736.240	
5.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20100928	1,498,000.000	1,589,887.320	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20120915	559,000.000	587,945.020	
5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20111031	1,411,000.000	1,512,676.660	
3.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20210415	654,000.000	637,368.780	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,301,706.890	
4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	580,547.000	
3.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110415	492,000.000	498,076.200	
3.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20151015	305,000.000	300,187.100	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	872,000.000	913,786.240	
5.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20110104	513,000.000	544,826.520	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,863,346.780	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	424,000.000	405,729.840	
4.5% HELLENIC REPUBLIC 20370920	972,000.000	760,774.680	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121226	840,000.000	1,025,371.200	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20100328	702,000.000	712,382.580	
5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20120715	866,000.000	929,192.020	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,030,000.000	1,073,857.400	
4.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20161015	625,000.000	642,237.500	
4.5% HELLENIC REPUBLIC 20140520	639,000.000	626,245.560	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,750,108.050	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	718,771.900	

4.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20171016	563,000.000	580,824.580	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,118,464.620	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	1,240,000.000	1,300,685.600	
4.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20180615	440,000.000	453,371.600	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	934,802.150	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,167,187.100	
4.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20231025	661,000.000	703,449.420	
3.1% HELLENIC REPUBLIC 20100420	672,000.000	673,814.400	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	852,000.000	845,158.440	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	756,000.000	808,118.640	
3.7% HELLENIC REPUBLIC 20150720	789,000.000	735,900.300	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,060,779.500	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20100730	1,690,000.000	1,724,594.300	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,386,647.640	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	649,000.000	683,455.410	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	933,000.000	874,491.570	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,650,364.020	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,516,674.940	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,826,827.200	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	1,935,364.200	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110328	459,000.000	469,579.950	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	831,000.000	826,554.150	
3.6% HELLENIC REPUBLIC 20160720	533,000.000	484,550.300	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,359,395.560	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	630,000.000	650,071.800	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	1,020,389.120	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	1,191,000.000	1,229,302.560	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031	993,000.000	1,024,974.600	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	664,000.000	669,564.320	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	1,188,831.250	
3.9% HELLENIC REPUBLIC 20110820	755,000.000	750,409.600	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	844,000.000	797,883.840	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110430	1,310,000.000	1,356,911.100	
4.3% HELLENIC REPUBLIC 20170720	875,000.000	822,587.500	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	933,297.570	

4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,515,723.460	
4.6% HELLENIC REPUBLIC 20400920	811,000.000	628,005.960	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	713,000.000	893,403.260	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	333,000.000	329,203.800	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	708,000.000	739,406.880	
4.7% HELLENIC REPUBLIC 20240320	1,016,000.000	892,037.840	
5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20101101	1,859,000.000	1,957,155.200	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	531,716.670	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	454,000.000	472,972.660	
4.1% HELLENIC REPUBLIC 20120820	610,000.000	596,677.600	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	587,000.000	609,705.160	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,302,000.000	1,544,093.880	
3.8% HELLENIC REPUBLIC 20110320	464,000.000	463,670.560	
4.6% HELLENIC REPUBLIC 20180720	760,000.000	718,929.600	
4% HELLENIC REPUBLIC 20130820	765,000.000	738,630.450	
6.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110425	1,673,000.000	1,839,162.360	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110801	1,816,000.000	1,915,353.360	
6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,255,000.000	1,397,793.900	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,694,000.000	2,013,149.600	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120201	3,012,000.000	3,168,804.720	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	734,000.000	910,732.520	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	3,289,223.160	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100425	1,324,000.000	1,387,896.240	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20101025	1,337,000.000	1,421,859.390	
5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	1,964,600.000	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20111025	1,324,000.000	1,424,862.320	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	1,892,000.000	2,122,786.160	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130201	2,997,000.000	3,130,875.990	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120425	1,980,000.000	2,145,231.000	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,009,000.000	2,160,418.330	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,637,000.000	2,033,203.110	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121025	1,748,000.000	1,889,657.920	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	1,908,000.000	1,902,371.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130425	1,700,000.000	1,796,645.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,147,165.280	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,781,143.080	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,166,931.620	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,635,951.290	

4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,589,003.010	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,887,507.020	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,916,255.130	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	1,794,000.000	1,903,774.860	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,278,908.450	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	1,802,475.420	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	1,585,000.000	1,638,430.350	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	1,847,000.000	1,849,345.690	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,555,694.370	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	1,752,000.000	1,754,260.080	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,332,000.000	2,353,687.600	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100115	1,419,000.000	1,435,829.340	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,599,000.000	1,599,031.980	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,275,607.960	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,271,000.000	1,324,191.350	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,006,709.120	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,370,251.520	
2.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100615	1,551,000.000	1,564,400.640	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	472,000.000	501,537.760	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100112	1,666,000.000	1,689,740.500	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,161,921.920	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100712	1,456,000.000	1,474,855.200	
6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	347,484.930	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	1,864,000.000	1,538,862.480	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110112	2,492,000.000	2,547,372.240	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	2,252,000.000	2,066,412.680	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110712	1,390,000.000	1,440,220.700	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110315	1,337,000.000	1,362,710.510	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	2,225,000.000	2,197,120.750	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120112	1,466,000.000	1,530,489.340	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120712	1,089,000.000	1,165,426.020	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110915	1,569,000.000	1,601,305.710	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130112	1,789,000.000	1,872,152.720	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,268,577.200	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100912	2,209,000.000	2,282,957.320	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100301	1,616,000.000	1,653,022.560	

4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	861,000.000	927,383.100	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	2,317,000.000	2,371,472.670	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100801	2,049,000.000	2,114,834.370	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	2,004,427.680	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121015	1,506,000.000	1,549,719.180	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	1,185,000.000	1,132,646.700	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110201	1,954,000.000	1,997,300.640	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	540,000.000	536,722.200	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,865,000.000	1,890,308.050	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100409	1,927,000.000	1,968,237.800	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130415	1,694,000.000	1,735,435.240	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20101008	1,611,000.000	1,636,614.900	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,524,000.000	1,575,937.920	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110408	1,727,000.000	1,798,843.200	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	867,000.000	869,835.090	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20111014	2,029,000.000	2,127,690.560	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120413	1,815,000.000	1,928,328.600	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20121012	2,441,000.000	2,630,226.320	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130412	1,914,000.000	2,012,838.960	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,205,137.880	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100312	1,420,000.000	1,445,276.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100611	1,814,000.000	1,895,756.980	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100910	2,350,000.000	2,443,741.500	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20101210	379,000.000	384,340.110	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	741,000.000	953,859.660	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,423,890.160	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	1,990,556.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	962,000.000	1,072,476.080	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	970,844.000	
5.375% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100104	1,731,000.000	1,794,891.210	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,274,000.000	1,670,315.920	
5.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100704	1,741,000.000	1,834,491.700	
5.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110104	2,052,000.000	2,197,425.240	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	740,000.000	872,770.800	

5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,567,000.000	1,898,655.550	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110704	2,633,000.000	2,845,746.400	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120104	3,326,000.000	3,620,317.740	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110715	1,032,000.000	1,104,116.160	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120704	2,935,000.000	3,217,141.550	
4.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130104	2,774,000.000	3,013,923.260	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	2,030,412.400	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120715	1,033,000.000	1,113,594.660	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	2,423,336.160	
4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	1,993,000.000	2,113,038.390	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,392,969.200	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,975,576.890	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,831,000.000	1,902,354.070	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,230,230.810	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	2,637,151.860	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,073,600.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20100715	1,017,000.000	1,073,626.560	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,631,659.700	
3% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20100115	1,007,000.000	1,021,299.400	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,826,424.800	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,323,179.400	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	838,000.000	842,877.160	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,415,839.270	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	838,000.000	834,924.540	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,309,802.570	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,953,562.960	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	739,000.000	769,528.090	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,049,797.400	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	683,000.000	673,267.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	428,000.000	505,626.360	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	974,000.000	1,041,400.800	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	1,148,000.000	1,223,125.120	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110115	1,172,000.000	1,218,692.480	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	732,000.000	754,509.000	
ユーロ 小計	ユーロ 314,360,000.000	ユーロ 331,624,590.620	

		(37,493,717,200)	(39,552,864,923)	
国債証券 合計		69,442,489,290 [69,442,489,290]	76,086,882,001 [76,086,882,001]	
合計		69,442,489,290 [69,442,489,290]	76,086,882,001 [76,086,882,001]	

[次へ](#)

- (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 134銘柄	100%	32.2%
イギリス・ポンド	国債証券 29銘柄	100%	8.6%
オーストラリア・ドル	国債証券 6銘柄	100%	0.4%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	100%	2.3%
シンガポール・ドル	国債証券 15銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 9銘柄	100%	0.8%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.6%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	100%	0.9%
マレーシア・リンギット	国債証券 9銘柄	100%	0.5%
ユーロ	国債証券 234銘柄	100%	52.1%

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（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成20年1月10日現在 金 額（円）	平成21年1月13日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	359,885,106	178,472,532
国債証券	8,675,645,160	6,705,033,290
地方債証券	841,074,960	888,051,956
特殊債券	837,748,240	1,416,460,087
社債券	659,253,677	1,211,438,262
未収入金	9,109,890	—
未収利息	27,827,133	29,375,936
前払費用	5,148,358	3,002,450
流動資産合計	11,415,692,524	10,431,834,513
資産合計	11,415,692,524	10,431,834,513
負債の部		
流動負債		
未払金	272,402,120	121,435,420
未払解約金	622,000	815,000
流動負債合計	273,024,120	122,250,420
負債合計	273,024,120	122,250,420
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	10,782,680,564	9,697,914,593
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	359,987,840	611,669,500
元本等合計	11,142,668,404	10,309,584,093
純資産合計	11,142,668,404	10,309,584,093
負債純資産合計	11,415,692,524	10,431,834,513

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19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,507,528,836円	10,782,680,564円
同期中における追加設定元本額	8,830,945,977円	5,650,312,849円
同期中における一部解約元本額	555,794,249円	6,735,078,820円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ・ライフ・バランス 30	2,504,152,353円	1,992,340,852円
ダイワ・ライフ・バランス 50	476,762円	5,532,453円
ダイワ・ライフ・バランス 70	253,029円	998,365円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／安定コース)	51,010,972円	65,770,839円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース)	67,203,974円	58,195,515円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース)	12,876,368円	10,775,773円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	－円	1,766,948円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	－円	409,790円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	－円	40,665円
ダイワ世界バランスファンド 40 VA	7,596,711,491円	4,488,570,699円
ダイワ世界バランスファンド 60 VA	492,141,170円	356,434,472円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 50 VA	9,642,408円	849,536,293円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 75 VA	48,212,037円	1,867,541,929円
計	10,782,680,564円	9,697,914,593円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	10,782,680,564口	9,697,914,593口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年1月10日現在		平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	8,675,645,160	33,439,480	6,705,033,290	104,140,940
地方債証券	841,074,960	4,510,881	888,051,956	4,932,475
特殊債券	837,748,240	4,205,790	1,416,460,087	8,584,979
社債券	659,253,677	3,002,908	1,211,438,262	8,712,008
合計	11,013,722,037	45,159,059	10,220,983,595	126,370,402

（注）「当期間」とは当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年12月1日から平成20年1月10日まで、及び平成20年12月2日から平成21年1月13日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
------------------------------	------------------------------

該当事項はありません。

同左

(1口当たり情報)

	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0334円 (10,334円)	1.0631円 (10,631円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	1 40年国債	20,000,000	21,757,000	
	1 30年国債	5,000,000	5,801,500	
	2 30年国債	8,000,000	8,727,200	
	3 30年国債	4,000,000	4,295,080	
	4 30年国債	8,000,000	9,476,320	
	5 30年国債	3,000,000	3,168,450	
	6 30年国債	9,000,000	9,834,300	
	7 30年国債	9,000,000	9,668,070	
	8 30年国債	4,000,000	3,905,480	
	9 30年国債	7,000,000	6,269,550	
	10 30年国債	7,000,000	5,849,480	
	11 30年国債	8,000,000	7,624,880	
	12 30年国債	8,000,000	8,261,840	
	13 30年国債	10,000,000	10,126,300	
	14 30年国債	10,000,000	10,944,500	
	15 30年国債	8,000,000	8,922,240	
	16 30年国債	10,000,000	11,141,100	
	17 30年国債	12,000,000	13,133,400	
	18 30年国債	13,000,000	13,969,930	
	19 30年国債	14,000,000	15,051,260	
	20 30年国債	9,000,000	10,044,900	
	20 利付国債20年	15,000,000	17,733,000	
	21 30年国債	4,000,000	4,300,320	
	22 30年国債	12,000,000	13,398,240	
	23 30年国債	13,000,000	14,537,380	
	24 30年国債	13,000,000	14,546,610	
	25 30年国債	10,000,000	10,759,200	
	26 30年国債	25,000,000	27,444,750	
	27 30年国債	25,000,000	28,018,250	
	28 30年国債	24,000,000	26,930,160	
	29 30年国債	13,000,000	14,314,950	
	30 利付国債20年	16,000,000	18,972,000	
	32 利付国債20年	8,000,000	9,597,040	
	33 利付国債20年	5,000,000	6,056,400	
	34 利付国債20年	27,000,000	32,184,810	
	36 利付国債20年	33,000,000	38,101,800	

3 7 利付国債 2 0 年	5,000,000	5,815,100
3 8 利付国債 2 0 年	11,000,000	12,430,110
3 9 2 0 年国債	32,000,000	35,864,640
4 0 2 0 年国債	36,000,000	39,348,000
4 1 2 0 年国債	40,000,000	40,755,200
4 2 2 0 年国債	11,000,000	12,362,460
4 3 2 0 年国債	26,000,000	30,097,600
4 4 2 0 年国債	23,000,000	25,780,470
4 5 5 年国債	29,000,000	29,099,760
4 5 2 0 年国債	15,000,000	16,666,500
4 6 5 年国債	37,000,000	37,083,990
4 6 2 0 年国債	19,000,000	20,691,380
4 7 5 年国債	31,000,000	31,076,880
4 7 2 0 年国債	18,000,000	19,592,820
4 8 5 年国債	25,000,000	25,132,750
4 8 2 0 年国債	11,000,000	12,337,710
4 9 5 年国債	3,000,000	3,012,480
4 9 2 0 年国債	10,000,000	10,767,500
5 0 5 年国債	33,000,000	33,244,530
5 0 2 0 年国債	13,000,000	13,704,730
5 1 5 年国債	28,000,000	28,301,000
5 1 2 0 年国債	15,000,000	15,944,250
5 2 5 年国債	20,000,000	20,170,200
5 2 2 0 年国債	14,000,000	15,014,720
5 3 5 年国債	22,000,000	22,275,660
5 3 2 0 年国債	17,000,000	18,212,780
5 4 5 年国債	25,000,000	25,390,500
5 4 2 0 年国債	14,000,000	15,167,740
5 5 5 年国債	36,000,000	36,794,880
5 5 2 0 年国債	20,000,000	21,158,200
5 6 5 年国債	78,000,000	79,882,140
5 6 2 0 年国債	21,000,000	22,160,880
5 7 5 年国債	6,000,000	6,142,560
5 7 2 0 年国債	19,000,000	19,815,860
5 8 5 年国債	88,000,000	90,302,080
5 8 2 0 年国債	12,000,000	12,495,000
5 9 5 年国債	30,000,000	30,640,800
5 9 2 0 年国債	15,000,000	15,188,100
6 0 5 年国債	25,000,000	25,506,000
6 0 2 0 年国債	15,000,000	14,608,350
6 1 5 年国債	3,000,000	3,064,980
6 1 2 0 年国債	19,000,000	17,500,900
6 2 5 年国債	2,000,000	2,049,080
6 2 2 0 年国債	6,000,000	5,325,060
6 3 5 年国債	20,000,000	20,446,800
6 3 2 0 年国債	23,000,000	23,470,120
6 4 5 年国債	45,000,000	46,491,300
6 4 2 0 年国債	27,000,000	27,863,190
6 5 5 年国債	52,000,000	53,548,560
6 5 2 0 年国債	15,000,000	15,458,250
6 6 5 年国債	24,000,000	24,471,120
6 6 2 0 年国債	11,000,000	11,190,850
6 7 5 年国債	15,000,000	15,405,300
6 7 2 0 年国債	18,000,000	18,545,940
6 8 5 年国債	27,000,000	27,533,520
6 8 2 0 年国債	13,000,000	13,918,190
6 9 5 年国債	55,000,000	55,664,400

69	20年国債	17,000,000	17,971,890
70	5年国債	114,000,000	114,857,280
70	20年国債	27,000,000	29,617,110
71	5年国債	32,000,000	32,898,240
71	20年国債	8,000,000	8,556,720
72	5年国債	31,000,000	32,140,180
72	20年国債	39,000,000	41,160,210
73	5年国債	24,000,000	24,676,080
73	20年国債	8,000,000	8,321,600
74	5年国債	25,000,000	25,376,250
74	20年国債	22,000,000	23,175,460
75	5年国債	34,000,000	34,647,020
75	20年国債	4,000,000	4,213,640
76	5年国債	53,000,000	54,261,400
76	20年国債	23,000,000	23,568,560
77	5年国債	45,000,000	45,662,850
77	20年国債	9,000,000	9,348,390
78	5年国債	68,000,000	68,647,360
78	20年国債	5,000,000	5,115,250
79	20年国債	17,000,000	17,654,670
80	20年国債	16,000,000	16,821,600
81	20年国債	11,000,000	11,391,710
82	20年国債	42,000,000	44,096,640
83	20年国債	20,000,000	20,968,800
84	20年国債	18,000,000	18,611,820
85	20年国債	26,000,000	27,219,400
86	20年国債	32,000,000	34,460,480
87	20年国債	3,000,000	3,186,660
88	20年国債	18,000,000	19,360,620
89	20年国債	25,000,000	26,502,000
90	20年国債	27,000,000	28,620,810
91	20年国債	21,000,000	22,574,370
92	20年国債	44,000,000	45,913,120
93	20年国債	25,000,000	25,702,250
94	20年国債	25,000,000	26,098,250
95	20年国債	21,000,000	22,561,980
96	20年国債	29,000,000	30,266,430
97	20年国債	25,000,000	26,490,250
98	20年国債	27,000,000	28,171,530
99	20年国債	53,000,000	55,283,240
100	20年国債	13,000,000	13,790,270
101	20年国債	24,000,000	26,239,440
102	20年国債	15,000,000	16,413,300
103	20年国債	24,000,000	25,857,120
104	20年国債	20,000,000	20,878,400
105	20年国債	45,000,000	47,029,500
106	20年国債	15,000,000	15,929,550
107	20年国債	22,000,000	23,001,660
221	利付国債	42,000,000	42,936,600
222	利付国債	12,000,000	12,250,560
223	利付国債	5,000,000	5,113,350
224	利付国債	5,000,000	5,121,700
225	利付国債	19,000,000	19,563,350
226	利付国債	35,000,000	35,970,900
227	利付国債	9,000,000	9,237,870
228	利付国債	16,000,000	16,386,560
229	10年国債	5,000,000	5,110,000

2 3 1	1 0 年国債	26,000,000	26,558,480
2 3 3	1 0 年国債	33,000,000	33,788,370
2 3 4	1 0 年国債	36,000,000	36,928,800
2 3 6	1 0 年国債	10,000,000	10,304,700
2 3 7	1 0 年国債	45,000,000	46,426,950
2 3 8	1 0 年国債	9,000,000	9,257,220
2 3 9	1 0 年国債	9,000,000	9,269,550
2 4 0	1 0 年国債	37,000,000	37,970,880
2 4 1	1 0 年国債	18,000,000	18,489,780
2 4 2	1 0 年国債	17,000,000	17,401,200
2 4 3	1 0 年国債	17,000,000	17,340,000
2 4 4	1 0 年国債	6,000,000	6,096,720
2 4 5	1 0 年国債	11,000,000	11,135,080
2 4 6	1 0 年国債	15,000,000	15,126,600
2 4 7	1 0 年国債	26,000,000	26,195,520
2 4 8	1 0 年国債	20,000,000	20,073,200
2 4 9	1 0 年国債	33,000,000	32,979,540
2 5 0	1 0 年国債	44,000,000	43,706,520
2 5 1	1 0 年国債	13,000,000	13,139,750
2 5 2	1 0 年国債	55,000,000	55,839,850
2 5 3	1 0 年国債	56,000,000	58,374,400
2 5 4	1 0 年国債	31,000,000	32,040,670
2 5 5	1 0 年国債	4,000,000	4,155,240
2 5 6	1 0 年国債	14,000,000	14,469,980
2 5 7	1 0 年国債	15,000,000	15,432,150
2 5 8	1 0 年国債	98,000,000	100,859,640
2 6 0	1 0 年国債	34,000,000	35,571,140
2 6 1	1 0 年国債	20,000,000	21,138,600
2 6 2	1 0 年国債	45,000,000	47,784,600
2 6 3	1 0 年国債	6,000,000	6,282,780
2 6 4	1 0 年国債	6,000,000	6,248,400
2 6 5	1 0 年国債	48,000,000	50,014,080
2 6 6	1 0 年国債	39,000,000	40,403,610
2 6 7	2 年国債	44,000,000	44,157,960
2 6 7	1 0 年国債	51,000,000	52,546,320
2 6 8	2 年国債	40,000,000	40,198,000
2 6 8	1 0 年国債	13,000,000	13,547,170
2 6 9	2 年国債	52,000,000	52,423,280
2 6 9	1 0 年国債	41,000,000	42,230,410
2 7 0	2 年国債	37,000,000	37,313,020
2 7 0	1 0 年国債	88,000,000	90,688,400
2 7 1	2 年国債	15,000,000	15,108,300
2 7 1	1 0 年国債	57,000,000	58,393,080
2 7 2	2 年国債	29,000,000	29,167,620
2 7 2	1 0 年国債	107,000,000	110,998,590
2 7 3	2 年国債	50,000,000	50,385,500
2 7 3	1 0 年国債	49,000,000	51,173,640
2 7 4	2 年国債	50,000,000	50,218,000
2 7 4	1 0 年国債	11,000,000	11,509,080
2 7 5	2 年国債	45,000,000	45,204,750
2 7 5	1 0 年国債	17,000,000	17,692,580
2 7 6	1 0 年国債	16,000,000	16,845,440
2 7 7	1 0 年国債	30,000,000	31,692,300
2 7 8	1 0 年国債	61,000,000	65,270,610
2 7 9	1 0 年国債	76,000,000	82,437,960
2 8 0	1 0 年国債	95,000,000	102,394,800
2 8 1	1 0 年国債	57,000,000	61,923,660

	2 8 2	1 0年国債	93,000,000	98,483,280	
	2 8 3	1 0年国債	69,000,000	73,670,610	
	2 8 4	1 0年国債	52,000,000	54,935,400	
	2 8 5	1 0年国債	43,000,000	45,359,410	
	2 8 6	1 0年国債	103,000,000	109,274,760	
	2 8 7	1 0年国債	56,000,000	59,939,040	
	2 8 8	1 0年国債	146,000,000	153,362,780	
	2 8 9	1 0年国債	155,000,000	159,973,950	
	2 9 0	1 0年国債	52,000,000	53,122,680	
	2 9 1	1 0年国債	32,000,000	32,411,520	
	2 9 2	1 0年国債	63,000,000	66,011,400	
	2 9 3	1 0年国債	49,000,000	51,642,080	
	2 9 4	1 0年国債	44,000,000	45,979,120	
	2 9 5	1 0年国債	69,000,000	70,872,660	
	2 9 6	1 0年国債	120,000,000	122,854,800	
	2 9 7	1 0年国債	68,000,000	68,961,520	
国債証券 合計			6,432,000,000	6,705,033,290	
地方債証券	1 2	共同発行地方	50,000,000	51,118,350	
	1 4	共同発行地方	16,400,000	16,847,703	
	1 8	共同発行地方	100,000,000	103,134,700	
	2 7	共同発行地方	20,000,000	20,207,200	
	7 6	川崎市公債	25,000,000	24,963,675	
	1 1 2	神奈川県公債	35,000,000	35,669,690	
	1 4 4	神奈川県公債	100,000,000	104,753,700	
	5 7 6	東京都公債	70,000,000	71,423,380	
	5 8 3	東京都公債	7,400,000	7,590,513	
	6 0 4	東京都公債	10,000,000	10,293,870	
	1 2－こ	名古屋市債	100,000,000	102,217,700	
	1 2－ゆ	名古屋市債	20,000,000	20,457,240	
	1 4－1	横浜市公債	5,000,000	5,112,190	
	1 4－5	横浜市公債	20,000,000	19,980,680	
	1 7－9	千葉県5年	100,500,000	101,608,615	
	1 6	川崎市5年	60,000,000	61,753,500	
	1 8	川崎市5年	60,000,000	60,470,580	
	1 9	神奈川県5年	40,000,000	40,258,320	
	2 0	東京都5年	30,000,000	30,190,350	
地方債証券 合計			869,300,000	888,051,956	
特殊債券	5	政保中部空港	21,000,000	21,064,407	
	6	政保政策投資B K	25,000,000	25,078,550	
	1 4	政保国民生活	19,000,000	19,643,264	
	3 9	政保関西空港	3,000,000	2,966,214	
	1 9 0	政保首都高速	3,000,000	3,086,391	
	1 9 3	しんきん中金	100,000,000	100,077,900	
	3 0 9	政保道路債	20,000,000	20,455,880	
	3 1 2	政保道路債	30,000,000	30,590,880	
	3 1 7	政保道路債	100,000,000	98,865,300	
	3 1 9	政保道路債	40,000,000	40,248,800	
	3 2 3	政保道路債	85,000,000	87,872,745	
	3 2 8	政保道路債	41,000,000	42,408,432	
	3 3 3	政保道路債	11,000,000	11,430,342	
	3 3 4	政保道路債	2,000,000	2,066,394	
	7 9 3	政保公営企業	100,000,000	102,279,400	
	8 0 3	政保公営企業	15,000,000	15,282,990	
	8 0 9	政保公営企業	15,000,000	15,366,285	
	8 2 8	政保公営企業	15,000,000	14,830,485	
	8 2 9	政保公営企業	10,000,000	10,150,980	

	8 3 1 政保公営企業	4,000,000	4,153,948	
	8 4 2 政保公営企業	5,000,000	5,252,200	
	い 6 8 6 利付農林債	30,000,000	30,525,900	
	い 6 8 8 利付商工債	100,000,000	100,666,900	
	2 成田国際空港	100,000,000	102,673,900	
	1 公営企業	100,000,000	101,905,900	
	4 国際協力銀行	100,000,000	102,194,000	
	1 3 首都高速道路	100,000,000	101,829,600	
	1 7 国民生活債券	100,000,000	100,002,100	
	2 6 公営企業	100,000,000	103,490,000	
特殊債券 合計		1,394,000,000	1,416,460,087	
社債券	4 みずほコーポレート	100,000,000	100,807,000	
	7 日産フィナンシャル	100,000,000	99,357,800	
	1 2 三菱UFJフィナンシャル	100,000,000	100,475,800	
	1 6 ソニー	100,000,000	100,358,100	
	2 1 東京瓦斯	100,000,000	101,784,300	
	2 8 トヨタファイナンス	100,000,000	100,679,000	
	4 1 三菱電機	100,000,000	101,204,300	
	2 6 1 北海道電力	3,000,000	3,334,443	
	3 9 0 東北電力	130,000,000	135,220,930	
	4 8 2 東京電力	100,000,000	101,675,800	
	5 1 3 東京電力	57,000,000	59,354,727	
	5 1 6 東京電力	17,000,000	17,263,262	
	8 ゴールドマン サックス	100,000,000	94,152,400	
	1 0 GEキャピタル	100,000,000	95,770,400	
社債券 合計		1,207,000,000	1,211,438,262	
合計		9,902,300,000	10,220,983,595	

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20年1月10日現在 金 額 (円)	平成21年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	4,891,052,158	1,560,671,854
コール・ローン	2,073,727,767	1,423,020,499
投資証券	137,197,262,192	62,227,509,336
派生商品評価勘定	4,715	1,249,285
未収入金	1,180,927,859	1,352,684,133
未収配当金	1,312,313,917	579,408,130
流動資産合計	146,655,288,608	67,144,543,237
資産合計	146,655,288,608	67,144,543,237
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,345,846	427,987
未払金	734,626,169	1,191,448,427
未払解約金	344,000,000	178,000,000
流動負債合計	1,079,972,015	1,369,876,414
負債合計	1,079,972,015	1,369,876,414
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	134,030,581,510	122,795,375,292
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) ※2	11,544,735,083	△57,020,708,469
元本等合計	145,575,316,593	65,774,666,823
純資産合計	145,575,316,593	65,774,666,823
負債純資産合計	146,655,288,608	67,144,543,237

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19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	49,326,358,957円	134,030,581,510円
同期中における追加設定元本額	98,796,497,620円	9,873,754,494円
同期中における一部解約元本額	14,092,275,067円	21,108,960,712円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREIT・オープン（毎月分配型）	72,531,285,119円	64,397,304,955円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	256,162,159円	284,739,568円

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	232,989,620円	326,030,016円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	284,156,009円	391,817,440円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,252,347,038円	1,257,988,404円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	5,365,943円	10,034,890円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	6,750,104円	8,981,598円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	19,942,247円	23,376,160円
6資産バランスファンド（分配型）	3,843,339,740円	4,399,393,447円
6資産バランスファンド（成長型）	4,306,670,879円	4,344,197,762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）	429,764,634円	395,206,346円
りそな ワールド・リート・ファンド	22,318,690,125円	22,145,712,972円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	3,366,204,023円	4,124,026,753円
『しがぎん』SR I三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	72,922,737円	85,268,114円
日の出・3資産バランスファンド	1,464,546,095円	706,151,030円
ダイワ海外・債券&REIT・ファンド	393,820円	—円
常陽3分法ファンド	4,261,092,532円	4,807,503,364円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	715,120,047円	949,085,945円
ダイワ・海外株式&REITファンド（毎月分配型）	308,038,537円	284,574,037円
ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）	491,418円	1,688,655円
ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）	112,198円	115,806円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	26,945,735円	71,699,205円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	57,916,433円	108,969,587円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	45,600,276円	83,891,141円
ダイワ・グローバルREITファンド（ダイワSMA専用）	3,882,576,260円	2,352,614,799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）	14,341,157,782円	11,235,003,298円
計	134,030,581,510円	122,795,375,292円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	134,030,581,510口	122,795,375,292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57,020,708,469円であります。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成20年1月10日現在		平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
投資証券	137,197,262,192	△28,388,570,088	62,227,509,336	△24,641,490,470
合計	137,197,262,192	△28,388,570,088	62,227,509,336	△24,641,490,470

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年9月19日から平成20年1月10日まで、及び平成20年9月17日から平成21年1月13日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成20年1月10日 現在				平成21年1月13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	228,663,623	—	229,982,908	△1,319,285	398,422,124	—	398,378,591	43,533
アメリカ・ドル	—	—	—	—	124,338,738	—	124,324,843	13,895
イギリス・ポンド	86,060,000	—	86,264,000	△204,000	148,904,166	—	148,892,904	11,262
オーストラリア・ドル	—	—	—	—	97,341,266	—	97,325,224	16,042
シンガポール・ドル	22,839,000	—	23,070,000	△231,000	—	—	—	—
ニュージーランド・ドル	33,540,000	—	34,096,000	△556,000	—	—	—	—
ユーロ	86,224,623	—	86,552,908	△328,285	27,837,954	—	27,835,620	2,334
買 建	38,089,623	—	38,067,777	△21,846	398,422,124	—	399,199,889	777,765
アメリカ・ドル	38,089,623	—	38,067,777	△21,846	274,083,386	—	275,289,138	1,205,752
シンガポール・ドル	—	—	—	—	124,338,738	—	123,910,751	△427,987
合計	266,753,246	—	268,050,685	△1,341,131	796,844,248	—	797,578,480	821,298

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

- ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0861円 (10,861円)	0.5356円 (5,356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	
		UDR 6.750 G	33,050.000	608,120.000	
		PUBLIC STORAGE INC N	45,861.000	946,571.040	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	138,470.000	7,068,893.500	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	632,987.000	27,680,521.510	

BOSTON PROPERTIES INC	386,440.000	18,780,984.000
BIOMED REALTY TRUST INC	460,577.000	4,886,721.970
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	290,630.000	3,060,333.900
VORNADO REALTY TRUST	409,799.000	21,301,352.020
EQUITY RESIDENTIAL	621,569.000	15,135,205.150
HOST HOTELS&RESORTS INC	1,844,781.000	12,360,032.700
KIMCO REALTY CORP	105,300.000	1,722,708.000
SOVRAN SELF STORAGE INC	299,257.000	7,879,436.810
VENTAS INC	252,736.000	6,593,882.240
ACADIA REALTY TRUST	406,454.000	5,332,676.480
AMB PROPERTY CORP	241,584.000	4,969,382.880
BRE PROPERTIES-CL A	246,298.000	6,031,838.020
MACK-CALI REALTY CORP	453,181.000	9,426,164.800
COLONIAL PROPERTIES TRUST	277,200.000	2,145,528.000
EASTGROUP PROPERTIES INC	119,408.000	3,742,246.720
ESSEX PROPERTY TRUST INC	91,346.000	5,764,846.060
FEDERAL REALTY INVS TRUST	114,700.000	6,016,015.000
HEALTH CARE REIT INC	144,483.000	5,218,725.960
HCP INC	332,787.000	7,231,461.510
HOME PROPERTIES INC	90,705.000	2,900,745.900
LIBERTY PROPERTY TRUST	695,157.000	13,131,515.730
MACERICH CO/THE	653,750.000	9,910,850.000
NATIONWIDE HEALTH PPTYS	222,914.000	5,443,559.880
PROLOGIS	646,276.000	7,994,434.120
PUBLIC STORAGE	163,000.000	10,389,620.000
REGENCY CENTERS CORP	224,063.000	8,514,394.000
SL GREEN REALTY CORP	90,683.000	1,650,430.600
SENIOR HOUSING PROP TRUST	355,033.000	5,282,891.040
TAUBMAN CENTERS INC	142,680.000	3,000,560.400
UDR INC	455,031.000	5,132,749.680
WEINGARTEN REALTY INVESTO	77,602.000	1,277,328.920
DEVELOP DIV RLTY 7.375% H	116,525.000	1,200,207.500
OMEGA HEALTHCARE INVESTOR	261,735.000	3,402,555.000
PS BUSINESS PARK 7% H	106,100.000	1,877,970.000
PS BUSINESS PARK 6.875% I	99,200.000	1,661,600.000
DEVELOP DIV RLTY 8% G	100,000.000	1,179,000.000
APARTMENT INVEST 8% T	167,000.000	2,705,400.000
APARTMENT INVEST 7.75% U	72,700.000	1,148,660.000
DUKE REALTY CORP 6.5% K	86,600.000	1,052,190.000
HCP INC 7.1% F	253,000.000	4,250,400.000
KIMCO REALTY 6.65% F	66,200.000	1,118,780.000
WEINGARTEN RLTY 6.75% D	155,000.000	2,379,250.000
INLAND REAL ESTATE CORP	141,200.000	1,496,720.000
KIMCO REALTY 7.75% G	339,542.000	6,705,954.500
DUKE REALTY CORP 8.375 O	144,700.000	2,459,900.000
APARTMENT INVEST 8% V	35,300.000	547,150.000
PS BUSINESS PARK 7.6% L	43,500.000	787,785.000
EXTRA SPACE STORAGE INC	469,665.000	4,194,108.450
CBL&ASSOC PROP 7.375% D	28,950.000	253,312.500
AMERICAN CAMPUS COMMUNITI	184,252.000	3,445,512.400
DIGITAL REALTY 7.875% B	20,900.000	344,850.000
PS BUSINESS PARKS 7.2% M	50,000.000	892,500.000
REGENCY CENTERS 7.25% D	57,110.000	1,098,796.400
REGENCY CENTERS 6.7% E	69,885.000	1,373,240.250
VORNADO REALTY TST 6.75%F	148,575.000	2,524,289.250
VORNADO REALTY TST 6.75%H	133,800.000	2,261,220.000
LASALLE HOTEL 8% E	87,700.000	1,122,560.000

	HRPT PROPERTIES 7.125% C	99,100.000	1,214,966.000	
	PUBLIC STORAGE 6.95% H	169,300.000	3,507,896.000	
	PUBLIC STORAGE INC I	165,000.000	3,795,000.000	
	VORNADO RLTY TST 6.625% I	193,700.000	3,370,380.000	
	PUBLIC STORAGE INC -K	100,000.000	2,260,000.000	
	DUKE REALTY CORP 6.60% L	49,700.000	644,112.000	
	NAT'L RETAIL PROP CL C	60,200.000	1,101,660.000	
	DOUGLAS EMMETT	372,782.000	4,257,170.440	
	PUBLIC STORAGE INC L	270,000.000	5,440,500.000	
	REALTY INCOME PFD E	60,000.000	1,095,000.000	
	BRE PROPERTIES 6.75 D	84,800.000	1,484,000.000	
	PS BUSINESS PARK P	267,100.000	4,594,120.000	
	BIOMED REALTY 7.375 A	213,200.000	3,112,720.000	
	WEINGARTEN RLTY F	356,219.000	5,378,906.900	
	LEXINGTON REALTY D	322,000.000	3,255,420.000	
	HOSPITALITY PROP C	202,000.000	2,906,780.000	
	FIRST IND REALTY 7.25% J	98,750.000	1,076,375.000	
	DUKE REALTY CORP 6.95% M	88,800.000	1,146,408.000	
アメリカ・ドル 小計		18,377,582.000	アメリカ・ドル 359,658,054.130 (32,182,202,683)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES PLC	2,295,527.000	イギリス・ポンド 21,566,476.160	
	SEGRO	2,324,449.000	6,129,572.010	
	HAMMERSON PLC	1,867,579.000	10,281,022.390	
	BRITISH LAND CO PLC	2,141,773.000	12,122,435.180	
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	1,489,279.000	3,872,125.400	
	DERWENT LONDON PLC	161,196.000	1,289,568.000	
イギリス・ポンド 小計		10,279,803.000	イギリス・ポンド 55,261,199.140 (7,306,635,750)	
オーストラリア・ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	7,500,002.000	オーストラリア・ドル 13,650,003.640	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	4,161,180.000	4,826,968.800	
	DEXUS PROPERTY GROUP	16,972,353.000	14,002,191.220	
	GPT GROUP	11,664,458.000	10,556,334.490	
	MIRVAC GROUP	5,797,138.000	7,478,308.020	
	STOCKLAND	4,614,979.000	17,583,069.990	
	WESTFIELD GROUP	8,068,130.000	111,501,556.600	
	GOODMAN GROUP	6,809,626.000	6,809,626.000	
オーストラリア・ドル 小計		65,587,866.000	オーストラリア・ドル 186,408,058.760 (11,311,241,005)	
カナダ・ドル	CAN REAL ESTATE INVEST TR	425,974.000	カナダ・ドル 9,575,895.520	
	BOARDWALK REAL ESTATE INV	109,370.000	2,892,836.500	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA	916,963.000	9,884,861.140	
カナダ・ドル 小計		1,452,307.000	カナダ・ドル 22,353,593.160 (1,641,200,810)	
シンガポール・ドル	CAPITACOMMERCIAL TRUST	1,272,000.000	シンガポール・ドル 1,240,200.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	1,791,000.000	2,525,310.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	11,260,000.000	4,504,000.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル	

		14,323,000.000	8,269,510.000 (496,253,295)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	KIWI INCOME PROPERTY TRU	3,790,656.000	3,942,282.240	
	AMP NZ OFFICE TRUST	3,775,561.000	3,737,805.390	
ニュージーランド・ドル 小計		7,566,217.000	ニュージーランド・ドル 7,680,087.630 (389,303,642)	
ユーロ			ユーロ	
	CORIO NV	264,730.000	9,646,761.200	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-C	97,844.000	2,317,924.360	
	VASTNED OFFICES/INDUSTRIA	25,078.000	210,655.200	
	VASTNED RETAIL NV	75,415.000	2,918,560.500	
	ICADE	103,257.000	6,271,830.180	
	UNIBAIL-RODAMCO	351,188.000	38,086,338.600	
	KLEPIERRE	150,808.000	2,932,461.560	
ユーロ 小計		1,068,320.000	ユーロ 62,384,531.600 (7,440,603,084)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	7,339,756.000	103,196,969.360	
	CHAMPION REIT	8,253,477.000	16,094,280.150	
	FORTUNE REAL ESTATE INVES	3,144,000.000	7,231,200.000	
香港・ドル 小計		18,737,233.000	香港・ドル 126,522,449.510 (1,460,069,067)	
投資証券 合計			62,227,509,336 [62,227,509,336]	
合計			62,227,509,336 [62,227,509,336]	

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 79銘柄	100%	51.7%
イギリス・ポンド	投資証券 6銘柄	100%	11.7%
オーストラリア・ドル	投資証券 8銘柄	100%	18.2%
カナダ・ドル	投資証券 3銘柄	100%	2.6%
シンガポール・ドル	投資証券 3銘柄	100%	0.8%
ニュージーランド・ドル	投資証券 2銘柄	100%	0.6%
ユーロ	投資証券 7銘柄	100%	12.0%
香港・ドル	投資証券 3銘柄	100%	2.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

「ダイワＪ－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20年1月10日現在 金 額（円）	平成21年1月13日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	162,067,434	56,840,176
投資証券	25,914,177,000	14,691,254,000
未収入金	—	95,813,822
未収配当金	272,612,181	310,203,005
流動資産合計	26,348,856,615	15,154,111,003
資産合計	26,348,856,615	15,154,111,003
負債の部		
流動負債		
未払金	33,042,960	—
未払解約金	8,000,000	32,250,000
流動負債合計	41,042,960	32,250,000
負債合計	41,042,960	32,250,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	20,534,779,587	20,731,418,174
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	5,773,034,068	△5,609,557,171
元本等合計	26,307,813,655	15,121,861,003
純資産合計	26,307,813,655	15,121,861,003
負債純資産合計	26,348,856,615	15,154,111,003

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19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13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）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資証券 同左
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	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。 （会計方針の変更） 従来、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、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しておりましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成19年7月1日以降計上する受取配当金については、原則として、投資証券の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。	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20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,952,616,075円	20,534,779,587円
同期中における追加設定元本額	10,918,818,794円	4,705,755,489円
同期中における一部解約元本額	2,336,655,282円	4,509,116,902円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	34,633,495円	39,972,916円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	219,730,190円	259,185,372円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	268,561,488円	314,796,796円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,130,533,213円	1,120,669,961円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	4,621,387円	8,200,926円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	5,792,050円	7,600,465円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	17,173,124円	22,208,843円
6資産バランスファンド（分配型）	3,498,999,023円	3,649,122,865円
6資産バランスファンド（成長型）	4,019,340,549円	3,389,360,936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）	368,204,308円	320,426,331円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	3,143,037,915円	3,070,552,183円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	31,469,449円	35,666,140円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	622,210,829円	777,678,646円

ダイワ円債重視バランスファンド （奇数月決算型）	403,100円	1,363,264円
ダイワ円債重視バランスファンド （資産形成型）	90,074円	95,363円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース）	22,886,081円	54,048,214円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	50,326,158円	84,101,313円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	38,533,692円	62,134,262円
DCダイワJ-REITアクティ ブファンド	48,137,098円	61,207,373円
ダイワファンドラップ J-REITセ レクト	1,484,642,750円	3,858,155,089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）	2,333,352,128円	1,021,545,811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）	496,687,125円	302,777,499円
ライフハーモニー（ダイワ世界資 産分散ファンド）（分配型）	2,695,414,361円	1,957,060,210円
ダイワJリート・ファンド	—円	313,487,396円
計	20,534,779,587円	20,731,418,174円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	20,534,779,587口	20,731,418,174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5,609,557,171円でありま す。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年1月10日現在		平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	25,914,177,000	△949,006,990	14,691,254,000	109,369,298
合計	25,914,177,000	△949,006,990	14,691,254,000	109,369,298

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年11月13日から平成20年1月10日まで、及び平成20年11月11日から平成21年1月13日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
本報告書における開示対象ファン ドの期末における当該親投資信託 の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2811円 （12,811円）	0.7294円 （7,294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	541	203,416,000	
	M I Dリート投資法人	530	71,285,000	
	森ヒルズリート	360	101,952,000	
	野村不レジデンシャル	606	174,588,600	
	日本ビルファンド	3,450	3,091,200,000	
	ジャパンリアルエステイト	2,830	2,085,710,000	
	日本リテールファンド	2,050	776,950,000	
	オリックス不動産投資	1,750	752,500,000	
	日本プライムリアルティ	2,833	611,928,000	
	プレミアム投資法人	841	185,020,000	
	東急リアル・エステート	1,200	655,200,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	800	520,000,000	
	野村不動産オフィスF	1,997	1,108,335,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,200	405,600,000	
	森トラスト総合リート	1,200	841,200,000	
	フロンティア不動産投資	1,294	592,652,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,000	523,000,000	
	福岡リート投資法人	500	187,500,000	
	ケネディクス不動産投資法人	1,970	439,310,000	
	ジョイントリート投資法人	1,175	127,605,000	
	ラサールジャパン投資法人	150	10,440,000	
	D Aオフィス投資法人	852	149,952,000	
	阪急リート投資法人	585	222,885,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	562	156,236,000	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	150	15,045,000	
	トップリート投資法人	1,100	330,000,000	
	ビ・ライフ投資法人	150	27,390,000	
	日本ホテルファンド投資法人	152	24,654,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	900	299,700,000	
投資証券 合計		32,728	14,691,254,000	
合計		32,728	14,691,254,000	

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20年1月10日現在 金 額（円）	平成21年1月13日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	86,802,289	176,284,014
コール・ローン	126,872,021	115,806,657
株式	4,011,790,294	2,033,564,956
ハイブリッド優先証券	1,326,024,495	686,144,074
投資証券	116,017,330	61,284,740
未収入金	16,279,300	5,033,746
未収配当金	9,578,431	6,768,775
未収利息	1,140,877	880,179
流動資産合計	5,694,505,037	3,085,767,141
資産合計	5,694,505,037	3,085,767,141
負債の部		
流動負債		
未払金	—	6,040,724
未払解約金	14,000,000	—
流動負債合計	14,000,000	6,040,724
負債合計	14,000,000	6,040,724
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	4,868,046,938	4,458,666,706
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	812,458,099	△1,378,940,289
元本等合計	5,680,505,037	3,079,726,417
純資産合計	5,680,505,037	3,079,726,417
負債純資産合計	5,694,505,037	3,085,767,141

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19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)ハイブリッド優先証券	(1)株式 同左 (2)ハイブリッド優先証券

	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、それに準ずる価格）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	同左
	(3)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	(3)投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)受取利息 ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。	(1)受取配当金 同左 (2)受取利息 同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準

	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。	同左
--	---	----

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,504,984,700円	4,868,046,938円
同期中における追加設定元本額	3,994,036,795円	194,141,572円
同期中における一部解約元本額	630,974,557円	603,521,804円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	13,530,707円	12,997,752円
ダイワ・グローバル好配当株ファンド(毎月分配型)	540,085,047円	464,783,512円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	158,650,118円	174,232,440円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	197,835,361円	208,102,799円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	3,019,983,001円	2,562,999,046円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	3,806,796円	5,157,153円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	4,537,601円	4,908,978円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	47,424,308円	47,128,179円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	340,517,496円	360,465,193円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	469,043,445円	487,342,196円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	9,972,182円	23,893,516円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	31,860,177円	55,030,823円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	30,800,699円	51,625,119円

計	4,868,046,938円	4,458,666,706円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	4,868,046,938口	4,458,666,706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1,378,940,289円でありま す。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年1月10日現在		平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	4,011,790,294	△ 341,199,115	2,033,564,956	△228,171,561
ハイブリッド優先 証券	1,326,024,495	△29,069,549	686,144,074	63,055,540
投資証券	116,017,330	△14,365,131	61,284,740	1,299,478
合計	5,453,832,119	△384,633,795	2,780,993,770	△163,816,543

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年10月16日から平成20年1月10日まで、及び平成20年10月16日から平成21年1月13日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左

5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
--------------------------	--	----

II 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1669円 (11,669円)	0.6907円 (6,907円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	ABBOTT LABS	16,200	50.060	810,972.000	
	ALCOA	5,600	10.060	56,336.000	
	AFLAC INC	10,600	41.550	440,430.000	
	GARMIN LTD	9,800	18.270	179,046.000	
	HCC INSURANCE HOLDINGS IN	14,300	24.840	355,212.000	
	DEVON ENERGY CORPORATION	5,300	63.150	334,695.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	4,300	26.900	115,670.000	
	BOEING CO	5,800	43.740	253,692.000	
	BECTON DICKINSON & CO	8,400	71.000	596,400.000	
	VERIZON COMMUNICATIONS	13,300	31.790	422,807.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	9,600	24.910	239,136.000	
	CORNING INC	37,700	9.960	375,492.000	
	DOW CHEMICAL	5,600	15.760	88,256.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	5,200	49.430	257,036.000	
	FRANKLIN RESOURCES INC	1,700	59.540	101,218.000	
	EXXON MOBIL CORP	11,000	76.540	841,940.000	
	L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	4,000	76.250	305,000.000	
	FPL GROUP INC	11,900	49.720	591,668.000	
	US BANCORP	7,400	21.680	160,432.000	
	GENERAL ELECTRIC CO	21,100	15.830	334,013.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	7,100	57.680	409,528.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	800	77.670	62,136.000	
	HARRIS CORP	11,400	38.320	436,848.000	
	HEWLETT-PACKARD CO	1,500	36.980	55,470.000	
	INT'L BUSINESS MACHINES	5,500	85.710	471,405.000	
	JOHNSON & JOHNSON	13,300	58.340	775,922.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	6,700	79.660	533,722.000	
	MCDONALD'S CORP	11,000	60.160	661,760.000	
	MATTEL INC	8,400	15.190	127,596.000	
	METLIFE INC	8,600	29.060	249,916.000	
	MONSANTO CO	3,100	78.050	241,955.000	

	NIKE INC -CL B	5,500	50.120	275,660.000	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,600	17.300	321,780.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATION	1,200	41.830	50,196.000	
	ALTRIA GROUP INC	34,000	15.790	536,860.000	
	PFIZER INC	20,600	17.360	357,616.000	
	PROCTER & GAMBLE CO	12,800	59.940	767,232.000	
	EXELON CORP	2,100	54.600	114,660.000	
	QUALCOMM INC	10,400	34.860	362,544.000	
	CHEVRON CORP	6,900	70.820	488,658.000	
	TRANSOCEAN LTD	4,306	50.530	217,582.180	
	SOUTHERN CO	2,900	35.790	103,791.000	
	SCHLUMBERGER LTD	8,500	41.350	351,475.000	
	AT&T INC	20,000	25.940	518,800.000	
	SEMPRA ENERGY	6,900	43.580	300,702.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY	23,800	4.760	113,288.000	
	MARATHON OIL CORP	16,000	27.760	444,160.000	
	UNITED TECHNOLOGIES	5,600	52.360	293,216.000	
	UNITED PARCEL SERVICE-B	4,300	50.650	217,795.000	
	THE WALT DISNEY CO.	13,500	21.860	295,110.000	
	WELLS FARGO & CO	9,200	23.800	218,960.000	
	WAL-MART STORES	7,100	51.390	364,869.000	
	BANK OF AMERICA CORP	19,400	11.430	221,742.000	
	NORDSTROM INC	5,100	13.370	68,187.000	
	INTEL CORP	26,600	13.790	366,814.000	
	MICROSOFT CORP	28,000	19.470	545,160.000	
	MEDTRONIC INC	16,900	32.450	548,405.000	
	BLACKROCK INC-CLASS A	2,000	123.530	247,060.000	
	KRAFT FOODS INC-A	18,652	28.530	532,141.560	
	APACHE CORP	4,000	75.220	300,880.000	
	ACE LTD	4,700	47.200	221,840.000	
	PRAXAIR INC	2,000	60.890	121,780.000	
アメリカ・ドル 小計		株 647,758		アメリカ・ドル 20,774,672.740 (1,858,917,718)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	TORONTO-DOMINION BANK	5,300	44.870	237,811.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	5,900	35.740	210,866.000	
	TRANSCANADA CORP	11,800	33.070	390,226.000	
	THOMSON REUTERS CORP	7,700	29.200	224,840.000	
	PETRO-CANADA	7,500	29.140	218,550.000	
	CAMECO CORP	8,700	21.770	189,399.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	3,000	44.330	132,990.000	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	13,500	42.560	574,560.000	
	IGM FINANCIAL INC	6,000	33.250	199,500.000	
カナダ・ドル 小計		株 69,400		カナダ・ドル 2,378,742.000 (174,647,238)	
合計		株 717,158		2,033,564,956 [2,033,564,956]	

(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	
		COMCAST 6.625	8,818.000	188,352.480	
		CITIGROUP CAP XIX 7.25	10,402.000	162,791.300	
		BEAR STEARNS CAP 7.8	14,740.000	334,598.000	

		BB&T CAP TR V 8.95	5,000.000	126,250.000
		JPMCHASE CAP XXVI 8.0	12,000.000	287,760.000
		JPMCHASE CAP J 8.625	10,000.000	247,600.000
		FPL CAP E 7.45	5,496.000	144,709.680
		XCEL ENERGY 7.6	10,000.000	249,000.000
		REGIONS FIN TR III8.875	3,000.000	66,930.000
		BANK OF AMERICA I 6.625	6,600.000	102,630.000
		BANK OF AMERICA Q 8.625	19,850.000	405,138.500
		METLIFE B 6.500	5,400.000	101,250.000
		EVEREST RE CP II 6.2	7,930.000	142,740.000
		ALLMERICA FIN I 8.00	5,000.000	83,750.000
		NEXEN INC B 7.35	6,198.000	123,402.180
		FPC CAPITAL I 7.100	11,950.000	283,215.000
		AXIS CAPITAL HLDG 7.25	6,000.000	114,000.000
		MBNA CAPITAL D 8.125	12,650.000	269,318.500
		PARTNERRE C 6.750	5,933.000	121,211.190
		TELEPHONE&DATASYS 7.600	15,950.000	270,671.500
		ARCH CAPITAL GRP A 8%	4,697.000	104,179.460
		SOVEREIGN CAP TR 7.75	3,500.000	66,710.000
		CAPITAL ONE CAP II 7.50	4,600.000	78,660.000
		CITIGROUP CAP XIV 6.875	9,000.000	131,040.000
		PPL ENERGY SUPPLY 7.00	6,019.000	151,979.750
		BAC CAP TR XII 6.875	5,000.000	97,100.000
		COMCAST B 7.000	14,950.000	337,571.000
		JPMCHASE CAP XIX 6.625	5,000.000	110,600.000
		USB CAPITAL XI 6.600	4,976.000	122,459.360
		ARCH CAPITAL GR B 7.875	5,900.000	128,325.000
		COUNTRYWIDE CAP V 7.00%	9,000.000	146,970.000
		KEYCORP CAP IX	10,000.000	164,600.000
		VIACOM 6.850	7,600.000	148,048.000
		RENAISSANCERE HL D 6.6%	3,000.000	55,920.000
		AT&T 6.375	3,400.000	85,918.000
		CBS 6.750	4,500.000	73,575.000
		CONSTELLAT ENER A 8.625	3,575.000	76,934.000
		BRISTOL MYERS SQUIBB6.8	3,000.000	73,500.000
		NATL CITY CAP IV 8.0	16,500.000	363,000.000
		WACHOVIA CAP X 7.850	14,475.000	337,267.500
		WELLS F CAP J 8.0	14,000.000	305,200.000
		BANK OF AMERICA H 8.20	2,300.000	50,830.000
		CITIGROUP INC F 8.50	4,000.000	60,920.000
		CITIGROUP CAP AA	12,057.000	171,209.400
		M & T CAP TR IV 8.5	3,100.000	76,725.000
		US BANCORP D 7.875	5,000.000	132,500.000
		AMERICAN ELEC PO 8.75	5,019.000	131,547.990
		PPL CAPITAL FDG 6.85	2,400.000	59,520.000
		アメリカ・ドル 小計	369,485.000	アメリカ・ドル 7,668,127.790 (686,144,074)
ハイブリッド優先証券 合計			369,485.000	686,144,074 [686,144,074]
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル
		KIMCO REALTY 7.75% G	7,000.000	138,250.000
		APARTMENT INVEST 8% V	4,000.000	62,000.000
		DIGITAL REALTY 8.5% A	2,000.000	33,500.000
		DIGITAL REALTY 7.875% B	4,000.000	66,000.000
		CORP OFFICE PROPS J	4,000.000	72,800.000

	PUBLIC STORAGE INC D	7,835.000	141,421.750	
	BIOMED REALTY 7.375 A	4,800.000	70,080.000	
	WEINGARTEN RLTY F	4,670.000	70,517.000	
	LEXINGTON REALTY D	3,000.000	30,330.000	
	アメリカ・ドル 小計	41,305.000	アメリカ・ドル 684,898.750 (61,284,740)	
投資証券 合計			61,284,740 [61,284,740]	
合計			747,428,814 [747,428,814]	

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 62銘柄 ハイブリッド 48銘柄 優先証券 投資証券 9銘柄	71.3%	26.3%	2.4%	93.7%
カナダ・ドル	株式 9銘柄	100%	-%	-%	6.3%

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（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成20年1月10日現在 金 額（円）	平成21年1月13日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	354,193,869	144,058,421
コール・ローン	109,561,783	73,561,955
株式	4,969,097,443	2,658,926,624
未収配当金	2,835,154	5,267,248
流動資産合計	5,435,688,249	2,881,814,248
資産合計	5,435,688,249	2,881,814,248
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,000,000	—
流動負債合計	14,000,000	—
負債合計	14,000,000	—
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	4,040,153,309	4,408,360,169
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	1,381,534,940	△1,526,545,921
元本等合計	5,421,688,249	2,881,814,248
純資産合計	5,421,688,249	2,881,814,248
負債純資産合計	5,435,688,249	2,881,814,248

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19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,295,454,607円	4,040,153,309円
同期中における追加設定元本額	3,265,105,904円	437,743,696円
同期中における一部解約元本額	520,407,202円	69,536,836円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	11,572,057円	13,186,120円
ダイワ・グローバル好配当株ファンド（毎月分配型）	454,564,435円	477,062,089円

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	132,808,348円	180,077,738円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	169,001,408円	218,912,311円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	2,504,253,129円	2,494,676,298円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	3,228,603円	5,422,956円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	3,757,079円	5,119,884円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	40,036,109円	46,748,940円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	282,852,740円	366,847,398円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	396,371,881円	526,686,252円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	5,726,894円	13,495,030円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	18,199,376円	30,656,212円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	17,781,250円	29,468,941円
計	4,040,153,309円	4,408,360,169円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	4,040,153,309口	4,408,360,169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1,526,545,921円であります。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年1月10日現在		平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	4,969,097,443	△641,037,801	2,658,926,624	△180,674,899
合計	4,969,097,443	△641,037,801	2,658,926,624	△180,674,899

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年10月16日から平成20年1月10日まで、及び平成20年10月16日から平成21年1月13日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	同左

3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3420円 (13,420円)	0.6537円 (6,537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	117,421	5.090	597,672.890	
	REXAM PLC	61,759	3.445	212,759.750	
	AVIVA PLC	55,530	4.355	241,833.150	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	42,639	13.050	556,438.950	
	RIO TINTO PLC-REG	10,963	16.070	176,175.410	
	VODAFONE GROUP PLC	566,348	1.383	783,259.280	
	NATIONAL GRID PLC	112,847	6.740	760,588.780	
	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	28,597	18.440	527,328.680	
	HSBC HOLDINGS PLC	52,661	6.387	336,345.800	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	53,712	17.730	952,313.760	
イギリス・ポンド 小計		株 1,102,477		イギリス・ポンド 5,144,716.450 (680,234,409)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	8,276	166.100	1,374,643.600	

	NESTLE SA-REGISTERED	34,634	40.380	1,398,520.920	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	22,670	29.600	671,032.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	20,245	53.500	1,083,107.500	
スイス・フラン 小計		株 85,825		スイス・フラン 4,527,304.020 (362,682,325)	
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	
	VOLVO AB-B SHS	59,297	39.500	2,342,231.500	
	NORDEA AB	91,642	56.800	5,205,265.600	
	SKANSKA AB-B	24,807	72.500	1,798,507.500	
	TELIASONERA AB	73,173	40.200	2,941,554.600	
	ENIRO AB	118,627	12.900	1,530,288.300	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,325	57.250	1,907,856.250	
スウェーデン・クローナ 小計		株 400,871		スウェーデン・クローナ 15,725,703.750 (174,398,054)	
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	
	STATOILHYDRO ASA	14,626	117.000	1,711,242.000	
ノルウェー・クローネ 小計		株 14,626		ノルウェー・クローネ 1,711,242.000 (21,749,885)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	E.ON AG	26,228	27.750	727,827.000	
	BASF SE	15,108	25.570	386,311.560	
	ALLIANZ SE-REG	7,153	73.000	522,169.000	
	MUNCHENER RUECK AG-REG	4,222	115.720	488,569.840	
	DAIMLER AG	10,031	26.930	270,134.830	
	DEUTSCHE POST AG	32,700	10.360	338,772.000	
	REED ELSEVIER NV	66,335	8.870	588,391.450	
	AKZO NOBEL	13,242	31.010	410,634.420	
	TOTAL SA	25,959	39.485	1,024,991.110	
	BNP PARIBAS	19,036	34.160	650,269.760	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	6,126	12.525	76,728.150	
	VIVENDI SA	29,771	21.470	639,183.370	
	SOCIETE GENERALE-A	5,603	36.285	203,304.850	
	AXA	23,717	15.250	361,684.250	
	GDF SUEZ	17,684	32.750	579,151.000	
	BELGACOM SA	11,622	27.085	314,781.870	
	INTESA SANPAOLO-RNC	163,779	1.973	323,135.960	
	ENI SPA	48,361	17.120	827,940.320	
	TELEFONICA S.A.	61,200	15.850	970,020.000	
	BANCO BILIBAO VIZCAYA	49,884	8.360	417,030.240	
	BANCO SANTANDER SA	43,574	6.840	298,046.160	
	FORTUM OYJ	20,758	16.400	340,431.200	
	OESTERREICHISCHE POST	26,837	23.700	636,036.900	
	SONAE SGPS SA	302,811	0.505	152,919.550	
	OPAP SA	16,262	21.900	356,137.800	
ユーロ 小計		株 1,048,003		ユーロ 11,904,602.590 (1,419,861,951)	
合計		株 2,651,802		2,658,926,624 [2,658,926,624]	

(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 10銘柄	100%	25.6%
スイス・フラン	株式 4銘柄	100%	13.6%
スウェーデン・クローナ	株式 6銘柄	100%	6.6%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	100%	0.8%
ユーロ	株式 25銘柄	100%	53.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」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20年1月10日現在 金 額（円）	平成21年1月13日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	40,942,784	89,676,227
コール・ローン	75,793,484	36,001,746
株式	5,598,395,450	2,531,088,249
未収入金	24,519,878	—
未収配当金	6,070,506	1,008,168
流動資産合計	5,745,722,102	2,657,774,390
資産合計	5,745,722,102	2,657,774,390
負債の部		
流動負債		
未払金	22,651,361	—
未払解約金	10,000,000	—
流動負債合計	32,651,361	—
負債合計	32,651,361	—
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	3,440,020,148	3,851,385,922
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	2,273,050,593	△1,193,611,532
元本等合計	5,713,070,741	2,657,774,390
純資産合計	5,713,070,741	2,657,774,390
負債純資産合計	5,745,722,102	2,657,774,390

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19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,363,871,449円	3,440,020,148円
同期中における追加設定元本額	2,678,025,775円	521,751,689円
同期中における一部解約元本額	601,877,076円	110,385,915円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	9,713,368円	12,691,778円
ダイワ・グローバル好配当株ファンド（毎月分配型）	402,327,977円	445,225,158円

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	110,207,623円	167,829,038円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	139,921,195円	202,408,731円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	2,164,975,414円	2,151,436,696円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	2,552,400円	5,007,486円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	3,049,728円	4,811,108円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	32,736,568円	43,810,144円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	234,153,342円	338,792,646円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	335,470,884円	470,581,089円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	673,292円	1,608,794円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	2,164,391円	3,658,836円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	2,073,966円	3,524,418円
計	3,440,020,148円	3,851,385,922円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	3,440,020,148口	3,851,385,922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1,193,611,532円であります。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年1月10日現在		平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	5,598,395,450	△516,551,646	2,531,088,249	△304,415,962
合計	5,598,395,450	△516,551,646	2,531,088,249	△304,415,962

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年10月16日から平成20年1月10日まで、及び平成20年10月16日から平成21年1月13日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	同左

3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6608円 (16,608円)	0.6901円 (6,901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	84,000	30.830	2,589,720.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	20,000	35.700	714,000.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	40,000	20.640	825,600.000	
	WESTPAC BANKING	74,000	16.440	1,216,560.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	55,000	15.080	829,400.000	
	RIO TINTO LTD	14,000	41.300	578,200.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	43,000	28.320	1,217,760.000	
	ORICA LIMITED	10,000	14.700	147,000.000	
	QBE INSURANCE	90,000	25.740	2,316,600.000	
	WOOLWORTHS	60,000	26.300	1,578,000.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	65,000	9.460	614,900.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	42,000	7.040	295,680.000	
	TELSTRA CORPORATION	270,000	3.650	985,500.000	
	AMP LIMITED	105,000	5.480	575,400.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	16,000	30.720	491,520.000	

	SUNCORP-METWAY LIMITED	20,000	8.730	174,600.000	
	ASX LTD	10,000	31.930	319,300.000	
オーストラリア・ドル 小計		株 1,018,000		オーストラリア・ドル 15,469,740.000 (938,703,823)	
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	80,000	12.560	1,004,800.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	32,670	11.340	370,477.800	
	FRASER & NEAVE LTD	160,000	3.140	502,400.000	
	KEPPEL CORP	60,000	4.480	268,800.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	40,000	3.020	120,800.000	
	O.C.B.C.	140,000	5.150	721,000.000	
	SINGAPORE TELECOM	250,000	2.550	637,500.000	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	40,000	2.460	98,400.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	90,000	5.200	468,000.000	
	SMRT CORPORATION LTD	100,000	1.630	163,000.000	
	SIA ENGINEERING CO LTD	40,000	2.070	82,800.000	
シンガポール・ドル 小計		株 1,032,670		シンガポール・ドル 4,437,977.800 (266,323,048)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,300	165,500.000	380,650,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	7,000	45,150.000	316,050,000.000	
	POSCO	1,700	383,000.000	651,100,000.000	
	GS ENGINEERING&CONSTRUCT	6,000	59,300.000	355,800,000.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,700	208,000.000	353,600,000.000	
	S-OIL CORPORATION	4,000	59,500.000	238,000,000.000	
	KT CORP	12,000	40,300.000	483,600,000.000	
	KT&G CORP	9,000	80,900.000	728,100,000.000	
	KANGWON LAND INC	20,000	12,850.000	257,000,000.000	
	KOREA GAS CORPORATION	7,000	54,300.000	380,100,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP	22,000	29,600.000	651,200,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS	2,600	489,500.000	1,272,700,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	3,000	204,500.000	613,500,000.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	7,000	62,800.000	439,600,000.000	
韓国・ウォン 小計		株 105,300		韓国・ウォン 7,121,000,000.000 (464,289,200)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	HOPEWELL HOLDINGS	110,000	24.600	2,706,000.000	
	CHEUNG KONG	40,000	75.000	3,000,000.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	65,000	52.400	3,406,000.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	80,000	41.900	3,352,000.000	
	HANG SENG BANK	30,000	100.400	3,012,000.000	
	HONG KONG EX & CL	50,000	74.750	3,737,500.000	
	LI & FUNG LTD	75,000	13.300	997,500.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	90,000	17.300	1,557,000.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	70,000	27.900	1,953,000.000	
	PETROCHINA CO LTD	420,000	6.680	2,805,600.000	
	CHINA MOBILE LTD	33,000	73.500	2,425,500.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-H	400,000	3.460	1,384,000.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	120,000	8.810	1,057,200.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	35,000	43.050	1,506,750.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	180,000	22.750	4,095,000.000	
香港・ドル 小計		株		香港・ドル	

		1,798,000		36,995,050.000 (426,922,878)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	ASIA CEMENT CORP	264,800	26.950	7,136,360.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	100,000	40.050	4,005,000.000	
	CHINA STEEL CORP	345,900	23.650	8,180,535.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	319,390	63.500	20,281,265.000	
	ACER INC	200,000	40.700	8,140,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	309,720	30.000	9,291,600.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	440,636	51.600	22,736,817.600	
	MEDIATEK INC	45,000	251.000	11,295,000.000	
	U-MING MARINE TRANSPORT	23,000	43.150	992,450.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING	520,000	20.650	10,738,000.000	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING	427,097	33.950	14,499,943.150	
	POU CHEN	274,997	14.950	4,111,205.150	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	660,000	41.650	27,489,000.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE COR	75,000	77.000	5,775,000.000	
	FAR EASTERN TEXTILE	307,570	22.700	6,981,839.000	
台湾・ドル 小計		株 4,313,110		台湾・ドル 161,654,014.900 (434,849,300)	
合計		株 8,267,080		2,531,088,249 [2,531,088,249]	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
オーストラリア・ドル	株式 17銘柄	100%	37.1%
シンガポール・ドル	株式 11銘柄	100%	10.5%
韓国・ウォン	株式 14銘柄	100%	18.3%
香港・ドル	株式 15銘柄	100%	16.9%
台湾・ドル	株式 15銘柄	100%	17.2%

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（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[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20年1月10日現在 金 額（円）	平成21年1月13日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,746,891,977	1,065,493,339
株式	36,316,662,300	24,600,152,700
投資証券	1,596,503,000	703,310,800
未収入金	389,297,430	395,051,554
未収配当金	93,740,184	56,289,200
前払金	143,559,000	—
差入委託証拠金	70,200,000	—
流動資産合計	42,356,853,891	26,820,297,593
資産合計	42,356,853,891	26,820,297,593
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	167,203,216	—
未払金	348,554,836	433,527,477
未払解約金	47,000,000	120,000,000
流動負債合計	562,758,052	553,527,477
負債合計	562,758,052	553,527,477
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	30,340,958,529	29,530,987,622
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	11,453,137,310	△3,264,217,506
元本等合計	41,794,095,839	26,266,770,116
純資産合計	41,794,095,839	26,266,770,116
負債純資産合計	42,356,853,891	26,820,297,593

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19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券	(1)株式 同左 (2)投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	同左
2. デリバティブ等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。	先物取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 （会計方針の変更） 従来、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、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上していましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成19年7月1日以降計上する受取配当金については、原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,028,963,122円	30,340,958,529円
同期中における追加設定元本額	17,934,399,983円	3,070,821,150円
同期中における一部解約元本額	8,622,404,576円	3,880,792,057円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	31,716,210円	31,860,623円
ダイワ好配当日本株投信Q（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,438,730,274円	1,855,888,601円
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	18,441,982,565円	17,702,028,602円

ダイワ・バランス2資産（外債・好配当日本株）（毎月分配型）	39,385,769円	45,629,465円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	208,364,637円	173,306,212円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	382,315,724円	423,326,728円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	478,765,388円	515,915,413円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,117,988,619円	6,420,135,604円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	8,623,374円	12,633,418円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	12,018,038円	12,018,050円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	112,614,517円	118,848,482円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	810,626,776円	854,344,623円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	1,149,830,404円	1,206,304,652円
ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）	385,530円	1,108,641円
ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）	89,217円	74,202円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	14,399,374円	29,504,459円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	47,438,595円	65,890,912円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	45,683,518円	62,168,935円
計	30,340,958,529円	29,530,987,622円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	30,340,958,529口	29,530,987,622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3,264,217,506円であります。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年1月10日現在		平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	36,316,662,300	△9,121,500,053	24,600,152,700	△1,614,297,652
投資証券	1,596,503,000	△408,699,466	703,310,800	△57,819,674
合計	37,913,165,300	△9,530,199,519	25,303,463,500	△1,672,117,326

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年10月16日から平成20年1月10日まで、及び平成20年10月16日から平成21年1月13日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
-----	------------------------------	------------------------------

1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、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。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

株式関連

種 類	平成20年1月10日 現在				平成21年1月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	1,851,759,000	—	1,684,800,000	△166,959,000	—	—	—	—
合計	1,851,759,000	—	1,684,800,000	△166,959,000	—	—	—	—

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

（1口当たり情報）

	平成20年1月10日現在	平成21年1月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3775円 (13,775円)	0.8895円 (8,895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	
ホクト	53,600	2,665	142,844,000	
コムシスホールディングス	186,000	780	145,080,000	
田辺工業	130,600	625	81,625,000	
東鉄工業	284,000	560	159,040,000	
N I P P Oコーポレーション	220,000	666	146,520,000	
ライト工業	150,000	161	24,150,000	
積水ハウス	150,000	751	112,650,000	
西部電気工業	65,000	405	26,325,000	
高田工業所	141,000	414	58,374,000	
明星工業	188,000	223	41,924,000	
高橋カーテンウォール	203,000	125	25,375,000	
日本製粉	257,000	458	117,706,000	
プリマハム	489,000	166	81,174,000	
K G情報	51,000	245	12,495,000	
ローソン	105,900	4,780	506,202,000	
キリン堂	68,900	469	32,314,100	
三井情報	2,756	15,300	42,166,800	
タビオ	73,400	1,100	80,740,000	
フィールズ	588	133,500	78,498,000	
コメ兵	176,600	282	49,801,200	
セリア	894	56,500	50,511,000	
サッポロドラッグストアー	154	133,000	20,482,000	
フジフーズ	446,000	330	147,180,000	
ココカラファイン HD	16,300	1,349	21,988,700	
日東紡績	434,000	184	79,856,000	
サイボー	56,900	400	22,760,000	
S R Aホールディングス	41,700	592	24,686,400	
J S C	164,900	595	98,115,500	
日本製紙G本社	85,200	2,890	246,228,000	
日本曹達	698,000	312	217,776,000	
日本ピグメント	438,000	189	82,782,000	
三菱瓦斯化学	120,000	367	44,040,000	
宇部興産	590,000	223	131,570,000	
プロトコーポレーション	62,500	1,865	116,562,500	
東邦システムサイエンス	331,700	540	179,118,000	
花 王	104,000	2,595	269,880,000	
武田薬品	132,000	4,400	580,800,000	
エーザイ	150,000	3,430	514,500,000	
第一三共	226,800	1,971	447,022,800	
ラウンドワン	132,000	671	88,572,000	
トレンドマイクロ	38,000	2,615	99,370,000	
インフォメーションディベロ	41,100	515	21,166,500	
日本オラクル	16,000	3,630	58,080,000	
日本ハウズイング	238,000	900	214,200,000	

電通国際情報S	273,500	541	147,963,500
シダックス	108,000	346	37,368,000
コニカミノルタHLDGS	54,000	659	35,586,000
マダム	101,600	2,420	245,872,000
コニシ	19,900	760	15,124,000
新日本石油	315,000	401	126,315,000
昭和シェル石油	283,000	809	228,947,000
新日鉱ホールディングス	315,000	340	107,100,000
住友ゴム	213,000	707	150,591,000
旭硝子	80,000	508	40,640,000
住友大阪セメント	710,000	207	146,970,000
日本ヒューム	580,000	303	175,740,000
ジャパンパイル	241,100	486	117,174,600
中山製鋼所	666,000	219	145,854,000
共英製鋼	59,000	1,651	97,409,000
北越メタル	273,000	157	42,861,000
淀川製鋼所	364,000	391	142,324,000
朝日工業	50	102,800	5,140,000
川金ホールディングス	286,000	280	80,080,000
日亜鋼業	195,000	222	43,290,000
住友鉱山	188,000	906	170,328,000
住友電工	136,000	732	99,552,000
川岸工業	829,000	234	193,986,000
那須電機	406,000	262	106,372,000
住生活グループ	40,600	1,234	50,100,400
岡部	432,300	372	160,815,600
日本発条	325,000	326	105,950,000
阪神内燃機	495,000	303	149,985,000
赤阪鐵工所	109,000	220	23,980,000
小池酸素	94,000	253	23,782,000
オカダアイヨン	383,000	255	97,665,000
シンニッタン	32,600	320	10,432,000
ダイコク電機	181,600	1,408	255,692,800
新晃工業	280,000	211	59,080,000
帝国ピストン	238,700	346	82,590,200
トウアバルブG本社	31,400	2,150	67,510,000
日本精工	220,000	334	73,480,000
中北製作所	117,000	452	52,884,000
東洋電機製造	125,000	266	33,250,000
明電舎	370,000	261	96,570,000
愛知電機	511,000	170	86,870,000
アクセル	694	342,000	237,348,000
日本信号	176,000	589	103,664,000
パナソニック	421,000	1,110	467,310,000
ミツミ電機	178,000	1,365	242,970,000
ホシデン	175,400	1,226	215,040,400
リオン	35,600	435	15,486,000
山武	70,400	1,897	133,548,800
三社電機製作所	232,000	669	155,208,000
原田工業	334,000	115	38,410,000
京セラ	18,500	6,400	118,400,000
ニッチツ	810,000	155	125,550,000
トヨタ自動車	167,000	2,875	480,125,000
エッチ・ケー・エス	30,000	308	9,240,000
ムロコーポレーション	74,300	446	33,137,800

本田技研	184,000	1,938	356,592,000
安永	157,900	425	67,107,500
T B K	70,000	146	10,220,000
豊田合成	37,000	1,117	41,329,000
フジオーゼックス	180,000	261	46,980,000
岡谷鋼機	7,500	879	6,592,500
共信テクノソニック	45,900	398	18,268,200
フジ・コーポレーション	57,000	246	14,022,000
オーエムツーネットワーク	54,600	525	28,665,000
スター精密	55,000	906	49,830,000
理研計器	155,900	585	91,201,500
HOYA	36,000	1,544	55,584,000
キャノン	41,000	2,905	119,105,000
リ コ ー	191,000	1,136	216,976,000
萩原工業	123,900	830	102,837,000
東京リスマチック	36,600	540	19,764,000
桑山	29,100	365	10,621,500
ムトー精工	73,600	453	33,340,800
任 天 堂	11,400	34,250	390,450,000
日本バルカー	152,000	228	34,656,000
伊 藤 忠	407,000	446	181,522,000
フアミリーマート	68,000	3,560	242,080,000
三井物産	667,000	902	601,634,000
住友商事	580,000	760	440,800,000
三菱商事	226,900	1,238	280,902,200
第一実業	130,000	254	33,020,000
佐藤商事	108,600	525	57,015,000
極東貿易	467,000	148	69,116,000
ヤマトインターナショナル	57,000	410	23,370,000
ナガホリ	172,000	145	24,940,000
三信電気	120,900	718	86,806,200
クレディセゾン	178,000	1,118	199,004,000
三菱UFJフィナンシャルG	813,800	526	428,058,800
三井住友フィナンシャルG	122,000	3,730	455,060,000
北越銀行	744,000	191	142,104,000
千葉銀行	130,000	500	65,000,000
ふくおかフィナンシャルG	210,000	338	70,980,000
セブン銀行	1,193	305,000	363,865,000
みずほフィナンシャルG	1,790,000	252	451,080,000
野村ホールディングス	160,000	662	105,920,000
東海東京証券	880,000	211	185,680,000
三井住友海上HD	84,500	2,415	204,067,500
あいおい損害保険	775,000	396	306,900,000
東京海上HD	51,900	2,215	114,958,500
東京建物	295,000	323	95,285,000
京阪神不動産	280,000	386	108,080,000
ゴールドクレスト	72,000	1,882	135,504,000
東日本旅客鉄道	32,000	6,440	206,080,000
サカイ引越センター	104,500	1,960	204,820,000
日本郵船	608,000	532	323,456,000
商船三井	280,000	583	163,240,000
川崎近海汽船	604,000	291	175,764,000
住友倉庫	297,000	415	123,255,000
東陽倉庫	542,000	171	92,682,000
宇徳	261,000	300	78,300,000

日本電信電話	69,000	4,580	316,020,000	
沖縄セルラー電話	225	196,000	44,100,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	5,170	161,900	837,023,000	
関西電力	146,300	2,310	337,953,000	
東北電力	190,500	2,140	407,670,000	
北海道電力	140,000	2,075	290,500,000	
アインファーマシーズ	211,300	1,963	414,781,900	
日本医療事務センター	492,100	380	186,998,000	
光 栄	134,400	885	118,944,000	
K S K	43,500	496	21,576,000	
ワオ・コーポレーション	173,300	265	45,924,500	
コナミ	74,000	1,928	142,672,000	
ベネッセコーポレーション	65,000	3,790	246,350,000	
ステップ	181,000	403	72,943,000	
日立機材	326,000	397	129,422,000	
因幡電機産業	40,800	2,045	83,436,000	
バイテック	104,600	485	50,731,000	
ベ ル ク	53,300	895	47,703,500	
合計	37,435,924		24,600,152,700	

(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	プレミアム投資法人	660	145,200,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	753	393,819,000	
	ジョイントリート投資法人	438	47,566,800	
	クリード・オフィス投資法人	1,750	116,725,000	
投資証券 合計		3,601	703,310,800	
合計		3,601	703,310,800	

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（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

(1) 当ファンドの財務諸表は、「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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成19年1月11日から平成20年1月10日まで）及び第3期計算期間（平成20年1月11日から平成21年1月13日まで）の財務諸表について、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

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

(1) 貸借対照表

	第2期 平成20年1月10日現在 金 額（円）	第3期 平成21年1月13日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,863,783	7,937,489
親投資信託受益証券	395,149,096	359,720,984
流動資産合計	404,012,879	367,658,473
資産合計	404,012,879	367,658,473
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,020,972	462,181
未払受託者報酬	105,641	103,161
未払委託者報酬	2,113,609	2,064,094
その他未払費用	15,762	15,394
流動負債合計	3,255,984	2,644,830
負債合計	3,255,984	2,644,830
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	378,362,583	515,403,058
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	22,394,312	△150,389,415
（分配準備積立金）	3,942,142	3,114,277
元本等合計	400,756,895	365,013,643
純資産合計	400,756,895	365,013,643
負債純資産合計	404,012,879	367,658,473

(2) 損益及び剰余金計算書

	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日 金 額（円）	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日 金 額（円）
営業収益		
受取利息	30,214	37,288
有価証券売買等損益	△50,436,604	△149,178,112
営業収益合計	△50,406,390	△149,140,824
営業費用		

受託者報酬	155,338	208,455
委託者報酬 ※1	3,108,200	4,170,736
その他費用	23,134	31,098
営業費用合計	3,286,672	4,410,289
営業損失（△）	△53,693,062	△153,551,113
経常損失（△）	△53,693,062	△153,551,113
当期純損失（△）	△53,693,062	△153,551,113
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△2,319,225	△10,841,757
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,320,092	22,394,312
剰余金増加額又は欠損金減少額	82,908,860	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	82,908,860	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,460,803	30,074,371
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,460,803	4,311,924
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	25,762,447
分配金 ※2	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	22,394,312	△150,389,415

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13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。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	—————	計算期間末日の取扱い 平成21年1月10日、その翌日及びその翌々日が休日のため、当計算期間末日を平成21年1月13日としております。このため、当計算期間は369日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期 平成20年1月10日現在	第3期 平成21年1月13日現在
1. ※1 期首元本額	83,923,595円	378,362,583円
期中追加設定元本額	404,876,993円	236,216,763円
期中一部解約元本額	110,438,005円	99,176,288円
2. 計算期間末日における受益権の総数	378,362,583口	515,403,058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150,389,415円であります。
-------------	-------	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13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	447,371円	610,989円
2. ※2 分配金の計算過程	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（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（26,257,437円）及び分配準備積立金（3,942,142円）より分配対象額は30,199,579円（1万口当たり798.17円）であります。が、分配を行っておりません。	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（0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（38,023,707円）及び分配準備積立金（3,114,277円）より分配対象額は41,137,984円（1万口当たり798.17円）であります。が、分配を行っておりません。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第2期 平成20年1月10日現在		第3期 平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	395,149,096	△50,068,181	359,720,984	△146,248,587
合計	395,149,096	△50,068,181	359,720,984	△146,248,587

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

	第2期 平成20年1月10日現在	第3期 平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0592円 (10,592円)	0.7082円 (7,082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	外国債券インデックスマザーファンド	33,773,081	58,961,044	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	58,195,515	61,867,651	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	108,969,587	58,364,110	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	84,101,313	61,343,497	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	55,030,823	38,009,789	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	30,656,212	20,039,965	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	3,658,836	2,524,962	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	65,890,912	58,609,966	
親投資信託受益証券 合計		440,276,279	359,720,984	
合計		440,276,279	359,720,984	

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

なお、同ファンドの状況は前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

[次へ](#)

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

(1) 当ファンドの財務諸表は、「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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成19年1月11日から平成20年1月10日まで）及び第3期計算期間（平成20年1月11日から平成21年1月13日まで）の財務諸表について、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

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

(1) 貸借対照表

	第2期 平成20年1月10日現在 金 額 (円)	第3期 平成21年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,045,253	5,027,391
親投資信託受益証券	251,399,974	224,839,750
流動資産合計	257,445,227	229,867,141
資産合計	257,445,227	229,867,141
負債の部		
流動負債		
未払解約金	585,573	—
未払受託者報酬	64,480	63,663
未払委託者報酬	1,484,304	1,465,305
その他未払費用	9,589	9,457
流動負債合計	2,143,946	1,538,425
負債合計	2,143,946	1,538,425
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	245,142,967	366,839,836
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	10,158,314	△138,511,120
（分配準備積立金）	900,347	742,945
元本等合計	255,301,281	228,328,716
純資産合計	255,301,281	228,328,716
負債純資産合計	257,445,227	229,867,141

(2) 損益及び剰余金計算書

	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日 金 額 (円)	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日 金 額 (円)
営業収益		
受取利息	15,807	23,485
有価証券売買等損益	△46,687,681	△116,930,224
営業収益合計	△46,671,874	△116,906,739
営業費用		

受託者報酬	82,002	131,650
委託者報酬 ※1	1,888,373	3,030,043
その他費用	12,130	19,578
営業費用合計	1,982,505	3,181,271
営業損失（△）	△48,654,379	△120,088,010
経常損失（△）	△48,654,379	△120,088,010
当期純損失（△）	△48,654,379	△120,088,010
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△2,335,540	△7,716,183
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,874,969	10,158,314
剰余金増加額又は欠損金減少額	61,769,172	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	61,769,172	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,166,988	36,297,607
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,166,988	924,605
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	35,373,002
分配金 ※2	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,158,314	△138,511,120

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13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。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	—————	計算期間末日の取扱い 平成21年1月10日、その翌日及びその翌々日が休日のため、当計算期間末日を平成21年1月13日としております。このため、当計算期間は369日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期 平成20年1月10日現在	第3期 平成21年1月13日現在
1. ※1 期首元本額	16,439,632円	245,142,967円
期中追加設定元本額	261,518,674円	176,277,629円
期中一部解約元本額	32,815,339円	54,580,760円
2. 計算期間末日における受益権の総数	245,142,967口	366,839,836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138,511,120円であります。
-------------	-------	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13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	320,188円	525,390円
2. ※2 分配金の計算過程	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（0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（17,492,948円）及び分配準備積立金（900,347円）より分配対象額は18,393,295円（1万口当たり750.31円）であります。が、分配を行っておりません。	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（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（26,781,617円）及び分配準備積立金（742,945円）より分配対象額は27,524,562円（1万口当たり750.32円）であります。が、分配を行っておりません。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第2期 平成20年1月10日現在		第3期 平成21年1月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	251,399,974	△46,032,728	224,839,750	△113,385,222
合計	251,399,974	△46,032,728	224,839,750	△113,385,222

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日	第3期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

	第2期 平成20年1月10日現在	第3期 平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0414円 (10,414円)	0.6224円 (6,224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	外国債券インデックスマザーファンド	6,002,073	10,478,419	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	10,775,773	11,455,724	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	83,891,141	44,932,095	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	62,134,262	45,320,730	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	51,625,119	35,657,469	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	29,468,941	19,263,846	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	3,524,418	2,432,200	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	62,168,935	55,299,267	
親投資信託受益証券 合計		309,590,662	224,839,750	
合計		309,590,662	224,839,750	

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

なお、同ファンドの状況は前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

ＤＣダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)

【純資産額計算書】

平成21年2月27日

I 資産総額	285,242,949円
II 負債総額	356,447円
III 純資産総額（I－II）	284,886,502円
IV 発行済数量	383,778,159口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.7423円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成21年2月27日

I 資産総額	84,076,827,860円
II 負債総額	1,205,811,391円
III 純資産総額（I－II）	82,871,016,469円
IV 発行済数量	45,494,392,677口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.8216円

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

平成21年2月27日

I 資産総額	10,151,485,602円
II 負債総額	419,278,000円
III 純資産総額（I－II）	9,732,207,602円
IV 発行済数量	9,164,464,106口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.0620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21年2月27日

I 資産総額	57,130,101,356円
II 負債総額	175,657,012円
III 純資産総額（I－II）	56,954,444,344円
IV 発行済数量	124,426,189,323口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.4577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21年2月27日

I 資産総額	13,556,053,064円
II 負債総額	0円
III 純資産総額（I－II）	13,556,053,064円
IV 発行済数量	19,846,446,753口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.6830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21年2月27日

I 資産総額	2,969,923,259円
II 負債総額	45,261,304円
III 純資産総額（I－II）	2,924,661,955円
IV 発行済数量	4,501,938,279口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.6496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21年2月27日

I 資産総額	2,760,763,282円
II 負債総額	46,177,588円
III 純資産総額（I－II）	2,714,585,694円
IV 発行済数量	4,541,762,817口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.5977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21年2月27日

I 資産総額	2,707,394,323円
II 負債総額	16,819,103円
III 純資産総額（I－II）	2,690,575,220円
IV 発行済数量	3,988,789,743口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.6745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21年2月27日

I 資産総額	25,142,375,293円
II 負債総額	475,883,007円
III 純資産総額（I－II）	24,666,492,286円
IV 発行済数量	29,409,165,322口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.8387円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／6分散コース)

純資産額計算書

平成21年2月27日

I 資産総額	366,844,951円
II 負債総額	732,931円
III 純資産総額（I－II）	366,112,020円
IV 発行済数量	542,676,508口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.6746円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（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「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／成長コース)

純資産額計算書

平成21年2月27日

I 資産総額	225,353,247円
II 負債総額	529,791円
III 純資産総額（I－II）	224,823,456円
IV 発行済数量	388,450,135口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.5788円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（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「ＤＣダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)」の記載と同じ。

第5 【設定及び解約の実績】**DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)**

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	12,039,908	15,785
第2計算期間	200,738,676	19,244,677
第3計算期間	191,806,441	33,745,836

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／6分散コース)

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	92,145,316	9,221,721
第2計算期間	404,876,993	110,438,005
第3計算期間	236,216,763	99,176,288

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／成長コース)

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	16,760,292	1,320,660
第2計算期間	261,518,674	32,815,339
第3計算期間	176,277,629	54,580,760

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

第三部 【特別情報】

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21年2月末日現在、資本金の額は151億7,427万2,500円です。なお、発行可能株式総数は799万9,980株であり、260万8,525株を発行済みです。

b. 委託会社の機構

① 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。

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

けて、必要事項を審議・決定します。

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに「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っています。

平成21年2月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（公募）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	13	43,746
追加型株式投資信託	258	4,370,441
株式投資信託 合計	271	4,414,187
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,984,901
公社債投資信託 合計	17	2,984,901
総合計	288	7,399,088

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第48期（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）については、改正前の「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、「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）に基づいて作成しており、第49期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

2. 当社は、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第48期事業年度（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）の財務諸表について、並びに、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第50期事業年度に係る中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）の中間財務諸表について、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】

		第48期 (平成19年3月31日現在)		第49期 (平成20年3月31日現在)	
区分	注記 番号	金額（千円）	構成比 (%)	金額（千円）	構成比 (%)
(資産の部)					
流動資産					
現金		797		915	
預金		3,286,544		3,397,966	
有価証券		29,144,223		32,206,041	
支払委託金		2,039,370		—	
収益分配金		757,956		—	
償還金		1,281,413		—	
前払金		30		3,357	
前払費用		79,358		96,205	
未収入金		38,983		75,494	
未収委託者報酬		9,621,508		8,899,037	
未収収益		56,871		136,888	
貯蔵品		146,207		83,453	
繰延税金資産		731,054		779,955	
デリバティブ資産		—		1,172,830	
その他	※1	11,654		30,104	
流動資産計		45,156,603	76.3	46,882,252	79.0
固定資産					
有形固定資産	※2	1,824,086	3.1	1,618,595	2.7
建物		499,267		388,414	

器具備品		907,818			1,229,446		
土地		417,000			—		
建設仮勘定		—			735		
無形固定資産	※ 3		1,404,601	2.4		1,989,254	3.3
ソフトウェア		1,191,767			1,976,209		
電話加入権		11,850			11,850		
その他		200,983			1,194		
投資その他の資産			10,795,565	18.2		8,890,810	15.0
投資有価証券		9,007,705			7,690,544		
関係会社株式		737,012			737,012		
出資金		226,126			166,719		
従業員長期貸付金		189,497			176,298		
長期差入保証金		627,430			633,855		
長期前払費用		10,287			10,039		
投資不動産	※ 2	—			593,270		
その他		506			43		
貸倒引当金	※ 6	△3,000			△1,116,972		
固定資産計			14,024,253	23.7		12,498,661	21.0
資産合計			59,180,856	100.0		59,380,914	100.0
(負債の部)							
流動負債							
預り金			43,592			50,693	
未払金	※ 4		11,692,067			10,302,751	
未払収益分配金		777,951			27,011		
未払償還金		1,761,987			332,721		
未払手数料		5,424,512			4,943,985		
その他未払金		3,727,616			4,999,033		
未払費用			2,393,500			2,177,782	
未払法人税等	※ 5		1,512,583			1,402,832	
未払消費税等			538,138			425,013	
前受金			348			329	
前受収益			66,100			39,700	
賞与引当金			838,700			480,300	
その他			—			21,767	
流動負債計			17,085,031	28.9		14,901,170	25.1
固定負債							
退職給付引当金			858,904			988,898	
役員退職慰労引当金			78,307			46,260	
繰延税金負債			1,915,808			2,300,289	
固定負債計			2,853,020	4.8		3,335,448	5.6
負債合計			19,938,052	33.7		18,236,618	30.7
(純資産の部)							
株主資本							
資本金			15,174,272	25.7		15,174,272	25.6
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	19.4		11,495,727	19.4
利益剰余金							
利益準備金		374,297			374,297		
その他利益剰余金							
特別償却準備金		2,261			—		

別途積立金		2,800,000			2,800,000		
繰越利益剰余金		8,834,028			11,702,152		
利益剰余金合計			12,010,588	20.3		14,876,450	25.0
株主資本合計			38,680,588	65.4		41,546,450	70.0
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金			562,216	0.9		△402,154	△0.7
評価・換算差額等合計			562,216	0.9		△402,154	△0.7
純資産合計			39,242,804	66.3		41,144,295	69.3
負債・純資産合計			59,180,856	100.0		59,380,914	100.0

(2) 【損益計算書】

		第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)			第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)		
区分	注記 番号	金額（千円）		百分比 (%)	金額（千円）		百分比 (%)
営業収益							
委託者報酬			58,445,063			82,506,998	
その他営業収益			488,432			572,557	
営業収益計			58,933,495	100.0		83,079,556	100.0
営業費用							
支払手数料			33,691,905			48,784,763	
広告宣伝費			1,415,258			1,542,009	
公告費			10,794			9,189	
受益証券発行費			96,932			41,501	
調査費			2,094,056			4,197,737	
調査費		555,078			672,732		
委託調査費		1,538,978			3,525,004		
委託計算費			472,577			642,326	
営業雑経費			1,583,497			2,103,482	
通信費		226,689			283,069		
印刷費		644,336			918,929		
協会費		32,902			40,717		
諸会費		10,168			10,258		
その他営業雑経費		669,400			850,507		
営業費用計			39,365,023	66.8		57,321,011	69.0
一般管理費							
給料			4,174,588			4,208,378	
役員報酬	※ 1	181,200			185,100		
給料・手当		2,718,896			3,139,424		
賞与		435,791			403,553		
賞与引当金繰入		838,700			480,300		
福利厚生費			471,209			548,953	
交際費			58,204			85,291	
寄付金			1,176			1,796	
旅費交通費			170,180			231,428	
租税公課			306,177			427,247	
不動産賃借料			646,084			666,919	
退職給付費用			272,142			309,416	
役員退職慰労引当金繰入			32,640			33,405	
固定資産減価償却費			406,515			713,538	
諸経費			769,819			1,349,328	
一般管理費計			7,308,737	12.4		8,575,704	10.3
営業利益			12,259,734	20.8		17,182,840	20.7
営業外収益							
受取配当金			482,340			205,108	
有価証券利息			63,198			473,605	
受取利息			4,536			4,674	
時効成立分配金・償還金			351,463			117,919	
有価証券償還益			24,360			226,585	

デリバティブ評価益			—			1,150,268	
その他			29,318			27,266	
営業外収益計			955,218	1.6		2,205,428	2.6
営業外費用							
時効成立後支払分配金・償還金			49,097			58,372	
貯蔵品廃棄損			149,447			161,462	
為替差損			—			1,632,650	
その他			730			41,095	
営業外費用計			199,275	0.3		1,893,580	2.3
経常利益			13,015,678	22.1		17,494,688	21.0
特別利益							
投資有価証券売却益	※ 2		5,512,833			2,241,103	
固定資産売却益	※ 3		624			—	
ゴルフ会員権売却益			—			13,021	
ゴルフ会員権償還益			18,663			—	
その他	※ 4		4,119			—	
特別利益計			5,536,240	9.4		2,254,124	2.7
特別損失							
投資有価証券売却損			249,585			21,921	
固定資産除売却損	※ 5		143,860			44,642	
減損損失	※ 6		2,184,523			—	
貸倒引当金繰入額	※ 7		—			1,113,972	
その他	※ 8		47,357			3,737	
特別損失計			2,625,326	4.5		1,184,273	1.4
税引前当期純利益			15,926,592	27.0		18,564,539	22.3
法人税、住民税及び事業税		5,557,969			6,901,995		
法人税等調整額		1,708,825	7,266,795	12.3	997,192	7,899,187	9.5
当期純利益			8,659,797	14.7		10,665,351	12.8

(3) 【株主資本等変動計算書】

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金	利益剰余金					株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金合計	
				特別償却準備金	別途積立金	繰越利益剰余金		
前期末残高	15, 174, 272	11, 495, 727	374, 297	15, 917	6, 500, 000	4, 124, 184	11, 014, 399	37,684, 399
事業年度中の変動額								
特別償却準備金の取崩し （主）	-	-	-	△6, 827	-	6, 827	-	-
特別償却準備金の取崩し	-	-	-	△6, 827	-	6, 827		
別途積立金 の取崩し（主）	-	-	-	-	△3, 700, 000	3, 700, 000	-	-
剰余金の配当（主）	-	-	-	-	-	△7, 499, 509	△7, 499, 509	△7,499, 509
役員賞与（主）	-	-	-	-	-	△164, 100	△164, 100	△164, 100
当期純利益	-	-	-	-	-	8, 659, 797	8, 659, 797	8,659, 797
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-
事業年度中の変動額合計	-	-	-	△13, 655	△3, 700, 000	4, 709, 844	996, 188	996, 188
事業年度末残高	15, 174, 272	11, 495, 727	374, 297	2, 261	2, 800, 000	8, 834, 028	12, 010, 588	38,680, 588

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
前期末残高	564,295	564,295	38,248,695
事業年度中の変動額			
特別償却準備金の取崩し（主）	-	-	-
特別償却準備金の取崩し	-	-	-
別途積立金の取崩し（主）	-	-	-
剰余金の配当（主）	-	-	△7,499,509
役員賞与（主）	-	-	△164,100
当期純利益	-	-	8,659,797
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）	△2,079	△2,079	△2,079
事業年度中の変動額合計	△2,079	△2,079	994,109
事業年度末残高	562,216	562,216	39,242,804

（主）平成18年6月の定時株主総会における利益処分項目であります。

第49期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							株主資本合計
	資本金	資本剰余金 資本準備金	利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
				その他利益剰余金		繰越利益 剰余金		
				特別償却 準備金	別途積立金			
前事業年度末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	2,261	2,800,000	8,834,028	12,010,588	38,680,588
事業年度中の変動額								
特別償却準備金の取崩し	-	-	-	△2,261	-	2,261	-	-
剰余金の配当	-	-	-	-	-	△7,799,489	△7,799,489	△7,799,489
当期純利益	-	-	-	-	-	10,665,351	10,665,351	10,665,351
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-
事業年度中の変動額合計	-	-	-	△2,261	-	2,868,123	2,865,862	2,865,862
事業年度末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	-	2,800,000	11,702,152	14,876,450	41,546,490

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
前事業年度末残高	562,216	562,216	39,242,804
事業年度中の変動額			
特別償却準備金の取崩し	-	-	-
剰余金の配当	-	-	△7,799,489
当期純利益	-	-	10,665,351
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）	△964,370	△964,370	△964,370
事業年度中の変動額合計	△964,370	△964,370	1,901,491
事業年度末残高	△402,154	△402,154	41,144,295

重要な会計方針

期別	第48期 （自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）	第49期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるものについては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）、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 -----	(1) 子会社及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左 (3) デリバティブ取引 時価法により計上しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

- (1) 有形固定資産
定率法によっております。
なお、主な耐用年数は以下の通りであります。
- | | |
|------|-------|
| 建物 | 7～50年 |
| 器具備品 | 5～10年 |

- (1) 有形固定資産及び投資不動産
定率法によっております。
なお、主な耐用年数は以下の通りであります。
- | | |
|------|-------|
| 建物 | 7～50年 |
| 器具備品 | 5～10年 |
- (会計方針の変更)
法人税法の改正（（所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日 法律第6号）及び（法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号））に伴い、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得したものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。
当該変更に伴う損益に与える影響は、軽微であります。

- (追加情報)
当事業年度より、平成19年3月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方法によっております。
当該変更に伴う損益に与える影響は、軽微であります。

- (2) 無形固定資産
定額法によっております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

- (2) 無形固定資産
同左

- (3) 長期前払費用
定額法によっております。

- (3) 長期前払費用
同左

3. 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
役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

- (1) 貸倒引当金
債権等の貸倒損失に備えるため一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。
- (2) 賞与引当金
同左

4. リース取引の処理方法 5. その他財務諸表作成のための重要な事項	(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期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会計期間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期末要支給額を計上しております。 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。 (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。ただし、固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は投資その他の資産に計上し、5年間で均等償却を行なっております。 (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。	(3) 退職給付引当金 同左 (4) 役員退職慰労引当金 同左 同左 (1) 消費税等の会計処理 同左 (2) 連結納税制度の適用 同左
---	--	---

会計方針の変更

期別	第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
----	---------------------------------------	---------------------------------------

1. 会計処理の変更	(1)貸借対照表の「純資産の部」の表示 当事業年度より「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準第5号 平成17年12月9日）及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（企業会計基準適用指針第8号 平成17年12月9日）を適用しております。 従来の資本の部の合計に相当する金額は、39,242,804千円であります。 なお、当事業年度における貸借対照表の純資産の部については、財務諸表等規則の改正に伴い、改正後の財務諸表等規則により作成しております。 (2)役員賞与の会計処理 当事業年度より「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第4号 平成17年11月29日）を適用しております。 この結果、従来の方法に比べて、営業利益、経常利益、税引前当期純利益がそれぞれ124,400千円減少しております。	----- -----
-------------------	--	---------------------------

注記事項

（貸借対照表関係）

第48期 (平成19年3月31日現在)	第49期 (平成20年3月31日現在)																				
※1 流動資産の「その他」の中には顧客分別金信託に伴う金銭の信託が10,000千円含まれております。 ※2 有形固定資産の減価償却累計額 <table data-bbox="239 1612 638 1702"> <tr> <td>建物</td><td>1,340,367千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>1,994,292千円</td></tr> </table> ※3 無形固定資産の減価償却累計額 <table data-bbox="159 1859 718 1937"> <tr> <td>ソフトウェア</td><td>469,143千円</td></tr> <tr> <td>その他（電話施設利用権）</td><td>5,638千円</td></tr> </table> ※4 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 3,664,317千円	建物	1,340,367千円	器具備品	1,994,292千円	ソフトウェア	469,143千円	その他（電話施設利用権）	5,638千円	※1 流動資産の「その他」の中には顧客分別金信託に伴う金銭の信託が1,000千円含まれております。 ※2 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 <table data-bbox="877 1612 1356 1758"> <tr> <td>建物</td><td>735,161千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>1,604,537千円</td></tr> <tr> <td>投資建物</td><td>662,012千円</td></tr> <tr> <td>投資器具備品</td><td>26,457千円</td></tr> </table> ※3 無形固定資産の減価償却累計額 <table data-bbox="877 1859 1356 1937"> <tr> <td>ソフトウェア</td><td>888,263千円</td></tr> <tr> <td>その他（電話施設利用権）</td><td>5,927千円</td></tr> </table> ※4 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 4,620,908千円	建物	735,161千円	器具備品	1,604,537千円	投資建物	662,012千円	投資器具備品	26,457千円	ソフトウェア	888,263千円	その他（電話施設利用権）	5,927千円
建物	1,340,367千円																				
器具備品	1,994,292千円																				
ソフトウェア	469,143千円																				
その他（電話施設利用権）	5,638千円																				
建物	735,161千円																				
器具備品	1,604,537千円																				
投資建物	662,012千円																				
投資器具備品	26,457千円																				
ソフトウェア	888,263千円																				
その他（電話施設利用権）	5,927千円																				

※ 5 未払法人税等の内訳は次の諸税金の未納付額であります。 <table> <tr> <td>住民税</td><td>641,341千円</td></tr> <tr> <td>事業税</td><td>871,241千円</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>1,512,583千円</td></tr> </table> ----- -----	住民税	641,341千円	事業税	871,241千円	合計	1,512,583千円	※ 5 未払法人税等の内訳は次の諸税金の未納付額であります。 <table> <tr> <td>住民税</td><td>585,947千円</td></tr> <tr> <td>事業税</td><td>816,884千円</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>1,402,832千円</td></tr> </table> ※ 6 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。 7 債務保証 当社は、子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務145,120千円に対して保証を行っております。	住民税	585,947千円	事業税	816,884千円	合計	1,402,832千円
住民税	641,341千円												
事業税	871,241千円												
合計	1,512,583千円												
住民税	585,947千円												
事業税	816,884千円												
合計	1,402,832千円												

（損益計算書関係）

第48期 （自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）	第49期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）																								
※ 1 役員報酬の範囲額 <table> <tr> <td>取締役 月額</td><td>35,000千円</td></tr> <tr> <td>監査役 月額</td><td>6,000千円</td></tr> </table> ※ 2 関係会社との取引 投資有価証券売却益 4,851,726千円 ※ 3 固定資産売却益の内容は次のとおりであります。 <table> <tr> <td>車両</td><td>624千円</td></tr> </table> ※ 4 特別利益の「その他」の主な内訳 ゴルフ会員権貸倒引当金戻入 4,119千円 ※ 5 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 <table> <tr> <td>固定資産売却損</td><td></td></tr> <tr> <td>建物</td><td>106,013千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>155千円</td></tr> <tr> <td>土地</td><td>19,875千円</td></tr> <tr> <td>固定資産除却損</td><td></td></tr> <tr> <td>建物</td><td>425千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>17,390千円</td></tr> </table>	取締役 月額	35,000千円	監査役 月額	6,000千円	車両	624千円	固定資産売却損		建物	106,013千円	器具備品	155千円	土地	19,875千円	固定資産除却損		建物	425千円	器具備品	17,390千円	※ 1 同左 ※ 2 関係会社との取引 投資有価証券売却益 2,067,950千円 ----- ----- ※ 5 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 <table> <tr> <td>固定資産除却損</td><td></td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>44,642千円</td></tr> </table>	固定資産除却損		器具備品	44,642千円
取締役 月額	35,000千円																								
監査役 月額	6,000千円																								
車両	624千円																								
固定資産売却損																									
建物	106,013千円																								
器具備品	155千円																								
土地	19,875千円																								
固定資産除却損																									
建物	425千円																								
器具備品	17,390千円																								
固定資産除却損																									
器具備品	44,642千円																								

※ 6 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所 千葉県浦安市

用途 福利厚生施設（大和投信浦安寮）

種類 建物及び土地

「浦安寮」についての位置付けを大和証券グループの補完的な寮としたことに伴い賃貸資産に区分され、資産区分は従来の「本社」のみのグルーピングから「本社」と「浦安寮」の2つのグルーピングへと変更しました。

「浦安寮」については、市場価格が大幅に下落しており、将来キャッシュフローが帳簿価格を大幅に下回るため、当該減少額を減損損失（2,184,523千円）として特別損失に計上しました。その内訳は、建物136,118千円及び土地2,048,404千円であります。

なお、当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、建物及び土地については不動産鑑定評価額により評価しております。

※ 7 貸倒引当金繰入額に関する注記

保有している外貨建資産担保債券の1銘柄について、清算事象が生じているため、当該銘柄の回収不能見込額を算定し、その見積金額を貸倒引当金として計上しております。

なお、貸倒引当金の計上基準については重要な会計方針に記載しております。

※ 8 特別損失の「その他」の主な内訳

貯蔵品評価損 47,333千円
ゴルフ会員権売却損 24千円

※ 8 特別損失の「その他」の主な内訳

会社清算損 3,069千円
保証金の返還に伴う損失 668千円

（株主資本等変動計算書関係）

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

平成18年6月23日 定時株主総会	普通株式	7,499	2,875	平成18年 3月31日	平成18年 6月23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19年6月22日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

- ①剰余金の配当の総額 7,799百万円
- ②配当の原資 利益剰余金
- ③1株当たり配当額 2,990円
- ④基準日 平成19年3月31日
- ⑤効力発生日 平成19年6月25日

第49期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成19年6月22日 定時株主総会	普通株式	7,799	2,990	平成19年 3月31日	平成19年 6月25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20年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

- ①剰余金の配当の総額 8,555百万円
- ②配当の原資 利益剰余金
- ③1株当たり配当額 3,280円
- ④基準日 平成20年3月31日
- ⑤効力発生日 平成20年6月23日

（リース取引関係）

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
---------------------------------------	---------------------------------------

有価証券報告書（内容）

（借主側）
リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引

①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

	器具備品	ソフトウェア	合計
取得価額相当額（千円）	7,852	—	7,852
減価償却累計額相当額（千円）	6,056	—	6,056
期末残高相当額（千円）	1,796	—	1,796

なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。

②未経過リース料期末残高相当額

1年以内	1,796千円
1年超	—千円
合計	1,796千円

なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。

③支払リース料及び減価償却費相当額

支払リース料	2,395千円
減価償却費相当額	2,395千円

④減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

（借主側）
リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引

①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

該当事項はありません。

②未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

③支払リース料及び減価償却費相当額

支払リース料	1,796千円
減価償却費相当額	1,796千円

④減価償却費相当額の算定方法

同左

（有価証券関係）

1. その他有価証券で時価のあるもの

区分	第48期 (平成19年3月31日現在)			第49期 (平成20年3月31日現在)		
	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額 (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	55,101	218,472	163,370	55,101	73,804	18,702
②債券	150,000	156,075	6,075	50,000	50,105	105
③その他						
証券投資信託の受益証券	3,944,950	4,764,879	819,929	3,110,512	3,238,991	128,479
小計	4,150,051	5,139,426	989,374	3,215,614	3,362,900	147,286
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの						

①債券	—	—	—	13,669,870	11,886,801	△1,783,068
②その他						
証券投資信託の受益証券	1,407,010	1,372,161	△34,848	2,816,910	2,591,485	△225,424
小計	1,407,010	1,372,161	△34,848	16,486,780	14,478,287	△2,008,493
合計	5,557,062	6,511,588	954,525	19,702,395	17,841,188	△1,861,206

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
売却額（千円）	8,446,553	3,892,206
売却益の合計額（千円）	5,512,833	2,241,103
売却損の合計額（千円）	249,585	21,921

3. 時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

区分	第48期 (平成19年3月31日現在)	第49期 (平成20年3月31日現在)
	貸借対照表計上額 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)
子会社株式及び関連会社株式		
子会社株式	737,012	737,012
小計	737,012	737,012
その他有価証券		
非上場株式	2,496,117	1,314,612
外貨建資産担保債券	—	2,504,860
MMF・中期国債ファンド・FFF	29,144,223	18,235,925
小計	31,640,341	22,055,397
合計	32,377,353	22,792,409

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

	1年以内（千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超（千円）
①債券				
社債	—	150,000	—	—
②その他				
証券投資信託の 受益証券	—	1,022,721	1,916,922	505,933
合計	—	1,172,721	1,916,922	505,933

第49期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

	1年以内（千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超（千円）
①債券				
社債	150,000	—	—	—
その他	13,569,000	—	—	—

②その他 証券投資信託の 受益証券	1,023,578	434,463	1,611,490	86,955
合計	14,742,578	434,463	1,611,490	86,955

5. デリバティブ取引関係

(1) 取引の状況に関する事項

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
-----	1. 取引の内容及び利用目的 当社が利用しているデリバティブ取引は為替予約取引であり、当社が保有する外貨建資産担保債券に係る為替変動リスクを軽減するために利用しております。 2. 取引に対する取組方針 為替予約取引については将来の為替変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である外貨建資産担保債券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的ではありません。 3. 取引に係るリスクの内容 為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動による市場リスクを有しております。また、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。 4. 取引に係るリスク管理体制 為替予約取引開始にあたっては、事前に取り締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。 なお、事後体制としまして、財務部長は毎月、為替予約取引の内容を含んだ財務報告を執行役員会議で行っております。また、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理しております。

(2) 取引の時価等に関する事項

区分	種類	第48期 (平成19年3月31日現在)			第49期 (平成20年3月31日現在)		
		契約額等 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)	契約額等 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	為替予約取引	—	—	—	16,334,748	1,150,268	1,150,268

(注) 時価の算定方法は、各通貨のキャッシュ・フローを計算し、現在価値に割り引き邦貨換算した額となっております。

(退職給付関係)

第48期 (平成19年3月31日現在)	第49期 (平成20年3月31日現在)												
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 <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>858,904千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>858,904千円</td></tr> </table> 3. 退職給付費用に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付費用</td><td>272,142千円</td></tr> </table> なお、退職給付費用の中には勤務費用のほか、確定拠出年金への掛金支払額92,983千円が含まれております。	退職給付債務	858,904千円	退職給付引当金	858,904千円	退職給付費用	272,142千円	1. 採用している退職給付制度の概要 同左 2. 退職給付債務に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>988,898千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>988,898千円</td></tr> </table> 3. 退職給付費用に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付費用</td><td>309,416千円</td></tr> </table> なお、退職給付費用の中には勤務費用のほか、確定拠出年金への掛金支払額106,630千円が含まれております。	退職給付債務	988,898千円	退職給付引当金	988,898千円	退職給付費用	309,416千円
退職給付債務	858,904千円												
退職給付引当金	858,904千円												
退職給付費用	272,142千円												
退職給付債務	988,898千円												
退職給付引当金	988,898千円												
退職給付費用	309,416千円												

(税効果会計関係)

第48期 (平成19年3月31日現在)	第49期 (平成20年3月31日現在)																																																																																																		
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 <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td>千円</td></tr> <tr> <td>減損損失否認</td><td>888,882</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>354,508</td></tr> <tr> <td>退職給与引当金繰入限度超過額</td><td>349,488</td></tr> <tr> <td>投資有価証券評価損否認</td><td>345,773</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入限度超過額</td><td>341,267</td></tr> <tr> <td>株式譲渡損繰延</td><td>155,151</td></tr> <tr> <td>出資金評価損否認</td><td>120,830</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>38,093</td></tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td><td>31,863</td></tr> <tr> <td>前受収益</td><td>26,896</td></tr> <tr> <td>社会保険料否認</td><td>22,249</td></tr> <tr> <td>貯蔵品評価損否認</td><td>19,259</td></tr> <tr> <td>ソフトウェア開発費否認</td><td>11,524</td></tr> <tr> <td>一括償却資産</td><td>7,700</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>20,899</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>2,734,388</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△1,542,565</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>1,191,823</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td>株式譲渡益</td><td>△1,986,751</td></tr> <tr> <td>有価証券評価差額</td><td>△385,711</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>△4,113</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>△2,376,577</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債の純額</td><td>1,184,754</td></tr> </table>	繰延税金資産	千円	減損損失否認	888,882	未払事業税	354,508	退職給与引当金繰入限度超過額	349,488	投資有価証券評価損否認	345,773	賞与引当金繰入限度超過額	341,267	株式譲渡損繰延	155,151	出資金評価損否認	120,830	器具備品	38,093	役員退職慰労引当金	31,863	前受収益	26,896	社会保険料否認	22,249	貯蔵品評価損否認	19,259	ソフトウェア開発費否認	11,524	一括償却資産	7,700	その他	20,899	繰延税金資産小計	2,734,388	評価性引当額	△1,542,565	繰延税金資産合計	1,191,823	繰延税金負債		株式譲渡益	△1,986,751	有価証券評価差額	△385,711	その他	△4,113	繰延税金負債合計	△2,376,577	繰延税金負債の純額	1,184,754	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 <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td>千円</td></tr> <tr> <td>減損損失否認</td><td>887,301</td></tr> <tr> <td>貸倒引当金否認</td><td>454,496</td></tr> <tr> <td>退職給与引当金繰入限度超過額</td><td>402,382</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>332,390</td></tr> <tr> <td>株式譲渡損繰延</td><td>287,965</td></tr> <tr> <td>有価証券評価差額</td><td>275,900</td></tr> <tr> <td>投資有価証券評価損否認</td><td>214,784</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入限度超過額</td><td>168,660</td></tr> <tr> <td>出資金評価損否認</td><td>118,268</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>38,093</td></tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td><td>18,823</td></tr> <tr> <td>社会保険料否認</td><td>18,208</td></tr> <tr> <td>前受収益</td><td>16,153</td></tr> <tr> <td>一括償却資産</td><td>10,048</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>23,392</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>3,266,871</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△1,947,529</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>1,319,341</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td>株式譲渡益</td><td>△2,837,113</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>△2,562</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>△2,839,675</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債の純額</td><td>1,520,333</td></tr> </table>	繰延税金資産	千円	減損損失否認	887,301	貸倒引当金否認	454,496	退職給与引当金繰入限度超過額	402,382	未払事業税	332,390	株式譲渡損繰延	287,965	有価証券評価差額	275,900	投資有価証券評価損否認	214,784	賞与引当金繰入限度超過額	168,660	出資金評価損否認	118,268	器具備品	38,093	役員退職慰労引当金	18,823	社会保険料否認	18,208	前受収益	16,153	一括償却資産	10,048	その他	23,392	繰延税金資産小計	3,266,871	評価性引当額	△1,947,529	繰延税金資産合計	1,319,341	繰延税金負債		株式譲渡益	△2,837,113	その他	△2,562	繰延税金負債合計	△2,839,675	繰延税金負債の純額	1,520,333
繰延税金資産	千円																																																																																																		
減損損失否認	888,882																																																																																																		
未払事業税	354,508																																																																																																		
退職給与引当金繰入限度超過額	349,488																																																																																																		
投資有価証券評価損否認	345,773																																																																																																		
賞与引当金繰入限度超過額	341,267																																																																																																		
株式譲渡損繰延	155,151																																																																																																		
出資金評価損否認	120,830																																																																																																		
器具備品	38,093																																																																																																		
役員退職慰労引当金	31,863																																																																																																		
前受収益	26,896																																																																																																		
社会保険料否認	22,249																																																																																																		
貯蔵品評価損否認	19,259																																																																																																		
ソフトウェア開発費否認	11,524																																																																																																		
一括償却資産	7,700																																																																																																		
その他	20,899																																																																																																		
繰延税金資産小計	2,734,388																																																																																																		
評価性引当額	△1,542,565																																																																																																		
繰延税金資産合計	1,191,823																																																																																																		
繰延税金負債																																																																																																			
株式譲渡益	△1,986,751																																																																																																		
有価証券評価差額	△385,711																																																																																																		
その他	△4,113																																																																																																		
繰延税金負債合計	△2,376,577																																																																																																		
繰延税金負債の純額	1,184,754																																																																																																		
繰延税金資産	千円																																																																																																		
減損損失否認	887,301																																																																																																		
貸倒引当金否認	454,496																																																																																																		
退職給与引当金繰入限度超過額	402,382																																																																																																		
未払事業税	332,390																																																																																																		
株式譲渡損繰延	287,965																																																																																																		
有価証券評価差額	275,900																																																																																																		
投資有価証券評価損否認	214,784																																																																																																		
賞与引当金繰入限度超過額	168,660																																																																																																		
出資金評価損否認	118,268																																																																																																		
器具備品	38,093																																																																																																		
役員退職慰労引当金	18,823																																																																																																		
社会保険料否認	18,208																																																																																																		
前受収益	16,153																																																																																																		
一括償却資産	10,048																																																																																																		
その他	23,392																																																																																																		
繰延税金資産小計	3,266,871																																																																																																		
評価性引当額	△1,947,529																																																																																																		
繰延税金資産合計	1,319,341																																																																																																		
繰延税金負債																																																																																																			
株式譲渡益	△2,837,113																																																																																																		
その他	△2,562																																																																																																		
繰延税金負債合計	△2,839,675																																																																																																		
繰延税金負債の純額	1,520,333																																																																																																		

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳				2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳			
法定実効税率 (調整)		40.69%		法定実効税率 (調整)		40.69%	
交際費等永久に損金に算入されない項目		0.15		交際費等永久に損金に算入されない項目		0.20	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目		△0.34		受取配当金等永久に益金に算入されない項目		△0.52	
住民税均等割		0.03		住民税均等割		0.02	
評価性引当額		5.03		評価性引当額		2.45	
その他		0.05		その他		△0.29	
税効果会計適用後の法人税等の負担率		45.62		税効果会計適用後の法人税等の負担率		42.55	

(関連当事者との取引)

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

1. 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	178,324	持ち株会社	100.0	役員 2人	経営管理	有価証券の売却 売却代金 売却益	5,590,761 4,851,726	— —	— —

2. 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	証券業	—	なし	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	23,821,581	未払手数料	4,396,864
親会社の子会社	大和証券エスエムビーシー(株)	東京都千代田区	255,700	証券業	—	なし	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	1,072,285	未払手数料	102,859

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

第49期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1. 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	178,324	持ち株会社	100.0	役員2人	経営管理	有価証券の売却 売却代金 売却益	3,153,487 2,067,950	— —	— —

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

有価証券の売却価格は、修正簿価純資産方式により決定しており、支払条件は現金一括払いであります。

2. 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	なし	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	31,893,085	未払手数料	3,927,855
親会社の子会社	大和証券エスエムビーシー(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	—	なし	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	1,197,059	未払手数料	82,472
								為替予約	25,434,342	—	—
親会社の子会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	—	なし	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,074,141	その他未払金	321,615

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。
- (3) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。
- (4) 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購入価格を決定しております。

(1株当たり情報)

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
1株当たり純資産額 15,044.05円 1株当たり当期純利益 3,319.80円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	1株当たり純資産額 15,773.01円 1株当たり当期純利益 4,088.65円 同左

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
---------------------------------------	---------------------------------------

当期純利益（千円）	8,659,797	10,665,351
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）

第48期 （自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）	第49期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）
該当事項はありません。	同左

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成20年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,584,194
有価証券		26,251,951
未収委託者報酬		8,211,233
貯蔵品		68,984
繰延税金資産		356,572
デリバティブ資産		31,948
その他		199,363
流動資産計		38,704,248
固定資産		
有形固定資産	※ 1	1,464,369
無形固定資産		1,868,989
投資その他の資産		
投資有価証券		9,021,178
その他	※ 1	1,552,276
貸倒引当金	※ 2	△1,267,185
投資その他の資産合計		9,306,270
固定資産計		12,639,629
資産合計		51,343,877

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成20年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		7,027,746
未払法人税等		1,091,821
賞与引当金		194,000
その他	※ 4	2,190,491
流動負債計		10,504,059
固定負債		
繰延税金負債		2,122,867
退職給付引当金		1,045,050
役員退職慰労引当金		59,610
固定負債計		3,227,528
負債合計		13,731,588

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	
別途積立金	2,800,000
繰越利益剰余金	8,050,878
利益剰余金合計	11,225,175
株主資本合計	37,895,175
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△282,886
評価・換算差額等合計	△282,886
純資産合計	37,612,289
負債・純資産合計	51,343,877

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	40,116,478
その他営業収益	248,863
営業収益計	40,365,342
営業費用	
支払手数料	23,959,701
その他営業費用	3,970,640
営業費用計	27,930,341
一般管理費	※ 1 4,077,894
営業利益	8,357,106
営業外収益	※ 2 1,182,712
営業外費用	※ 1 , ※ 3 1,289,770
経常利益	8,250,049
特別利益	1,293
特別損失	7,822
税引前中間純利益	8,243,519
法人税、住民税及び事業税	3,174,696
法人税等調整額	164,136
中間純利益	4,904,687

(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20年4月1日 至 平成20年9月30日)
株主資本	
資本金	
前期末残高	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	
前期末残高	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	
前期末残高	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	
前期末残高	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	
別途積立金	
前期末残高	2,800,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,800,000
繰越利益剰余金	
前期末残高	11,702,152
当中間期変動額	
剰余金の配当	△8,555,962
中間純利益	4,904,687
当中間期変動額合計	△3,651,274
当中間期末残高	8,050,878

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
利益剰余金合計	

前期末残高	14,876,450
当中間期変動額	
剰余金の配当	△8,555,962
中間純利益	4,904,687
当中間期変動額合計	△3,651,274
当中間期末残高	11,225,175
株主資本合計	
前期末残高	41,546,450
当中間期変動額	
剰余金の配当	△8,555,962
中間純利益	4,904,687
当中間期変動額合計	△3,651,274
当中間期末残高	37,895,175
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	△402,154
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）	119,268
当中間期変動額合計	119,268
当中間期末残高	△282,886
評価・換算差額等合計	
前期末残高	△402,154
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）	119,268
当中間期変動額合計	119,268
当中間期末残高	△282,886
純資産合計	
前期末残高	41,144,295
当中間期変動額	
剰余金の配当	△8,555,962
中間純利益	4,904,687
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	119,268
当中間期変動額合計	△3,532,006
当中間期末残高	37,612,289

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

	当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
--	--

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法によっております。 (2) その他有価証券 時価のあるものについては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）、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 (3) デリバティブ取引 時価法により計上しております。
2. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は次の通りであります。 建物 7～50年 器具備品 5～10年 (2) 無形固定資産 定額法によっております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。
3. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担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。
	当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
4. 消費税等の会計処理	(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。 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。ただし固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は投資その他の資産に計上し、5年間で均等償却を行っております。
5. 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

会計方針の変更

当中間会計期間末 (平成20年9月30日現在)
(リース取引に関する会計基準等) 当中間会計期間から平成19年3月30日改正の「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第13号）及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第16号）を適用しております。 当該変更に伴う損益に与える影響はありません。 (棚卸資産の評価に関する会計基準) 当中間会計期間から平成18年7月5日公表の「棚卸資産の評価に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第9号）を適用しております。 当該変更に伴う損益に与える影響はありません。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末 (平成20年9月30日現在)	
※1.	減価償却累計額
	有形固定資産 2,535,700千円
	投資不動産 695,574千円
※2.	投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。
3	債務保証
	当社は、子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務795,850千円に対して保証を行っております。
※4.	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20年4月1日 至 平成20年9月30日)	
※ 1. 減価償却実施額	
有形固定資産	202,006千円
無形固定資産	291,294千円
投資不動産	7,104千円
※ 2. 営業外収益の主要項目	
有価証券利息	210,872千円
為替差益	896,638千円
※ 3. 営業外費用の主要項目	
貸倒引当金繰入額	150,213千円

デリバティブ損失

997,832千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日）

1. 発行済株式に関する事項

	前事業年度末 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)
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 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20年6月22日 定時株主総会	普通株式	8,555	3,280	平成20年 3月31日	平成20年 6月23日

(リース取引関係)

当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)		
リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) (借主側)		
①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額		
	有形固定資産 (工具、器具 及び備品)	合計
	千円	千円
取得価額相当額	4,290	4,290
減価償却累計額 相当額	2,758	2,758
中間期末残高 相当額	1,532	1,532
(注) 取得価額相当額は、未経過リース料中間期末残高が有形固定資産の中間期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。		
②未経過リース料中間期末残高相当額		
1 年 内	1,273千円	
1 年 超	326千円	
合 計	1,600千円	
(注) 未経過リース料中間期末残高相当額は、未経過リース料中間期末残高が有形固定資産の中間期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。		
③支払リース料及び減価償却費相当額		
支払リース料	657千円	

減価償却費相当額

612千円

④減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

(有価証券関係)

当中間会計期間末（平成20年9月30日現在）

1. 時価のある有価証券

	取得原価 (千円)	中間貸借対照表計上額 (千円)	差額 (千円)
(1) 其他有価証券			
①株 式	55,101	84,233	29,131
②債 券	50,000	49,915	△85
③そ の 他 証券投資信託の受益証券	5,815,150	5,318,862	△496,288
計	5,920,252	5,453,010	△467,241

2. 時価評価されていない主な有価証券

	中間貸借対照表計上額 (千円)
(1) 其他有価証券	
①非上場株式	1,312,394
②外貨建資産担保債券	2,589,363
③MMF	25,181,349
計	29,083,107
(2) 子会社株式及び関連会社株式	737,012
計	737,012

(デリバティブ取引関係)

(1) 取引の状況に関する事項

当中間会計期間
(自 平成20年4月1日
至 平成20年9月30日)

1. 取引の内容及び利用目的

当社が利用しているデリバティブ取引は為替予約取引であり、当社が保有する外貨建資産担保債券に係る為替変動リスクを軽減するために利用しております。

2. 取引に対する取組方針

為替予約取引については将来の為替変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である外貨建資産担保債券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的ではありません。

3. 取引に係るリスクの内容

為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動による市場リスクを有しております。また、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。

4. 取引に係るリスク管理体制

為替予約取引開始にあたっては、事前に取り締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。

なお、事後体制としまして、財務部長は毎月、為替予約取引の内容を含んだ財務報告を執行役員会議で行っております。また、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理しております。

(2)取引の時価等に関する事項

区分	種類	当中間会計期間末 (平成20年9月30日現在)		
		契約額等 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	為替予約取引	1,469,068	31,948	31,948

(注) 時価の算定方法は、各通貨のキャッシュ・フローを計算し、現在価値に割り引き

邦貨換算した額となっております。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)	
1株当たり純資産額	14,418.99円
1株当たり中間純利益	1,880.25円
(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、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)	4,904,687
普通株式に係る中間純利益(千円)	4,904,687
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。

- ① 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うことを内容とした運用を行うこと（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。）。
- ② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（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。）。
- ③ 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤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うこと。
- ④ 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うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤ 上記③④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20年7月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 公告の方法の変更（電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。）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

① 名称 住友信託銀行株式会社

② 資本金の額 287,537百万円（平成20年3月末日現在）

③ 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

① 名 称	② 資本金の額 単位：百万円 (平成20年3月 末日現在)	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注1)
住友信託銀行株式会社	287,537	(注2)

(注1) 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。

(注2) 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。

<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

① 名称 コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

② 資本金の額 411千米ドル（約46百万円）（平成19年12月末日現在）

③ 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

① 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

② 資本金の額 15,493千ユーロ（約2,582百万円）（平成19年12月末日現在）

③ 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】

該当ありません。

＜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20年3月末日現在）

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

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

第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
平成20年2月28日	有価証券届出書の訂正届出書
平成20年4月3日	有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第2期）・同添付書類
平成20年10月3日	半期報告書（第3期中）、有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成21年2月27日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の平成20年1月11日から平成21年1月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の平成21年1月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年2月27日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 山元 太志 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の平成20年1月11日から平成21年1月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の平成21年1月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年2月27日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の平成20年1月11日から平成21年1月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の平成21年1月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月20日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社
員 公認会計士
業務執行社員
堀内 巧 印

指 定 社
員 公認会計士
業務執行社員
小澤 陽一 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19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[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20年12月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社
員 公認会計士
業務執行社員
堀 内 巧 印

指 定 社
員 公認会計士
業務執行社員
小 澤 陽 一 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20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の中間会計期間（平成20年4月1日から平成20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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、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20年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成20年4月1日から平成20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。

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。

独立監査人の監査報告書

平成20年2月29日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の平成19年1月11日から平成20年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の平成20年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年2月29日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の平成19年1月11日から平成20年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の平成20年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年2月29日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の平成19年1月11日から平成20年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の平成20年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成19年6月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

当監査法人は、証券取引法第193条の2の 指 定 社
員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員

指 定 社
員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

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18年4月1日から平成19年3月31日までの第48期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成19年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

追記情報

会計方針の変更に記載されているとおり、会社は当事業年度より、貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準及び貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針を適用している。

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

以 上

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