

【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26年12月1日提出 |
| 【計算期間】 | 第17特定期間 (自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日) |
| 【ファンド名】 | 世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型) (愛称:ベストシックス) |
| 【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 白川 真 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 山部 努 |
| 【連絡場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【電話番号】 | 03-5555-3111 |
| 【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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

| | | |
|------|---------------|--|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 内外 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 資産複合 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、不動産投信））） |
| | 決算頻度 | 年12回（毎月） |
| | 投資対象地域 | グローバル（含む日本） |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 為替ヘッジ | 為替ヘッジなし |

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

(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12回（毎月）」…目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
- ・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

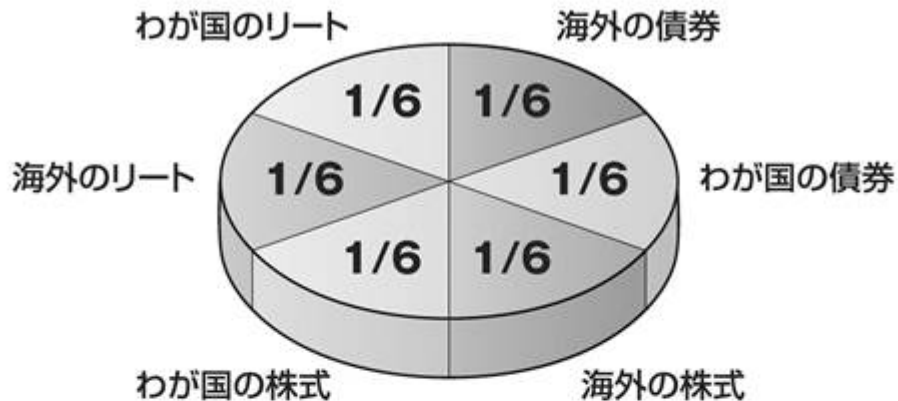
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1

内外の債券、株式およびリートに投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処とします。



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



2

海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

債券の格付けについて

| 信用度 | ムーディーズの場合 | S&Pの場合 |
|-----|----------------------|---------------------|
| 高い | Aaa | AAA |
| | Aa { Aa1, Aa2, Aa3 } | AA { AA+, AA, AA- } |
| | A { A1, A2, A3 } | A { A+, A, A- } |
| | Baa | BBB |
| | Ba | BB |
| | B | B |
| | Caa | CCC |
| | Ca | CC |
| 低い | C | C |
| | | D |

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

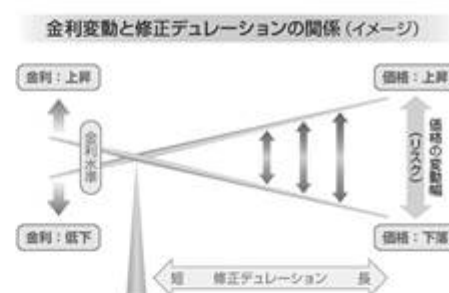
※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

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

修正デュレーションについて

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



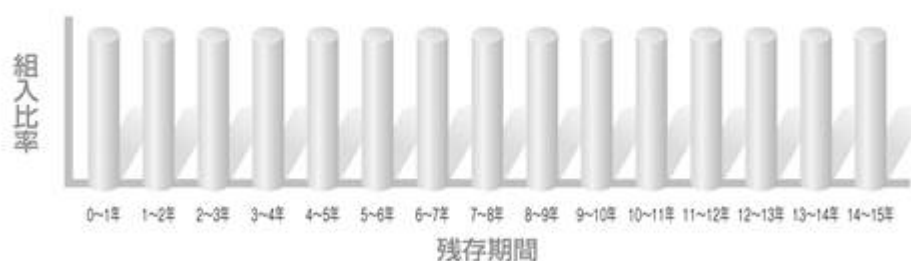
- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

3

わが国の債券への投資にあたっては、国債に投資します。

- 残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- 原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。

残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

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

4 内外の株式への投資にあたっては、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資します。

●ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。

イ. 持続可能なより良い社会への企業の取組みに着目し、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します（外部調査機関による企業の社会的責任に関する調査等を参考にします。）。

ロ. 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。

〈海外の株式〉

銘柄選定にあたっては、ドイツのイーコム・リサーチ・アーゲーの調査情報を参考にします。

◇イーコム・リサーチは、世界的な調査・格付会社の一つであり、環境への取組みを含めた企業責任の格付け（Corporate Responsibility格付け）等を行なっています。

◇イーコム・リサーチの企業責任の格付けは、環境的側面と社会的・文化的側面において行なわれ、それらをベースとした総合格付けが行なわれます。

（委託会社に対してダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの運用にかかる投資助言を行なうものではありません。）

〈わが国の株式〉

銘柄選定にあたっては、株式会社日本総合研究所の調査情報を参考にします。

◇日本総合研究所は、1969年に設立された日本を代表するシンクタンクです。

◇日本総合研究所は、企業の「社会的責任」（社会的側面、環境的側面）の調査を行ないます。なお、日本総合研究所は、投資助言・代理業の登録を行なっておらず、有価証券の価値等または有価証券の価値等の分析に基づく投資判断の助言を行なうものではありません。

5

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

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

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

投資対象銘柄の業種 (イメージ)



投資対象地域 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

〈コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- ・ 米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- ・ 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。
- ・ 優先証券や大型バリューストックなどインカム資産に加え、インフラ株といった実物資産クラスの運用を展開。
- ・ 所在地：アメリカ合衆国 ニューヨーク州 ニューヨーク

- わが国のリートへの投資にあたっては、個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

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

・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～5.の運用が行なわれないことがあります。

6 毎月6日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に6月と12月の計算期末に分配する場合があります。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



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

【収益分配金に関する留意事項】

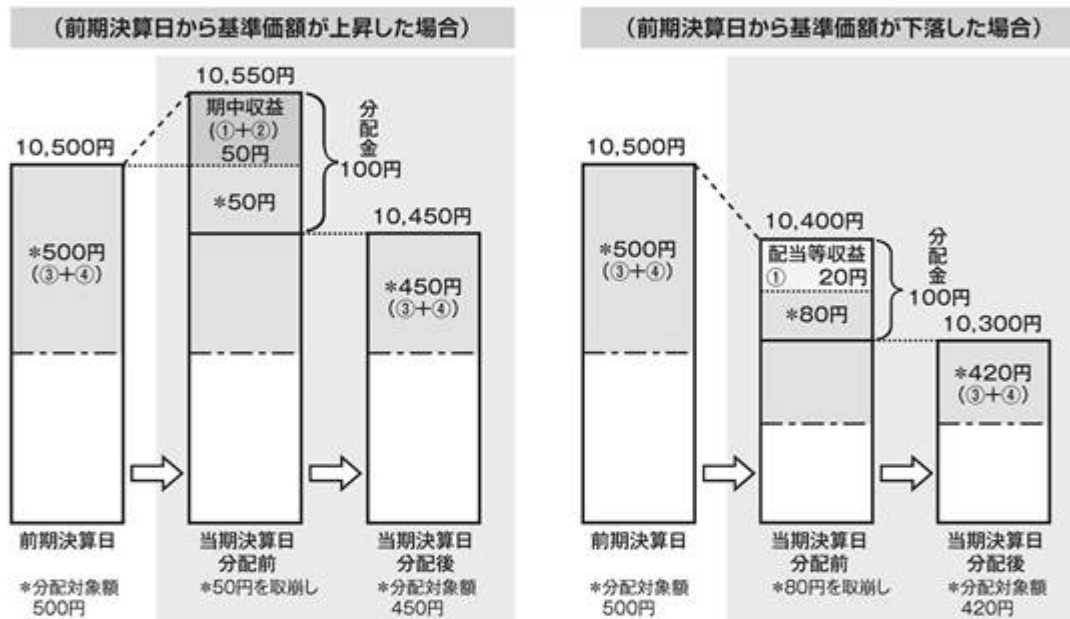
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



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

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



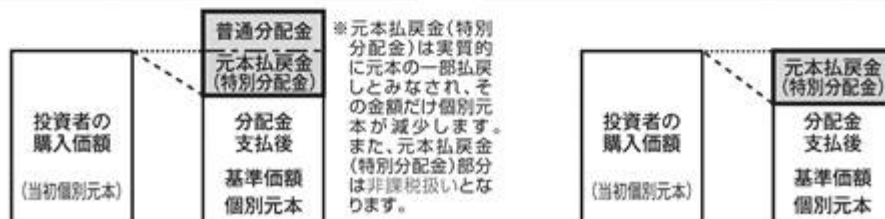
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

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

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成18年6月28日

信託契約締結、当初設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金(注1)、償還金など お申込金(5)

| | | |
|-------|------|--|
| お取扱窓口 | 販売会社 | <p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約(1)に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p> |
|-------|------|--|

1

収益分配金、償還金など お申込金(5)

| | | |
|------|----------------|---|
| 委託会社 | 大和証券投資信託委託株式会社 | <p>当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)(2)の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p> |
|------|----------------|---|

運用指図

2

損益 信託金(5)

| | | |
|------|--|--|
| 受託会社 | <p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p> | <p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。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。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p> |
|------|--|--|

損益 投資

| | |
|------|---|
| 投資対象 | <p>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 など</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ファミリーファンド方式で運用を行ないます。 ・なお、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」における外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社(コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)(注2)に運用の指図にかかる権限を委託します。 |
|------|---|

(注1)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

- 1: 受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2: 「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項(運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等)が規定されています。
- 3: 運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。

- 4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- 5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

< 委託会社の概況（平成26年9月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

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

(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第352号)

・ 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
3. ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券
4. ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
6. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券

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、株式、および不動産投資信託証券に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
- ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないません。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。
- ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ハ．保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

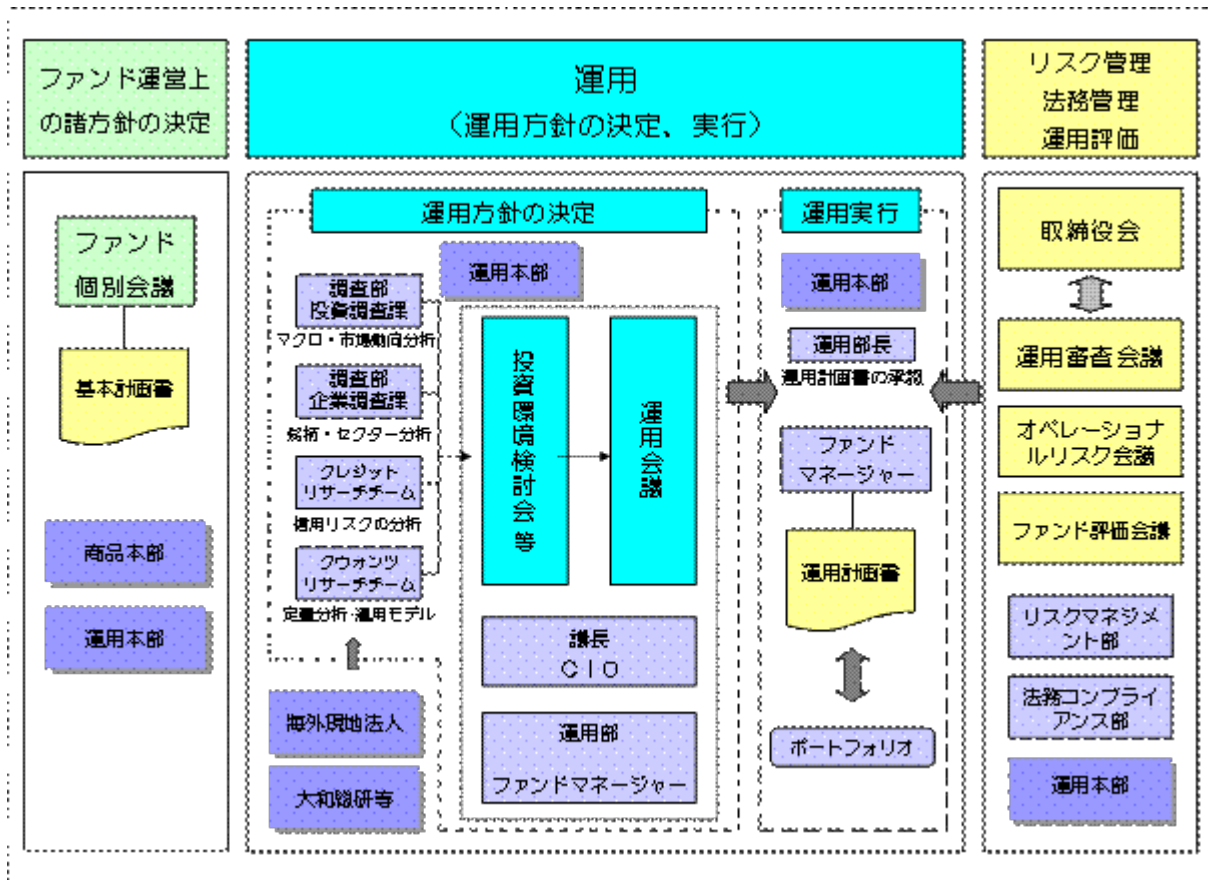
3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク会議

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の状況・運用リスク管理等の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

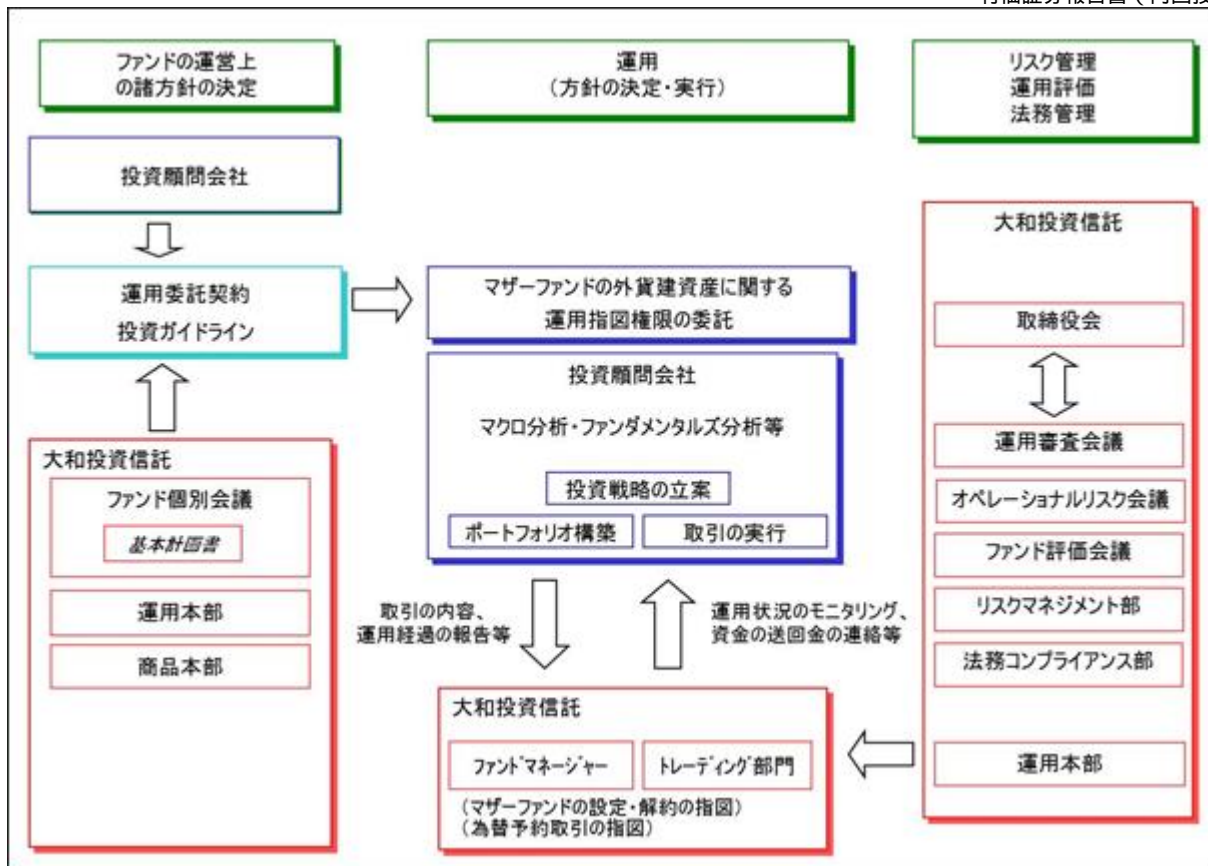
さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

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。

受託会社に対する管理体制

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

海外リート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」では、投資顧問会社に外貨建資産の運用の指図にかかる権限を委託します。このため、当該投資顧問会社と委託会社の間で締結する運用委託契約に基づく投資ガイドラインに、このファンド運営上の諸方針が反映されます。

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

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

ニ．リスク管理、運用評価、法務管理

（前 に同じ。）

上記の運用体制は平成26年10月1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】

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

原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益(評価益を含みます。)等を中心に6月と12月の計算期末に分配する場合があります。また、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。なお、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式(信託約款)

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

外国為替予約取引(信託約款)

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

資金の借入れ(信託約款)

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

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> マザーファンドの概要

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

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

東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。)の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 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. コマーシャル・ペーパー
 8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
 9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 12. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの
なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

2. ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- ロ．わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間毎の投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。
- ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- ニ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

1.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

2.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（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書

2.～16.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

イ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ロ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの八.と同規定）

スワップ取引

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

ロ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ハ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

ホ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

金利先渡取引

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

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

ハ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

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

3. ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

- イ．主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。
- ロ．ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。
- (a) 持続可能なより良い社会への企業の取組みに着目し、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します（外部調査機関による企業の社会的責任に関する調査等を参考にします。）。
- (b) 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。
- 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．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。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ハ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。)の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引

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

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、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、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、

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、

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

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、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、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、

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、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、

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、

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

4. ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。

ロ．（ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定）

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90%程度以上とすることを基本とします。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．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．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書

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

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

20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

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

（ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

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

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

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

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

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

にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引

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

金利先渡取引

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

5. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

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

6. ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

(2) 投資対象

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

1.（ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンドと同規定）

2.（ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンドと同規定）

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。
(ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定)

(3) 主な投資制限

～ (ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定)
外貨建資産への直接投資は、行ないません。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

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。

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。

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、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

・リートの収益は、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、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
 - ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
 - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
- ハ．リートに関する法制度(税制、会計制度等)が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く規制(建築規制、環境規制等)に変更があった場合も、リートの価格や配当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えます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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。

その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

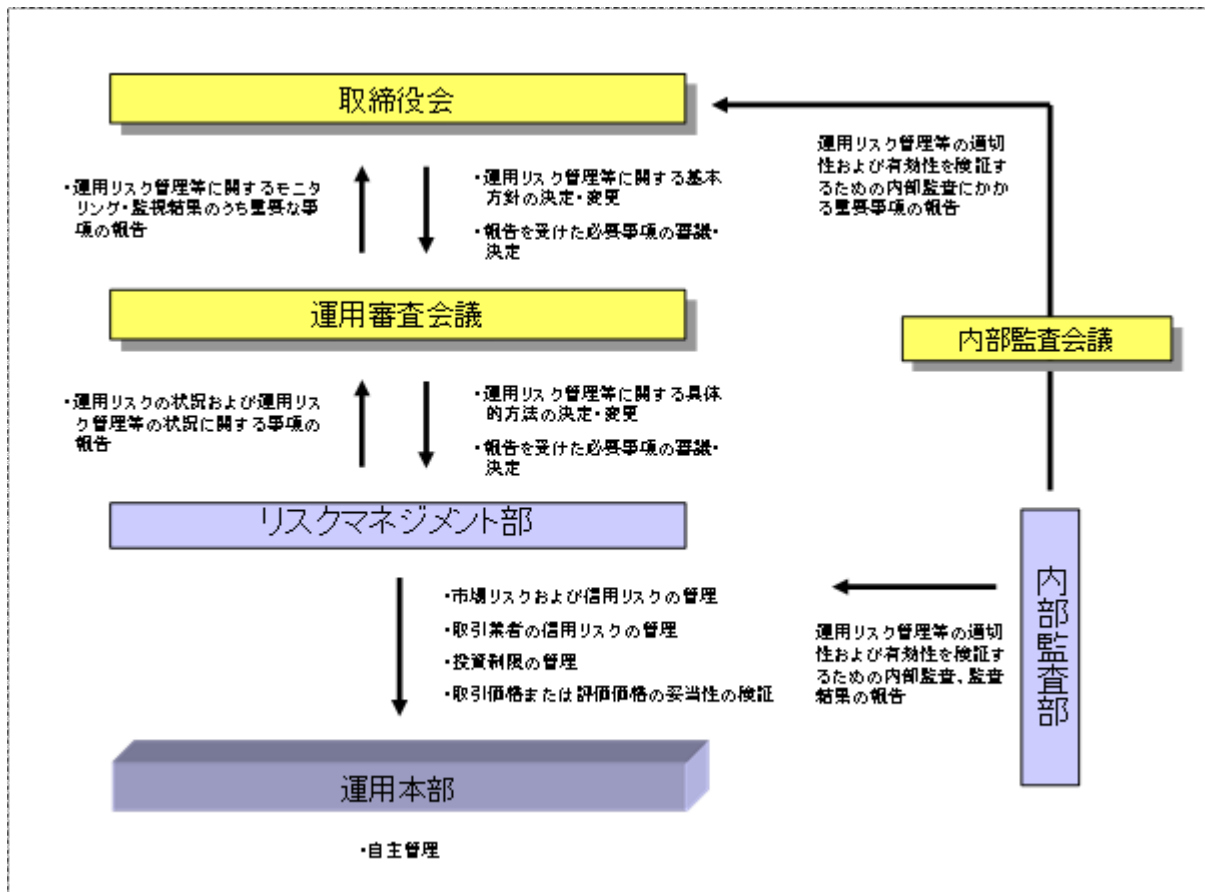
受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参 考 情 報

●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

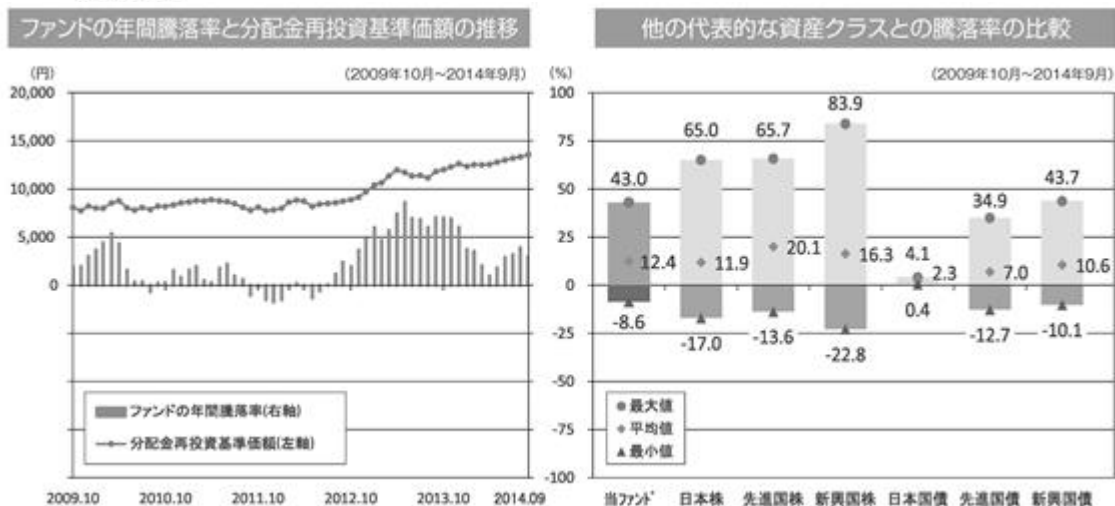
※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。

②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。



| 資産クラス | 対象指数 |
|-------|---|
| 日本株 | 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) |
| 先進国株 | MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース) |
| 新興国株 | MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) |
| 日本国債 | NOMURA-BPI 国債 |
| 先進国債 | シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース) |
| 新興国債 | JP モルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース) |

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.7%（税抜2.5%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.4148%（税抜1.31%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

| 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.63% （税抜） | 年率0.63% （税抜） | 年率0.05% （税抜） |

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

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

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

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：資金運用の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

八．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。

なお、税額控除制度が適用されます。益金不算入制度の適用はありません。

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

- () 上記は、平成26年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 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】

(1) 【投資状況】（平成26年9月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 1,699,172,097 | 99.15 |
| 内 日本 | 1,699,172,097 | 99.15 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 14,524,112 | 0.85 |
| 純資産総額 | 1,713,696,209 | 100.00 |

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

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

(2) 【投資資産】（平成26年9月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 また は 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|---|-----------------------------|----|-------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------|
| 1 | ダイワ・REITアクティブ・マザー ファンド | 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 145,039,696 | 1.9299 279,912,110 | 1.9904 288,687,010 | 16.85 |
| 2 | ダイワ日本ハーモニースtock・マ ザーファンド | 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 309,536,371 | 0.8928 276,354,076 | 0.9206 284,959,183 | 16.63 |
| 3 | ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド | 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 170,432,965 | 1.6391 279,356,675 | 1.6618 283,225,501 | 16.53 |
| 4 | ダイワ日本国債マザーファンド | 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 235,583,734 | 1.1986 282,370,664 | 1.1995 282,582,688 | 16.49 |
| 5 | ダイワ外国ハーモニースtock・マ ザーファンド | 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 172,659,409 | 1.6135 278,585,965 | 1.6324 281,849,219 | 16.45 |
| 6 | 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 | 170,785,800 | 1.6671 284,717,014 | 1.6270 277,868,496 | 16.21 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.15% |
| 合計 | 99.15% |

(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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

| | 純資産総額 (分配落) (円) | 純資産総額 (分配付) (円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落)(円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付)(円) |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1特定期間末 (平成18年9月6日) | 3,487,112,318 | 3,487,112,318 | 1.0601 | 1.0601 |
| 第2特定期間末 (平成19年3月6日) | 14,625,425,299 | 14,677,767,431 | 1.1104 | 1.1144 |
| 第3特定期間末 (平成19年9月6日) | 25,582,206,696 | 25,732,236,572 | 1.0157 | 1.0216 |
| 第4特定期間末 (平成20年3月6日) | 22,465,604,226 | 22,620,727,624 | 0.8689 | 0.8749 |
| 第5特定期間末 (平成20年9月8日) | 19,687,955,233 | 19,837,377,967 | 0.7906 | 0.7966 |
| 第6特定期間末 (平成21年3月6日) | 11,935,013,318 | 12,031,575,030 | 0.4944 | 0.4984 |
| 第7特定期間末 (平成21年9月7日) | 13,901,836,782 | 13,993,633,497 | 0.6057 | 0.6097 |
| 第8特定期間末 (平成22年3月8日) | 10,692,248,916 | 10,745,973,634 | 0.5971 | 0.6001 |
| 第9特定期間末 (平成22年9月6日) | 7,798,140,191 | 7,839,456,750 | 0.5662 | 0.5692 |

| | | | | |
|-------------------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第10特定期間末 (平成23年3月7日) | 5,730,967,463 | 5,749,873,656 | 0.6063 | 0.6083 |
| 第11特定期間末 (平成23年9月6日) | 3,560,134,170 | 3,573,461,950 | 0.5342 | 0.5362 |
| 第12特定期間末 (平成24年3月6日) | 2,726,947,257 | 2,731,732,476 | 0.5699 | 0.5709 |
| 第13特定期間末 (平成24年9月6日) | 2,078,365,006 | 2,082,077,533 | 0.5598 | 0.5608 |
| 第14特定期間末 (平成25年3月6日) | 2,223,686,916 | 2,226,847,683 | 0.7035 | 0.7045 |
| 第15特定期間末 (平成25年9月6日) | 1,965,705,474 | 1,968,408,487 | 0.7272 | 0.7282 |
| 平成25年9月末日 | 2,007,785,384 | - | 0.7573 | - |
| 10月末日 | 2,008,435,407 | - | 0.7701 | - |
| 11月末日 | 2,001,005,984 | - | 0.7873 | - |
| 12月末日 | 1,977,214,948 | - | 0.8073 | - |
| 平成26年1月末日 | 1,892,866,076 | - | 0.7884 | - |
| 2月末日 | 1,880,843,682 | - | 0.7988 | - |
| 第16特定期間末 (平成26年3月6日) | 1,885,679,377 | 1,888,027,488 | 0.8031 | 0.8041 |
| 3月末日 | 1,834,067,309 | - | 0.7962 | - |
| 4月末日 | 1,803,269,262 | - | 0.7989 | - |
| 5月末日 | 1,798,205,308 | - | 0.8123 | - |
| 6月末日 | 1,769,792,153 | - | 0.8251 | - |
| 7月末日 | 1,753,097,363 | - | 0.8366 | - |
| 8月末日 | 1,729,887,697 | - | 0.8449 | - |
| 第17特定期間末 (平成26年9月8日) | 1,730,255,928 | 1,732,293,672 | 0.8491 | 0.8501 |
| 9月末日 | 1,713,696,209 | - | 0.8574 | - |

【分配の推移】

| | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1特定期間 | 0.0000 |
| 第2特定期間 | 0.0325 |
| 第3特定期間 | 0.0920 |
| 第4特定期間 | 0.0360 |
| 第5特定期間 | 0.0360 |
| 第6特定期間 | 0.0320 |

| | |
|---------|--------|
| 第7特定期間 | 0.0240 |
| 第8特定期間 | 0.0220 |
| 第9特定期間 | 0.0180 |
| 第10特定期間 | 0.0150 |
| 第11特定期間 | 0.0120 |
| 第12特定期間 | 0.0090 |
| 第13特定期間 | 0.0060 |
| 第14特定期間 | 0.0060 |
| 第15特定期間 | 0.0060 |
| 第16特定期間 | 0.0060 |
| 第17特定期間 | 0.0060 |

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|---------|--------|
| 第1特定期間 | 6.0 |
| 第2特定期間 | 7.8 |
| 第3特定期間 | 0.2 |
| 第4特定期間 | 10.9 |
| 第5特定期間 | 4.9 |
| 第6特定期間 | 33.4 |
| 第7特定期間 | 27.4 |
| 第8特定期間 | 2.2 |
| 第9特定期間 | 2.2 |
| 第10特定期間 | 9.7 |
| 第11特定期間 | 9.9 |
| 第12特定期間 | 8.4 |
| 第13特定期間 | 0.7 |
| 第14特定期間 | 26.7 |
| 第15特定期間 | 4.2 |
| 第16特定期間 | 11.3 |
| 第17特定期間 | 6.5 |

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|--------|----------------|-------------|
| 第1特定期間 | 1,916,142,957 | 19,407,932 |
| 第2特定期間 | 10,280,081,989 | 398,477,795 |

| | | |
|---------|----------------|---------------|
| 第3特定期間 | 12,688,787,389 | 672,491,834 |
| 第4特定期間 | 1,793,489,262 | 1,126,729,309 |
| 第5特定期間 | 149,620,087 | 1,099,816,750 |
| 第6特定期間 | 112,127,245 | 875,488,163 |
| 第7特定期間 | 138,194,296 | 1,327,887,558 |
| 第8特定期間 | 74,873,258 | 5,117,368,720 |
| 第9特定期間 | 28,038,971 | 4,164,091,913 |
| 第10特定期間 | 17,489,243 | 4,336,578,861 |
| 第11特定期間 | 9,176,941 | 2,798,383,496 |
| 第12特定期間 | 7,129,746 | 1,885,800,773 |
| 第13特定期間 | 3,288,231 | 1,075,979,918 |
| 第14特定期間 | 2,642,560 | 554,402,406 |
| 第15特定期間 | 1,750,484 | 459,505,224 |
| 第16特定期間 | 1,260,298 | 356,162,054 |
| 第17特定期間 | 802,846 | 311,169,491 |

(注) 当初設定数量は1,392,591,022口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年9月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 国債証券 | 51,122,525,127 | 80.84 |
| 内 ユーロ | 21,858,091,479 | 34.56 |
| 内 スウェーデン | 2,321,499,247 | 3.67 |
| 内 イギリス | 5,068,096,134 | 8.01 |
| 内 ポーランド | 3,633,506,100 | 5.75 |
| 内 カナダ | 1,728,917,753 | 2.73 |
| 内 アメリカ | 12,664,780,355 | 20.03 |
| 内 オーストラリア | 3,847,634,059 | 6.08 |
| 特殊債券 | 4,985,587,895 | 7.88 |
| 内 ノルウェー | 1,379,862,720 | 2.18 |
| 内 カナダ | 3,144,863,394 | 4.97 |
| 内 オーストラリア | 460,861,781 | 0.73 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 7,132,667,575 | 11.28 |
| 純資産総額 | 63,240,780,597 | 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) | | 21,163,718,381 | 33.47 |
| | 内 日本 | 21,163,718,381 | 33.47 |
| 為替予約取引(売建) | | 21,337,874,554 | 33.74 |
| | 内 日本 | 21,337,874,554 | 33.74 |

(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26年9月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|----|--|---------|----------|-----------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-----------------|
| | | | | また は 額面金額 | | | | |
| 1 | IRISH TREASURY | ユーロ | 国債 証券 | 53,500,000 | 110.48 8,208,408,504 | 114.76 8,526,517,319 | 3.400000 2024/03/18 | 13.48 |
| 2 | IRISH TREASURY | ユーロ | 国債 証券 | 39,000,000 | 131.57 7,125,946,017 | 132.79 7,192,030,084 | 5.400000 2025/03/13 | 11.37 |
| 3 | United Kingdom Gilt | イギリス | 国債 証券 | 17,500,000 | 122.41 3,807,595,158 | 123.54 3,842,649,930 | 5.000000 2025/03/07 | 6.08 |
| 4 | Poland Government Bond | ポーランド | 国債 証券 | 105,000,000 | 103.96 3,625,253,415 | 104.20 3,633,506,100 | 3.250000 2019/07/25 | 5.75 |
| 5 | Belgium Government Bond | ユーロ | 国債 証券 | 15,000,000 | 123.35 2,569,442,175 | 124.34 2,590,085,200 | 4.250000 2021/09/28 | 4.10 |
| 6 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債 証券 | 13,500,000 | 145.57 2,151,001,525 | 145.27 2,146,517,529 | 7.500000 2024/11/15 | 3.39 |
| 7 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | オーストラリア | 国債 証券 | 23,000,000 | 93.28 2,042,261,470 | 93.40 2,044,981,048 | 3.250000 2029/04/21 | 3.23 |
| 8 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債 証券 | 12,000,000 | 118.40 1,973,214,939 | 119.41 1,990,045,983 | 3.250000 2045/05/25 | 3.15 |
| 9 | US Treasury Inflation Indexed Bonds | アメリカ | 国債 証券 | 15,000,000 | 109.34 1,795,117,492 | 109.30 1,794,451,193 | 0.125000 2016/04/15 | 2.84 |
| 10 | CANADA HOUSING TRUST | カナダ | 特殊 債券 | 15,000,000 | 109.71 1,613,409,966 | 109.57 1,611,336,420 | 4.100000 2018/12/15 | 2.55 |
| 11 | Belgium Government Bond | ユーロ | 国債 証券 | 10,000,000 | 112.48 1,562,051,421 | 112.29 1,559,412,891 | 2.600000 2024/06/22 | 2.47 |

| | | | | | | | | |
|----|---|-------------|----------|------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|------|
| 12 | INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT | ノル ウェー | 特殊 債券 | 75,000,000 | 104.87 1,335,570,390 | 108.35 1,379,862,720 | 3.625000 2020/06/22 | 2.18 |
| 13 | Mexico Government International Bond | アメリカ | 国債 証券 | 12,000,000 | 105.85 1,390,321,460 | 103.12 1,354,443,750 | 4.000000 2023/10/02 | 2.14 |
| 14 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債 証券 | 12,000,000 | 99.27 1,303,908,632 | 99.34 1,304,823,498 | 1.625000 2019/08/31 | 2.06 |
| 15 | United Kingdom Gilt | イギリス | 国債 証券 | 6,000,000 | 115.22 1,228,773,496 | 114.91 1,225,446,204 | 4.750000 2020/03/07 | 1.94 |
| 16 | Mexico Government International Bond | アメリカ | 国債 証券 | 9,000,000 | 114.43 1,127,225,550 | 111.50 1,098,330,750 | 5.550000 2045/01/21 | 1.74 |
| 17 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債 証券 | 10,000,000 | 99.71 1,091,421,718 | 99.96 1,094,105,980 | 1.750000 2019/09/30 | 1.73 |
| 18 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | オース トラリア | 国債 証券 | 10,000,000 | 105.62 1,005,472,932 | 106.52 1,014,011,475 | 4.500000 2033/04/21 | 1.60 |
| 19 | Mexico Government International Bond | アメリカ | 国債 証券 | 8,000,000 | 115.57 1,011,974,700 | 114.25 1,000,373,000 | 5.950000 2019/03/19 | 1.58 |
| 20 | SWEDISH GOVERNMENT BOND | スウェー デン | 国債 証券 | 50,000,000 | 116.03 877,254,840 | 116.11 877,799,160 | 4.250000 2019/03/12 | 1.39 |
| 21 | SWEDISH GOVERNMENT BOND | スウェー デン | 国債 証券 | 45,000,000 | 126.45 860,386,212 | 126.65 861,774,228 | 3.500000 2039/03/30 | 1.36 |
| 22 | US Treasury Inflation Indexed Bonds | アメリカ | 国債 証券 | 5,000,000 | 127.88 699,826,858 | 125.48 686,740,523 | 2.625000 2017/07/15 | 1.09 |
| 23 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | オース トラリア | 国債 証券 | 6,000,000 | 114.48 653,869,629 | 115.47 659,546,760 | 5.500000 2023/04/21 | 1.04 |
| 24 | Mexico Government International Bond | アメリカ | 国債 証券 | 6,000,000 | 103.28 678,272,595 | 99.75 655,058,250 | 4.750000 2044/03/08 | 1.04 |
| 25 | SWEDISH GOVERNMENT BOND | スウェー デン | 国債 証券 | 38,000,000 | 98.64 566,776,224 | 101.28 581,925,859 | 1.500000 2023/11/13 | 0.92 |
| 26 | Mexico Government International Bond | アメリカ | 国債 証券 | 5,000,000 | 104.03 569,337,010 | 102.00 558,195,000 | 3.625000 2022/03/15 | 0.88 |
| 27 | INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK | カナダ | 特殊 債券 | 5,000,000 | 111.38 546,014,172 | 112.15 549,783,810 | 4.400000 2026/01/26 | 0.87 |
| 28 | CANADIAN GOVERNMENT BOND | カナダ | 国債 証券 | 5,000,000 | 110.63 542,318,064 | 109.95 538,974,900 | 3.750000 2019/06/01 | 0.85 |
| 29 | CANADIAN GOVERNMENT BOND | カナダ | 国債 証券 | 5,000,000 | 111.62 547,190,652 | 106.80 523,553,208 | 11.250000 2015/06/01 | 0.83 |
| 30 | Mexico Government International Bond | アメリカ | 国債 証券 | 4,000,000 | 120.25 526,454,500 | 118.12 517,151,250 | 6.050000 2040/01/11 | 0.82 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．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 | 80.84% |
| 特殊債券 | 7.88% |
| 合計 | 88.72% |

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|--------|----|--------------------------|-----------|-------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | 豪ドル買/円売 2014年10月 | 買建 | 8,191,573 | 782,160,000 | 779,100,511 | 1.23% |
| | | ポーランド・ズロチ買/円売 2014年10月 | 買建 | 30,000,000 | 995,940,740 | 995,700,000 | 1.57% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2014年10月 | 買建 | 68,095,925 | 6,699,890,612 | 6,673,400,650 | 10.55% |
| | | 米ドル買/円売 2014年10月 | 買建 | 40,000,000 | 4,368,204,758 | 4,377,600,000 | 6.92% |
| | | ノルウェー・クローネ買/円売 2014年10月 | 買建 | 133,492,219 | 2,260,500,000 | 2,265,362,952 | 3.58% |
| | | 英ポンド買/円売 2014年10月 | 買建 | 34,172,122 | 6,063,445,000 | 6,072,554,268 | 9.60% |
| | | 豪ドル売/円買 2014年10月 | 売建 | 35,000,000 | 3,346,850,000 | 3,328,850,000 | 5.26% |
| | | ポーランド・ズロチ売/円買 2014年10月 | 売建 | 92,000,000 | 3,050,360,000 | 3,053,780,000 | 4.83% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2014年10月 | 売建 | 8,000,000 | 782,160,000 | 784,000,000 | 1.24% |
| | | スウェーデン・クローネ売/円買 2014年10月 | 売建 | 150,000,000 | 2,260,500,000 | 2,268,000,000 | 3.59% |

| | | | | | | |
|--|-----------------------------|----|-------------|---------------|---------------|--------|
| | ノルウェー・クローネ 売/円買 2014年10月 | 売建 | 100,000,000 | 1,698,000,000 | 1,697,000,000 | 2.68% |
| | ユーロ売/円買 2014年10月 | 売建 | 66,329,598 | 9,244,614,370 | 9,210,527,948 | 14.56% |
| | 英ポンド売/円買 2014年10月 | 売建 | 5,603,357 | 995,940,740 | 995,716,606 | 1.57% |

(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。

ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年9月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|-----------------|---------|
| 国債証券 | | 365,100,306,349 | 99.62 |
| | 内 日本 | 365,100,306,349 | 99.62 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 1,398,151,551 | 0.38 |
| 純資産総額 | | 366,498,457,900 | 100.00 |

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

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

(2) 投資資産（平成26年9月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 また は 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|---|----------|----|------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | 43 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 10,772,000,000 | 114.84 12,370,772,080 | 113.53 12,229,451,600 | 2.900000 2019/09/20 | 3.34 |
| 2 | 40 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 11,142,000,000 | 109.56 12,208,092,720 | 108.62 12,103,331,760 | 2.300000 2018/09/20 | 3.30 |
| 3 | 80 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 10,423,000,000 | 115.20 12,007,808,570 | 115.74 12,063,788,660 | 2.100000 2025/06/20 | 3.29 |
| 4 | 70 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 9,888,000,000 | 117.51 11,620,143,880 | 118.04 11,671,795,200 | 2.400000 2024/06/20 | 3.18 |

| | | | | | | | | |
|----|------------|----|------|----------------|--------------------------|--------------------------|------------------------|------|
| 5 | 42 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 10,518,000,000 | 112.02 11,782,678,860 | 110.91 11,665,513,800 | 2.600000 2019/03/20 | 3.18 |
| 6 | 33 利付国債20年 | 日本 | 国債証券 | 10,694,000,000 | 109.37 11,696,881,540 | 107.31 11,476,373,040 | 3.800000 2016/09/20 | 3.13 |
| 7 | 37利付国債20年 | 日本 | 国債証券 | 10,323,000,000 | 110.40 11,397,587,460 | 108.92 11,244,121,290 | 3.100000 2017/09/20 | 3.07 |
| 8 | 44 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 9,285,000,000 | 113.52 10,540,844,500 | 112.58 10,453,145,850 | 2.500000 2020/03/20 | 2.85 |
| 9 | 38利付国債20年 | 日本 | 国債証券 | 9,426,000,000 | 110.18 10,386,169,600 | 108.99 10,273,491,660 | 2.700000 2018/03/20 | 2.80 |
| 10 | 29 利付国債20年 | 日本 | 国債証券 | 9,850,000,000 | 106.26 10,467,334,000 | 104.01 10,245,674,499 | 4.200000 2015/09/21 | 2.80 |
| 11 | 28 利付国債20年 | 日本 | 国債証券 | 9,963,000,000 | 104.93 10,454,700,270 | 102.29 10,191,252,330 | 5.000000 2015/03/20 | 2.78 |
| 12 | 111 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 8,650,000,000 | 116.66 10,091,092,500 | 117.73 10,183,904,500 | 2.200000 2029/06/20 | 2.78 |
| 13 | 32 利付国債20年 | 日本 | 国債証券 | 9,543,000,000 | 107.25 10,234,907,270 | 105.31 10,050,210,450 | 3.700000 2016/03/21 | 2.74 |
| 14 | 102 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 8,320,000,000 | 119.36 9,931,133,000 | 120.36 10,014,700,800 | 2.400000 2028/06/20 | 2.73 |
| 15 | 34 利付国債20年 | 日本 | 国債証券 | 9,219,000,000 | 110.22 10,161,939,440 | 108.42 9,995,239,800 | 3.500000 2017/03/20 | 2.73 |
| 16 | 95 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 8,405,000,000 | 118.05 9,922,600,400 | 118.88 9,992,620,450 | 2.300000 2027/06/20 | 2.73 |
| 17 | 88 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 7,860,000,000 | 117.80 9,259,364,000 | 118.41 9,307,261,800 | 2.300000 2026/06/20 | 2.54 |
| 18 | 47 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 8,300,000,000 | 112.17 9,310,649,000 | 111.79 9,279,234,000 | 2.200000 2020/09/21 | 2.53 |
| 19 | 58 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 7,375,000,000 | 111.68 8,237,007,200 | 112.10 8,267,375,000 | 1.900000 2022/09/20 | 2.26 |
| 20 | 64 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 7,185,000,000 | 112.51 8,084,034,500 | 112.88 8,110,930,950 | 1.900000 2023/09/20 | 2.21 |
| 21 | 52 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 7,118,000,000 | 112.50 8,008,159,080 | 112.59 8,014,583,280 | 2.100000 2021/09/21 | 2.19 |
| 22 | 63 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 6,508,000,000 | 111.33 7,245,490,900 | 111.83 7,278,351,960 | 1.800000 2023/06/20 | 1.99 |
| 23 | 91 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 6,000,000,000 | 117.74 7,064,872,000 | 118.51 7,111,080,000 | 2.300000 2026/09/20 | 1.94 |
| 24 | 97 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,940,000,000 | 116.81 6,938,814,000 | 117.69 6,990,904,800 | 2.200000 2027/09/20 | 1.91 |

| | | | | | | | | | |
|----|-----|-------|----|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|------|
| 25 | 48 | 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,901,000,000 | 114.71 6,769,193,280 | 114.12 6,734,693,280 | 2.500000 2020/12/21 | 1.84 |
| 26 | 56 | 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,870,000,000 | 112.39 6,597,474,300 | 112.64 6,612,496,300 | 2.000000 2022/06/20 | 1.80 |
| 27 | 110 | 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,650,000,000 | 115.17 6,507,312,000 | 116.39 6,576,543,500 | 2.100000 2029/03/20 | 1.79 |
| 28 | 51 | 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,550,000,000 | 111.66 6,197,637,500 | 111.67 6,197,796,000 | 2.000000 2021/06/21 | 1.69 |
| 29 | 101 | 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 4,960,000,000 | 119.22 5,913,735,000 | 120.32 5,968,020,800 | 2.400000 2028/03/20 | 1.63 |
| 30 | 1 | 30年国債 | 日本 | 国債証券 | 4,700,000,000 | 125.63 5,904,977,000 | 126.14 5,928,721,000 | 2.800000 2029/09/20 | 1.62 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 国債証券 | 99.62% |
| 合計 | 99.62% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年9月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---------|---------|---------------|---------|
| 株式 | | 2,382,550,469 | 95.32 |
| | 内 ノルウェー | 40,887,840 | 1.64 |

| | | |
|-----------------------|---------------|--------|
| 内 スウェーデン | 28,092,960 | 1.12 |
| 内 イギリス | 101,182,050 | 4.05 |
| 内 オランダ | 24,190,460 | 0.97 |
| 内 フランス | 173,627,079 | 6.95 |
| 内 ドイツ | 136,460,606 | 5.46 |
| 内 スペイン | 124,261,987 | 4.97 |
| 内 イタリア | 49,576,590 | 1.98 |
| 内 フィンランド | 53,469,810 | 2.14 |
| 内 カナダ | 170,336,657 | 6.82 |
| 内 アメリカ | 1,480,464,430 | 59.23 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 116,867,154 | 4.68 |
| 純資産総額 | 2,499,417,623 | 100.00 |

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

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

(2) 投資資産（平成26年9月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、口数 また は 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|---|---------------------------------|------|----|--------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 1 | UNION PACIFIC CORP | アメリカ | 株式 | 資本財・ サービス | 8,200 | 11,786.67 96,650,698 | 11,878.60 97,404,590 | 3.90 |
| 2 | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | カナダ | 株式 | 資本財・ サービス | 4,000 | 22,092.33 88,369,334 | 22,409.98 89,639,933 | 3.59 |
| 3 | BANK OF AMERICA CORP | アメリカ | 株式 | 金融 | 45,000 | 1,778.78 80,046,354 | 1,861.74 83,778,503 | 3.35 |
| 4 | NVIDIA CORP | アメリカ | 株式 | 情報技 術 | 40,000 | 2,185.71 87,428,660 | 2,026.46 81,058,670 | 3.24 |
| 5 | BANK OF MONTREAL | カナダ | 株式 | 金融 | 10,000 | 8,268.69 82,686,936 | 8,069.67 80,696,724 | 3.23 |
| 6 | CVS HEALTH CORP | アメリカ | 株式 | 生活必 需品 | 9,200 | 8,935.49 82,206,582 | 8,759.28 80,585,408 | 3.22 |
| 7 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | アメリカ | 株式 | 一般消 費財・ サービス | 10,000 | 7,338.62 73,386,291 | 7,325.48 73,254,885 | 2.93 |
| 8 | ALCOA INC | アメリカ | 株式 | 素材 | 40,000 | 1,891.29 75,651,840 | 1,743.53 69,741,540 | 2.79 |

| | | | | | | | | |
|----|---------------------------------|------------|----|--------------------|---------|-------------------------|-------------------------|------|
| 9 | WYNDHAM WORLDWIDE CORP | アメリカ | 株式 | 一般消 費財・ サービス | 7,800 | 8,958.48 69,876,164 | 8,904.85 69,457,846 | 2.78 |
| 10 | MICRON TECHNOLOGY INC | アメリカ | 株式 | 情報技 術 | 18,000 | 3,605.28 64,895,094 | 3,776.02 67,968,450 | 2.72 |
| 11 | AXA SA | フランス | 株式 | 金融 | 25,000 | 2,697.13 67,431,327 | 2,697.54 67,438,744 | 2.70 |
| 12 | ENAGAS | スペイン | 株式 | 公益事 業 | 18,000 | 3,633.53 65,403,604 | 3,539.79 63,716,333 | 2.55 |
| 13 | GOOGLE INC-CL C | アメリカ | 株式 | 情報技 術 | 1,000 | 64,146.45 64,146,456 | 63,082.60 63,082,602 | 2.52 |
| 14 | INTEL CORP | アメリカ | 株式 | 情報技 術 | 16,000 | 3,830.75 61,292,000 | 3,819.80 61,116,880 | 2.45 |
| 15 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | スペイン | 株式 | 金融 | 46,000 | 1,354.26 62,295,971 | 1,305.37 60,047,388 | 2.40 |
| 16 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | ドイツ | 株式 | 一般消 費財・ サービス | 5,000 | 12,782.98 63,914,918 | 11,833.11 59,165,564 | 2.37 |
| 17 | STATE STREET CORP | アメリカ | 株式 | 金融 | 7,000 | 7,952.63 55,668,459 | 8,056.61 56,396,302 | 2.26 |
| 18 | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | イギリス | 株式 | 金融 | 135,000 | 429.59 57,995,673 | 415.73 56,124,071 | 2.25 |
| 19 | TOTAL SA | フランス | 株式 | エネル ギー | 8,000 | 7,139.30 57,114,454 | 6,986.54 55,892,398 | 2.24 |
| 20 | CONOCOPHILLIPS | アメリカ | 株式 | エネル ギー | 6,500 | 8,794.30 57,162,999 | 8,519.58 55,377,322 | 2.22 |
| 21 | MOHAWK INDUSTRIES INC | アメリカ | 株式 | 一般消 費財・ サービス | 3,700 | 16,211.73 59,983,416 | 14,881.91 55,063,091 | 2.20 |
| 22 | APPLE INC | アメリカ | 株式 | 情報技 術 | 5,000 | 10,832.26 54,161,333 | 10,957.03 54,785,198 | 2.19 |
| 23 | PPG INDUSTRIES INC | アメリカ | 株式 | 素材 | 2,500 | 22,323.42 55,808,555 | 21,830.89 54,577,243 | 2.18 |
| 24 | 3M CO | アメリカ | 株式 | 資本財・ サービス | 3,500 | 15,782.69 55,239,415 | 15,562.69 54,469,434 | 2.18 |
| 25 | NOKIA OYJ | フィンラ ンド | 株式 | 情報技 術 | 57,000 | 902.23 51,432,404 | 938.06 53,469,810 | 2.14 |
| 26 | DASSAULT SYSTEMES SA | フランス | 株式 | 情報技 術 | 7,000 | 7,146.25 50,023,751 | 7,185.13 50,295,937 | 2.01 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------|------|----|------------|---------|------------------------|------------------------|------|
| 27 | INTESA SANPAOLO | イタリア | 株式 | 金融 | 150,000 | 341.34 51,201,369 | 330.51 49,576,590 | 1.98 |
| 28 | WALT DISNEY CO | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス | 5,000 | 9,953.38 49,766,915 | 9,722.44 48,612,218 | 1.94 |
| 29 | INFINEON TECHNOLOGIES AG | ドイツ | 株式 | 情報技術 | 40,000 | 1,256.35 50,254,276 | 1,176.22 47,049,156 | 1.88 |
| 30 | NUCOR CORP | アメリカ | 株式 | 素材 | 7,500 | 6,287.02 47,152,784 | 5,971.59 44,786,940 | 1.79 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 株式 | 95.32% |
| 合計 | 95.32% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種 | 投資比率 |
|------------|--------|
| エネルギー | 4.45% |
| 素材 | 7.89% |
| 資本財・サービス | 13.43% |
| 一般消費財・サービス | 16.62% |
| 生活必需品 | 3.22% |
| ヘルスケア | 1.70% |
| 金融 | 21.08% |
| 情報技術 | 24.35% |
| 公益事業 | 2.55% |
| その他 | 0.02% |
| 合計 | 95.32% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年9月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|---------------|---------|
| 株式 | | 2,409,207,700 | 94.77 |
| | 内 日本 | 2,409,207,700 | 94.77 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 132,889,042 | 5.23 |
| 純資産総額 | | 2,542,096,742 | 100.00 |

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

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

(2) 投資資産（平成26年9月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、口数 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|---|---------------|----|----|-------|-----------------|------------------------|------------------------|-----------------|
| | | | | | また は 額面金額 | | | |
| 1 | トヨタ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 13,000 | 6,107.00 79,391,000 | 6,463.00 84,019,000 | 3.31 |
| 2 | セイコーエプソン | 日本 | 株式 | 電気機器 | 13,500 | 5,590.00 75,465,000 | 5,270.00 71,145,000 | 2.80 |
| 3 | バンダイナムコHLDGS | 日本 | 株式 | その他製品 | 23,000 | 2,793.00 64,239,000 | 2,815.00 64,745,000 | 2.55 |
| 4 | 日本電産 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 8,600 | 6,875.00 59,125,000 | 7,420.00 63,812,000 | 2.51 |
| 5 | 日立 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 75,000 | 806.80 60,510,000 | 837.50 62,812,500 | 2.47 |
| 6 | マツダ | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 22,000 | 2,529.00 55,638,000 | 2,749.00 60,478,000 | 2.38 |
| 7 | ミネベア | 日本 | 株式 | 電気機器 | 40,000 | 1,356.00 54,240,000 | 1,496.00 59,840,000 | 2.35 |
| 8 | CKD | 日本 | 株式 | 機械 | 60,000 | 981.46 58,887,902 | 996.00 59,760,000 | 2.35 |
| 9 | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 95,000 | 610.40 57,988,000 | 620.20 58,919,000 | 2.32 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------|----|----|-------------|---------|-------------------------|-------------------------|------|
| 10 | アルプス電気 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 31,000 | 1,636.00 50,716,000 | 1,883.00 58,373,000 | 2.30 |
| 11 | ジェイテクト | 日本 | 株式 | 機械 | 30,000 | 1,691.49 50,744,712 | 1,834.00 55,020,000 | 2.16 |
| 12 | 三菱商事 | 日本 | 株式 | 卸売業 | 24,000 | 2,195.50 52,692,000 | 2,246.00 53,904,000 | 2.12 |
| 13 | ソフトバンク | 日本 | 株式 | 情報・通 信業 | 7,000 | 7,628.00 53,396,000 | 7,689.00 53,823,000 | 2.12 |
| 14 | 富士電機 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 100,000 | 532.40 53,240,691 | 531.00 53,100,000 | 2.09 |
| 15 | カシオ | 日本 | 株式 | 電気機器 | 29,000 | 1,761.66 51,088,348 | 1,828.00 53,012,000 | 2.09 |
| 16 | 良品計画 | 日本 | 株式 | 小売業 | 4,000 | 12,150.00 48,600,000 | 13,070.00 52,280,000 | 2.06 |
| 17 | 西日本旅客鉄道 | 日本 | 株式 | 陸運業 | 10,500 | 4,909.18 51,546,462 | 4,909.50 51,549,750 | 2.03 |
| 18 | 三菱電機 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 35,000 | 1,371.00 47,985,000 | 1,460.50 51,117,500 | 2.01 |
| 19 | トプコン | 日本 | 株式 | 精密機器 | 20,000 | 2,473.00 49,460,000 | 2,496.00 49,920,000 | 1.96 |
| 20 | 日立金属 | 日本 | 株式 | 鉄鋼 | 25,000 | 1,937.61 48,440,380 | 1,976.00 49,400,000 | 1.94 |
| 21 | 三菱ケミカルHLDGS | 日本 | 株式 | 化学 | 90,000 | 534.78 48,130,845 | 539.60 48,564,000 | 1.91 |
| 22 | 建設技術研究所 | 日本 | 株式 | サービ ス業 | 25,300 | 1,686.00 42,655,800 | 1,865.00 47,184,500 | 1.86 |
| 23 | 大成建設 | 日本 | 株式 | 建設業 | 75,000 | 625.00 46,875,000 | 619.00 46,425,000 | 1.83 |
| 24 | 東洋インキSCホールディング | 日本 | 株式 | 化学 | 90,000 | 495.00 44,550,000 | 512.00 46,080,000 | 1.81 |
| 25 | 三井住友フィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 9,100 | 4,328.50 39,389,350 | 4,471.00 40,686,100 | 1.60 |
| 26 | 日本郵船 | 日本 | 株式 | 海運業 | 140,000 | 301.00 42,140,000 | 289.00 40,460,000 | 1.59 |
| 27 | JXホールディングス | 日本 | 株式 | 石油・石 炭製品 | 80,000 | 522.10 41,768,000 | 505.50 40,440,000 | 1.59 |
| 28 | KDDI | 日本 | 株式 | 情報・通 信業 | 6,000 | 6,193.00 37,158,000 | 6,593.00 39,558,000 | 1.56 |
| 29 | 京王電鉄 | 日本 | 株式 | 陸運業 | 48,000 | 803.00 38,544,000 | 811.00 38,928,000 | 1.53 |

| | | | | | | | | |
|----|------|----|----|------|--------|------------------------|------------------------|------|
| 30 | 住友電工 | 日本 | 株式 | 非鉄金属 | 22,000 | 1,560.00 34,320,000 | 1,620.50 35,651,000 | 1.40 |
|----|------|----|----|------|--------|------------------------|------------------------|------|

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 株式 | 94.77% |
| 合計 | 94.77% |

(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

| 業種 | 投資比率 |
|------------|--------|
| 鉱業 | 1.15% |
| 建設業 | 6.35% |
| 繊維製品 | 1.20% |
| 化学 | 5.77% |
| 医薬品 | 1.37% |
| 石油・石炭製品 | 1.59% |
| ガラス・土石製品 | 1.03% |
| 鉄鋼 | 1.94% |
| 非鉄金属 | 2.62% |
| 機械 | 6.52% |
| 電気機器 | 20.72% |
| 輸送用機器 | 8.49% |
| 精密機器 | 1.96% |
| その他製品 | 2.55% |
| 陸運業 | 4.44% |
| 海運業 | 1.59% |
| 情報・通信業 | 4.56% |
| 卸売業 | 5.05% |
| 小売業 | 4.57% |
| 銀行業 | 4.88% |
| 証券、商品先物取引業 | 0.77% |
| 保険業 | 1.03% |
| その他金融業 | 0.89% |
| 不動産業 | 1.06% |
| サービス業 | 2.67% |
| 合計 | 94.77% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年9月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 投資証券 | 156,208,125,975 | 97.92 |
| 内 香港 | 4,973,670,656 | 3.12 |
| 内 シンガポール | 8,002,840,279 | 5.02 |
| 内 イギリス | 20,401,896,413 | 12.79 |
| 内 オランダ | 4,826,079,017 | 3.03 |
| 内 フランス | 11,702,554,668 | 7.34 |
| 内 ドイツ | 1,181,887,433 | 0.74 |
| 内 スペイン | 763,907,969 | 0.48 |
| 内 カナダ | 3,072,662,439 | 1.93 |
| 内 アメリカ | 78,410,761,336 | 49.15 |
| 内 オーストラリア | 22,871,865,765 | 14.34 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 3,324,593,737 | 2.08 |
| 純資産総額 | 159,532,719,712 | 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) | 596,403,748 | 0.37 |
| 内 日本 | 596,403,748 | 0.37 |
| 為替予約取引(売建) | 599,308,779 | 0.38 |
| 内 日本 | 599,308,779 | 0.38 |

(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26年9月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 また は 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|---------------------------------|---------|------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1 | HAMMERSON PLC | イギリス | 投資証券 | 6,889,259 | 1,063.24 7,324,948,721 | 1,021.11 7,034,734,659 | 4.41 |
| 2 | LAND SECURITIES GROUP PLC | イギリス | 投資証券 | 3,765,574 | 1,882.26 7,087,814,170 | 1,860.93 7,007,498,995 | 4.39 |
| 3 | UNIBAIL-RODAMCO SE | フランス | 投資証券 | 222,941 | 28,579.44 6,371,530,271 | 27,905.92 6,221,375,160 | 3.90 |
| 4 | WESTFIELD CORP | オーストラリア | 投資証券 | 8,657,923 | 709.16 6,139,900,293 | 716.78 6,205,832,108 | 3.89 |
| 5 | SIMON PROPERTY GROUP INC | アメリカ | 投資証券 | 312,716 | 18,118.35 5,665,898,877 | 17,995.76 5,627,564,899 | 3.53 |
| 6 | DEXUS PROPERTY GROUP | オーストラリア | 投資証券 | 44,862,662 | 108.99 4,889,695,931 | 107.08 4,804,286,395 | 3.01 |
| 7 | GOODMAN GROUP | オーストラリア | 投資証券 | 9,573,213 | 494.03 4,729,512,815 | 493.08 4,720,400,074 | 2.96 |
| 8 | CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP | オーストラリア | 投資証券 | 21,857,236 | 193.23 4,223,598,299 | 188.47 4,119,568,784 | 2.58 |
| 9 | PROLOGIS INC | アメリカ | 投資証券 | 953,716 | 4,249.94 4,053,239,115 | 4,178.80 3,985,389,375 | 2.50 |
| 10 | LINK REIT | 香港 | 投資証券 | 6,407,420 | 637.32 4,083,576,914 | 616.17 3,948,059,981 | 2.47 |
| 11 | VORNADO REALTY TRUST | アメリカ | 投資証券 | 332,690 | 11,204.39 3,727,590,672 | 10,994.25 3,657,677,864 | 2.29 |
| 12 | DERWENT LONDON PLC | イギリス | 投資証券 | 674,943 | 4,889.62 3,300,219,786 | 4,846.96 3,271,428,338 | 2.05 |
| 13 | EXTRA SPACE STORAGE INC | アメリカ | 投資証券 | 573,262 | 5,505.33 3,155,999,353 | 5,666.22 3,248,232,336 | 2.04 |
| 14 | SL GREEN REALTY CORP | アメリカ | 投資証券 | 285,301 | 11,322.60 3,230,349,816 | 11,217.53 3,200,372,669 | 2.01 |
| 15 | EQUITY RESIDENTIAL | アメリカ | 投資証券 | 471,560 | 6,795.75 3,204,604,106 | 6,735.55 3,176,217,373 | 1.99 |
| 16 | KLEPIERRE | フランス | 投資証券 | 655,892 | 4,863.22 3,189,751,946 | 4,795.18 3,145,120,922 | 1.97 |

| | | | | | | | |
|----|------------------------------|--------|------|------------|----------------------------|----------------------------|------|
| 17 | CORIO NV | オランダ | 投資証券 | 572,239 | 5,529.80 3,164,369,168 | 5,360.38 3,067,419,635 | 1.92 |
| 18 | REGENCY CENTERS CORP | アメリカ | 投資証券 | 498,008 | 6,033.97 3,004,969,565 | 5,947.51 2,961,909,054 | 1.86 |
| 19 | VENTAS INC | アメリカ | 投資証券 | 420,294 | 6,719.13 2,824,012,336 | 6,796.84 2,856,673,172 | 1.79 |
| 20 | MACERICH CO | アメリカ | 投資証券 | 407,780 | 7,039.49 2,870,603,073 | 6,971.96 2,843,027,888 | 1.78 |
| 21 | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | アメリカ | 投資証券 | 1,735,255 | 1,531.20 2,657,032,000 | 1,535.58 2,664,628,946 | 1.67 |
| 22 | APARTMENT INVT & MGMT CO - A | アメリカ | 投資証券 | 740,608 | 3,579.01 2,650,647,141 | 3,502.40 2,593,905,459 | 1.63 |
| 23 | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | アメリカ | 投資証券 | 1,820,668 | 1,421.75 2,588,544,743 | 1,406.43 2,560,646,647 | 1.61 |
| 24 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | アメリカ | 投資証券 | 125,280 | 19,957.11 2,500,227,117 | 19,681.29 2,465,673,139 | 1.55 |
| 25 | GECINA SA | フランス | 投資証券 | 163,003 | 14,720.22 2,399,440,021 | 14,331.38 2,336,058,586 | 1.46 |
| 26 | SUNTEC REIT | シンガポール | 投資証券 | 14,551,555 | 154.76 2,252,056,858 | 152.18 2,214,522,577 | 1.39 |
| 27 | UDR INC | アメリカ | 投資証券 | 714,767 | 3,076.63 2,199,080,385 | 2,991.26 2,138,060,012 | 1.34 |
| 28 | KILROY REALTY CORP | アメリカ | 投資証券 | 321,073 | 6,638.14 2,131,328,327 | 6,526.50 2,095,484,058 | 1.31 |
| 29 | WEINGARTEN REALTY INVESTORS | アメリカ | 投資証券 | 591,278 | 3,525.38 2,084,482,296 | 3,479.41 2,057,301,838 | 1.29 |
| 30 | PUBLIC STORAGE | アメリカ | 投資証券 | 112,023 | 18,198.25 2,038,622,728 | 18,159.94 2,034,331,407 | 1.28 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 投資証券 | 97.92% |
| 合計 | 97.92% |

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

八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|--------|----|----------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | 豪ドル買/円売 2014年10 月 | 買建 | 6,269,479 | 599,304,048 | 596,403,748 | 0.37% |
| | | 米ドル売/円買 2014年10 月 | 売建 | 5,476,140 | 599,304,048 | 599,308,779 | 0.38% |

(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。

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年9月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資証券 | 42,749,215,000 | 98.55 |
| 内 日本 | 42,749,215,000 | 98.55 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 630,170,099 | 1.45 |
| 純資産総額 | 43,379,385,099 | 100.00 |

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

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

(2) 投資資産（平成26年9月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

| 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 また は 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|----|------|--------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------|
| 1 日本ビルファンド | 日本 | 投資証券 | 6,300 | 579,434.76 3,650,438,997 | 577,000.00 3,635,100,000 | 8.38 |

| | | | | | | | |
|----|-------------------|----|------|--------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 2 | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 投資証券 | 6,000 | 554,902.01 3,329,412,079 | 564,000.00 3,384,000,000 | 7.80 |
| 3 | 日本リテールファンド | 日本 | 投資証券 | 11,000 | 206,954.41 2,276,498,615 | 221,000.00 2,431,000,000 | 5.60 |
| 4 | 日本プライムリアルティ | 日本 | 投資証券 | 5,500 | 371,125.71 2,041,191,457 | 395,000.00 2,172,500,000 | 5.01 |
| 5 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 日本 | 投資証券 | 12,000 | 155,759.92 1,869,119,103 | 168,300.00 2,019,600,000 | 4.66 |
| 6 | 森トラスト総合リート | 日本 | 投資証券 | 9,950 | 172,412.18 1,715,501,260 | 202,900.00 2,018,855,000 | 4.65 |
| 7 | 日本プロロジスリート | 日本 | 投資証券 | 7,700 | 220,815.93 1,700,282,732 | 255,100.00 1,964,270,000 | 4.53 |
| 8 | 森ヒルズリート | 日本 | 投資証券 | 10,000 | 138,107.66 1,381,076,627 | 152,400.00 1,524,000,000 | 3.51 |
| 9 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 22,000 | 49,080.23 1,079,765,259 | 66,800.00 1,469,600,000 | 3.39 |
| 10 | ケネディクス・オフィス投資法人 | 日本 | 投資証券 | 2,400 | 506,087.03 1,214,608,886 | 589,000.00 1,413,600,000 | 3.26 |
| 11 | オリックス不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 10,000 | 134,070.01 1,340,700,108 | 137,900.00 1,379,000,000 | 3.18 |
| 12 | アドバンス・レジデンス | 日本 | 投資証券 | 4,500 | 232,200.00 1,044,900,000 | 255,000.00 1,147,500,000 | 2.65 |
| 13 | 大和証券オフィス投資法人 | 日本 | 投資証券 | 1,900 | 533,908.66 1,014,426,458 | 592,000.00 1,124,800,000 | 2.59 |
| 14 | NMF投資法人 | 日本 | 投資証券 | 8,000 | 107,335.55 858,684,466 | 137,700.00 1,101,600,000 | 2.54 |
| 15 | 産業ファンド | 日本 | 投資証券 | 1,200 | 890,026.68 1,068,032,022 | 909,000.00 1,090,800,000 | 2.51 |
| 16 | API投資法人 | 日本 | 投資証券 | 1,200 | 857,856.29 1,029,427,556 | 881,000.00 1,057,200,000 | 2.44 |
| 17 | フロンティア不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 2,000 | 533,000.00 1,066,000,000 | 526,000.00 1,052,000,000 | 2.43 |
| 18 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 4,300 | 223,551.63 961,272,011 | 242,400.00 1,042,320,000 | 2.40 |
| 19 | GLP投資法人 | 日本 | 投資証券 | 8,200 | 105,616.99 866,059,330 | 126,700.00 1,038,940,000 | 2.40 |
| 20 | 星野リゾート・リート | 日本 | 投資証券 | 800 | 859,606.32 687,685,060 | 1,150,000.00 920,000,000 | 2.12 |
| 21 | ジャパンエクセレント投資法人 | 日本 | 投資証券 | 6,000 | 137,954.16 827,725,013 | 140,900.00 845,400,000 | 1.95 |

| | | | | | | | |
|----|----------------|----|------|--------|---------------------------|---------------------------|------|
| 22 | ヒューリックリート投資法 | 日本 | 投資証券 | 4,800 | 142,306.60 683,071,709 | 176,100.00 845,280,000 | 1.95 |
| 23 | インヴィンシブル投資法人 | 日本 | 投資証券 | 23,000 | 27,059.02 622,357,580 | 35,300.00 811,900,000 | 1.87 |
| 24 | 東急リアル・エステート | 日本 | 投資証券 | 4,700 | 133,526.90 627,576,476 | 144,600.00 679,620,000 | 1.57 |
| 25 | 福岡リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 3,000 | 169,823.45 509,470,368 | 202,500.00 607,500,000 | 1.40 |
| 26 | ケネディクスレジデンシャル | 日本 | 投資証券 | 2,000 | 227,061.06 454,122,135 | 280,400.00 560,800,000 | 1.29 |
| 27 | イオンリート投資 | 日本 | 投資証券 | 4,000 | 133,268.75 533,075,006 | 137,000.00 548,000,000 | 1.26 |
| 28 | インベスコ・オフィス・リート | 日本 | 投資証券 | 5,000 | 105,785.16 528,925,849 | 102,800.00 514,000,000 | 1.18 |
| 29 | コンフォリア・レジデンシャル | 日本 | 投資証券 | 2,400 | 182,500.00 438,000,000 | 203,900.00 489,360,000 | 1.13 |
| 30 | 大和ハウスリート | 日本 | 投資証券 | 1,000 | 428,862.69 428,862,699 | 486,000.00 486,000,000 | 1.12 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 投資証券 | 98.55% |
| 合計 | 98.55% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報) 運用実績

2014年9月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

| | |
|-------|--------|
| 基準価額 | 8,574円 |
| 純資産総額 | 17億円 |

基準価額の騰落率

| 期間 | ファンド |
|------|-------|
| 1カ月間 | 1.6% |
| 3カ月間 | 4.3% |
| 6カ月間 | 8.5% |
| 1年間 | 14.9% |
| 3年間 | 74.1% |
| 5年間 | 66.9% |
| 設定来 | 35.7% |



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 120円 設定来分配金合計額: 3,585円

| 決算期 | 第88期 | 第89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 | 第94期 | 第95期 | 第96期 | 第97期 | 第98期 | 第99期 |
|-----|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | 13年10月 | 13年11月 | 13年12月 | 14年1月 | 14年2月 | 14年3月 | 14年4月 | 14年5月 | 14年6月 | 14年7月 | 14年8月 | 14年9月 |
| 分配金 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

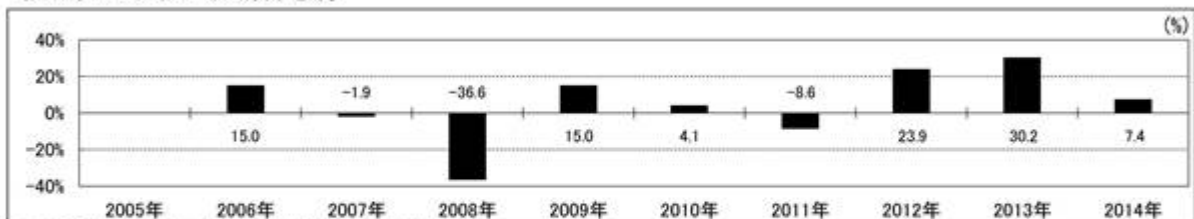
| 資産別構成 | 銘柄数 | 比率 | 通貨別構成 | 比率 | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位銘柄 | 国・地域名 | 比率 |
|-------------|-----|--------|------------|--------|--------------|------------------------------|-------|------|
| 国内リート | 44 | 16.6% | 日本円 | 51.1% | 直接利回り(%) | UNION PACIFIC CORP | アメリカ | 0.6% |
| 国内債券 | 63 | 16.4% | 米ドル | 23.1% | 最終利回り(%) | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | カナダ | 0.6% |
| 外国リート | 76 | 15.9% | ユーロ | 9.3% | 修正デュレーション | BANK OF AMERICA CORP | アメリカ | 0.6% |
| 国内株式 | 67 | 15.8% | 英ポンド | 5.6% | 残存年数 | トヨタ自動車 | 日本 | 0.5% |
| 外国株式 | 47 | 15.7% | カナダ・ドル | 4.3% | 債券格付別構成 | NVIDIA CORP | アメリカ | 0.5% |
| 外国債券 | 37 | 14.7% | 豪ドル | 3.5% | AAA | 日本ビルファンド | 日本 | 1.4% |
| | | | ポーランド・ズロチ | 0.8% | AA | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 1.3% |
| | | | ノルウェー・クローネ | 0.8% | A | 日本リテールファンド | 日本 | 0.9% |
| | | | シンガポール・ドル | 0.7% | BBB | 日本プライムリアルティ | 日本 | 0.8% |
| コール・ローン、その他 | | 5.0% | その他 | 0.9% | BB | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 日本 | 0.8% |
| 合計 | 334 | 100.0% | 合計 | 100.0% | 合計 | 合計 | | 8.2% |

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2006年は設定日(6月28日)から年末、2014年は9月30日までの騰落率を表しています。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。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時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

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

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)
電話番号(コールセンター) 0120-106212
(営業日の9:00~17:00)
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・ お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00～17:00)

- ・ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎月7日から翌月6日までとします。ただし、第1計算期間は、平成18年6月28日から平成18年7月6日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

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

信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前 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 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 の3.または前 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。

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年3月および9月の計算期末に作成し、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。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

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

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成26年3月7日から平成26年9月8日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

| | 前 期 平成26年3月6日現在 | 当 期 平成26年9月8日現在 |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 23,614,872 | 19,915,517 |
| 親投資信託受益証券 | 1,865,115,110 | 1,715,892,846 |
| 未収入金 | 4,000,000 | - |
| 流動資産合計 | 1,892,729,982 | 1,735,808,363 |
| 資産合計 | 1,892,729,982 | 1,735,808,363 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 2,348,111 | 2,037,744 |
| 未払解約金 | 2,636,891 | 1,230,172 |
| 未払受託者報酬 | 75,829 | 84,383 |
| 未払委託者報酬 | 1,910,988 | 2,126,654 |
| その他未払費用 | 78,786 | 73,482 |
| 流動負債合計 | 7,050,605 | 5,552,435 |
| 負債合計 | 7,050,605 | 5,552,435 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 2,348,111,273 | ¹ 2,037,744,628 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | ² 462,431,896 | ² 307,488,700 |
| （分配準備積立金） | 30,280,240 | 31,657,982 |
| 元本等合計 | 1,885,679,377 | 1,730,255,928 |
| 純資産合計 | 1,885,679,377 | 1,730,255,928 |
| 負債純資産合計 | 1,892,729,982 | 1,735,808,363 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 自 至 | 前 期 平成25年9月7日 平成26年3月6日 | 自 至 | 当 期 平成26年3月7日 平成26年9月8日 |
|-------------------------|--------|-------------------------------|--------|-------------------------------|
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 7,135 | | 5,445 |
| 有価証券売買等損益 | | 224,292,738 | | 123,777,736 |
| 営業収益合計 | | 224,299,873 | | 123,783,181 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 511,193 | | 488,548 |
| 委託者報酬 | | 1 12,883,467 | | 1 12,312,463 |
| その他費用 | | 78,786 | | 73,482 |
| 営業費用合計 | | 13,473,446 | | 12,874,493 |
| 営業利益 | | 210,826,427 | | 110,908,688 |
| 経常利益 | | 210,826,427 | | 110,908,688 |
| 当期純利益 | | 210,826,427 | | 110,908,688 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | | 4,766,060 | | 1,221,226 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 737,307,555 | | 462,431,896 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 84,075,761 | | 58,391,011 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 84,075,761 | | 58,391,011 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 302,103 | | 151,700 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 302,103 | | 151,700 |
| 分配金 | | 2 14,958,366 | | 2 12,983,577 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 462,431,896 | | 307,488,700 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分 | 当 期 | |
|----------------------------|---|-------------|
| | 自 平成26年3月7日 | 至 平成26年9月8日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 | |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 特定期間末日 平成26年9月6日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成26年9月8日としております。このため、当特定期間は186日となっております。 | |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前 期 | 当 期 |
|---------------------|---|---|
| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
| 1. 1 期首元本額 | 2,703,013,029円 | 2,348,111,273円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,260,298円 | 802,846円 |
| 期中一部解約元本額 | 356,162,054円 | 311,169,491円 |
| 2. 特定期間末日における受益権の総数 | 2,348,111,273口 | 2,037,744,628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462,431,896円であります。 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は307,488,700円であります。 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 前 期 | 当 期 |
|-----|----------------------------|----------------------------|
| | 自 平成25年9月7日 至 平成26年3月6日 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8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 | 717,789円 | 675,122円 |
| 2. 2 分配金の計算過程 | <p>（自平成25年9月7日 至平成25年10月7日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,569,404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（14,244,231円）及び分配準備積立金（25,444,334円）より分配対象額は45,257,969円（1万口当たり170.88円）であり、うち2,648,558円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成25年10月8日 至平成25年11月6日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,948,374円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（13,996,817円）及び分配準備積立金（27,865,020円）より分配対象額は44,810,211円（1万口当たり172.21円）であり、うち2,602,085円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> | <p>（自平成26年3月7日 至平成26年4月7日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,143,235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（12,250,481円）及び分配準備積立金（29,341,164円）より分配対象額は45,734,880円（1万口当たり200.99円）であり、うち2,275,442円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成26年4月8日 至平成26年5月7日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,387,600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（12,145,606円）及び分配準備積立金（30,934,503円）より分配対象額は44,467,709円（1万口当たり197.15円）であり、うち2,255,578円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> |

（自平成25年11月7日 至平成25年12月6日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,974,362円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金

（13,558,668円）及び分配準備積立金（27,321,063円）より分配対象額は44,854,093円（1万口当たり177.98円）であり、うち2,520,189円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

（自平成25年12月7日 至平成26年1月6日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,265,740円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金

（13,162,637円）及び分配準備積立金（27,927,328円）より分配対象額は46,355,705円（1万口当たり189.51円）であり、うち2,446,124円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

（自平成26年5月8日 至平成26年6月6日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,564,854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

（11,815,200円）及び分配準備積立金（29,241,696円）より分配対象額は45,621,750円（1万口当たり207.95円）であり、うち2,193,844円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

（自平成26年6月7日 至平成26年7月7日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,024,597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

（11,497,734円）及び分配準備積立金（30,757,051円）より分配対象額は46,279,382円（1万口当たり216.81円）であり、うち2,134,579円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

| | |
|---|---|
| <p>(自平成26年1月7日 至平成26年2月6日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(992,639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(12,880,420円)及び分配準備積立金(30,080,941円)より分配対象額は43,954,000円(1万口当たり183.65円)であり、うち2,393,299円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> | <p>(自平成26年7月8日 至平成26年8月6日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(607,290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(11,239,915円)及び分配準備積立金(31,908,317円)より分配対象額は43,755,522円(1万口当たり209.72円)であり、うち2,086,390円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> |
| <p>(自平成26年2月7日 至平成26年3月6日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,491,816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(12,639,506円)及び分配準備積立金(28,136,535円)より分配対象額は45,267,857円(1万口当たり192.78円)であり、うち2,348,111円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> | <p>(自平成26年8月7日 至平成26年9月8日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,977,649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(10,979,569円)及び分配準備積立金(29,718,077円)より分配対象額は44,675,295円(1万口当たり219.24円)であり、うち2,037,744円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 当 期 |
|----------------------------|---|
| | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 当 期 |
|--------------------------|--|
| | 平成26年9月8日現在 |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| | 前 期 | 当 期 |
|--|-------------|-------------|
| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |

| 種 類 | 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) | 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) |
|-----------|----------------------------|----------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 78,187,635 | 56,619,382 |
| 合計 | 78,187,635 | 56,619,382 |

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 前 期 平成26年3月6日現在 | 当 期 平成26年9月8日現在 |
|--------------------|--------------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 当 期 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

(1口当たり情報)

| | 前 期 平成26年3月6日現在 | 当 期 平成26年9月8日現在 |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.8031円 (8,031円) | 0.8491円 (8,491円) |

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|---------------|----------------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益 証券 | ダイワ・外債ソブリン・マザーファン ド | 173,454,970 | 284,310,041 | |
| | ダイワ日本国債マザーファンド | 236,419,925 | 283,372,922 | |
| | ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド | 173,184,459 | 288,715,811 | |
| | ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド | 146,576,241 | 282,877,487 | |

| | | | | |
|--------------|-------------------------|-------------|---------------|--|
| | ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド | 320,491,911 | 286,135,178 | |
| | ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド | 180,031,861 | 290,481,407 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 1,715,892,846 | |
| 合計 | | | 1,715,892,846 | |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券及び「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

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26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|----------|----------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 2,194,221,801 | 1,999,442,062 |
| コール・ローン | 719,718,472 | 393,918,656 |
| 国債証券 | 55,801,901,669 | 51,227,210,677 |
| 特殊債券 | 4,957,204,155 | 8,774,654,544 |
| 派生商品評価勘定 | 33,831,767 | 261,869,842 |
| 未収入金 | 8,649,359,001 | 12,201,658,081 |
| 未収利息 | 324,653,419 | 283,152,508 |
| 前払費用 | 517,994,891 | 534,675,308 |
| 流動資産合計 | 73,198,885,175 | 75,676,581,678 |

| | | |
|-----------------|------------------|----------------|
| 資産合計 | 73,198,885,175 | 75,676,581,678 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 47,211,018 | 278,843,141 |
| 未払金 | 6,176,828,552 | 11,932,325,577 |
| 未払解約金 | 141,915,000 | 156,880,000 |
| 流動負債合計 | 6,365,954,570 | 12,368,048,718 |
| 負債合計 | 6,365,954,570 | 12,368,048,718 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 43,284,227,751 | 38,623,793,031 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 23,548,702,854 | 24,684,739,929 |
| 元本等合計 | 66,832,930,605 | 63,308,532,960 |
| 純資産合計 | 66,832,930,605 | 63,308,532,960 |
| 負債純資産合計 | 73,198,885,175 | 75,676,581,678 |

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26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> |

外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|--------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首 | 平成25年9月7日 | 平成26年3月7日 |
| 期首元本額 | 48,929,922,498円 | 43,284,227,751円 |
| 期中追加設定元本額 | 73,345,062円 | 208,237,450円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,719,039,809円 | 4,868,672,170円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用） | 4,231,175,729円 | 3,619,290,934円 |
| 富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス／毎月分配型） | 1,000,523,601円 | 882,543,632円 |
| 北海道応援・外債バランスファンド（毎月分配型） | 1,760,456,741円 | 1,690,560,337円 |
| 福島応援・外債バランスファンド（毎月分配型） | 372,856,761円 | 323,261,764円 |
| ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型） | 1,994,609,691円 | 1,786,286,298円 |
| ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株） | 76,232,744円 | 75,587,278円 |
| 新潟県応援ファンド（外債バランス・毎月分配型） | 471,503,016円 | 411,260,625円 |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 376,489,379円 | 332,195,560円 |
| インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 858,962,909円 | 759,883,512円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| 成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型) | 1,137,510,689円 | 1,022,472,011円 |
| FITネット・三県応援ファンド(毎月分配型) | 451,414,667円 | 382,172,208円 |
| 長野応援ファンド(毎月分配型) | 516,529,066円 | 484,531,241円 |
| 栃木応援・外債バランスファンド(毎月分配型) | 461,871,832円 | 403,030,394円 |
| 京都応援バランスファンド(隔月分配型) | 490,458,408円 | 426,743,341円 |
| 北東北三県応援・外債バランスファンド(毎月分配型) | 427,371,409円 | 357,813,577円 |
| 6資産バランスファンド(分配型) | 2,209,267,800円 | 1,982,137,396円 |
| 6資産バランスファンド(成長型) | 209,256,981円 | 190,403,647円 |
| ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型) | 18,564,062,805円 | 16,766,824,985円 |
| 富山応援ファンドPART2(地域企業株・外債バランス/隔月分配型) | 510,737,775円 | 479,942,619円 |
| 奈良応援ファンド(外債バランス・毎月分配型) | 156,080,131円 | 145,849,742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) | 595,945,360円 | 463,640,392円 |
| 世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型) | 201,924,693円 | 173,454,970円 |
| ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型) | 2,069,179,445円 | 1,851,901,370円 |
| 兵庫応援バランスファンド(毎月分配型) | 177,430,414円 | 149,454,489円 |
| 『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型) | 56,152,902円 | 49,927,520円 |
| ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド | 603,468,137円 | 525,257,412円 |
| 紀陽地域株式・外債バランスファンド(隔月分配型) | 252,685,853円 | 236,217,561円 |
| 愛媛県応援ファンド(外債バランス・毎月分配型) | 169,983,309円 | 139,608,510円 |

| | | |
|-----------------------------|-----------------|-----------------|
| ダイワ資産分散インカムオー プン（奇数月決算型） | 2,676,572,770円 | 2,323,735,328円 |
| 地球環境株・外債バランス・ ファンド | 184,360,426円 | 142,265,250円 |
| ダイワ海外ソブリン・ファン ド（1年決算型） | 19,152,308円 | 45,539,128円 |
| 計 | 43,284,227,751円 | 38,623,793,031円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 43,284,227,751口 | 38,623,793,031口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|--------------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 平成26年9月8日現在 |
|-----|-------------|
|-----|-------------|

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|------|------------------------|------------------------|
| | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 316,725,984 | 777,493,091 |
| 特殊債券 | 46,679,757 | 36,844,270 |
| 合計 | 363,405,741 | 814,337,361 |

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年10月11日から平成26年3月6日まで、及び平成26年4月11日から平成26年9月8日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種 類 | 平成26年3月6日 現在 | | | | 平成26年9月8日 現在 | | | |
|------------------------------------|---------------|-----------|---------------|-------------|----------------|-----------|----------------|-------------|
| | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | (円) | うち 1年超 | | | (円) | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 為替予約取引 売 建 | 4,793,719,682 | - | 4,839,355,998 | 45,636,316 | 37,120,708,384 | - | 36,959,473,075 | 161,235,309 |

| | | | | | | | | |
|-------------|---------------|---|---------------|------------|----------------|---|----------------|-------------|
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 3,730,809,473 | - | 3,713,497,991 | 17,311,482 |
| イギリス・ポンド | 428,000,000 | - | 427,950,000 | 50,000 | 4,877,502,197 | - | 4,848,703,214 | 28,798,983 |
| オーストラリア・ドル | 1,632,200,000 | - | 1,663,740,000 | 31,540,000 | 429,063,919 | - | 435,302,757 | 6,238,838 |
| カナダ・ドル | 458,100,000 | - | 463,950,000 | 5,850,000 | 1,257,510,000 | - | 1,254,500,000 | 3,010,000 |
| スウェーデン・クローナ | - | - | - | - | 5,670,800,000 | - | 5,627,800,000 | 43,000,000 |
| ノルウェー・クローネ | - | - | - | - | 4,178,791,575 | - | 4,144,071,645 | 34,719,930 |
| ポーランド・ズロチ | 504,150,000 | - | 503,850,000 | 300,000 | 7,721,944,707 | - | 7,729,550,816 | 7,606,109 |
| ユーロ | 1,771,269,682 | - | 1,779,865,998 | 8,596,316 | 9,254,286,513 | - | 9,206,046,652 | 48,239,861 |
| 買建 | 4,556,575,122 | - | 4,588,832,187 | 32,257,065 | 36,448,374,665 | - | 36,270,166,057 | 178,208,608 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 5,939,024,303 | - | 5,999,711,122 | 60,686,819 |
| イギリス・ポンド | 962,250,000 | - | 964,627,865 | 2,377,865 | 7,727,242,351 | - | 7,629,561,494 | 97,680,857 |
| オーストラリア・ドル | - | - | - | - | 488,294,949 | - | 491,850,000 | 3,555,051 |
| カナダ・ドル | 1,598,500,000 | - | 1,621,229,663 | 22,729,663 | 2,055,060,986 | - | 2,074,190,000 | 19,129,014 |
| スウェーデン・クローナ | - | - | - | - | 3,795,786,729 | - | 3,761,740,000 | 34,046,729 |
| ノルウェー・クローネ | - | - | - | - | 7,962,772,272 | - | 7,929,961,893 | 32,810,379 |
| ポーランド・ズロチ | 836,625,122 | - | 839,750,000 | 3,124,878 | 4,087,641,575 | - | 4,061,541,579 | 26,099,996 |
| ユーロ | 1,159,200,000 | - | 1,163,224,659 | 4,024,659 | 4,392,551,500 | - | 4,321,609,969 | 70,941,531 |
| 合計 | 9,350,294,804 | - | 9,428,188,185 | 13,379,251 | 73,569,083,049 | - | 73,229,639,132 | 16,973,299 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1,5440円 (15,440円) | 1,6391円 (16,391円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------|--|----------------|----------------|----|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | 8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815 | 5,000,000.000 | 6,542,950.000 | |
| | | 8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815 | 10,000,000.000 | 13,864,800.000 | |
| | | 7.5% United States Treasury Note/Bond 20241115 | 7,500,000.000 | 10,942,950.000 | |
| | | 7.625% United States Treasury Note/Bond 20250215 | 10,000,000.000 | 14,778,900.000 | |
| | | 3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515 | 8,000,000.000 | 8,218,080.000 | |

| | | | | |
|---------------|--|----------------|--|--|
| | 2.625% US Treasury Inflation Indexed Bonds 20170715 | 15,000,000.000 | 18,994,371.250 | |
| | 0.125% US Treasury Inflation Indexed Bonds 20160415 | 5,000,000.000 | 5,489,776.060 | |
| | 5.95% Mexico Government International Bond 20190319 | 8,000,000.000 | 9,248,000.000 | |
| | 3.625% Mexico Government International Bond 20220315 | 5,000,000.000 | 5,180,000.000 | |
| | 4.75% Mexico Government International Bond 20440308 | 6,000,000.000 | 6,210,000.000 | |
| | 4% Mexico Government International Bond 20231002 | 12,000,000.000 | 12,663,000.000 | |
| | 5.55% Mexico Government International Bond 20450121 | 3,000,000.000 | 3,468,000.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | | アメリカ・ドル 115,600,827.310 (12,148,490,943) | |
| イギリス・ポンド | 4.25% United Kingdom Gilt 20551207 | 8,000,000.000 | 10,238,400.000 | |
| | 1.875% United Kingdom Gilt Inflation Linked 20221122 | 10,500,000.000 | 16,016,851.300 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | | イギリス・ポンド 26,255,251.300 (4,477,833,109) | |
| オーストラリア・ドル | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615 | 11,200,000.000 | 11,612,272.000 | |
| | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421 | 18,500,000.000 | 20,493,745.000 | |
| | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421 | 5,000,000.000 | 4,678,000.000 | |
| | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421 | 8,000,000.000 | 7,797,360.000 | |
| | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421 | 4,000,000.000 | 4,276,800.000 | |
| | 3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250920 | 1,000,000.000 | 1,361,120.000 | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | | オーストラリア・ドル | |

| | | | | |
|----------------|--|-------------------------------|---|--|
| | | | 50,219,297.000 (4,941,076,631) | |
| カナダ・ドル | 11.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601 | カナダ・ドル 5,000,000.000 | カナダ・ドル 5,370,700.000 | |
| | 10.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210315 | 2,500,000.000 | 3,852,725.000 | |
| | 8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601 | 2,000,000.000 | 2,964,420.000 | |
| | 3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601 | 13,000,000.000 | 14,326,000.000 | |
| | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201 | 12,000,000.000 | 14,109,120.000 | |
| カナダ・ドル 小計 | | | カナダ・ドル 40,622,965.000 (3,920,522,353) | |
| スウェーデン・クローナ | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330 | スウェーデン・クローナ 95,000,000.000 | スウェーデン・クローナ 122,103,500.000 | |
| | 1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113 | 38,000,000.000 | 38,721,240.000 | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | | | スウェーデン・クローナ 160,824,740.000 (2,381,814,400) | |
| ポーランド・ズロチ | 5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425 | ポーランド・ズロチ 24,000,000.000 | ポーランド・ズロチ 30,914,400.000 | |
| | 4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025 | 73,000,000.000 | 79,229,090.000 | |
| | 3.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20190725 | 65,000,000.000 | 68,150,550.000 | |
| ポーランド・ズロチ 小計 | | | ポーランド・ズロチ 178,294,040.000 (5,814,168,645) | |
| ユーロ | 5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328 | ユーロ 21,600,000.000 | ユーロ 31,580,712.000 | |
| | 2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20240622 | 10,000,000.000 | 11,244,600.000 | |

| | | | | | | |
|------------|--|--|------------------------------|---|---|--|
| | | 5.4% IRISH TREASURY 20250313 | 29,000,000.000 | 38,790,400.000 | | |
| | | 3.4% IRISH TREASURY 20240318 | 41,000,000.000 | 47,303,340.000 | | |
| | ユーロ 小計 | | | ユーロ 128,919,052.000 (17,543,304,596) | | |
| 国債証券 合計 | | | | 51,227,210,677 [51,227,210,677] | | |
| 特殊債券 | オーストラリア・ドル | 6.25% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20210519 | 2,350,000.000 | 2,692,935.500 | | |
| | | 5.5% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20220209 | 10,000,000.000 | 11,055,800.000 | | |
| | | 6.5% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20190807 | 10,000,000.000 | 11,352,200.000 | | |
| | | 6% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20200806 | 6,000,000.000 | 6,742,560.000 | | |
| | | 5% ASIAN DEVELOPMENT BANK 20220309 | 4,509,000.000 | 4,857,410.430 | | |
| | オーストラリア・ドル 小計 | | | | オーストラリア・ドル 36,700,905.930 (3,611,002,135) | |
| | カナダ・ドル | 4.1% CANADA HOUSING TRUST 20181215 | カナダ・ドル 15,000,000.000 | カナダ・ドル 16,463,250.000 | | |
| | | 2.9% CANADA HOUSING TRUST 20240615 | 12,000,000.000 | 12,350,280.000 | | |
| | | 1.875% INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT 20190530 | 5,000,000.000 | 5,029,700.000 | | |
| | | 4.4% INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 20260126 | 5,000,000.000 | 5,621,650.000 | | |
| | カナダ・ドル 小計 | | | | カナダ・ドル 39,464,880.000 (3,808,755,569) | |
| ノルウェー・クローネ | 3.625% INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT 20200622 | ノルウェー・クローネ 75,000,000.000 | ノルウェー・クローネ 81,034,500.000 | | | |
| | ノルウェー・クローネ 小計 | | | ノルウェー・クローネ 81,034,500.000 (1,354,896,840) | | |

| | | | |
|---------|--|------------------------------------|--|
| 特殊債券 合計 | | 8,774,654,544 [8,774,654,544] | |
| 合計 | | 60,001,865,221 [60,001,865,221] | |

- (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 12銘柄 | 100% | 20.2% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 2銘柄 | 100% | 7.5% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 6銘柄 特殊債券 5銘柄 | 100% | 14.3% |
| カナダ・ドル | 国債証券 5銘柄 特殊債券 4銘柄 | 100% | 12.9% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 2銘柄 | 100% | 4.0% |
| ノルウェー・クローネ | 特殊債券 1銘柄 | 100% | 2.3% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 3銘柄 | 100% | 9.7% |
| ユーロ | 国債証券 4銘柄 | 100% | 29.1% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|---------|-----------------|-----------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,309,149,582 | 822,681,542 |
| 国債証券 | 316,982,433,989 | 354,497,421,450 |
| 未収入金 | 173,551,500 | - |
| 未収利息 | 2,920,004,772 | 3,225,862,667 |

| | | | |
|-----------------|---|-----------------|-----------------|
| 前払費用 | | 196,489,658 | 113,919,069 |
| 流動資産合計 | | 321,581,629,501 | 358,659,884,728 |
| 資産合計 | | 321,581,629,501 | 358,659,884,728 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 211,250,000 | - |
| 未払解約金 | | 12,218,953 | 43,332,307 |
| 流動負債合計 | | 223,468,953 | 43,332,307 |
| 負債合計 | | 223,468,953 | 43,332,307 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 270,494,585,662 | 299,199,767,674 |
| 剰余金 | | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 50,863,574,886 | 59,416,784,747 |
| 元本等合計 | | 321,358,160,548 | 358,616,552,421 |
| 純資産合計 | | 321,358,160,548 | 358,616,552,421 |
| 負債純資産合計 | | 321,581,629,501 | 358,659,884,728 |

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26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-----------|------------------|------------------|
| 1. 1期首 | 平成25年9月7日 | 平成26年3月7日 |
| 期首元本額 | 254,968,668,879円 | 270,494,585,662円 |
| 期中追加設定元本額 | 24,990,681,796円 | 39,560,880,037円 |
| 期中一部解約元本額 | 9,464,765,013円 | 10,855,698,025円 |
| 期末元本額の内訳 | | |

| ファンド名 | | |
|---|------------------|------------------|
| ダイワ日本国債ファンドV A （適格機関投資家専用） | 16,499,776円 | 14,947,237円 |
| ダイワ日本国債ファンド （FOFs用）（適格機関投資家 専用） | 4,485,816,933円 | 122,646,980円 |
| 安定重視ポートフォリオ（奇 数月分配型） | 486,592,501円 | 455,483,483円 |
| 6資産バランスファンド（分 配型） | 566,444,365円 | 535,400,224円 |
| 6資産バランスファンド（成 長型） | 269,690,354円 | 260,454,772円 |
| ダイワ日本国債ファンド（毎 月分配型） | 262,245,080,862円 | 293,886,347,031円 |
| 世界6資産均等分散ファンド （毎月分配型） | 259,919,888円 | 236,419,925円 |
| ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド | 110,323,179円 | 102,785,294円 |
| ダイワ日本国債ファンド（年1 回決算型） | 1,247,830,366円 | 3,005,909,599円 |
| ダイワ・ニッポン応援ファン ドVol.4 - 日本の真価 - （国 債コース） | 806,387,438円 | 579,373,129円 |
| 計 | 270,494,585,662円 | 299,199,767,674円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 270,494,585,662口 | 299,199,767,674口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |

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

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 平成26年9月8日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種 類 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|------|------------------------|------------------------|
| | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 2,581,894,156 | 783,843,140 |
| 合計 | 2,581,894,156 | 783,843,140 |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年3月12日から平成26年3月6日まで、及び平成26年3月11日から平成26年9月8日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-------------|-------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(1口当たり情報)

| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.1880円 (11,880円) | 1.1986円 (11,986円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|-------------|----------------|----------------|----------------|----|
| 国債証券 | 2 6 5 1 0 年国債 | 100,000,000 | 100,406,000 | |
| | 2 7 0 1 0 年国債 | 1,200,000,000 | 1,211,712,000 | |
| | 2 8 1 1 0 年国債 | 1,900,000,000 | 1,965,018,000 | |
| | 2 8 5 1 0 年国債 | 200,000,000 | 208,184,000 | |
| | 2 8 7 1 0 年国債 | 950,000,000 | 997,870,500 | |
| | 2 9 2 1 0 年国債 | 1,200,000,000 | 1,267,848,000 | |
| | 2 7 利付国債 2 0 年 | 11,346,000,000 | 11,364,380,520 | |
| | 2 8 利付国債 2 0 年 | 9,963,000,000 | 10,220,443,920 | |
| | 2 9 利付国債 2 0 年 | 9,750,000,000 | 10,165,545,000 | |
| | 3 0 利付国債 2 0 年 | 690,000,000 | 715,819,800 | |
| | 3 2 利付国債 2 0 年 | 9,543,000,000 | 10,071,777,630 | |
| | 3 3 利付国債 2 0 年 | 10,694,000,000 | 11,502,680,280 | |
| | 3 4 利付国債 2 0 年 | 9,219,000,000 | 10,015,429,410 | |
| | 3 5 利付国債 2 0 年 | 300,000,000 | 324,405,000 | |
| | 3 6 利付国債 2 0 年 | 770,000,000 | 837,898,600 | |
| | 3 7 利付国債 2 0 年 | 9,823,000,000 | 10,718,857,600 | |
| | 3 8 利付国債 2 0 年 | 9,426,000,000 | 10,288,196,220 | |
| | 4 0 2 0 年国債 | 10,542,000,000 | 11,465,373,780 | |
| | 4 2 2 0 年国債 | 10,518,000,000 | 11,683,604,760 | |
| | 4 3 2 0 年国債 | 10,272,000,000 | 11,681,421,120 | |
| | 4 4 2 0 年国債 | 9,285,000,000 | 10,471,623,000 | |
| | 4 6 2 0 年国債 | 800,000,000 | 892,704,000 | |
| | 4 7 2 0 年国債 | 4,430,000,000 | 4,960,846,900 | |
| | 4 8 2 0 年国債 | 6,101,000,000 | 6,971,185,630 | |
| | 4 9 2 0 年国債 | 5,218,000,000 | 5,849,378,000 | |
| | 5 1 2 0 年国債 | 5,550,000,000 | 6,203,512,500 | |
| 5 2 2 0 年国債 | 7,118,000,000 | 8,022,199,540 | | |

| | | | | |
|---------|-------|----------------|-----------------|--|
| 5 4 | 20年国債 | 3,987,000,000 | 4,532,900,040 | |
| 5 5 | 20年国債 | 4,304,000,000 | 4,844,281,120 | |
| 5 6 | 20年国債 | 5,870,000,000 | 6,620,655,600 | |
| 5 8 | 20年国債 | 7,175,000,000 | 8,046,475,500 | |
| 5 9 | 20年国債 | 4,495,000,000 | 4,979,066,550 | |
| 6 1 | 20年国債 | 4,000,000,000 | 4,199,520,000 | |
| 6 3 | 20年国債 | 6,108,000,000 | 6,832,897,440 | |
| 6 4 | 20年国債 | 3,235,000,000 | 3,652,994,350 | |
| 6 5 | 20年国債 | 2,877,000,000 | 3,252,822,510 | |
| 6 8 | 20年国債 | 4,705,000,000 | 5,454,365,350 | |
| 7 0 | 20年国債 | 9,888,000,000 | 11,671,498,560 | |
| 7 2 | 20年国債 | 2,250,000,000 | 2,594,970,000 | |
| 7 4 | 20年国債 | 3,915,000,000 | 4,520,611,350 | |
| 7 5 | 20年国債 | 3,974,000,000 | 4,595,851,520 | |
| 7 7 | 20年国債 | 236,000,000 | 270,441,840 | |
| 8 0 | 20年国債 | 10,423,000,000 | 12,066,394,410 | |
| 8 2 | 20年国債 | 3,985,000,000 | 4,617,578,900 | |
| 8 3 | 20年国債 | 3,810,000,000 | 4,418,266,500 | |
| 8 6 | 20年国債 | 4,850,000,000 | 5,735,561,500 | |
| 8 8 | 20年国債 | 7,860,000,000 | 9,303,960,600 | |
| 9 1 | 20年国債 | 6,100,000,000 | 7,230,818,000 | |
| 9 2 | 20年国債 | 2,720,000,000 | 3,163,006,400 | |
| 9 4 | 20年国債 | 3,700,000,000 | 4,303,840,000 | |
| 9 5 | 20年国債 | 7,905,000,000 | 9,388,136,100 | |
| 9 7 | 20年国債 | 4,440,000,000 | 5,222,638,800 | |
| 9 9 | 20年国債 | 2,400,000,000 | 2,792,880,000 | |
| 1 0 1 | 20年国債 | 4,960,000,000 | 5,961,126,400 | |
| 1 0 2 | 20年国債 | 8,320,000,000 | 10,002,720,000 | |
| 1 0 6 | 20年国債 | 4,440,000,000 | 5,223,926,400 | |
| 1 0 7 | 20年国債 | 1,800,000,000 | 2,093,112,000 | |
| 1 1 0 | 20年国債 | 5,650,000,000 | 6,562,983,500 | |
| 1 1 1 | 20年国債 | 8,650,000,000 | 10,162,798,500 | |
| 国債証券 合計 | | | 354,497,421,450 | |
| 合計 | | | 354,497,421,450 | |

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。

「ダイワ外国ハーモニースtock・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26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-----------------|---------------|---------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 75,443,478 | 58,091,066 |
| コール・ローン | 6,392,921 | 12,322,717 |
| 株式 | 2,539,861,208 | 2,436,464,672 |
| 派生商品評価勘定 | - | 2,000 |
| 未収入金 | - | 115,175,118 |
| 未収配当金 | 2,017,304 | 3,352,561 |
| 流動資産合計 | 2,623,714,911 | 2,625,408,134 |
| 資産合計 | 2,623,714,911 | 2,625,408,134 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 37,850 | 14,565 |
| 未払金 | - | 82,501,277 |
| 未払解約金 | 6,000,000 | 4,000,000 |
| 流動負債合計 | 6,037,850 | 86,515,842 |
| 負債合計 | 6,037,850 | 86,515,842 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,716,404,441 | 1,573,524,242 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 901,272,620 | 965,368,050 |
| 元本等合計 | 2,617,677,061 | 2,538,892,292 |
| 純資産合計 | 2,617,677,061 | 2,538,892,292 |
| 負債純資産合計 | 2,623,714,911 | 2,625,408,134 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-----------|----------------|----------------|
| 1. 1期首 | 平成25年9月7日 | 平成26年3月7日 |
| 期首元本額 | 2,093,068,666円 | 1,716,404,441円 |
| 期中追加設定元本額 | - 円 | 13,309,544円 |
| 期中一部解約元本額 | 376,664,225円 | 156,189,743円 |

| 期末元本額の内訳 | | |
|-----------------------|----------------|----------------|
| ファンド名 | | |
| 6 資産バランスファンド（分配型） | 447,324,538円 | 409,193,558円 |
| 6 資産バランスファンド（成長型） | 1,064,529,721円 | 984,298,823円 |
| 世界6 資産均等分散ファンド（毎月分配型） | 204,550,182円 | 180,031,861円 |
| 計 | 1,716,404,441円 | 1,573,524,242円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 1,716,404,441口 | 1,573,524,242口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|----------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 平成26年9月8日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-----|------------------------|------------------------|
| | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） |
| 株式 | 296,294,422 | 164,944,565 |
| 合計 | 296,294,422 | 164,944,565 |

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年9月7日から平成26年3月6日まで、及び平成26年3月7日から平成26年9月8日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種 類 | 平成26年3月6日 現在 | | | | 平成26年9月8日 現在 | | | |
|-----------|--------------|-----------|------------|-------------|--------------|-----------|------------|-------------|
| | 契約額等 | | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 | | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| | （円） | うち 1年超 | | | （円） | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 25,559,650 | - | 25,597,500 | 37,850 | 34,110,000 | - | 34,108,000 | 2,000 |
| アメリカ・ドル | 25,559,650 | - | 25,597,500 | 37,850 | - | - | - | - |
| イギリス・ポンド | - | - | - | - | 34,110,000 | - | 34,108,000 | 2,000 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------|---|------------|--------|------------|---|------------|--------|
| 買建 | - | - | - | - | 34,110,000 | - | 34,095,435 | 14,565 |
| ユーロ | - | - | - | - | 34,110,000 | - | 34,095,435 | 14,565 |
| 合計 | 25,559,650 | - | 25,597,500 | 37,850 | 68,220,000 | - | 68,203,435 | 12,565 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.5251円 (15,251円) | 1.6135円 (16,135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 | |
| | FIRST SOLAR INC | 4,700 | 71.470 | 335,909.000 | |
| | ALCOA | 40,000 | 17.280 | 691,200.000 | |
| | APPLE INC | 5,900 | 98.970 | 583,923.000 | |
| | CALGON CARBON CORP | 16,000 | 21.100 | 337,600.000 | |

| | | | | | |
|-------------|---------------------------|---------|----------|--|--|
| | WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 7,800 | 81.850 | 638,430.000 | |
| | CUMMINS INC | 2,800 | 142.620 | 399,336.000 | |
| | FORD MOTOR CO | 33,000 | 17.140 | 565,620.000 | |
| | FREEMPORT-MCMORAN INC | 10,000 | 35.020 | 350,200.000 | |
| | US BANCORP | 7,000 | 42.130 | 294,910.000 | |
| | GOOGLE INC-CL C | 1,000 | 586.080 | 586,080.000 | |
| | 3M CO | 3,500 | 144.200 | 504,700.000 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 6,500 | 80.350 | 522,275.000 | |
| | CHEVRON CORP | 3,000 | 127.400 | 382,200.000 | |
| | SYMANTEC CORP | 10,000 | 24.390 | 243,900.000 | |
| | TRW INC | 4,500 | 100.210 | 450,945.000 | |
| | UNION PACIFIC CORP | 8,200 | 107.690 | 883,058.000 | |
| | UNITEDHEALTH GROUP INC | 4,500 | 87.750 | 394,875.000 | |
| | THE WALT DISNEY CO. | 5,000 | 90.940 | 454,700.000 | |
| | PPG INDUSTRIES INC | 2,500 | 203.960 | 509,900.000 | |
| | NVIDIA CORP | 40,000 | 19.970 | 798,800.000 | |
| | BANK OF AMERICA CORP | 33,000 | 16.020 | 528,660.000 | |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES L | 8,000 | 66.980 | 535,840.000 | |
| | GAP INC | 8,000 | 44.650 | 357,200.000 | |
| | STATE STREET CORP | 7,000 | 72.660 | 508,620.000 | |
| | INTEL CORP | 16,000 | 35.000 | 560,000.000 | |
| | MICROSOFT CORP | 8,500 | 45.910 | 390,235.000 | |
| | CVS CAREMARK CORP | 9,200 | 81.640 | 751,088.000 | |
| | MICRON TECHNOLOGY INC | 18,000 | 32.940 | 592,920.000 | |
| | BALL CORP | 4,000 | 66.330 | 265,320.000 | |
| | MOHAWK INDUSTRIES INC | 3,700 | 148.120 | 548,044.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | | | アメリカ・ドル 14,966,488.000 (1,572,828,224) | |
| イギリス・ポンド | | 株 | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド | |
| | REED ELSEVIER PLC | 17,000 | 9.900 | 168,300.000 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 135,000 | 2.417 | 326,295.000 | |
| | ITV PLC | 40,000 | 2.204 | 88,160.000 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | | | イギリス・ポンド 582,755.000 (99,388,865) | |
| カナダ・ドル | | 株 | カナダ・ドル | カナダ・ドル | |
| | BANK OF MONTREAL | 10,000 | 84.340 | 843,400.000 | |
| | CANADIAN PACIFIC RAILWAY | 4,000 | 225.340 | 901,360.000 | |

| | | | | | |
|----------------|--------------------------|---------|------------|---|--|
| カナダ・ドル 小計 | | | | カナダ・ドル 1,744,760.000 (168,386,788) | |
| ノルウェー・ク ローネ | | 株 | ノルウェー・クローネ | ノルウェー・クローネ | |
| | DNB ASA | 20,000 | 115.700 | 2,314,000.000 | |
| ノルウェー・クローネ 小計 | | | | ノルウェー・クローネ 2,314,000.000 (38,690,080) | |
| ユーロ | | 株 | ユーロ | ユーロ | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE | 6,000 | 92.050 | 552,300.000 | |
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 40,000 | 9.047 | 361,880.000 | |
| | NORDEX SE | 15,000 | 14.480 | 217,200.000 | |
| | TOTAL SA | 8,000 | 51.410 | 411,280.000 | |
| | VALEO | 2,700 | 94.940 | 256,338.000 | |
| | AXA | 10,000 | 19.425 | 194,250.000 | |
| | DASSAULT SYSTEMS SA | 7,000 | 51.460 | 360,220.000 | |
| | INTESA SANPAOLO | 150,000 | 2.458 | 368,700.000 | |
| | BANCO BILBAO VIZCAYA | 46,000 | 9.752 | 448,592.000 | |
| | GAMESA CORP TECNOLOGICA | 25,000 | 9.865 | 246,625.000 | |
| | ENAGAS | 18,000 | 26.165 | 470,970.000 | |
| | NOKIA OYJ | 32,000 | 6.440 | 206,080.000 | |
| ユーロ 小計 | | | | ユーロ 4,094,435.000 (557,170,715) | |
| 合計 | | | | 2,436,464,672 [2,436,464,672] | |

(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 |
|------------|---------|--------------|----------------|
| アメリカ・ドル | 株式 30銘柄 | 100% | 64.5% |
| イギリス・ポンド | 株式 3銘柄 | 100% | 4.1% |
| カナダ・ドル | 株式 2銘柄 | 100% | 6.9% |
| ノルウェー・クローネ | 株式 1銘柄 | 100% | 1.6% |

| | | | | |
|-----|----|------|------|-------|
| ユーロ | 株式 | 12銘柄 | 100% | 22.9% |
|-----|----|------|------|-------|

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ日本ハーモニースtock・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26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-----------------|-----------------|---------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 89,525,293 | 72,806,428 |
| 株式 | 2,535,131,050 | 2,393,661,800 |
| 未収入金 | 37,460,665 | 53,374,340 |
| 未収配当金 | 1,598,400 | 1,255,500 |
| 流動資産合計 | 2,663,715,408 | 2,521,098,068 |
| 資産合計 | 2,663,715,408 | 2,521,098,068 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 39,832,627 | 16,478,467 |
| 未払解約金 | - | 9,000,000 |
| 流動負債合計 | 39,832,627 | 25,478,467 |
| 負債合計 | 39,832,627 | 25,478,467 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 3,134,726,183 | 2,795,375,050 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 2 510,843,402 | 299,755,449 |
| 元本等合計 | 2,623,882,781 | 2,495,619,601 |
| 純資産合計 | 2,623,882,781 | 2,495,619,601 |
| 負債純資産合計 | 2,663,715,408 | 2,521,098,068 |

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26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|----------------------|---|---|
| 1. 1 期首 | 平成25年9月7日 | 平成26年3月7日 |
| 期首元本額 | 3,566,135,839円 | 3,134,726,183円 |
| 期中追加設定元本額 | 121,981,906円 | 47,891,930円 |
| 期中一部解約元本額 | 553,391,562円 | 387,243,063円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| 6 資産バランスファンド（分配型） | 825,498,499円 | 725,470,441円 |
| 6 資産バランスファンド（成長型） | 1,936,099,575円 | 1,749,412,698円 |
| 世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型） | 373,128,109円 | 320,491,911円 |
| 計 | 3,134,726,183円 | 2,795,375,050円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 3,134,726,183口 | 2,795,375,050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510,843,402円であり ます。 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は299,755,449円であり ます。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 平成26年9月8日現在 |
|------------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-----|------------------------|------------------------|
| | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） |
| 株式 | 209,507,494 | 171,179,027 |
| 合計 | 209,507,494 | 171,179,027 |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成25年9月7日から平成26年3月6日まで、及び平成26年3月7日から平成26年9月8日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-------------|-------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(1口当たり情報)

| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.8370円 (8,370円) | 0.8928円 (8,928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 | |
| 国際石油開発帝石 | 18,800 | 1,479.00 | 27,805,200 | |
| 大成建設 | 75,000 | 625.00 | 46,875,000 | |
| 大林組 | 35,000 | 788.00 | 27,580,000 | |
| 前田建設 | 30,000 | 926.00 | 27,780,000 | |
| 大和ハウス | 18,000 | 1,935.50 | 34,839,000 | |
| 積水ハウス | 9,000 | 1,314.50 | 11,830,500 | |
| 日揮 | 9,000 | 2,996.50 | 26,968,500 | |
| 総合警備保障 | 2,000 | 2,529.00 | 5,058,000 | |
| セブン&アイ・HLDGS | 7,000 | 4,125.00 | 28,875,000 | |
| 帝人 | 60,000 | 260.00 | 15,600,000 | |
| 東レ | 20,000 | 720.20 | 14,404,000 | |
| 三菱総合研究所 | 3,000 | 2,493.00 | 7,479,000 | |
| 電気化学 | 30,000 | 350.00 | 10,500,000 | |
| 三菱ケミカルHLDGS | 60,000 | 532.10 | 31,926,000 | |
| 積水化学 | 15,000 | 1,243.00 | 18,645,000 | |
| 中外製薬 | 11,000 | 3,140.00 | 34,540,000 | |
| 東洋インキSCホールディング | 90,000 | 495.00 | 44,550,000 | |
| オリエンタルランド | 3,000 | 20,200.00 | 60,600,000 | |
| ヤフー | 20,000 | 415.00 | 8,300,000 | |

| | | | |
|------------------|--------|-----------|------------|
| J Xホールディングス | 80,000 | 522.10 | 41,768,000 |
| ブリヂストン | 2,500 | 3,583.50 | 8,958,750 |
| 日本碍子 | 10,000 | 2,672.00 | 26,720,000 |
| D O W Aホールディングス | 34,000 | 901.00 | 30,634,000 |
| 住友電工 | 22,000 | 1,560.00 | 34,320,000 |
| サト - ホールディングス | 6,500 | 2,880.00 | 18,720,000 |
| C K D | 50,000 | 984.00 | 49,200,000 |
| ジェイテクト | 20,000 | 1,650.00 | 33,000,000 |
| ミネベア | 40,000 | 1,356.00 | 54,240,000 |
| 日 立 | 75,000 | 806.80 | 60,510,000 |
| 三菱電機 | 35,000 | 1,371.00 | 47,985,000 |
| 富士電機 | 65,000 | 531.00 | 34,515,000 |
| マキタ | 5,000 | 6,060.00 | 30,300,000 |
| 日本電産 | 8,600 | 6,875.00 | 59,125,000 |
| 富 士 通 | 40,000 | 708.70 | 28,348,000 |
| セイコーエプソン | 13,500 | 5,590.00 | 75,465,000 |
| アルプス電気 | 31,000 | 1,636.00 | 50,716,000 |
| シスメックス | 6,000 | 4,050.00 | 24,300,000 |
| デンソー | 2,000 | 4,747.00 | 9,494,000 |
| カ シ オ | 24,000 | 1,759.00 | 42,216,000 |
| 日東電工 | 5,500 | 5,496.00 | 30,228,000 |
| トヨタ自動車 | 13,000 | 6,107.00 | 79,391,000 |
| 三菱自動車工業 | 26,000 | 1,219.00 | 31,694,000 |
| マ ッ ダ | 22,000 | 2,529.00 | 55,638,000 |
| 本田技研 | 7,000 | 3,553.00 | 24,871,000 |
| 良品計画 | 4,000 | 12,150.00 | 48,600,000 |
| 黒田電気 | 17,000 | 1,569.00 | 26,673,000 |
| トプコン | 20,000 | 2,473.00 | 49,460,000 |
| バンダイナムコH L D G S | 23,000 | 2,793.00 | 64,239,000 |
| 三井物産 | 12,000 | 1,714.00 | 20,568,000 |
| 住友商事 | 29,000 | 1,360.00 | 39,440,000 |
| 三菱商事 | 24,000 | 2,195.50 | 52,692,000 |
| 阪和興業 | 80,000 | 415.00 | 33,200,000 |
| カ ス ミ | 20,000 | 867.00 | 17,340,000 |
| アクシアル リテイリング | 1,500 | 1,970.00 | 2,955,000 |
| 三菱U F JフィナンシャルG | 95,000 | 610.40 | 57,988,000 |
| 三井住友フィナンシャルG | 9,100 | 4,328.50 | 39,389,350 |
| 静岡銀行 | 10,000 | 1,103.00 | 11,030,000 |
| スルガ銀行 | 6,000 | 1,993.00 | 11,958,000 |
| オリックス | 35,000 | 1,588.00 | 55,580,000 |

| | | | | |
|-------------|---------|-----------|---------------|--|
| 野村ホールディングス | 30,000 | 681.80 | 20,454,000 | |
| 東京海上HD | 7,700 | 3,221.00 | 24,801,700 | |
| 三井不動産 | 8,000 | 3,430.50 | 27,444,000 | |
| 三菱地所 | 10,000 | 2,451.50 | 24,515,000 | |
| 東京急行 | 31,000 | 734.00 | 22,754,000 | |
| 京王電鉄 | 48,000 | 803.00 | 38,544,000 | |
| 西日本旅客鉄道 | 8,500 | 4,896.00 | 41,616,000 | |
| 日本郵船 | 140,000 | 301.00 | 42,140,000 | |
| 日本電信電話 | 1,500 | 6,914.00 | 10,371,000 | |
| KDDI | 6,000 | 6,193.00 | 37,158,000 | |
| 建設技術研究所 | 25,300 | 1,686.00 | 42,655,800 | |
| ファーストリテイリング | 300 | 33,960.00 | 10,188,000 | |
| ソフトバンク | 7,000 | 7,628.00 | 53,396,000 | |
| 合計 | | | 2,393,661,800 | |

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「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26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|----------|-----------------|-----------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 2,716,474,471 | 2,018,097,229 |
| コール・ローン | 1,637,080,163 | 1,978,650,085 |
| 投資証券 | 164,134,315,840 | 161,321,106,432 |
| 派生商品評価勘定 | 3,733,708 | 478,443 |
| 未収入金 | 1,119,341,577 | 1,496,297,304 |
| 未収配当金 | 118,159,409 | 149,022,021 |
| 流動資産合計 | 169,729,105,168 | 166,963,651,514 |

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 資産合計 | 169,729,105,168 | 166,963,651,514 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 13,017,240 | 600,624 |
| 未払金 | 1,215,978,608 | 884,318,369 |
| 未払解約金 | 328,500,000 | 492,487,000 |
| 流動負債合計 | 1,557,495,848 | 1,377,405,993 |
| 負債合計 | 1,557,495,848 | 1,377,405,993 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 113,655,042,864 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 54,516,566,456 | 66,258,324,402 |
| 元本等合計 | 168,171,609,320 | 165,586,245,521 |
| 純資産合計 | 168,171,609,320 | 165,586,245,521 |
| 負債純資産合計 | 169,729,105,168 | 166,963,651,514 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 |

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

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|------------------------------|------------------|------------------|
| 1. 1 期首 | 平成25年9月7日 | 平成26年3月7日 |
| 期首元本額 | 136,420,547,686円 | 113,655,042,864円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,833,367,863円 | 565,827,839円 |
| 期中一部解約元本額 | 24,598,872,685円 | 14,892,949,584円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ・グローバルREIT・オープン（毎月分配型） | 102,557,139,453円 | 89,622,911,013円 |
| ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株） | 80,122,137円 | 75,761,257円 |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 56,900,722円 | 47,149,616円 |
| インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 64,543,866円 | 53,608,138円 |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 300,001,698円 | 252,759,642円 |
| 6資産バランスファンド（分配型） | 465,882,824円 | 393,541,544円 |
| 6資産バランスファンド（成長型） | 883,402,316円 | 757,474,719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) | 62,463,891円 | 46,134,405円 |
| りそな ワールド・リート・ ファンド | 5,091,471,539円 | 4,370,268,252円 |
| 世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型) | 212,497,866円 | 173,184,459円 |
| 『しがぎん』S R I三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型) | 15,111,036円 | 12,450,264円 |
| 常陽3分法ファンド | 927,731,539円 | 786,307,474円 |
| ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型) | 201,109,345円 | 163,688,651円 |
| ダイワ・海外株式& R E I T ファンド(毎月分配型) | 57,841,407円 | 49,705,398円 |
| スマート・インカム・ balan ス | 211,292円 | 182,170円 |
| ワールドアセット(安定コー ス) | 137,318円 | - 円 |
| ワールドアセット(分散コー ス) | 155,658円 | - 円 |
| D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース) | 184,666,088円 | 180,215,749円 |
| D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス) | 225,228,929円 | 237,057,996円 |
| D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース) | 214,132,525円 | 226,917,568円 |
| ダイワ・グローバル R E I T ファンド(ダイワ S M A 専 用) | 666,765,592円 | 690,590,486円 |
| ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(分配 型) | 1,368,507,557円 | 1,154,421,042円 |
| ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(部分為替ヘッジあ り) | 8,164,726円 | 14,801,305円 |
| ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし) | 10,853,540円 | 18,789,971円 |
| 計 | 113,655,042,864円 | 99,327,921,119円 |

| | | |
|------------------|------------------|-----------------|
| 2. 期末日における受益権の総数 | 113,655,042,864口 | 99,327,921,119口 |
|------------------|------------------|-----------------|

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|--------------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 平成26年9月8日現在 |
|------------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 |

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|------|------------------------|------------------------|
| | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 11,612,319,332 | 14,465,802,669 |
| 合計 | 11,612,319,332 | 14,465,802,669 |

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年9月18日から平成26年3月6日まで、及び平成26年3月18日から平成26年9月8日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種 類 | 平成26年3月6日 現在 | | | | 平成26年9月8日 現在 | | | |
|----------------|---------------|-----------|---------------|-------------|--------------|-----------|-------------|-------------|
| | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | (円) | うち 1年超 | | | (円) | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の 取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 1,368,358,954 | - | 1,378,766,543 | 10,407,589 | 466,303,309 | - | 466,233,035 | 70,274 |
| アメリカ・ドル | 823,804,611 | - | 832,504,482 | 8,699,871 | 387,911,957 | - | 387,846,279 | 65,678 |
| イギリス・ポンド | - | - | - | - | 78,391,352 | - | 78,386,756 | 4,596 |
| オーストラリア・ ドル | 544,554,343 | - | 546,262,061 | 1,707,718 | - | - | - | - |
| 買 建 | 1,368,358,954 | - | 1,369,483,011 | 1,124,057 | 466,303,309 | - | 466,110,854 | 192,455 |
| アメリカ・ドル | 544,554,343 | - | 542,055,699 | 2,498,644 | 78,391,352 | - | 78,799,521 | 408,169 |
| シンガポール・ ドル | - | - | - | - | 58,503,416 | - | 58,438,660 | 64,756 |
| ユーロ | 823,804,611 | - | 827,427,312 | 3,622,701 | 329,408,541 | - | 328,872,673 | 535,868 |

| | | | | | | | | |
|----|---------------|---|---------------|-----------|-------------|---|-------------|---------|
| | | | | | | | | |
| 合計 | 2,736,717,908 | - | 2,748,249,554 | 9,283,532 | 932,606,618 | - | 932,343,889 | 122,181 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|--------------|-------------|-------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.4797円 | 1.6671円 |
| (1万口当たり純資産額) | (14,797円) | (16,671円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------|--------------------------|---------|----------------|----|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | | | アメリカ・ドル | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 369,602 | 64,007,674.360 | |
| | | APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 740,608 | 25,795,376.640 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 332,690 | 35,857,328.200 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 471,560 | 31,717,125.600 | |
| | | HOST HOTELS&RESORTS INC | 366,741 | 8,332,355.520 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 433,200 | 7,866,912.000 | |

| | | | |
|---------------------------|-----------|----------------|--|
| CYRUSONE INC | 324,387 | 8,515,158.750 | |
| KIMCO REALTY CORP | 345,743 | 8,159,534.800 | |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERI | 699,749 | 8,746,862.500 | |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 252,033 | 8,906,846.220 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST | 244,002 | 3,989,432.700 | |
| VENTAS INC | 420,294 | 27,739,404.000 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP | 342,791 | 8,103,579.240 | |
| AMERICAN REALTY CAP PROP | 1,049,043 | 14,015,214.480 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 143,044 | 7,751,554.360 | |
| PROLOGIS INC | 953,716 | 39,350,322.160 | |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 492,762 | 7,933,468.200 | |
| MACK-CALI REALTY CORP | 369,321 | 7,921,935.450 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 125,280 | 24,493,492.800 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY | 486,764 | 8,878,575.360 | |
| GLIMCHER REALTY TRUST | 1,072,311 | 12,106,391.190 | |
| HOME PROPERTIES INC | 222,203 | 14,232,102.150 | |
| KILROY REALTY CORP | 321,073 | 20,490,878.860 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 144,754 | 5,283,521.000 | |
| MACERICH CO/THE | 297,889 | 19,815,576.280 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTI | 412,492 | 12,048,891.320 | |
| PARKWAY PROPERTIES INC | 397,165 | 8,268,975.300 | |
| POST PROPERTIES INC | 131,892 | 7,323,962.760 | |
| PUBLIC STORAGE | 112,023 | 19,787,742.720 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 498,008 | 28,839,643.280 | |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTI | 632,299 | 10,919,803.730 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 314,647 | 34,258,765.360 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 210,202 | 16,141,411.580 | |
| UDR INC | 714,767 | 21,643,144.760 | |
| WEINGARTEN REALTY INVESTO | 591,278 | 20,203,969.260 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTOR | 251,732 | 9,424,846.080 | |
| STRATEGIC HOTELS&RESORTS | 1,076,438 | 13,003,371.040 | |
| CUBESMART | 872,576 | 16,570,218.240 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS | 1,735,255 | 25,612,363.800 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 573,262 | 31,139,591.840 | |
| EDUCATION REALTY TRUST | 772,566 | 8,475,049.020 | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY | 1,820,668 | 24,724,671.440 | |
| DOUGLAS EMMETT | 546,991 | 15,775,220.440 | |
| RETAIL PROPERTIES OF AME- | 767,808 | 12,277,249.920 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | アメリカ・ドル | |

| | | | |
|------------|---------------------------|------------|---|
| | | | 766,449,514.710 (80,546,179,501) |
| イギリス・ポンド | | | イギリス・ポンド |
| | LAND SECURITIES PLC | 3,765,574 | 40,705,854.940 |
| | SEGREO PLC | 2,448,425 | 9,002,858.720 |
| | HAMMERSON PLC | 6,447,709 | 39,556,694.710 |
| | BRITISH LAND CO PLC | 1,169,783 | 8,568,660.470 |
| | DERWENT LONDON PLC | 674,943 | 18,918,652.290 |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 1,607,348 | 8,535,017.880 |
| イギリス・ポンド | 小計 | | イギリス・ポンド 125,287,739.010 (21,367,823,887) |
| オーストラリア・ドル | | | オーストラリア・ドル |
| | SCENTRE GROUP | 6,309,378 | 22,082,823.000 |
| | CFS RETAIL PROPERTY TRUST | 22,690,533 | 47,877,024.630 |
| | DEXUS PROPERTY GROUP | 44,862,662 | 53,835,194.400 |
| | MIRVAC GROUP | 4,072,894 | 7,473,760.490 |
| | WESTFIELD CORP | 8,801,113 | 67,064,481.060 |
| | GOODMAN GROUP | 9,898,935 | 54,246,163.800 |
| オーストラリア・ドル | 小計 | | オーストラリア・ドル 252,579,447.380 (24,851,291,828) |
| カナダ・ドル | | | カナダ・ドル |
| | CAN REAL ESTATE INVEST TR | 334,700 | 16,326,666.000 |
| | ALLIED PROPERTIES REAL ES | 451,217 | 16,180,641.620 |
| カナダ・ドル | 小計 | | カナダ・ドル 32,507,307.620 (3,137,280,258) |
| シンガポール・ドル | | | シンガポール・ドル |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV | 8,331,500 | 19,662,340.000 |
| | CAPITAMALL TRUST | 1,977,884 | 3,935,989.160 |
| | SUNTEC REIT | 15,704,555 | 28,503,767.320 |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 2,398,000 | 4,016,650.000 |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 8,861,000 | 17,323,255.000 |
| シンガポール・ドル | 小計 | | シンガポール・ドル 73,442,001.480 (6,157,377,404) |
| ユーロ | | | ユーロ |
| | ALSTRIA OFFICE REIT | 884,877 | 9,025,745.400 |

| | | | | |
|------|--------------------------|------------|---|--|
| | WERELDHAVE NV | 43,502 | 3,045,575.020 | |
| | CORIO NV | 518,238 | 21,535,380.090 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 229,789 | 47,382,491.800 | |
| | NIEUWE STEEN INVESTMENTS | 2,377,983 | 10,037,466.240 | |
| | GECINA SA | 163,003 | 17,767,327.000 | |
| | KLEPIERRE | 670,128 | 24,808,138.560 | |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE | 588,330 | 5,543,833.590 | |
| | ユーロ 小計 | | ユーロ 139,145,957.700 (18,934,981,924) | |
| | 香港・ドル | | 香港・ドル | |
| | FORTUNE REIT | 12,017,070 | 87,484,269.600 | |
| | LINK REIT | 6,407,420 | 300,507,998.000 | |
| | CHAMPION REIT | 22,312,376 | 78,539,563.520 | |
| | 香港・ドル 小計 | | 香港・ドル 466,531,831.120 (6,326,171,630) | |
| 投資証券 | 合計 | | 161,321,106,432 [161,321,106,432] | |
| 合計 | | | 161,321,106,432 [161,321,106,432] | |

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 44銘柄 | 100% | 50.1% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 6銘柄 | 100% | 13.2% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 6銘柄 | 100% | 15.4% |
| カナダ・ドル | 投資証券 2銘柄 | 100% | 1.9% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 5銘柄 | 100% | 3.8% |
| ユーロ | 投資証券 8銘柄 | 100% | 11.7% |
| 香港・ドル | 投資証券 3銘柄 | 100% | 3.9% |

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-----------------|------------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 475,471,502 | 1,181,578,968 |
| 投資証券 | 28,458,461,000 | 39,075,980,000 |
| 未収配当金 | 325,912,700 | 346,130,490 |
| 流動資産合計 | 29,259,845,202 | 40,603,689,458 |
| 資産合計 | 29,259,845,202 | 40,603,689,458 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 132,079,129 | 119,133,429 |
| 未払解約金 | 30,050,000 | 6,959,000 |
| 流動負債合計 | 162,129,129 | 126,092,429 |
| 負債合計 | 162,129,129 | 126,092,429 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 16,861,798,372 | 20,973,961,634 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 12,235,917,701 | 19,503,635,395 |
| 元本等合計 | 29,097,716,073 | 40,477,597,029 |
| 純資産合計 | 29,097,716,073 | 40,477,597,029 |
| 負債純資産合計 | 29,259,845,202 | 40,603,689,458 |

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26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|-----|----------------------------|

| | |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> |
| 2. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|--|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首 | 平成25年9月7日 | 平成26年3月7日 |
| 期首元本額 | 14,729,788,672円 | 16,861,798,372円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,024,103,675円 | 5,064,843,567円 |
| 期中一部解約元本額 | 892,093,975円 | 952,680,305円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 46,119,017円 | 39,585,635円 |
| インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 53,577,072円 | 45,402,553円 |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 248,825,386円 | 213,745,581円 |
| 6 資産バランスファンド（分配型） | 387,615,201円 | 334,048,380円 |
| 6 資産バランスファンド（成長型） | 737,902,693円 | 643,295,056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） | 52,346,367円 | 38,532,347円 |
| 世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型） | 177,236,923円 | 146,576,241円 |
| 『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型） | 6,181,258円 | 5,217,018円 |
| ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型） | 167,478,930円 | 140,035,373円 |

| | | |
|------------------------------|-----------------|-----------------|
| ワールドアセット(安定コース) | 111,315円 | -円 |
| ワールドアセット(分散コース) | 126,064円 | -円 |
| 成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-07 | -円 | 218,864,125円 |
| 成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-08 | -円 | 165,190,753円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) | 153,973,887円 | 153,613,815円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) | 187,415,376円 | 200,233,097円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) | 176,105,524円 | 191,873,106円 |
| DCダイワJ-REITアクティブファンド | 295,186,904円 | 350,617,506円 |
| ダイワファンドラップJ-REITセレクト | 12,910,680,364円 | 16,976,470,227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) | 302,130,217円 | 263,400,454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) | 96,981,708円 | 73,575,060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) | 474,437,293円 | 403,221,407円 |
| ダイワJリート・ファンド | 387,366,873円 | 370,463,900円 |
| 計 | 16,861,798,372円 | 20,973,961,634円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 16,861,798,372口 | 20,973,961,634口 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自 平成26年3月7日 至 平成26年9月8日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |

| | |
|----------------------------|--|
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 平成26年9月8日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類 | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|------|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 1,236,788,488 | 2,706,871,875 |
| 合計 | 1,236,788,488 | 2,706,871,875 |

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年11月12日から平成26年3月6日まで、及び平成26年5月13日から平成26年9月8日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|-------------|-------------|
| | |

| | |
|-------------|-------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |
|-------------|-------------|

(1口当たり情報)

| | 平成26年3月6日現在 | 平成26年9月8日現在 |
|--------------|-------------|-------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.7257円 | 1.9299円 |
| (1万口当たり純資産額) | (17,257円) | (19,299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 | 1,200 | 447,000,000 | |
| | M I Dリート投資法人 | 1,000 | 254,000,000 | |
| | 森ヒルズリート | 9,400 | 1,369,580,000 | |
| | 野村不レジデンシャル | 100 | 56,500,000 | |
| | 産業ファンド | 1,000 | 934,000,000 | |
| | 大和ハウスリート | 1,000 | 493,000,000 | |
| | アドバンス・レジデンス | 4,500 | 1,111,500,000 | |
| | ケネディクスレジデンシャル | 2,000 | 536,600,000 | |
| | A P I投資法人 | 1,200 | 1,101,600,000 | |
| | G L P投資法人 | 8,200 | 1,024,180,000 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル | 2,400 | 465,120,000 | |
| | 日本プロロジスリート | 7,000 | 1,786,400,000 | |
| | N M F投資法人 | 8,000 | 1,102,400,000 | |
| | 星野リゾート・リート | 750 | 813,750,000 | |
| | S I A不動産投資 | 200 | 88,100,000 | |
| | イオンリート投資 | 4,000 | 575,200,000 | |
| | ヒューリックリート投資法 | 4,778 | 836,150,000 | |
| | 日本リート投資法人 | 1,000 | 284,600,000 | |
| | インベスコ・オフィス・Jリート | 5,000 | 503,000,000 | |
| | 日本ビルファンド | 6,300 | 3,483,900,000 | |
| | ジャパンリアルエステイト | 5,600 | 3,074,400,000 | |
| | 日本リテールファンド | 8,200 | 1,750,700,000 | |
| | オリックス不動産投資 | 8,000 | 1,095,200,000 | |
| 日本プライムリアルティ | 4,600 | 1,718,100,000 | | |

| | | | |
|-----------------------|--------|----------------|--|
| 東急リアル・エステート | 6,000 | 863,400,000 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 200 | 61,400,000 | |
| 野村不動産オフィスF | 400 | 194,800,000 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 12,000 | 1,959,600,000 | |
| 森トラスト総合リート | 8,000 | 1,522,400,000 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 15,000 | 488,250,000 | |
| フロンティア不動産投資 | 2,000 | 1,058,000,000 | |
| 平和不動産リート | 1,000 | 86,500,000 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 4,000 | 936,800,000 | |
| 福岡リート投資法人 | 3,000 | 602,700,000 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 2,400 | 1,315,200,000 | |
| 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 | 3,000 | 326,400,000 | |
| いちご不動産投資法人 | 1,000 | 75,600,000 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 1,900 | 1,065,900,000 | |
| 阪急リート投資法人 | 400 | 245,200,000 | |
| トップリート投資法人 | 500 | 233,750,000 | |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 1,000 | 456,500,000 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 22,000 | 1,390,400,000 | |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 6,000 | 459,000,000 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 6,000 | 829,200,000 | |
| 投資証券 合計 | | 39,075,980,000 | |
| 合計 | | 39,075,980,000 | |

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。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年9月30日

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,723,082,667円 |
| 負債総額 | 9,386,458円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,713,696,209円 |
| 発行済数量 | 1,998,636,276口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 0.8574円 |

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

平成26年9月30日

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 70,495,913,723円 |
| 負債総額 | 7,255,133,126円 |
| 純資産総額（ - ） | 63,240,780,597円 |
| 発行済数量 | 38,054,959,375口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 1.6618円 |

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

純資産額計算書

平成26年9月30日

| | |
|-----------------|------------------|
| 資産総額 | 368,489,385,333円 |
| 負債総額 | 1,990,927,433円 |
| 純資産総額（ - ） | 366,498,457,900円 |
| 発行済数量 | 305,553,668,492口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 1.1995円 |

(参考) ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド

純資産額計算書

平成26年9月30日

| | |
|------------------|----------------|
| 資産総額 | 2,546,207,499円 |
| 負債総額 | 46,789,876円 |
| 純資産総額（ - ） | 2,499,417,623円 |
| 発行済数量 | 1,531,116,669口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.6324円 |

(参考) ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

純資産額計算書

平成26年9月30日

| | |
|------------------|----------------|
| 資産総額 | 2,617,644,612円 |
| 負債総額 | 75,547,870円 |
| 純資産総額（ - ） | 2,542,096,742円 |
| 発行済数量 | 2,761,487,874口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 0.9206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26年9月30日

| | |
|------------------|------------------|
| 資産総額 | 161,276,129,266円 |
| 負債総額 | 1,743,409,554円 |
| 純資産総額（ - ） | 159,532,719,712円 |
| 発行済数量 | 98,052,786,173口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.6270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26年9月30日

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 44,465,818,850円 |
| 負債総額 | 1,086,433,751円 |
| 純資産総額（ - ） | 43,379,385,099円 |
| 発行済数量 | 21,794,750,687口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 1.9904円 |

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成26年9月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、3名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク会議

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の状況・運用リスク管理等の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成26年9月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

| 基本的性格 | 本数（本） | 純資産額の合計額（百万円） |
|------------|-------|---------------|
| 単位型株式投資信託 | 16 | 178,500 |
| 追加型株式投資信託 | 528 | 10,266,586 |
| 株式投資信託 合計 | 544 | 10,445,086 |
| 単位型公社債投資信託 | - | - |
| 追加型公社債投資信託 | 17 | 3,186,555 |
| 公社債投資信託 合計 | 17 | 3,186,555 |
| 総合計 | 561 | 13,631,641 |

3 【委託会社等の経理状況】

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

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

3．財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

| | 前事業年度 (平成25年3月31日現在) | 当事業年度 (平成26年3月31日現在) |
|---------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 14,380,327 | 15,186,222 |
| 有価証券 | 9,427,636 | 15,003,765 |
| 前払金 | 207 | 453 |
| 前払費用 | 142,919 | 157,453 |
| 未収入金 | 521,825 | - |
| 未収委託者報酬 | 7,183,011 | 8,265,950 |
| 未収収益 | 106,914 | 103,432 |
| 貯蔵品 | 9,551 | 14,492 |
| 繰延税金資産 | 491,727 | 674,141 |
| その他 | 8,445 | 597 |
| 流動資産計 | 32,272,567 | 39,406,511 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 1 | 1 |
| 建物（純額） | 254,258 | 252,417 |
| 器具備品（純額） | 26,257 | 23,555 |
| リース資産（純額） | 222,274 | 224,362 |
| リース資産（純額） | 5,726 | 4,499 |
| 無形固定資産 | 3,194,512 | 2,991,462 |
| ソフトウェア | 3,132,238 | 2,910,918 |
| ソフトウェア仮勘定 | 50,423 | 68,693 |
| 電話加入権 | 11,850 | 11,850 |
| 投資その他の資産 | 15,113,434 | 15,077,046 |

| | | | | |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 投資有価証券 | | 8,342,934 | | 8,338,733 |
| 関係会社株式 | | 5,141,069 | | 5,141,069 |
| 出資金 | | 136,315 | | 129,405 |
| 従業員に対する長期貸付金 | | 92,527 | | 68,396 |
| 差入保証金 | | 1,000,820 | | 997,594 |
| 長期前払費用 | | 7,376 | | 6,484 |
| 投資不動産（純額） | 1 | 402,340 | 1 | 398,402 |
| 貸倒引当金 | | 9,950 | | 3,040 |
| 固定資産計 | | 18,562,205 | | 18,320,926 |
| 資産合計 | | 50,834,773 | | 57,727,438 |

(単位:千円)

| | 前事業年度 (平成25年3月31日現在) | 当事業年度 (平成26年3月31日現在) |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| リース債務 | 1,227 | 1,227 |
| 預り金 | 56,491 | 53,677 |
| 未払金 | 6,795,899 | 8,998,456 |
| 未払収益分配金 | 10,333 | 7,931 |
| 未払償還金 | 113,002 | 77,698 |
| 未払手数料 | 3,764,501 | 4,277,412 |
| その他未払金 | 2,908,061 | 4,635,414 |
| 未払費用 | 3,383,551 | 3,463,796 |
| 未払法人税等 | 588,040 | 1,530,565 |
| 未払消費税等 | 189,139 | 530,831 |
| 賞与引当金 | 841,300 | 955,600 |
| 流動負債計 | 11,855,648 | 15,534,154 |
| 固定負債 | | |
| リース債務 | 4,494 | 3,272 |
| 退職給付引当金 | 1,935,442 | 1,959,451 |
| 役員退職慰労引当金 | 67,410 | 80,280 |
| 繰延税金負債 | 1,740,407 | 1,789,543 |
| 固定負債計 | 3,747,753 | 3,832,547 |
| 負債合計 | 15,603,402 | 19,366,702 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 15,174,272 | 15,174,272 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 11,495,727 | 11,495,727 |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 資本剰余金合計 | 11,495,727 | 11,495,727 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 374,297 | 374,297 |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | 7,722,723 | 10,821,849 |
| 利益剰余金合計 | 8,097,020 | 11,196,146 |
| 株主資本合計 | 34,767,020 | 37,866,146 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 464,350 | 494,589 |
| 評価・換算差額等合計 | 464,350 | 494,589 |
| 純資産合計 | 35,231,371 | 38,360,735 |
| 負債・純資産合計 | 50,834,773 | 57,727,438 |

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

| | 前事業年度 | | 当事業年度 | |
|----------|-------|-------------|-------|-------------|
| | (自 | 平成24年4月1日 | (自 | 平成25年4月1日 |
| | 至 | 平成25年3月31日) | 至 | 平成26年3月31日) |
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | | 73,498,726 | | 84,771,977 |
| その他営業収益 | | 526,465 | | 788,473 |
| 営業収益計 | | 74,025,191 | | 85,560,451 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | | 41,213,272 | | 47,520,063 |
| 広告宣伝費 | | 604,864 | | 668,841 |
| 公告費 | | 949 | | 533 |
| 受益証券発行費 | | - | | 25 |
| 調査費 | | 8,116,701 | | 8,246,807 |
| 調査費 | | 824,915 | | 741,792 |
| 委託調査費 | | 7,291,786 | | 7,505,015 |
| 委託計算費 | | 807,090 | | 735,588 |
| 営業雑経費 | | 1,280,599 | | 1,322,711 |
| 通信費 | | 206,564 | | 249,081 |
| 印刷費 | | 404,023 | | 477,092 |
| 協会費 | | 53,643 | | 54,190 |
| 諸会費 | | 11,281 | | 11,711 |
| その他営業雑経費 | | 605,086 | | 530,634 |
| 営業費用計 | | 52,023,478 | | 58,494,570 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | | 5,264,128 | | 5,708,541 |
| 役員報酬 | | 249,180 | | 243,000 |
| 給料・手当 | | 3,782,533 | | 3,785,717 |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 賞与 | 391,114 | 724,223 |
| 賞与引当金繰入額 | 841,300 | 955,600 |
| 福利厚生費 | 809,254 | 793,740 |
| 交際費 | 55,806 | 37,951 |
| 寄付金 | 636 | - |
| 旅費交通費 | 196,147 | 191,623 |
| 租税公課 | 206,178 | 222,767 |
| 不動産賃借料 | 887,968 | 1,182,703 |
| 退職給付費用 | 469,713 | 373,920 |
| 役員退職慰労引当金繰入額 | 38,970 | 33,750 |
| 固定資産減価償却費 | 1,181,438 | 963,183 |
| 諸経費 | 1,094,627 | 1,354,169 |
| 一般管理費計 | 10,204,869 | 10,862,351 |
| 営業利益 | 11,796,843 | 16,203,530 |

(単位:千円)

| | 前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) | | 当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) | |
|----------------|--|------------|--|------------|
| 営業外収益 | | | | |
| 受取配当金 | 1 | 257,704 | 1 | 144,660 |
| 有価証券利息 | | 11,102 | | 13,966 |
| 受取利息 | | 10,598 | | 9,117 |
| 時効成立分配金・償還金 | | 21,305 | | 44,877 |
| 投資有価証券売却益 | | 279,443 | | 64,122 |
| 有価証券償還益 | | 101,052 | | 63,228 |
| その他 | | 44,912 | | 34,445 |
| 営業外収益計 | | 726,118 | | 374,418 |
| 営業外費用 | | | | |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | | 19,392 | | 16,985 |
| 投資有価証券売却損 | | 36,469 | | 3,171 |
| 有価証券償還損 | | 33,338 | | 18,848 |
| 投資不動産管理費用 | | 16,271 | | 16,864 |
| 貯蔵品廃棄損 | | 9,990 | | 9,503 |
| その他 | | 13,120 | | 9,343 |
| 営業外費用計 | | 128,584 | | 74,716 |
| 経常利益 | | 12,394,377 | | 16,503,232 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 39,827 | | - |
| 固定資産売却益 | | 31 | | - |
| その他 | | 16,466 | | - |

| | | | | |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 特別利益計 | | 56,325 | | - |
| 特別損失 | | | | |
| 固定資産除却損 | 2 | 129,816 | 2 | 888 |
| 本社移転関連費用 | | 1,099,913 | | - |
| その他 | | 14,428 | | - |
| 特別損失計 | | 1,244,158 | | 888 |
| 税引前当期純利益 | | 11,206,544 | | 16,502,343 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 4,286,691 | | 6,525,874 |
| 法人税等調整額 | | 109,902 | | 150,022 |
| 法人税等合計 | | 4,176,789 | | 6,375,851 |
| 当期純利益 | | 7,029,755 | | 10,126,492 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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 | 利益剰余金 | | | |
| | | 資本準備金 | 利益準備金 | その他利益剰余金 繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 15,174,272 | 11,495,727 | 974,297 | 7,715,116 | 8,089,414 | 34,759,414 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | - | △7,022,149 | △7,022,149 | △7,022,149 |
| 当期純利益 | - | - | - | 7,029,755 | 7,029,755 | 7,029,755 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | - | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 7,606 | 7,606 | 7,606 |
| 当期末残高 | 15,174,272 | 11,495,727 | 974,297 | 7,722,723 | 8,097,020 | 34,767,020 |

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|---------------------|--------------|---------|------------|------------|
| | その他有価証券評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 33,879 | 53,783 | 87,663 | 34,847,077 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | - | △7,022,149 |
| 当期純利益 | - | - | - | 7,029,755 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 430,470 | △53,783 | 376,686 | 376,686 |
| 当期変動額合計 | 430,470 | △53,783 | 376,686 | 384,293 |
| 当期末残高 | 464,350 | - | 464,350 | 35,231,371 |

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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 | 利益剰余金 | | | |
| | | 資本準備金 | 利益準備金 | その他利益剰余金 繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 15,174,272 | 11,495,727 | 374,297 | 7,722,723 | 8,097,020 | 34,767,020 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | - | △7,027,366 | △7,027,366 | △7,027,366 |
| 当期純利益 | - | - | - | 10,126,492 | 10,126,492 | 10,126,492 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | - | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 3,099,125 | 3,099,125 | 3,099,125 |
| 当期末残高 | 15,174,272 | 11,495,727 | 374,297 | 10,821,849 | 11,196,146 | 37,866,146 |

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|---------------------|--------------|---------|------------|------------|
| | その他有価証券評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 464,350 | - | 464,350 | 35,231,371 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | - | △7,027,366 |
| 当期純利益 | - | - | - | 10,126,492 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 30,238 | - | 30,238 | 30,238 |
| 当期変動額合計 | 30,238 | - | 30,238 | 3,129,364 |
| 当期末残高 | 494,589 | - | 494,589 | 38,360,735 |

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～47年

器具備品 4～20年

（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、当事業年度より有形固定資産（投資不動産を含む）の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。

この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。

この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微です。

（２）無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（５年間）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。

（４）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

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

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

（３）退職給付引当金

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

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

（４）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「貯蔵品廃棄損」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた23,111千円は、「貯蔵品廃棄損」9,990千円、「その他」13,120千円として組替えております。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

| | 前事業年度 (平成25年3月31日現在) | 当事業年度 (平成26年3月31日現在) |
|--------|-------------------------|-------------------------|
| 建物 | 15,528千円 | 18,230千円 |
| 器具備品 | 250,072千円 | 249,761千円 |
| リース資産 | 409千円 | 1,636千円 |
| 投資建物 | 724,130千円 | 729,348千円 |
| 投資器具備品 | 23,691千円 | 24,180千円 |

2 関係会社項目

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

| | 前事業年度 (平成25年3月31日現在) | 当事業年度 (平成26年3月31日現在) |
|-----|-------------------------|-------------------------|
| 未払金 | 2,883,398千円 | 4,508,988千円 |

3 保証債務

前事業年度（平成25年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,591,590千円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成26年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719,900千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

| | 前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日) |
|-------|---|---|
| 受取配当金 | 185,280千円 | - |

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

| | 前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日) |
|-------------|---|---|
| 建物 | 546千円 | - |
| 器具備品 | 128,892千円 | 888千円 |
| 無形固定資産(その他) | 377千円 | - |
| 計 | 129,816千円 | 888千円 |

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成25年 6月24日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

| | |
|-----------|-------------|
| 剰余金の配当の総額 | 7,027百万円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 2,694円 |
| 基準日 | 平成25年 3月31日 |
| 効力発生日 | 平成25年 6月25日 |

当事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 剰余金の配当の 総額（百万円） | 1株当たり 配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|--------------------|-----------------|----------------|----------------|
| 平成25年6月24日 定時株主総会 | 普通株式 | 7,027 | 2,694 | 平成25年 3月31日 | 平成25年 6月25日 |

(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26年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

| | |
|-----------|------------|
| 剰余金の配当の総額 | 10,126百万円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 3,882円 |
| 基準日 | 平成26年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成26年6月26日 |

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

| | 貸借対照表 計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------------------|--------------|------------|----|
| (1) 現金・預金 | 14,380,327 | 14,380,327 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 7,183,011 | 7,183,011 | - |
| (3) 未収入金 | 521,825 | 521,825 | - |
| (4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 16,711,401 | 16,711,401 | - |
| 資産計 | 38,796,567 | 38,796,567 | - |
| (1) 未払手数料 | 3,764,501 | 3,764,501 | - |
| (2) その他未払金 | 2,908,061 | 2,908,061 | - |
| (3) 未払費用(*) | 2,782,587 | 2,782,587 | - |
| 負債計 | 9,455,149 | 9,455,149 | - |

(*) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度(平成26年3月31日現在)

(単位:千円)

| | 貸借対照表 計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------------------|--------------|------------|----|
| (1) 現金・預金 | 15,186,222 | 15,186,222 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 8,265,950 | 8,265,950 | - |
| (3) 未収入金 | - | - | - |
| (4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 22,283,329 | 22,283,329 | - |
| 資産計 | 45,735,503 | 45,735,503 | - |
| (1) 未払手数料 | 4,277,412 | 4,277,412 | - |
| (2) その他未払金 | 4,635,414 | 4,635,414 | - |
| (3) 未払費用(*) | 2,678,610 | 2,678,610 | - |
| 負債計 | 11,591,437 | 11,591,437 | - |

(*) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法

資 産

- (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、並びに(3) 未収入金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

- (4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

負 債

- (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

| 区分 | 前事業年度 (平成25年3月31日現在) | 当事業年度 (平成26年3月31日現在) |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| (1) 其他有価証券 非上場株式 | 1,059,169 | 1,059,169 |
| (2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式 | 5,141,069 | 5,141,069 |
| (3) 差入保証金 | 1,000,820 | 997,594 |

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日現在）

(単位：千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|----------------------------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金 | 14,380,327 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 7,183,011 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの | - | 1,434,397 | 4,840,276 | - |
| 合計 | 21,563,339 | 1,434,397 | 4,840,276 | - |

当事業年度（平成26年3月31日現在）

(単位：千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|--------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金 | 15,186,222 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 8,265,950 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |

| | | | | |
|-------------------|------------|-----------|-----------|--------|
| その他有価証券のうち満期があるもの | - | 1,498,464 | 3,978,251 | 97,038 |
| 合計 | 23,452,173 | 1,498,464 | 3,978,251 | 97,038 |

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成25年3月31日現在)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141,069千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成26年3月31日現在)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141,069千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(平成25年3月31日現在)

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| (1) 株式 | 93,459 | 55,101 | 38,357 |
| (2) その他 | | | |
| 証券投資信託の受益証券 | 6,224,312 | 5,440,857 | 783,455 |
| 小計 | 6,317,771 | 5,495,959 | 821,812 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | | | |
| 証券投資信託の受益証券 | 10,393,629 | 10,493,953 | 100,323 |
| 小計 | 10,393,629 | 10,493,953 | 100,323 |
| 合計 | 16,711,401 | 15,989,912 | 721,489 |

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059,169千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成26年3月31日現在)

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|---------------------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| (1) 株式 | 113,247 | 55,101 | 58,145 |
| (2) その他 | | | |
| 証券投資信託の受益証券 | 5,625,179 | 4,873,552 | 751,626 |
| 小計 | 5,738,426 | 4,928,653 | 809,772 |

| | | | |
|----------------------|------------|------------|---------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | | | |
| 証券投資信託の受益証券 | 16,544,903 | 16,586,202 | 41,299 |
| 小計 | 16,544,903 | 16,586,202 | 41,299 |
| 合計 | 22,283,329 | 21,514,856 | 768,472 |

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,059,169千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

| 種類 | 売却額 (千円) | 売却益の合計額 (千円) | 売却損の合計額 (千円) |
|-------------|-------------|-----------------|-----------------|
| (1) 株式 | 141,128 | 39,827 | - |
| (2) その他 | | | |
| 証券投資信託の受益証券 | 28,114,625 | 279,443 | 36,469 |
| 合計 | 28,255,753 | 319,271 | 36,469 |

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

| 種類 | 売却額 (千円) | 売却益の合計額 (千円) | 売却損の合計額 (千円) |
|-------------|-------------|-----------------|-----------------|
| その他 | | | |
| 証券投資信託の受益証券 | 24,501,921 | 64,122 | 3,171 |
| 合計 | 24,501,921 | 64,122 | 3,171 |

4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

| | |
|---------|-------------|
| 退職給付債務 | 1,935,442千円 |
| 退職給付引当金 | 1,935,442千円 |

3. 退職給付費用に関する事項

| | |
|--------|-----------|
| 勤務費用 | 301,777千円 |
| その他 | 167,935千円 |
| 退職給付費用 | 469,713千円 |

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | |
|--------------|-------------|
| 期首における退職給付債務 | 1,935,442千円 |
| 勤務費用 | 201,327千円 |
| 退職給付の支払額 | 177,317千円 |
| 期末における退職給付債務 | 1,959,451千円 |

(2)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

| | |
|---------------------|-------------|
| 積立型制度の退職給付債務 | - |
| 年金資産 | - |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 1,959,451千円 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 1,959,451千円 |
| 退職給付引当金 | 1,959,451千円 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 1,959,451千円 |

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | |
|-----------------|-----------|
| 勤務費用 | 201,327千円 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 201,327千円 |

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172,593千円でありました。

(表示方法の変更)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し（ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。）、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っておりません。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別内訳

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成25年3月31日現在) | 当事業年度 (平成26年3月31日現在) |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 減損損失 | 837,121 | 833,243 |
| 退職給付引当金 | 693,199 | 698,348 |
| 未払事業税 | 154,219 | 335,386 |
| 賞与引当金 | 280,855 | 287,721 |
| 連結法人間取引(譲渡損) | 264,269 | 141,925 |
| 投資有価証券評価損 | 128,953 | 128,953 |
| 繰延資産 | 157,330 | 121,437 |
| 出資金評価損 | 114,425 | 116,888 |
| 未払社会保険料 | 43,411 | 38,787 |
| 器具備品 | 33,316 | 33,316 |
| 役員退職慰労引当金 | 24,920 | 28,611 |
| その他 | 29,627 | 24,709 |
| 繰延税金資産小計 | 2,761,651 | 2,789,330 |
| 評価性引当額 | 1,323,069 | 1,200,725 |
| 繰延税金資産合計 | 1,438,582 | 1,588,604 |
| 繰延税金負債 | | |
| 連結法人間取引(譲渡益) | 2,428,233 | 2,428,233 |
| その他有価証券評価差額金 | 257,138 | 273,883 |
| その他 | 1,888 | 1,888 |
| 繰延税金負債合計 | 2,687,261 | 2,704,006 |
| 繰延税金負債の純額 | 1,248,679 | 1,115,401 |

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

この変更による影響は軽微であります。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金(百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(千円) | 科目 | 期末残高(千円) |
|-----|---|-----------|---------------|---------|-------------------|-----------|---------|-----------|----|----------|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. | Singapore | 133 | 金融商品取引業 | (所有)直接100.0 | 経営管理 | 債務保証(注) | 1,591,590 | - | - |

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金 (百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有 (被所有)割合 (%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-----|---|-----------|-------------------|---------|---------------------------|-----------|---------|--------------|----|--------------|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. | Singapore | 133 | 金融商品取引業 | (所有)直接100.0 | 経営管理 | 債務保証(注) | 1,719,900 | - | - |

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金または出資金 (百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有 (被所有)割合 (%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|---------------------|---------|--------------------|---------|---------------------------|-----------------|--------------|--------------|---------|--------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券(株) | 東京都千代田区 | 100,000 | 金融商品取引業 | - | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料 | 20,510,864 | 未払手数料 | 2,758,584 |
| 同一の親会社をもつ会社 | (株)大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区 | 3,000 | 情報サービス業 | - | ソフトウェアの開発 | ソフトウェアの購入 | 1,205,721 | 未払費用 | 82,519 |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和プロパティ(株) | 東京都中央区 | 100 | 不動産管理業 | - | 本社ビルの管理 | 不動産の賃借料 | 1,194,567 | 長期差入保証金 | 971,157 |
| | | | | | | | | | 未収入金 | 511,559 |

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金または出資金 (百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有 (被所有)割合 (%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|---------------------|---------|--------------------|---------|---------------------------|-----------------|--------------|--------------|-------|--------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券(株) | 東京都千代田区 | 100,000 | 金融商品取引業 | - | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料 | 25,994,992 | 未払手数料 | 3,216,077 |
| 同一の親会社をもつ会社 | (株)大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区 | 3,000 | 情報サービス業 | - | ソフトウェアの開発 | ソフトウェアの購入 | 678,054 | 未払費用 | 393,881 |

| | | | | | | | | | | |
|-------------|------------|--------|-----|--------|---|---------|---------|---------|---------|---------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和プロパティ(株) | 東京都中央区 | 100 | 不動産管理業 | - | 本社ビルの管理 | 不動産の賃借料 | 978,984 | 長期差入保証金 | 971,157 |
|-------------|------------|--------|-----|--------|---|---------|---------|---------|---------|---------|

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1 株当たり情報)

| 前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) | | 当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) | |
|--|------------|--|------------|
| 1株当たり純資産額 | 13,506.24円 | 1株当たり純資産額 | 14,705.91円 |
| 1株当たり当期純利益 | 2,694.91円 | 1株当たり当期純利益 | 3,882.07円 |

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

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

| | 前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) | 当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 当期純利益(千円) | 7,029,755 | 10,126,492 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 2,608,525 | 2,608,525 |

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成26年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

| 名 称 | 資本金の額 単位：百万円 （平成26年3月 末日現在） | 事業の内容 |
|--------------|--------------------------------------|-------|
| 株式会社関西アーバン銀行 | 47,039 | （注） |

（注）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

<参考> 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の投資顧問会社

名称 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

資本金の額 477千米ドル（約50百万円）（平成25年12月末日現在）

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないません。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せん。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<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26年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【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26年3月17日 | 臨時報告書 |
| 平成26年5月30日 | 有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第16特定期間）・ 同添付書類 |
| 平成26年6月16日 | 臨時報告書 |

独立監査人の監査報告書

平成26年 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | | |
|--------------------|-------|-------|---|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 高波 博之 | 印 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 貞廣 篤典 | 印 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 内田 和男 | 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注) 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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年10月10日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）の平成26年3月7日から平成26年9月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）の平成26年9月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。