

【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22年2月4日提出
【計算期間】 第5特定期間
（自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日）
【ファンド名】 ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）
（愛称：大黒柱）
【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 石橋 俊朗
【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【事務連絡者氏名】 長谷川 英男
【連絡場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【電話番号】 03-5695-2111
【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

<信託金の限度額>

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

<ファンドの特色>

1. マザーファンドを通じて、主として内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

◆各資産への投資は、それぞれ次のマザーファンドを通じて行ないます。

国内債券	ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド
国内短期債券	ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド
海外債券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド
国内株式	ダイワ好配当日本株マザーファンド
海外株式	ダイワ海外好配当株マザーファンド
国内リート	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
海外リート	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

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

マザーファンド方式について

当ファンドは、マザーファンド方式で運用を行ないます。

マザーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金を主として各マザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なうしくみです。

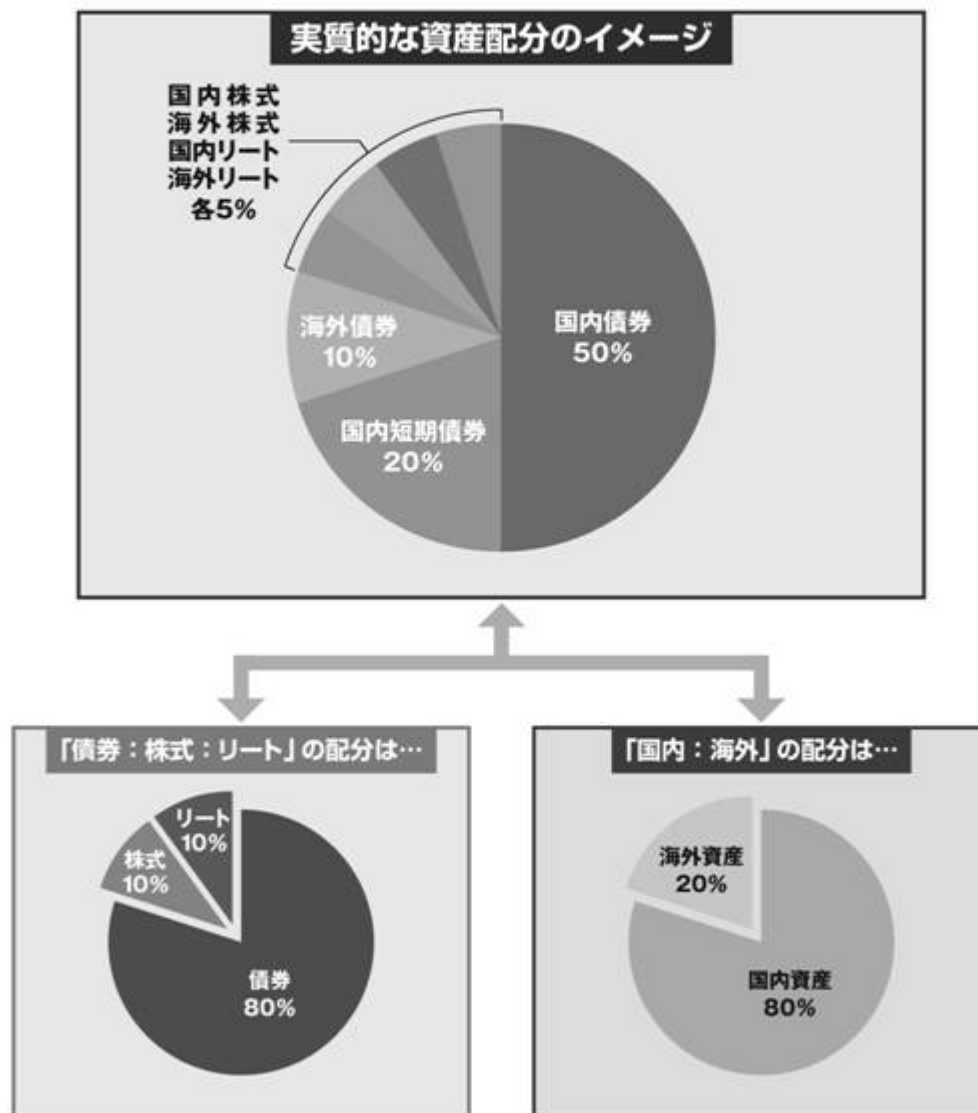


(注) 「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- ・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。
- ・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.

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



(注1) 各資産への投資は、マザーファンドを通じて行ないます。

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

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

〈分配方針〉

- ◆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行なうことを目標に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たうえで分配を行なうことがあります。
- ◆なお、分配対象額が少額の場合は分配を行なわない場合があります。

分配時期のイメージ



- 上記は、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。

各マザーファンドの投資態度等

1. ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド

- ①主としてわが国の円建ての公社債等(各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。)に投資し、ベンチマーク(NOMURA-BPI 総合指数)を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行ないます。
- ②運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債等の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

NOMURA-BPI 総合指数とは…

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

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

2. ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド

- ①主としてわが国の円建ての公社債等(各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。)に投資し、ベンチマーク(NOMURA-BPI 総合短期指数)を上回る投資成果をめざして運用を行ないます。
- ②運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債等の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

NOMURA-BPI 総合短期指数とは…

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

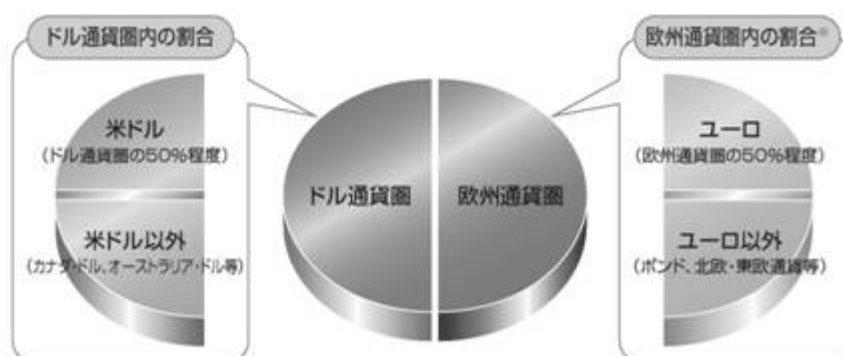
NOMURA-BPI 総合には、債券の残存期間別に短期・中期・長期などのサブ・インデックスがあり、NOMURA-BPI 総合短期(NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合短期)は、残存期間1年以上3年未満の短期の公募利付債市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の銘柄採用基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

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

3. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

- ①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。
- ②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。
- イ. 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
- ロ. 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。)
- ハ. 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。
- ニ. 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。
- ホ. 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。
- ③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。

ポートフォリオのイメージ図



※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。

4. ダイワ好配当日本株マザーファンド

- ①主としてわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。)に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。
- ②株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。
- ③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。
- ④J-REIT(不動産投資信託証券)に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。

5. ダイワ海外好配当株マザーファンド

- ①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(上場予定および店頭登録予定を含みます。)を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と株式の値上がり益の獲得により信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
- ②投資にあたっては、以下の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。
 - イ. アメリカ、ヨーロッパ、アジア・オセアニアの3地域に均等に投資することを基本とします。
 - ロ. 定量分析データ(S&P社クオリティランキング[※]等)を参考に、配当の質の高い企業を選定します。
 - ハ. 配当利回りの水準、時価総額規模、流動性を勘案します。
 - ニ. 定性分析に基づき利益や配当の継続性を考慮します。
- ③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
- ④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。

※…スタンダード・プアーズ(S&P社)のクオリティランキング(QR/IQR)は、企業の投資適格性を評価するための投資指標で、個別銘柄の中長期的な投資判断やポートフォリオの構築に利用されています。クオリティランキングは、一株当たり利益、一株当たり配当、売上高をもとに、独自のスコアリング手法に基づいて算出され、企業をA+、A、A-、B+、B、B-、C、Dの8つのランクで評価します。米国、日本その他世界各国の9,000銘柄以上にランキングが付与されています。

「Standard & Poor's」、「S&P」、「S&P Quality Rankings」、「S&P International Quality Ranking」はザ・マグロウ・ヒル・カンパニーズ社の登録商標であり、本商品の提供者である大和証券投資信託委託株式会社に対しては、その利用許諾が与えられています。スタンダード・プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関し、いかなる意思表示等を行なうものではありません。スタンダード・プアーズは、大和証券投資信託委託株式会社や本商品の投資家及びその他いかなる者に対しても、S&P Quality Ranking及びS&P International Quality Rankingその付随データの利用による結果に対して、明示的にも暗示的にも何ら保証等を行なうものではありません。スタンダード・プアーズは、S&P Quality Ranking及びS&P International Quality Rankingの利用や投資目的への適合性やその販売性等に関し、一切の保証等を行なうものではないことを明示的に表明しています。

6. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

- ①わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）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、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
- ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。
 - イ. 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。
 - ロ. 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。
- ③不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

7. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

- ①海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）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、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。
- ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。
 - イ. 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。
 - ロ. 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
- ③外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- ④不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
- ⑤外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

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

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) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金（※5）

お取扱窓口	販売会社 受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
↑ ↓ ※1	収益分配金、償還金など ↑ ↓ お申込金（※5）
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社 当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓ 運用指図 ↑ ↓ ※2	損益 ↑ ↓ 信託金（※5）
受託会社	住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社 信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益 ↑ ↓ 投資
投資対象	内外の公社債、株式および不動産投資信託証券 など ・マザ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・アンド・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、マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます（※4）。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

※3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。

※4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

※5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

<委託会社の概況（平成21年11月末日現在）>

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

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

1. ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンドの受益証券
3. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
4. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
5. ダイワ海外好配当株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
7. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券

② 投資態度

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

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

ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の50%

ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンドの受益証券

……………信託財産の純資産総額の20%

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10%
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券……………	信託財産の純資産総額の5%
ダイワ海外好配当株マザーファンドの受益証券……………	信託財産の純資産総額の5%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券	
	……………信託財産の純資産総額の5%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券	
	……………信託財産の純資産総額の5%

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

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

(2) 【投資対象】

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ、有価証券

ロ、約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ、為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

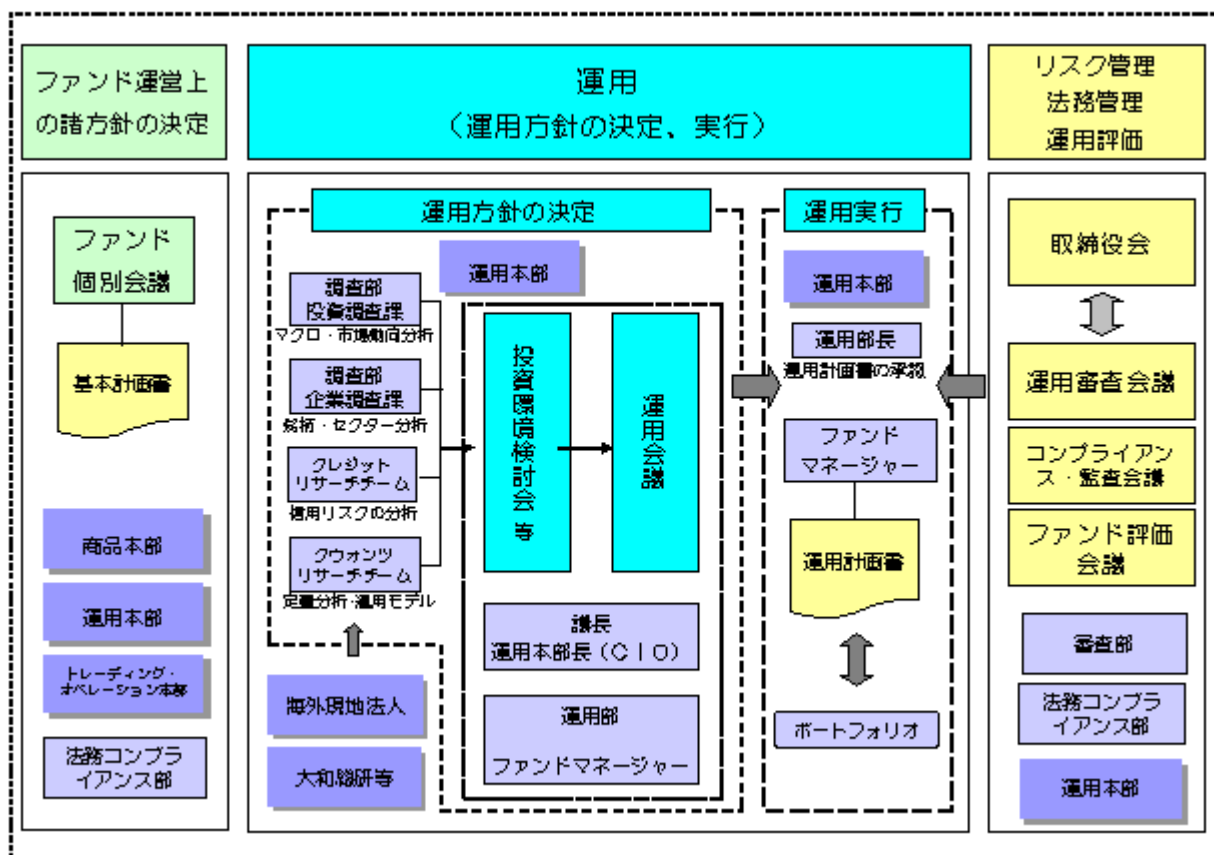
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ. 基本計画書の策定

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

ロ. 投資環境の検討

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

ハ. 基本的な運用方針の決定

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。

③ 職務権限

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

イ. 運用本部長（C I O）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ. 運用副本部長（1～5名程度）

C I Oを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ. 運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ. ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

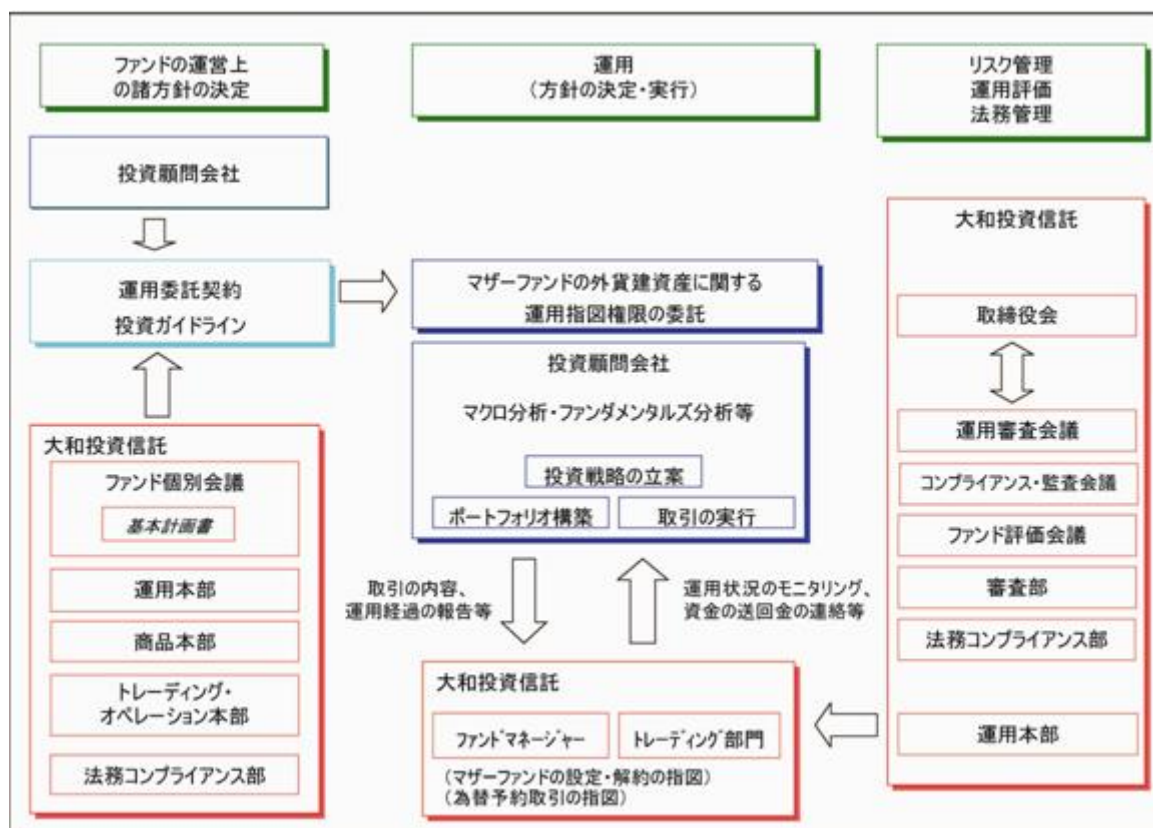
これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は15～25名程度です。

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 海外リート部分にかかる運用体制について

（ダイワ・グローバルREIT・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④に同じ。）

※ 上記の運用体制は平成21年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

- 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目標に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たうえで分配を行なうことがあります。なお、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

② 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

④ 外国為替予約取引（信託約款）

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

⑤ 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考>マザーファンドの概要

1. ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド

2. ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

<ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド>

① 主要投資対象

わが国の円建ての公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ. 主としてわが国の円建ての公社債等に投資し、ベンチマーク（NOMURA－BPI総合指数）を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

<ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド>

① 主要投資対象

（ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンドと同規定）

② 投資態度

イ. 主としてわが国の円建ての公社債等に投資し、ベンチマーク（NOMURA－BPI総合短期指数）を上回る投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ. ～ハ. （ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンドと同規定）

(2) 投資対象

<各ファンド共通>

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（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)⑤、⑥および⑦に定めるものに限りします。）

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 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. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

<各ファンド共通>

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資は、行ないません。

⑤ 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。）、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。

⑥ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑦ 金利先渡取引

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

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

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

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

ホ. 委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担

保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

3. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

② 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。

a. 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

b. 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。）。

c. 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A 3以上またはS & PでA－以上）とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてA A格相当以上（ムーディーズでA a 3以上またはS & PでA A－以上）とすることを基本とします。

d. 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。

e. 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。

ハ. 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。

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、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)

④、⑤および⑥に定めるものに限り、後掲(3)

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ④ 先物取引等
 - イ. 委託会社は、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。
- ⑤ スワップ取引
 - イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
 - ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- ⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引
 - イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
 - ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超え

ることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

4. ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ、有価証券

ロ、デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)③、④および⑤に定めるものに限ります。）

ハ、約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ、為替手形

② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（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書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 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. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 外貨建資産への直接投資は、行ないません。
- ③ 先物取引等

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

④ スワップ取引

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

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

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、

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

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

⑤ 金利先渡取引

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

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

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

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

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

5. ダイワ海外好配当株マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

イ、主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と株式の値上がり益の獲得により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。

- a. アメリカ、ヨーロッパ、アジア・オセアニアの3地域に均等に投資することを基本とします。
- b. 定量分析データ（S & P社クオリティランキング等）を参考に、配当の質の高い企業を選定します。
- c. 配当利回りの水準、時価総額規模、流動性を勘案します。
- d. 定性分析に基づき利益や配当の継続性を考慮します。

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%程度以上に維持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。

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、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)④、⑤および⑥に定めるものに限りします。）

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2.～10. （ダイワ好配当日本株マザーファンドと同規定）

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.～20. （ダイワ好配当日本株マザーファンドと同規定）

③ （ダイワ好配当日本株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④ 先物取引等

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

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

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

す。

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

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

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

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

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引

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

6. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

- イ. わが国の金融商品取引所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

- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

④ 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

7. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

- a. 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。
- b. 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
- ハ. 外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- ニ. 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
- ホ. 外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ヘ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1. （ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンドと同規定）
 - 2. （ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンドと同規定）
- ② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
 - 1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 - 2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
 - 3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - 5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 6. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ③ （ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

- ①～③（ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンドと同規定）
- ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

- ① 委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次のものに委託します。

コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

280 パーク・アベニュー、ニューヨーク、ニューヨーク州 10017

- ② 前①の規定にかかわらず、前①により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

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

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

〈基準価額の主な変動要因〉

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

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

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

③ リートの価格変動



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

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

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

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

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

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

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

④ 外国証券への投資に伴うリスク

イ. 為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ. カントリー・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。

⑤ その他

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

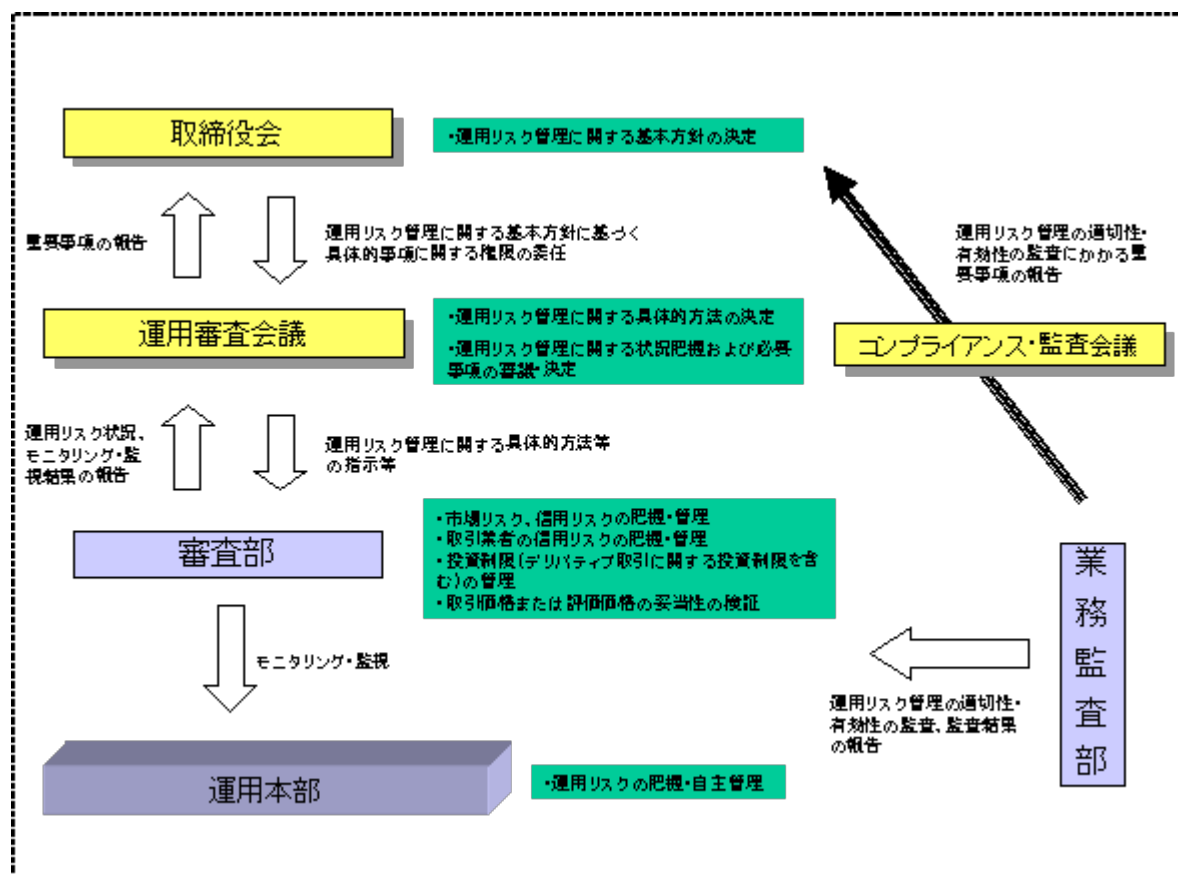
ロ. ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

- ① 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、1.05%（税抜1.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.672%（税抜0.64%）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。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.315% (税抜0.30%)	年0.315% (税抜0.30%)	年0.042% (税抜0.04%)

- ④ 前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。
- ⑤ 委託会社は、「ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該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0.57%
275億円超1,000億円以下の部分	年0.47%
1,000億円超2,500億円以下の部分	年0.37%
2,500億円超の部分	年0.30%

(4) 【その他の手数料等】

- ① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。
- ④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 【課税上の取扱い】

- ① 個人の受益者に対する課税

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、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。

ただし、平成21年1月1日から平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。

ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

ただし、平成21年1月1日から平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用されます。

ハ. 損益通算について

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

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。

② 法人の受益者に対する課税

法人の受益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、平成23年12月31日までは7%（所得税7%）、平成24年1月1日から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、特別分配金には課税されません。

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

- ① 受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ② 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行なうつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。
- ③ 受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

- ① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- ② 受益者が収益分配金を受取る際、イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

（※）税法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21年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	22,304,656	98.56
内 日本	22,304,656	98.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	325,405	1.44
純資産総額	22,630,061	100.00

（参考）ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	402,026,610	75.15
内 日本	402,026,610	75.15
地方債証券	10,459,890	1.96
内 日本	10,459,890	1.96
特殊債券	75,877,900	14.18
内 日本	75,877,900	14.18
社債券	23,823,653	4.45
内 日本	23,823,653	4.45
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	22,771,998	4.26
純資産総額	534,960,051	100.00

（参考）ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	99,837,960	31.75
内 日本	99,837,960	31.75
社債券	200,707,800	63.82
内 日本	200,707,800	63.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	13,937,154	4.43
純資産総額	314,482,914	100.00

（参考）ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	271,284,177,640	97.77
内 オーストラリア	44,046,416,593	15.87
内 カナダ	29,672,041,837	10.69
内 チェコ	4,828,147,997	1.74
内 デンマーク	1,955,438,590	0.70
内 ユーロ	61,882,085,831	22.30
内 英国	26,679,337,269	9.62

内 ノルウェー	12,163,505,641	4.38
内 ポーランド	20,590,409,124	7.42
内 スウェーデン	6,772,115,250	2.44
内 米国	62,694,679,508	22.60
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,173,796,138	2.23
純資産総額	277,457,973,778	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）	260,400,000	0.09
内 日本	260,400,000	0.09
為替予約取引（売建）	1,041,600,000	△0.38
内 日本	1,041,600,000	△0.38

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	24,595,686,750	92.01
内 日本	24,595,686,750	92.01
投資証券	888,376,000	3.32
内 日本	888,376,000	3.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,247,842,385	4.67
純資産総額	26,731,905,135	100.00

（参考）ダイワ海外好配当株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	8,519,535,379	96.28
内 オーストラリア	1,092,534,985	12.35
内 カナダ	118,301,901	1.34
内 スイス	205,123,533	2.32
内 デンマーク	20,151,250	0.23
内 ユーロ	1,489,362,889	16.83
内 英国	1,037,065,505	11.72
内 香港	702,376,638	7.94
内 韓国	308,119,900	3.48
内 スウェーデン	143,911,542	1.63
内 シンガポール	258,357,278	2.92
内 台湾	469,227,781	5.30
内 米国	2,675,002,176	30.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	328,969,221	3.72
純資産総額	8,848,504,600	100.00

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
投資証券	14,148,453,600	95.71
内 日本	14,148,453,600	95.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	634,104,896	4.29
純資産総額	14,782,558,496	100.00

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
投資証券	154,927,693,275	95.75
内 オーストラリア	30,126,466,884	18.62
内 カナダ	3,897,282,150	2.41
内 ユーロ	20,018,042,588	12.37
内 英国	16,885,165,002	10.44
内 香港	4,829,168,826	2.98
内 ニュージーランド	417,423,474	0.26
内 シンガポール	3,725,607,556	2.30
内 米国	75,028,536,795	46.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,872,301,977	4.25
純資産総額	161,799,995,252	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	2,077,852,948	1.28
内 日本	2,077,852,948	1.28
為替予約取引（売建）	81,804,824	△0.05
内 日本	81,804,824	△0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（2）【投資資産】（平成21年11月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	ダイワ日本債券アクティブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	10,783,612	1.04350 11,252,699	1.0548 11,374,553	— —	50.26%
2	ダイワ短期日本債券アクティ ブ・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 —	4,330,197	1.03680 4,489,548	1.0388 4,498,208	— —	19.88%
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 —	1,974,637	1.14970 2,270,240	1.1262 2,223,836	— —	9.83%

4	ダイワ海外好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 —	1,597,134	0.73290 1,170,539	0.6999 1,117,834	— —	4.94%
5	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 —	1,498,935	0.75700 1,134,693	0.7197 1,078,783	— —	4.77%
6	ダイワ好配当日本株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 —	1,095,294	0.98330 1,077,002	0.9303 1,018,952	— —	4.50%
7	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 —	1,329,347	0.81210 1,079,562	0.7466 992,490	— —	4.39%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.56%
合計	98.56%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	63 5年国債 日本	国債証券 —	105,000,000	102.16 107,268,440	102.17 107,285,850	1.200000 12/03/20	20.05%
2	301 10年国債 日本	国債証券 —	64,000,000	101.27 64,814,160	102.35 65,504,000	1.500000 19/06/20	12.24%
3	1 アフリカ開発銀行SUB 日本	特殊債券 —	30,000,000	115.84 34,754,910	115.47 34,642,020	5.100000 13/10/04	6.48%
4	287 10年国債 日本	国債証券 —	28,000,000	105.97 29,673,720	107.29 30,041,760	1.900000 17/06/20	5.62%
5	64 20年国債 日本	国債証券 —	27,000,000	100.39 27,105,300	102.63 27,711,720	1.900000 23/09/20	5.18%
6	26 30年国債 日本	国債証券 —	24,000,000	103.72 24,894,520	105.11 25,227,120	2.400000 37/03/20	4.72%
7	516 東京電力 日本	社債券 —	23,000,000	103.02 23,695,520	103.58 23,823,653	1.420000 15/04/27	4.45%
8	14 政保国民生活 日本	特殊債券 —	20,000,000	103.37 20,675,580	104.40 20,881,980	1.500000 14/09/17	3.90%

9	70 20年国債	日本	国債証券	—	19,000,000	107.85 20,492,570	108.47 20,611,010	2.400000 24/06/20	3.85%
10	319 政保道路債	日本	特殊債券	—	20,000,000	100.99 20,198,460	101.76 20,353,900	0.900000 13/08/22	3.80%
11	280 10年国債	日本	国債証券	—	14,000,000	106.73 14,942,200	107.17 15,004,360	1.900000 16/06/20	2.80%
12	94 20年国債	日本	国債証券	—	13,000,000	99.87 12,983,210	102.46 13,320,970	2.100000 27/03/20	2.49%
13	82 5年国債	日本	国債証券	—	13,000,000	101.25 13,163,300	101.83 13,237,900	0.900000 14/03/20	2.47%
14	67 5年国債	日本	国債証券	—	12,000,000	102.74 12,328,800	102.85 12,343,080	1.300000 12/09/20	2.31%
15	25 15年国債FR	日本	国債証券	—	11,000,000	98.35 10,818,500	98.30 10,813,000	0.750000 18/11/20	2.02%
16	108 20年国債	日本	国債証券	—	11,000,000	96.48 10,612,940	98.28 10,810,910	1.900000 28/12/20	2.02%
17	26 15年国債FR	日本	国債証券	—	11,000,000	97.75 10,752,500	97.70 10,747,000	0.610000 19/01/20	2.01%
18	18 共同発行地方	日本	地方債証券	—	10,000,000	103.52 10,352,630	104.59 10,459,890	1.600000 14/09/25	1.96%
19	37 15年国債FR	日本	国債証券	—	10,000,000	96.20 9,620,000	96.75 9,675,000	0.690000 20/11/20	1.81%
20	268 10年国債	日本	国債証券	—	9,000,000	103.51 9,316,800	104.67 9,420,300	1.500000 15/03/20	1.76%
21	296 10年国債	日本	国債証券	—	7,000,000	103.26 7,228,690	103.16 7,221,690	1.500000 18/09/20	1.35%
22	1 30年国債	日本	国債証券	—	5,000,000	109.97 5,498,600	112.78 5,639,250	2.800000 29/09/20	1.05%
23	28 30年国債	日本	国債証券	—	5,000,000	103.18 5,159,150	107.28 5,364,450	2.500000 38/03/20	1.00%
24	96 20年国債	日本	国債証券	—	2,000,000	101.43 2,028,640	102.36 2,047,240	2.100000 27/06/20	0.38%

（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	75.15%
地方債証券	1.96%
特殊債券	14.18%
社債券	4.45%
合計	95.74%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	19 三洋電機 日本	社債券 —	100,000,000	100.54 100,540,800	100.72 100,729,500	1.520000 11/08/26	32.03%
2	24 住友化学工業 日本	社債券 —	100,000,000	100.01 100,010,000	99.97 99,978,300	0.440000 10/06/10	31.79%
3	67 5年国債 日本	国債証券 —	30,000,000	102.83 30,850,400	102.85 30,857,700	1.300000 12/09/20	9.81%
4	85 5年国債 日本	国債証券 —	30,000,000	100.77 30,231,600	100.77 30,231,300	0.700000 14/09/20	9.61%
5	82 5年国債 日本	国債証券 —	15,000,000	101.30 15,195,050	101.83 15,274,500	0.900000 14/03/20	4.86%
6	69 5年国債 日本	国債証券 —	13,000,000	101.55 13,201,500	101.84 13,239,460	0.900000 12/12/20	4.21%
7	301 10年国債 日本	国債証券 —	10,000,000	100.76 10,076,100	102.35 10,235,000	1.500000 19/06/20	3.25%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	31.75%
社債券	63.82%
合計	95.57%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND オーストラリア	国債証券 —	36,944,250,000	101.68 37,567,499,498	104.04 38,438,644,913	5.750000 21/05/15	13.85%
2	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	18,360,315,000	139.08 25,536,444,118	141.87 26,048,696,906	7.500000 24/11/15	9.39%
3	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	14,504,996,000	141.94 20,589,006,208	140.26 20,346,157,889	8.000000 21/06/07	7.33%
4	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	19,532,250,000	102.72 20,064,334,262	102.87 20,093,802,188	4.375000 39/11/15	7.24%

5	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	16,276,250,000	103.16 16,792,044,363	103.06 16,774,791,538	5.000000 39/08/01	6.05%
6	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	13,021,000,000	112.78 14,685,734,850	114.32 14,885,607,200	4.750000 40/07/04	5.36%
7	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	11,190,272,000	106.63 11,932,187,034	108.76 12,171,099,341	4.250000 18/06/01	4.39%
8	POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド	国債証券 —	11,343,870,000	101.75 11,543,408,673	102.05 11,576,873,090	6.250000 15/10/24	4.17%
9	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	10,026,170,000	104.11 10,438,746,896	104.02 10,429,723,343	4.250000 19/02/01	3.76%
10	POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド	国債証券 —	8,472,600,000	101.69 8,615,793,216	101.65 8,612,567,352	6.000000 10/11/24	3.10%
11	BELGIUM GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	6,471,437,000	125.87 8,145,727,181	125.98 8,152,845,761	8.000000 15/03/28	2.94%
12	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	4,948,170,000	143.68 7,109,877,028	145.50 7,199,933,722	11.250000 15/02/15	2.59%
13	SPANISH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	5,859,450,000	114.39 6,703,035,017	114.47 6,707,722,577	5.500000 17/07/30	2.42%
14	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	4,271,052,000	141.48 6,042,855,212	144.01 6,150,955,538	8.125000 21/08/15	2.22%
15	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND オーストラリア	国債証券 —	5,561,500,000	100.72 5,601,669,920	100.83 5,607,771,680	5.250000 10/08/15	2.02%
16	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND ノルウェー	国債証券 —	5,005,245,000	110.27 5,519,483,871	110.99 5,555,771,898	6.500000 13/05/15	2.00%
17	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	3,718,840,320	131.63 4,895,397,544	132.77 4,937,727,423	10.250000 14/03/15	1.78%
18	Czech Republic Government Bond チェコ	国債証券 —	4,078,620,000	116.40 4,747,513,680	118.37 4,828,147,997	6.950000 16/01/26	1.74%
19	HELLENIC REPUBLIC ユーロ	国債証券 —	3,906,300,000	111.96 4,373,493,480	106.58 4,163,568,918	6.000000 19/07/19	1.50%
20	SWEDISH GOVERNMENT BOND スウェーデン	国債証券 —	3,423,750,000	117.50 4,023,155,250	118.08 4,042,900,950	6.750000 14/05/05	1.46%
21	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	3,612,672,000	105.24 3,802,012,140	107.37 3,879,070,433	4.000000 17/06/01	1.40%
22	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND ノルウェー	国債証券 —	3,349,605,000	106.25 3,559,156,289	107.27 3,593,322,260	5.000000 15/05/15	1.30%
23	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	3,583,250,000	98.24 3,520,363,963	99.32 3,558,883,900	4.000000 60/01/22	1.28%
24	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	2,015,232,000	157.28 3,169,556,890	159.45 3,213,368,033	9.000000 25/06/01	1.16%
25	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND ノルウェー	国債証券 —	2,912,700,000	102.04 2,972,264,715	103.49 3,014,411,484	4.250000 17/05/19	1.09%
26	SWEDISH GOVERNMENT BOND スウェーデン	国債証券 —	2,490,000,000	109.88 2,736,086,700	109.60 2,729,214,300	5.500000 12/10/08	0.98%

27	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	1,622,016,000	149.24 2,420,745,339	151.26 2,453,526,282	8.000000 27/06/01	0.88%
28	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	1,691,294,000	140.06 2,368,995,506	137.99 2,333,985,720	8.750000 17/08/25	0.84%
29	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	1,884,160,000	117.94 2,222,333,952	119.63 2,254,209,024	5.000000 37/06/01	0.81%
30	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	1,388,960,000	139.83 1,942,265,238	143.43 1,992,282,555	7.625000 25/02/15	0.72%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.77%
合計	97.77%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2009年12月	買建	3,000,000	258,420,000	260,400,000	0.09%
		ユーロ売/円買 2009年12月	売建	8,000,000	1,058,296,000	1,041,600,000	△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。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	249,000	3,620 901,380,000	3,440 856,560,000	— —	3.20%
2	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	217,000	3,822 829,460,170	3,750 813,750,000	— —	3.04%
3	キヤノン 日本	株式 電気機器	218,000	3,536 770,987,587	3,330 725,940,000	— —	2.72%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	174,900	3,250 568,448,887	2,850 498,465,000	— —	1.86%
5	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先 物取引業	798,900	638 510,318,881	622 496,915,800	— —	1.86%

6	本田技研 日本	株式 輸送用機器	155,000	2,810 435,550,000	2,700 418,500,000	— —	1.57%
7	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券 —	605	694,000 419,870,000	658,000 398,090,000	— —	1.49%
8	日東電工 日本	株式 化学	137,000	2,705 370,585,000	2,770 379,490,000	— —	1.42%
9	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	713,800	485 346,193,000	482 344,051,600	— —	1.29%
10	日鉄鉱業 日本	株式 鉱業	898,000	452 406,570,983	380 341,240,000	— —	1.28%
11	日本ハウズイング 日本	株式 サービス業	231,800	1,490 345,382,000	1,450 336,110,000	— —	1.26%
12	旭 化 成 日本	株式 化学	790,000	445 351,550,000	420 331,800,000	— —	1.24%
13	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	510,000	676 345,148,399	626 319,260,000	— —	1.19%
14	西日本シティ銀行 日本	株式 銀行業	1,344,000	214 287,616,000	237 318,528,000	— —	1.19%
15	フジクラ 日本	株式 非鉄金属	779,000	460 358,730,018	405 315,495,000	— —	1.18%
16	三井物産 日本	株式 卸売業	263,000	1,235 324,933,825	1,144 300,872,000	— —	1.13%
17	愛知製鋼 日本	株式 鉄鋼	783,000	403 315,549,000	382 299,106,000	— —	1.12%
18	アインファーマシーズ 日本	株式 小売業	124,600	2,505 312,123,000	2,345 292,187,000	— —	1.09%
19	綜研化学 日本	株式 化学	281,300	1,280 360,064,000	1,021 287,207,300	— —	1.07%
20	住友大阪セメント 日本	株式 ガラス・土石 製品	2,207,000	168 370,776,000	130 286,910,000	— —	1.07%
21	プレミアム投資法人 日本	投資証券 —	921	385,000 354,585,000	309,000 284,589,000	— —	1.06%
22	住友商事 日本	株式 卸売業	323,000	937 302,651,000	850 274,550,000	— —	1.03%
23	ダイコク電機 日本	株式 機械	158,600	1,823 289,127,800	1,686 267,399,600	— —	1.00%
24	日本トムソン 日本	株式 機械	637,000	500 319,063,773	413 263,081,000	— —	0.98%
25	太陽誘電 日本	株式 電気機器	295,000	1,066 314,699,091	887 261,665,000	— —	0.98%
26	東海東京HD 日本	株式 証券・商品先 物取引業	812,000	291 236,292,000	306 248,472,000	— —	0.93%
27	日本医療事務センター 日本	株式 サービス業	574,300	505 290,021,500	427 245,226,100	— —	0.92%
28	エディオン 日本	株式 小売業	330,000	738 243,540,000	704 232,320,000	— —	0.87%
29	コカカラファイン HD 日本	株式 小売業	126,500	2,290 289,685,000	1,809 228,838,500	— —	0.86%
30	ファースト住建 日本	株式 不動産業	363,600	656 238,554,670	619 225,068,400	— —	0.84%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

株式	92.01%
投資証券	3.32%
合計	95.33%

（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	1.28%
建設業	1.95%
食料品	2.30%
繊維製品	0.62%
パルプ・紙	0.72%
化学	8.32%
医薬品	1.91%
石油・石炭製品	0.30%
ゴム製品	1.18%
ガラス・土石製品	3.54%
鉄鋼	2.64%
非鉄金属	1.90%
金属製品	2.74%
機械	3.95%
電気機器	8.98%
輸送用機器	9.51%
精密機器	0.78%
その他製品	0.93%
陸運業	2.81%
海運業	0.42%
倉庫・運輸関連業	0.84%
情報・通信業	5.69%
卸売業	3.30%
小売業	5.65%
銀行業	5.63%
証券・商品先物取引業	4.24%
保険業	0.73%
その他金融業	0.84%
不動産業	3.45%
サービス業	4.88%
合計	92.01%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ海外好配当株マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	BHP BILLITON LTD オーストラリア	株式 鉱業	59,300	2,983 176,912,052	3,208 190,292,840	— —	2.15%
2	CHEVRON CORP 米国	株式 石油・石炭製 品	22,700	6,118 138,886,972	6,785 154,040,786	— —	1.74%
3	WESTPAC BANKING オーストラリア	株式 銀行業	76,200	1,949 148,567,369	1,837 140,031,102	— —	1.58%
4	BANCO SANTANDER SA ユーロ	株式 銀行業	86,901	1,404 122,082,986	1,507 131,032,091	— —	1.48%
5	TELEFONICA S.A. ユーロ	株式 情報・通信業	51,500	2,327 119,866,443	2,514 129,489,288	— —	1.46%
6	BP PLC 英国	株式 石油・石炭製 品	147,800	782 115,604,382	836 123,673,208	— —	1.40%
7	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC 英国	株式 食料品	45,000	2,737 123,192,135	2,651 119,322,225	— —	1.35%
8	AUSTRALIA & NZLAND BK オーストラリア	株式 銀行業	68,900	1,743 120,156,605	1,683 115,996,285	— —	1.31%
9	CREDIT AGRICOLE SA ユーロ	株式 銀行業	61,300	1,676 102,776,193	1,827 112,025,588	— —	1.27%
10	BNP PARIBAS ユーロ	株式 銀行業	15,500	6,820 105,716,599	7,179 111,286,581	— —	1.26%
11	INT'L BUSINESS MACHINES 米国	株式 電気機器	10,000	10,170 101,706,596	10,912 109,120,170	— —	1.23%
12	PHILIP MORRIS INTERNATION 米国	株式 食料品	25,000	4,119 102,978,363	4,339 108,490,798	— —	1.23%
13	COMMONWEALTH BANK OF AUST オーストラリア	株式 銀行業	25,500	3,752 95,684,649	4,020 102,514,335	— —	1.16%
14	MICROSOFT CORP 米国	株式 サービス業	40,000	2,154 86,184,968	2,536 101,463,528	— —	1.15%
15	HSBC HOLDINGS PLC 英国	株式 銀行業	99,500	959 95,499,263	1,012 100,727,809	— —	1.14%
16	AIR PRODUCTS & CHEMICALS 米国	株式 化学	13,700	6,552 89,768,138	7,127 97,653,177	— —	1.10%
17	RIO TINTO LTD オーストラリア	株式 鉱業	17,400	4,591 79,890,630	5,446 94,765,577	— —	1.07%
18	TOTAL SA ユーロ	株式 石油・石炭製 品	17,000	5,314 90,346,860	5,451 92,671,108	— —	1.05%
19	AT&T INC 米国	株式 情報・通信業	37,500	2,235 83,825,906	2,343 87,862,571	— —	0.99%
20	SCHNEIDER ELECTRIC SA ユーロ	株式 機械	9,000	8,638 77,743,183	9,597 86,380,012	— —	0.98%
21	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 電気機器	528,333	168 89,110,229	161 85,272,946	— —	0.96%
22	SAMSUNG ELECTRONICS 韓国	株式 電気機器	1,600	58,418 93,470,080	53,257 85,212,160	— —	0.96%
23	BHP BILLITON PLC 英国	株式 鉱業	31,200	2,384 74,406,023	2,671 83,356,141	— —	0.94%

24	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	17,200	4,287 73,744,808	4,804 82,633,349	— —	0.93%
25	CNOOC LTD 香港	株式 石油他	626,000	121 76,001,408	131 82,591,936	— —	0.93%
26	MARATHON OIL CORP 米国	株式 石油他	27,300	2,735 74,675,959	2,832 77,330,261	— —	0.87%
27	STANDARD CHARTERED PLC 英国	株式 銀行業	35,200	1,999 70,380,763	2,178 76,687,283	— —	0.87%
28	R.W.E. AG ユーロ	株式 電気・ガス業	9,100	8,125 73,938,446	8,084 73,571,124	— —	0.83%
29	COLGATE PALMOLIVE CO 米国	株式 化学	10,000	6,206 62,060,469	7,259 72,599,203	— —	0.82%
30	WELLS FARGO & CO 米国	株式 銀行業	29,800	2,342 69,795,587	2,356 70,209,497	— —	0.79%

（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	96.28%
合計	96.28%

（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	5.12%
建設業	0.78%
食料品	5.94%
繊維製品	0.78%
化学	5.42%
医薬品	4.71%
石油・石炭製品	7.40%
ガラス・土石製品	0.22%
鉄鋼	1.15%
非鉄金属	0.28%
機械	3.38%
電気機器	9.70%
輸送用機器	1.60%
精密機器	0.30%
その他製品	0.53%
電気・ガス業	3.67%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	5.09%
卸売業	0.55%
小売業	3.85%
銀行業	17.36%
証券・商品先物取引業	0.47%
保険業	4.45%
その他金融業	1.62%

不動産業	1.11%
サービス業	2.94%
消費材	0.56%
石油他	2.61%
建設資材	0.07%
コング`ロマリット	3.07%
電力	0.45%
その他製造	0.87%
合計	96.28%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	日本ビルファンド 日本	投資証券 —	3,100	756,000 2,343,600,000	702,000 2,176,200,000	— —	14.72%
2	ジャパンリアルエステイト 日本	投資証券 —	2,570	729,000 1,873,530,000	630,000 1,619,100,000	— —	10.95%
3	日本リテールファンド 日本	投資証券 —	2,700	405,707 1,095,411,491	375,000 1,012,500,000	— —	6.85%
4	野村不動産オフィスF 日本	投資証券 —	1,765	541,000 954,865,000	492,000 868,380,000	— —	5.87%
5	森トラスト総合リート 日本	投資証券 —	1,100	701,000 771,100,000	684,000 752,400,000	— —	5.09%
6	日本プライムリアルティ 日本	投資証券 —	3,663	193,600 709,156,800	196,200 718,680,600	— —	4.86%
7	フロンティア不動産投資 日本	投資証券 —	1,094	641,000 701,254,000	627,000 685,938,000	— —	4.64%
8	オリックス不動産投資 日本	投資証券 —	1,650	419,000 691,350,000	382,000 630,300,000	— —	4.26%
9	ユナイテッド・アーバン投資 法人 日本	投資証券 —	1,300	508,000 660,400,000	449,000 583,700,000	— —	3.95%
10	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券 —	700	683,000 478,100,000	658,000 460,600,000	— —	3.12%
11	ジャパンエクセレント投資法 人 日本	投資証券 —	1,100	425,000 467,500,000	392,000 431,200,000	— —	2.92%
12	DAオフィス投資法人 日本	投資証券 —	2,000	246,300 492,600,000	190,100 380,200,000	— —	2.57%
13	トップリート投資法人 日本	投資証券 —	950	396,000 376,200,000	383,000 363,850,000	— —	2.46%

14	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券 —	800	471,000 376,800,000	444,000 355,200,000	— —	2.40%
15	東急リアル・エステート 日本	投資証券 —	800	477,000 381,600,000	423,000 338,400,000	— —	2.29%
16	グローバル・ワン不動産投資法人 日本	投資証券 —	550	593,000 326,150,000	573,000 315,150,000	— —	2.13%
17	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券 —	1,350	256,800 346,680,000	230,000 310,500,000	— —	2.10%
18	日本レジデンシャル 日本	投資証券 —	1,400	234,000 327,600,000	200,000 280,000,000	— —	1.89%
19	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券 —	750	366,000 274,500,000	325,000 243,750,000	— —	1.65%
20	M I D リート投資法人 日本	投資証券 —	1,100	209,500 230,450,000	199,100 219,010,000	— —	1.48%
21	日本コマーシャル投資 日本	投資証券 —	1,600	148,400 237,440,000	126,600 202,560,000	— —	1.37%
22	プレミアム投資法人 日本	投資証券 —	580	349,000 202,420,000	309,000 179,220,000	— —	1.21%
23	野村不レジデンシャル 日本	投資証券 —	600	422,000 253,200,000	298,500 179,100,000	— —	1.21%
24	ビ・ライフ投資法人 日本	投資証券 —	450	420,000 189,000,000	396,000 178,200,000	— —	1.21%
25	福岡リート投資法人 日本	投資証券 —	333	504,000 167,832,000	452,000 150,516,000	— —	1.02%
26	ジョイントリート投資法人 日本	投資証券 —	800	193,400 154,720,000	169,000 135,200,000	— —	0.91%
27	産業ファンド 日本	投資証券 —	500	247,000 123,500,000	240,400 120,200,000	— —	0.81%
28	ラサールジャパン投資法人 日本	投資証券 —	1,050	117,400 123,270,000	104,000 109,200,000	— —	0.74%
29	森ヒルズリート 日本	投資証券 —	310	277,000 85,870,000	239,900 74,369,000	— —	0.50%
30	阪急リート投資法人 日本	投資証券 —	150	383,000 57,450,000	341,000 51,150,000	— —	0.35%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	95.71%
合計	95.71%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	UNIBAIL-RODAMCO SE ユーロ	投資証券 —	537,867	18,942 10,188,559,386	19,726 10,610,402,804	— —	6.56%
2	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資証券 —	9,851,063	1,041 10,263,312,974	943 9,298,083,430	— —	5.75%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC 米国	投資証券 —	1,100,076	6,018 6,620,707,946	6,053 6,659,047,478	— —	4.12%
4	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 —	17,425,756	309 5,397,966,397	310 5,413,302,389	— —	3.35%
5	LAND SECURITIES PLC 英国	投資証券 —	4,312,542	947 4,084,120,023	961 4,144,472,104	— —	2.56%
6	LINK REIT 香港	投資証券 —	19,270,756	190 3,669,901,772	210 4,057,650,383	— —	2.51%
7	PUBLIC STORAGE 米国	投資証券 —	586,582	6,431 3,772,821,655	6,635 3,892,415,261	— —	2.41%
8	PROLOGIS 米国	投資証券 —	3,246,331	1,046 3,397,866,826	1,096 3,559,310,746	— —	2.20%
9	VORNADO REALTY TRUST 米国	投資証券 —	659,767	5,399 3,562,535,234	5,386 3,553,874,861	— —	2.20%
10	BOSTON PROPERTIES INC 米国	投資証券 —	593,410	5,708 3,387,444,644	5,537 3,286,073,091	— —	2.03%
11	HAMMERSON PLC 英国	投資証券 —	5,442,196	602 3,280,348,647	589 3,207,483,165	— —	1.98%
12	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券 —	50,553,459	60 3,083,501,451	62 3,173,013,131	— —	1.96%
13	BRITISH LAND CO PLC 英国	投資証券 —	4,576,353	715 3,275,548,723	659 3,015,960,049	— —	1.86%
14	SEGRO PLC 英国	投資証券 —	5,901,294	533 3,148,815,510	483 2,853,838,750	— —	1.76%
15	EQUITY RESIDENTIAL 米国	投資証券 —	1,033,147	2,608 2,694,707,551	2,683 2,772,240,349	— —	1.71%
16	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 —	22,630,451	126 2,853,017,175	119 2,714,963,891	— —	1.68%
17	CORIO NV ユーロ	投資証券 —	436,109	5,755 2,509,841,124	5,977 2,607,033,915	— —	1.61%
18	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 —	53,222,323	47 2,527,417,936	46 2,452,537,866	— —	1.52%
19	HOST HOTELS&RESORTS INC 米国	投資証券 —	2,648,554	937 2,483,313,578	873 2,313,004,986	— —	1.43%
20	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券 —	46,922,825	48 2,265,881,808	46 2,180,890,791	— —	1.35%
21	MACERICH CO/THE 米国	投資証券 —	858,437	2,663 2,286,565,880	2,468 2,119,374,850	— —	1.31%
22	HCP INC 米国	投資証券 —	804,481	2,500 2,011,305,474	2,580 2,076,253,879	— —	1.28%
23	LIBERTY PROPERTY TRUST 米国	投資証券 —	692,792	2,847 1,972,780,687	2,481 1,719,439,010	— —	1.06%
24	CAPITACOMMERCIAL TRUST シンガポール	投資証券 —	23,823,000	62 1,490,668,477	70 1,690,036,972	— —	1.04%
25	COMMONWEALTH PROPERTY OFF オーストラリア	投資証券 —	22,113,505	71 1,577,433,021	75 1,660,287,483	— —	1.03%

26	ING OFFICE FUND オーストラリア	投資証券	—	36,299,938	46 1,691,614,154	45 1,658,317,293	— —	1.02%
27	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA カナダ	投資証券	—	1,269,611	1,170 1,485,992,812	1,301 1,652,663,811	— —	1.02%
28	SENIOR HOUSING PROP TRUST 米国	投資証券	—	950,550	1,673 1,590,306,269	1,733 1,647,869,393	— —	1.02%
29	DERWENT LONDON PLC 英国	投資証券	—	882,618	1,770 1,562,823,903	1,866 1,647,103,406	— —	1.02%
30	ICADE ユーロ	投資証券	—	186,994	8,825 1,650,309,258	8,682 1,623,557,229	— —	1.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	95.75%
合計	95.75%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2009年12月	買建	23,938,398	2,074,217,857	2,077,852,948	1.28%
		シンガポールドル売/円買 2009年12月	売建	1,303,247	81,817,857	81,804,824	△0.05%

（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。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
設定時 (平成19年9月28日)	1,000,000	—	1.0000	—
第1特定期間末 (平成19年11月12日)	7,430,141	7,430,141	0.9884	0.9884
第2特定期間末 (平成20年5月12日)	16,087,587	16,121,148	0.9587	0.9607

第3特定期間末 (平成20年11月10日)	21,221,012	21,270,001	0.8664	0.8684
平成20年11月末日	20,958,862	—	0.8557	—
12月末日	21,310,206	—	0.8700	—
平成21年1月末日	21,012,246	—	0.8498	—
2月末日	20,903,408	—	0.8454	—
3月末日	21,549,791	—	0.8515	—
4月末日	21,968,125	—	0.8680	—
第4特定期間末 (平成21年5月11日)	22,258,538	22,309,044	0.8795	0.8815
5月末日	22,173,330	—	0.8761	—
6月末日	22,522,802	—	0.8899	—
7月末日	22,704,235	—	0.8971	—
8月末日	22,518,988	—	0.9082	—
9月末日	21,989,013	—	0.9081	—
10月末日	22,927,511	—	0.9061	—
第5特定期間末 (平成21年11月10日)	22,808,123	22,858,083	0.9013	0.9033
11月末日	22,630,061	—	0.8943	—

② 【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	0.0060
第3特定期間	0.0060
第4特定期間	0.0060
第5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。

③ 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1特定期間	△1.2
第2特定期間	△2.4
第3特定期間	△9.0
第4特定期間	2.2
第5特定期間	3.2

第二部 【ファンドの詳細情報】

第1 【ファンドの沿革】

平成19年9月28日 信託契約締結、当初自己設定、運用開始

第2 【手続等】

1 【申込（販売）手続等】

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せん。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

2 【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時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。

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

第3 【管理及び運営】

1 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外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るほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年1月11日から3月10日まで、3月11日から5月10日まで、5月11日から7月10日まで、7月11日から9月10日まで、9月11日から11月10日まで、および11月11日から翌年1月10日までとします。ただし、第1計算期間は、平成19年9月28日から平成19年11月10日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

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

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受

託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

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

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

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

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
<http://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 関係法人との契約の更改

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

2 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金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。）を持分に应じて請求する権利を有します。

収益分配金は、第1計算期間を除く毎計算期間終了日後1か月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から、毎計算期間の末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計算期間の末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します。）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対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に支払われます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みに応じるものとします。当該取得申込みにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日後1か月以内の委託会社の指定する日（原則として信託終了日から起算して5営業日まで）から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社が当ファンドの償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

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。

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

受益者が、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。

② 換金請求権

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

第4 【ファンドの経理状況】

(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、前特定期間（平成20年11月11日から平成21年5月11日まで）及び当特定期間（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）

ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成21年5月11日現在	当 期 平成21年11月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	317,505	359,029
親投資信託受益証券	21,967,001	22,474,283
未収入金	50,000	51,000
流動資産合計	22,334,506	22,884,312
資産合計	22,334,506	22,884,312
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	50,506	49,960
未払受託者報酬	1,535	1,575
未払委託者報酬	23,199	23,922
その他未払費用	728	732
流動負債合計	75,968	76,189
負債合計	75,968	76,189
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 25,309,090	※ 1 25,304,559
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※ 2 △3,050,552	※ 2 △2,496,436
（分配準備積立金）	140,600	192,490
元本等合計	22,258,538	22,808,123
純資産合計	22,258,538	22,808,123
負債純資産合計	22,334,506	22,884,312

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	当 期 自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
営業収益		
受取利息	189	103
有価証券売買等損益	565,214	779,282
営業収益合計	565,403	779,385
営業費用		
受託者報酬	4,407	4,696
委託者報酬	※ 1 66,521	※ 1 71,088
その他費用	728	732
営業費用合計	71,656	76,516
営業利益	493,747	702,869
経常利益	493,747	702,869
当期純利益	493,747	702,869
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	—	16,170
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△3,273,500	△3,050,552
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	116,895
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	116,895
剰余金減少額又は欠損金増加額	121,850	100,149
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	121,850	100,149
分配金	※ 2 148,949	※ 2 149,329
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,050,552	△2,496,436

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	当 期 自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 平成21年5月10日が休日のため、当特定期間末日を平成21年5月11日としております。このため、当特定期間は182日となっております。	計算期間末日の取扱い 平成21年5月10日が休日のため、前特定期間末日を平成21年5月11日としております。このため、当特定期間は183日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成21年5月11日現在	当 期 平成21年11月10日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	24,494,512円 814,578円 －円	25,309,090円 1,089,759円 1,094,290円
2. 特定期間末日における受益権の総数	25,309,090口	25,304,559口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,050,552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2,496,436円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期 自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	当 期 自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	2,559円	2,924円

2. ※2 分配金の計算過程

（自平成20年11月11日 至平成21年1月13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（59,698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（96,162円）及び分配準備積立金（71,767円）より分配対象額は227,627円（1万口当たり92.93円）であり、うち48,989円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

（自平成21年1月14日 至平成21年3月10日）
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（48,253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（98,011円）及び分配準備積立金（82,476円）より分配対象額は228,740円（1万口当たり92.50円）であり、うち49,454円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

（自平成21年5月12日 至平成21年7月10日）
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（67,158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（103,244円）及び分配準備積立金（140,600円）より分配対象額は311,002円（1万口当たり122.88円）であり、うち50,506円（1万口当たり19.96円）を分配金額としております。なお、当該分配金額は、1万口当たり20円の分配金額に期末残存口数を乗じた額(50,618円)から外国所得税控除額(112円)を控除した後の額であります。

（自平成21年7月11日 至平成21年9月10日）
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（81,294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（101,153円）及び分配準備積立金（154,067円）より分配対象額は336,514円（1万口当たり135.71円）であり、うち48,863円（1万口当たり19.71円）を分配金額としております。なお、当該分配金額は、1万口当たり20円の分配金額に期末残存口数を乗じた額(49,592円)から外国所得税控除額(729円)を控除した後の額であります。

	（自平成21年3月11日 至平成21年5月11日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（109,831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（103,244円）及び分配準備積立金（81,275円）より分配対象額は294,350円（1万口当たり116.30円）であり、うち50,506円（1万口当たり19.96円）を分配金額としております。なお、当該分配金額は、1万口当たり20円の分配金額に期末残存口数を乗じた額（50,618円）から外国所得税控除額（112円）を控除した後の額であります。	（自平成21年9月11日 至平成21年11月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（60,326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（112,302円）及び分配準備積立金（182,124円）より分配対象額は354,752円（1万口当たり140.19円）であり、うち49,960円（1万口当たり19.74円）を分配金額としております。なお、当該分配金額は、1万口当たり20円の分配金額に期末残存口数を乗じた額（50,609円）から外国所得税控除額（649円）を控除した後の額であります。
--	---	--

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成21年5月11日現在		当 期 平成21年11月10日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	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	21,967,001	1,205,293	22,474,283	△103,552
合計	21,967,001	1,205,293	22,474,283	△103,552

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

前 期 自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	当 期 自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前 期 自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	当 期 自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	前 期 平成21年5月11日現在	当 期 平成21年11月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8795円 (8,795円)	0.9013円 (9,013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	ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド	10,783,612	11,252,699	
	ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド	4,330,197	4,489,548	
	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	1,974,637	2,270,240	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	1,095,294	1,077,002	
	ダイワ海外好配当株マザーファンド	1,597,134	1,170,539	
	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	1,329,347	1,079,562	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	1,498,935	1,134,693	
親投資信託受益証券 合計		22,609,156	22,474,283	
合計		22,609,156	22,474,283	

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。

[次へ](#)

（参考）

当ファンドは、「ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ海外好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド」受益証券及び「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「ダイワ日本債券アクティブ・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21年5月11日現在 金 額（円）	平成21年11月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,045,347	16,189,095
国債証券	432,490,400	422,145,220
地方債証券	10,257,660	10,384,150
特殊債券	61,001,580	75,563,040
未収入金	—	27,958,585
未収利息	1,760,419	1,286,815
前払費用	189,395	669,646
流動資産合計	523,744,801	554,196,551
資産合計	523,744,801	554,196,551
負債の部		
流動負債		
未払金	—	24,898,400
未払解約金	4,503	13,620
流動負債合計	4,503	24,912,020
負債合計	4,503	24,912,020
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	507,747,086	507,238,479
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,993,212	22,046,052
元本等合計	523,740,298	529,284,531
純資産合計	523,740,298	529,284,531
負債純資産合計	523,744,801	554,196,551

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20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券及び特殊債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券及び特殊債券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
-----	--------------	---------------

1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	508,734,582円	507,747,086円
同期中における追加設定元本額	202,118円	537,163円
同期中における一部解約元本額	1,189,614円	1,045,770円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ日本債券アクティブ（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	496,830,248円	495,784,478円
ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）	10,257,991円	10,783,612円
ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）	658,847円	670,389円
計	507,747,086円	507,238,479円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	507,747,086口	507,238,479口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年5月11日現在		平成21年11月10日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	432,490,400	△3,132,100	422,145,220	26,180
地方債証券	10,257,660	53,360	10,384,150	31,520
特殊債券	61,001,580	456,780	75,563,040	△65,910
合計	503,749,640	△2,621,960	508,092,410	△8,210

（注）「当期間」とは当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年8月12日から平成21年5月11日まで、及び平成21年8月11日から平成21年11月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0315円 (10,315円)	1.0435円 (10,435円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	1 3 0 年国債	5,000,000	5,513,550	
	2 5 1 5 年国債 F R	11,000,000	10,862,500	
	2 6 1 5 年国債 F R	11,000,000	10,796,500	
	2 6 3 0 年国債	8,000,000	8,196,160	
	2 8 3 0 年国債	5,000,000	5,225,350	
	2 9 3 0 年国債	2,000,000	2,048,900	
	3 7 1 5 年国債 F R	10,000,000	9,720,000	
	6 2 5 年国債	27,000,000	27,575,100	
	6 4 5 年国債	7,000,000	7,208,320	
	6 4 2 0 年国債	32,000,000	32,265,280	
	6 7 5 年国債	4,000,000	4,104,400	
	6 9 5 年国債	15,000,000	15,220,350	
	7 0 5 年国債	6,000,000	6,068,220	
	7 3 5 年国債	5,000,000	5,141,450	
	8 2 5 年国債	13,000,000	13,151,320	
	9 4 2 0 年国債	16,000,000	16,050,880	
	9 6 2 0 年国債	14,000,000	14,027,020	
	1 0 3 2 0 年国債	2,000,000	2,053,500	
	1 0 8 2 0 年国債	22,000,000	21,169,060	
	2 4 7 1 0 年国債	24,000,000	24,272,880	
	2 6 8 1 0 年国債	12,000,000	12,449,880	
	2 7 8 2 年国債	35,000,000	35,088,200	
	2 8 7 1 0 年国債	34,000,000	35,869,660	
	2 8 9 1 0 年国債	8,000,000	8,168,080	
	2 9 5 1 0 年国債	10,000,000	10,162,500	
	2 9 6 1 0 年国債	38,000,000	38,511,480	
	3 0 1 1 0 年国債	41,000,000	41,224,680	
国債証券 合計		417,000,000	422,145,220	
地方債証券	1 8 共同発行地方	10,000,000	10,384,150	
地方債証券 合計		10,000,000	10,384,150	
特殊債券	1 アフリカ開発銀行 S U B	30,000,000	34,592,640	
	1 4 政保国民生活	20,000,000	20,721,940	
	3 1 9 政保道路債	20,000,000	20,248,460	
特殊債券 合計		70,000,000	75,563,040	
合計		497,000,000	508,092,410	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「ダイワ短期日本債券アクティブ・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21年5月11日現在 金 額（円）	平成21年11月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,277,798	23,886,854
国債証券	176,151,310	89,322,070
特殊債券	20,387,880	—
社債券	99,332,500	200,786,600
未収入金	—	9,314,305
未収利息	1,080,326	421,656
前払費用	116,895	282,250
流動資産合計	310,346,709	324,013,735
資産合計	310,346,709	324,013,735
負債の部		
流動負債		
未払金	—	10,118,600
未払解約金	1,801	5,464
流動負債合計	1,801	10,124,064
負債合計	1,801	10,124,064
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	303,078,563	302,754,960
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,266,345	11,134,711
元本等合計	310,344,908	313,889,671
純資産合計	310,344,908	313,889,671
負債純資産合計	310,346,709	324,013,735

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20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、特殊債券及び社債券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
-----	--------------	---------------

1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	303,546,093円	303,078,563円
同期中における追加設定元本額	—円	243,258円
同期中における一部解約元本額	467,530円	566,861円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ短期日本債券アクティブ (F0Fs用) (適格機関投資家専用)	298,624,349円	298,154,032円
ダイワ円債重視バランスファンド (奇数月決算型)	4,185,413円	4,330,197円
ダイワ円債重視バランスファンド (資産形成型)	268,801円	270,731円
計	303,078,563円	302,754,960円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 特定期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	303,078,563口	302,754,960口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成21年5月11日現在		平成21年11月10日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	176,151,310	△123,970	89,322,070	△179,850
特殊債券	20,387,880	△34,420	—	—
社債券	99,332,500	△598,800	200,786,600	235,800
合計	295,871,690	△757,190	290,108,670	55,950

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年8月12日から平成21年5月11日まで、及び平成21年8月11日から平成21年11月10日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0240円 (10,240円)	1.0368円 (10,368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	6 7 5年国債	20,000,000	20,522,000	
	6 9 5年国債	23,000,000	23,337,870	
	8 2 5年国債	35,000,000	35,407,400	
	3 0 1 10年国債	10,000,000	10,054,800	
国債証券 合計		88,000,000	89,322,070	
社債券	1 9 三洋電機	100,000,000	100,808,800	
	2 4 住友化学工業	100,000,000	99,977,800	
社債券 合計		200,000,000	200,786,600	
合計		288,000,000	290,108,670	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「ダイワ・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21年5月11日現在 金 額（円）	平成21年11月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	4,820,462,728	1,489,619,923
コール・ローン	503,195,886	2,591,425,981
国債証券	298,884,974,712	280,796,882,084
派生商品評価勘定	—	50,848,912
未収入金	17,146,465,331	11,075,178,976
未収利息	4,168,600,518	4,451,948,700
前払費用	1,471,693,651	770,747,626
流動資産合計	326,995,392,826	301,226,652,202
資産合計	326,995,392,826	301,226,652,202
負債の部		
流動負債		
未払金	20,144,138,320	11,548,494,829
未払解約金	155,000,000	465,040,000
流動負債合計	20,299,138,320	12,013,534,829
負債合計	20,299,138,320	12,013,534,829
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	272,157,961,376	251,561,559,287
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	34,538,293,130	37,651,558,086
元本等合計	306,696,254,506	289,213,117,373
純資産合計	306,696,254,506	289,213,117,373
負債純資産合計	326,995,392,826	301,226,652,202

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20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	292,310,795,721円	272,157,961,376円
同期中における追加設定元本額	259,846,336円	3,022,667,003円
同期中における一部解約元本額	20,412,680,681円	23,619,069,092円
同期末における元本の内訳 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）	22,783,378,576円	22,226,759,410円
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	134,380,768円	147,094,231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）	4,683,530,373円	4,452,939,403円
北海道応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	3,716,810,876円	3,530,637,741円
福島応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	2,476,451,083円	2,335,319,984円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	11,011,071,073円	10,595,914,454円

ダイワ・バランス2資産（外債・好配当日本株）（毎月分配型）	90,556,213円	89,682,672円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	130,221,738円	135,916,483円
新潟県応援ファンド（外債バランス・毎月分配型）	2,007,539,795円	1,884,090,206円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,243,717,588円	1,268,250,886円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	3,081,394,429円	3,080,399,991円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	2,875,888,103円	2,875,888,103円
F I T ネット・三県応援ファンド（毎月分配型）	2,293,213,838円	2,169,005,890円
長野応援ファンド（毎月分配型）	1,275,259,029円	1,239,939,778円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	36,821,294円	38,555,175円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	72,978,104円	76,957,359円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	55,496,377円	61,784,204円
栃木応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	1,984,382,824円	1,937,344,969円
京都応援バランスファンド（隔月分配型）	1,154,246,852円	1,106,089,956円
北東北三県応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	1,914,217,432円	1,821,524,771円
6資産バランスファンド（分配型）	11,450,903,215円	9,585,118,045円
6資産バランスファンド（成長型）	465,893,058円	492,525,179円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	168,495,830,436円	153,360,477,045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）	1,068,886,028円	1,086,284,898円
奈良応援ファンド（外債バランス・毎月分配型）	567,586,067円	530,657,996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）	1,881,114,915円	1,582,084,718円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	1,975,029,320円	1,854,487,771円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	9,813,547,025円	8,954,212,262円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	803,400,991円	750,468,857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）	183,804,173円	191,748,736円
日の出・3資産バランスファンド	708,312,322円	431,708,321円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	1,252,361,158円	1,335,530,104円
紀陽地域株式・外債バランスファンド（隔月分配型）	650,785,529円	628,679,232円
愛媛県応援ファンド（外債バランス・毎月分配型）	1,437,990,356円	1,388,556,821円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	7,449,953,506円	7,441,218,355円

地球環境株・外債バランス・ファンド	903,572,433円	828,016,007円
ダイワ円債重視バランスファンド （奇数月決算型）	1,986,235円	1,974,637円
ダイワ円債重視バランスファンド （資産形成型）	129,749円	129,749円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1 年決算型）	25,318,495円	43,584,888円
計	272,157,961,376円	251,561,559,287円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 特定期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	272,157,961,376口	251,561,559,287口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年5月11日現在		平成21年11月10日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	298,884,974,712	△4,517,905,799	280,796,882,084	△2,676,505,435
合計	298,884,974,712	△4,517,905,799	280,796,882,084	△2,676,505,435

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年4月11日から平成21年5月11日まで、及び平成21年10月14日から平成21年11月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、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。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左

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

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成21年5月11日 現在				平成21年11月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	—	—	—	—	11,756,930,000	—	11,745,089,000	11,841,000
アメリカ・ドル	—	—	—	—	8,721,680,000	—	8,710,064,000	11,616,000
ユーロ	—	—	—	—	3,035,250,000	—	3,035,025,000	225,000
買 建	—	—	—	—	11,691,309,000	—	11,730,316,912	39,007,912
オーストラリア・ドル	—	—	—	—	3,426,370,000	—	3,430,880,000	4,510,000
カナダ・ドル	—	—	—	—	5,085,600,000	—	5,110,800,000	25,200,000
スウェーデン・クローナ	—	—	—	—	3,179,339,000	—	3,188,636,912	9,297,912
合計	—	—	—	—	23,448,239,000	—	23,475,405,912	50,848,912

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - ① 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 特定期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 特定期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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

(1口当たり情報)

	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
--	--------------	---------------

本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1269円 (11,269円)	1.1497円 (11,497円)
--	----------------------	----------------------

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	アメリカ・ドル 57,000,000.000	アメリカ・ドル 82,070,880.000	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	9,700,000.000	13,578,448.000	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	49,200,000.000	69,064,500.000	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	401,500,000.000	550,396,275.000	
		7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	16,000,000.000	22,158,720.000	
		アメリカ・ドル 小計	アメリカ・ドル 533,400,000.000 (48,000,666,000)	アメリカ・ドル 737,268,823.000 (66,346,821,382)	
	イギリス・ポンド	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	イギリス・ポンド 11,800,000.000	イギリス・ポンド 16,058,620.000	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	2,400,000.000	3,043,200.000	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	101,200,000.000	138,907,120.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	25,000,000.000	23,817,500.000	
		イギリス・ポンド 小計	イギリス・ポンド 140,400,000.000 (21,180,744,000)	イギリス・ポンド 181,826,440.000 (27,430,336,739)	
	オーストラリア・ドル	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20100815	オーストラリア・ドル 40,000,000.000	オーストラリア・ドル 40,294,000.000	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	480,000,000.000	479,592,000.000	
		オーストラリア・ドル 小計	オーストラリア・ドル 520,000,000.000 (43,524,000,000)	オーストラリア・ドル 519,886,000.000 (43,514,458,200)	
	カナダ・ドル	10.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140315	カナダ・ドル 45,396,000.000	カナダ・ドル 59,684,844.960	
		10.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210315	1,700,000.000	2,746,826.000	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	4,500,000.000	6,405,435.000	
		9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	24,600,000.000	38,434,794.000	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	19,800,000.000	29,360,430.000	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	18,000,000.000	20,915,820.000	

	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	44,100,000.000	46,442,151.000	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	136,600,000.000	145,525,444.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 294,696,000.000 (25,105,152,240)	カナダ・ドル 349,515,744.960 (29,775,246,313)	
スウェーデン・ク ローナ	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	200,000,000.000	235,428,000.000	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 200,000,000.000 (2,626,000,000)	スウェーデン・クローナ 235,428,000.000 (3,091,169,640)	
チェコ・コルナ	6.95% Czech Republic Government Bond 20160126	819,000,000.000	966,493,710.000	
チェコ・コルナ 小計		チェコ・コルナ 819,000,000.000 (4,332,510,000)	チェコ・コルナ 966,493,710.000 (5,112,751,726)	
デンマーク・ク ローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	56,100,000.000	74,767,275.000	
	6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	18,500,000.000	20,037,350.000	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	102,200,000.000	111,179,292.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	25,000,000.000	26,136,250.000	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	50,000,000.000	52,357,000.000	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 251,800,000.000 (4,565,134,000)	デンマーク・クローネ 284,477,167.000 (5,157,571,037)	
ノルウェー・ク ローネ	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	326,500,000.000	360,286,220.000	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	218,500,000.000	231,850,350.000	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	250,000,000.000	255,360,000.000	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 795,000,000.000 (12,807,450,000)	ノルウェー・クローネ 847,496,570.000 (13,653,169,743)	
ポーランド・ズロ チ	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	361,500,000.000	370,118,160.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20101124	170,000,000.000	172,901,900.000	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	13,300,000.000	12,877,592.000	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 544,800,000.000 (17,531,664,000)	ポーランド・ズロチ 555,897,652.000 (17,888,786,441)	
ユーロ	8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	49,700,000.000	62,546,456.000	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	45,000,000.000	51,341,400.000	

	6% HELLENIC REPUBLIC 20190719	37,000,000.000	40,669,660.000	
	4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	157,000,000.000	163,181,090.000	
	4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	55,000,000.000	58,669,600.000	
	5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	125,000,000.000	127,991,250.000	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	4,600,000.000	5,804,924.000	
	ユーロ 小計	ユーロ 473,300,000.000 (63,848,170,000)	ユーロ 510,204,380.000 (68,826,570,863)	
国債証券 合計		243,521,490,240 [243,521,490,240]	280,796,882,084 [280,796,882,084]	
合計		243,521,490,240 [243,521,490,240]	280,796,882,084 [280,796,882,084]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 5銘柄	100%	23.6%
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	100%	9.8%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄	100%	15.5%
カナダ・ドル	国債証券 8銘柄	100%	10.6%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	100%	1.1%
チェコ・コルナ	国債証券 1銘柄	100%	1.8%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100%	1.8%
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	100%	4.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	100%	6.4%
ユーロ	国債証券 7銘柄	100%	24.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成21年5月11日現在 金 額（円）	平成21年11月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	984,397,112	1,285,402,481
株式	25,931,605,200	25,664,322,800
投資証券	1,011,454,800	955,413,200
派生商品評価勘定	—	258,672
未収入金	116,255,726	456,209,590
未収配当金	419,767,100	260,057,280
前払金	—	8,900,000
差入委託証拠金	—	13,200,000
流動資産合計	28,463,479,938	28,643,764,023
資産合計	28,463,479,938	28,643,764,023
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	6,495,009
未払金	269,122,447	435,859,555
未払解約金	56,000,000	14,000,000
流動負債合計	325,122,447	456,354,564
負債合計	325,122,447	456,354,564
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	29,343,214,150	28,664,772,142
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△1,204,856,659	△477,362,683
元本等合計	28,138,357,491	28,187,409,459
純資産合計	28,138,357,491	28,187,409,459
負債純資産合計	28,463,479,938	28,643,764,023

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20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券	(1)株式 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)投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	先物取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	30,345,603,287円	29,343,214,150円
同期中における追加設定元本額	681,583,177円	1,005,539,121円
同期中における一部解約元本額	1,683,972,314円	1,683,981,129円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	82,402,033円	82,477,093円
ダイワ好配当日本株投信Q（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	1,893,569,844円	2,338,683,594円
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	17,608,601,288円	16,907,605,574円
ダイワ・バランス2資産（外債・好配当日本株）（毎月分配型）	46,386,892円	42,171,054円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	167,228,814円	146,117,964円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	428,306,188円	399,600,125円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	529,601,153円	490,636,432円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,167,355,073円	5,862,001,403円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	12,812,973円	11,887,561円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	12,725,585円	12,352,485円

成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	121,588,210円	124,628,315円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	880,117,941円	843,453,212円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	1,206,304,652円	1,186,902,537円
ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）	1,236,281円	1,095,294円
ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）	74,202円	74,202円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	34,965,509円	43,011,325円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	78,204,470円	86,688,406円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	71,733,042円	85,385,566円
計	29,343,214,150円	28,664,772,142円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	29,343,214,150口	28,664,772,142口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,204,856,659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477,362,683円であります。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年5月11日現在		平成21年11月10日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	25,931,605,200	1,534,494,926	25,664,322,800	△1,053,973,106
投資証券	1,011,454,800	22,981,800	955,413,200	△67,722,500
合計	26,943,060,000	1,557,476,726	26,619,736,000	△1,121,695,606

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年4月16日から平成21年5月11日まで、及び平成21年10月16日から平成21年11月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用してあります。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。	同左

4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

株式関連

種 類	平成21年5月11日 現在				平成21年11月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	—	—	—	—	400,900,000	—	394,800,000	△6,100,000
合計	—	—	—	—	400,900,000	—	394,800,000	△6,100,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9589円 (9,589円)	0.9833円 (9,833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	
日鉄鉱業	746,000	406	302,876,000	
田辺工業	130,600	609	79,535,400	

東鉄工業	9,000	520	4,680,000
大東建託	26,000	3,950	102,700,000
大林道路	448,000	147	65,856,000
ライト工業	489,000	194	94,866,000
高田工業所	178,500	380	67,830,000
明星工業	113,000	190	21,470,000
東芝プラントシステム	48,000	1,192	57,216,000
高橋カーテンウォール	203,000	220	44,660,000
日本製粉	278,000	456	126,768,000
フレンテ	84,000	2,395	201,180,000
スタジオアリス	160,800	915	147,132,000
新日鉄ソリューションズ	42,000	1,675	70,350,000
K G 情報	51,000	255	13,005,000
ゲオ	1,646	98,900	162,789,400
エディオン	330,000	776	256,080,000
トーマンデバイス	23,200	1,729	40,112,800
フィールズ	588	103,900	61,093,200
セリア	879	135,900	119,456,100
サッポロドラッグストアー	154	141,100	21,729,400
ナフコ	60,900	1,646	100,241,400
味の素	141,000	851	119,991,000
フジフーズ	386,000	430	165,980,000
コカカラファイン HD	126,500	1,908	241,362,000
サイボー	56,900	510	29,019,000
旭化成	790,000	461	364,190,000
日本バイリーン	310,000	456	141,360,000
J S C	164,900	575	94,817,500
ニッポン高度紙工業	30,000	711	21,330,000
日本製紙G本社	64,200	2,315	148,623,000
関東電化	242,000	777	188,034,000
日本化学産業	296,000	617	182,632,000
日本ピグメント	419,000	162	67,878,000
日本合成化学	133,000	634	84,322,000
サンエー化研	42,400	495	20,988,000
プロトコーポレーション	46,500	2,700	125,550,000
インテージ	30,000	1,584	47,520,000
武田薬品	40,000	3,580	143,200,000
小野薬品	32,000	4,100	131,200,000
みらかホールディングス	55,000	3,060	168,300,000
第一三共	89,800	1,719	154,366,200
キョーリン	95,000	1,480	140,600,000
東洋インキ	694,000	337	233,878,000
T & K TOKA	117,100	1,039	121,666,900
秀英予備校	174,300	493	85,929,900
インフォメーションディベロ	21,000	610	12,810,000
日本オラクル	79,900	4,180	333,982,000
日本ハウズイング	232,800	1,590	370,152,000
電通国際情報S	273,500	579	158,356,500
富士フイルムHLDS	45,700	2,565	117,220,500
上村工業	20,000	3,440	68,800,000
綜研化学	281,300	1,200	337,560,000
昭和シェル石油	110,000	818	89,980,000
東洋ゴム	1,145,000	160	183,200,000
東海ゴム	201,700	1,067	215,213,900
旭硝子	100,000	832	83,200,000

日本電気硝子	128,000	998	127,744,000
住友大阪セメント	2,207,000	161	355,327,000
日本ヒューム	590,000	254	149,860,000
日本カーボン	705,000	319	224,895,000
東京鐵鋼	351,000	295	103,545,000
北越メタル	273,000	238	64,974,000
朝日工業	50	194,500	9,725,000
山陽特殊鋼	396,000	353	139,788,000
愛知製鋼	783,000	412	322,596,000
川金ホールディングス	286,000	283	80,938,000
東邦亜鉛	60,000	471	28,260,000
住友鋁山	113,000	1,526	172,438,000
フジクラ	859,000	448	384,832,000
川岸工業	822,000	250	205,500,000
那須電機	406,000	310	125,860,000
高田機工	422,000	179	75,538,000
菊池プレス工業	36,700	1,201	44,076,700
日本発条	219,000	684	149,796,000
阪神内燃機	410,000	166	68,060,000
オカダアイヨン	383,000	138	52,854,000
フロイント産業	150,400	492	73,996,800
東洋エンジニア	90,000	311	27,990,000
ダイコク電機	158,600	1,501	238,058,600
モリタホールディングス	105,000	442	46,410,000
新晃工業	142,000	345	48,990,000
帝国ピストン	238,700	360	85,932,000
トウアバルブG本社	49,500	1,700	84,150,000
日本トムソン	637,000	445	283,465,000
中北製作所	117,000	650	76,050,000
愛知電機	511,000	244	124,684,000
日東工業	191,300	854	163,370,200
アクセル	63,800	3,300	210,540,000
日本信号	156,000	771	120,276,000
T D K	45,100	5,120	230,912,000
三社電機製作所	232,000	294	68,208,000
ジオマテック	140,800	1,111	156,428,800
東光電気	220,000	477	104,940,000
スタンレー電気	29,000	1,782	51,678,000
大真空	185,000	301	55,685,000
太陽誘電	348,000	994	345,912,000
村田製作所	37,000	4,190	155,030,000
日東電工	137,000	2,870	393,190,000
三井造船	590,000	242	142,780,000
ニッチツ	679,000	220	149,380,000
日産自動車	530,000	653	346,090,000
トヨタ自動車	254,000	3,410	866,140,000
エッチ・ケー・エス	30,000	380	11,400,000
アイシン精機	30,000	2,200	66,000,000
今仙電機製作所	54,100	1,211	65,515,100
本田技研	155,000	2,850	441,750,000
ショーワ	389,100	474	184,433,400
小糸製作所	80,000	1,350	108,000,000
豊田合成	67,000	2,375	159,125,000
愛三工業	125,400	730	91,542,000
フジオーゼックス	180,000	237	42,660,000

フジ・コーポレーション	57,000	264	15,048,000
オーエムツーネットワーク	54,600	550	30,030,000
京都きもの友禅	117,300	878	102,989,400
川澄化学工業	205,000	587	120,335,000
理研計器	155,900	609	94,943,100
キャノン	218,000	3,410	743,380,000
萩原工業	67,000	766	51,322,000
東京リスマチック	19,600	570	11,172,000
桑山	23,700	312	7,394,400
大日本印刷	128,000	1,090	139,520,000
ムトー精工	94,300	865	81,569,500
三井物産	243,000	1,183	287,469,000
住友商事	343,000	864	296,352,000
ナガホリ	172,000	182	31,304,000
三菱UFJフィナンシャルG	713,800	503	359,041,400
三井住友フィナンシャルG	164,900	3,170	522,733,000
北越銀行	744,000	146	108,624,000
西日本シティ銀行	1,430,000	227	324,610,000
セブン銀行	792	183,900	145,648,800
野村ホールディングス	708,900	638	452,278,200
みずほ証券	1,015,000	309	313,635,000
東洋証券	445,000	166	73,870,000
東海東京HD	812,000	291	236,292,000
極東証券	242,300	683	165,490,900
三井住友海上HD	86,300	2,230	192,449,000
NECキャピタルソリューション	182,000	1,235	224,770,000
東京建物	402,000	435	174,870,000
京阪神不動産	213,700	402	85,907,400
フジ住宅	307,100	343	105,335,300
日本エスリード	191,700	775	148,567,500
日神不動産	429,600	458	196,756,800
リベレステ	1,193	87,600	104,506,800
サンヨーハウジ 名古屋	1,456	84,000	122,304,000
ファースト住建	255,300	706	180,241,800
サカイ引越センター	84,700	1,960	166,012,000
アルプス物流	146,900	866	127,215,400
ヒューテックノオリン	262,700	740	194,398,000
ヤマトホールディングス	173,000	1,285	222,305,000
センコー	168,000	331	55,608,000
川崎近海汽船	526,000	240	126,240,000
住友倉庫	334,000	403	134,602,000
東陽倉庫	542,000	185	100,270,000
日本電信電話	197,000	3,590	707,230,000
KDDI	415	455,000	188,825,000
アインファーマシーズ	124,600	2,250	280,350,000
日本医療事務センター	574,300	448	257,286,400
KSK	43,500	465	20,227,500
ワオ・コーポレーション	170,900	246	42,041,400
ベネッセホールディングス	30,000	3,790	113,700,000
ステップ	177,000	451	79,827,000
オートバックスセブン	15,000	2,850	42,750,000
日立機材	339,000	373	126,447,000
因幡電機産業	34,800	2,160	75,168,000
王将フードサービス	55,600	2,485	138,166,000
バイテック	89,000	453	40,317,000

東 テ ク	37,000	280	10,360,000	
や ま や	128,700	793	102,059,100	
合計	41,607,873		25,664,322,800	

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	プレミアム投資法人	921	321,429,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	605	413,215,000	
	ジョイントリート投資法人	443	85,676,200	
	ジャパン・オフィス投資法人	1,470	135,093,000	
投資証券 合計		3,439	955,413,200	
合計		3,439	955,413,200	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成21年5月11日現在 金 額（円）	平成21年11月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	239,191,590	166,005,156
コール・ローン	232,774,387	112,204,739
株式	9,931,485,143	9,087,882,523
派生商品評価勘定	243,132	—
未収入金	181,730,589	55,785,048
未収配当金	41,546,693	16,201,545
流動資産合計	10,626,971,534	9,438,079,011
資産合計	10,626,971,534	9,438,079,011
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,211,400	—
未払金	36,905,156	19,732,604
未払解約金	165,000,000	11,000
流動負債合計	203,116,556	19,743,604
負債合計	203,116,556	19,743,604
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	16,398,328,959	12,850,107,987
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△5,974,473,981	△3,431,772,580
元本等合計	10,423,854,978	9,418,335,407
純資産合計	10,423,854,978	9,418,335,407
負債純資産合計	10,626,971,534	9,438,079,011

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20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,619,786,804円	16,398,328,959円
同期中における追加設定元本額	4,764,603,885円	914,259,831円
同期中における一部解約元本額	986,061,730円	4,462,480,803円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ海外好配当株ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）	16,071,196,967円	12,496,013,057円
ダイワ・海外株式&REITファンド（毎月分配型）	259,237,171円	273,825,957円

ダイワ円債重視バランスファンド （奇数月決算型）	1,977,777円	1,597,134円
ダイワ円債重視バランスファンド （資産形成型）	112,530円	112,530円
ダイワ外国好配当株ファンド（ダイワSMA専用）	65,804,514円	78,559,309円
計	16,398,328,959円	12,850,107,987円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 特定期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	16,398,328,959口	12,850,107,987口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は5,974,473,981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3,431,772,580円でありま す。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年5月11日現在		平成21年11月10日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	9,931,485,143	1,875,698,937	9,087,882,523	452,452,665
合計	9,931,485,143	1,875,698,937	9,087,882,523	452,452,665

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年3月10日から平成21年5月11日まで、及び平成21年9月10日から平成21年11月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、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。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左

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

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成21年5月11日 現在				平成21年11月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	161,061,268	—	162,029,668	△968,400	—	—	—	—
アメリカ・ドル	29,808,000	—	29,565,000	243,000	—	—	—	—
イギリス・ポンド	37,287,500	—	37,440,000	△152,500	—	—	—	—
オーストラリア・ドル	26,250,000	—	26,470,500	△220,500	—	—	—	—
カナダ・ドル	21,212,500	—	21,407,500	△195,000	—	—	—	—
スイス・フラン	35,124,000	—	35,660,000	△536,000	—	—	—	—
デンマーク・クローネ	10,704,600	—	10,812,000	△107,400	—	—	—	—
香港・ドル	674,668	—	674,668	0	—	—	—	—
買 建	674,668	—	674,800	132	—	—	—	—
シンガポール・ドル	674,668	—	674,800	132	—	—	—	—
合計	161,735,936	—	162,704,468	△968,268	—	—	—	—

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
--	--------------	---------------

本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6357円 (6,357円)	0.7329円 (7,329円)
--	---------------------	---------------------

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	ABBOTT LABS	7,500	52.350	392,625.000	
	AGL RESOURCES INC	6,000	35.760	214,560.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	13,700	82.030	1,123,811.000	
	D.R.HORTON INC	20,900	12.130	253,517.000	
	BECTON DICKINSON & CO	5,300	71.640	379,692.000	
	BRISTOL MYERS SQUIBB	27,000	23.050	622,350.000	
	CATERPILLAR INC DEL	9,800	60.000	588,000.000	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	7,100	36.610	259,931.000	
	COLGATE PALMOLIVE CO	10,000	81.230	812,300.000	
	CUMMINS INC	12,500	47.010	587,625.000	
	COCA COLA CO	12,900	55.480	715,692.000	
	FPL GROUP INC	1,400	50.840	71,176.000	
	US BANCORP	25,300	24.510	620,103.000	
	FAMILY DOLLAR STORES	8,100	29.610	239,841.000	
	FASTENAL CO	5,500	37.230	204,765.000	
	GENERAL ELECTRIC CO	18,200	15.850	288,470.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	5,900	67.310	397,129.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,900	176.570	512,053.000	
	GENUINE PARTS CO	9,800	37.000	362,600.000	
	FIFTH THIRD BANCORP	8,000	9.730	77,840.000	
	HARSCO CORP	6,400	33.640	215,296.000	
	INT'L BUSINESS MACHINES	10,000	126.000	1,260,000.000	
	JOHNSON & JOHNSON	8,600	60.750	522,450.000	
	LOWE'S COS INC	14,500	21.250	308,125.000	
	ELI LILLY & CO	11,000	35.320	388,520.000	
	LUBRIZOL CORP	11,000	73.460	808,060.000	
	LINCOLN NATIONAL CORP	8,100	24.810	200,961.000	
	MCDONALD'S CORP	7,300	62.640	457,272.000	
	3M CO	8,500	77.200	656,200.000	
	METLIFE INC	20,400	35.100	716,040.000	
	M & T BANK CORP	11,000	64.620	710,820.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATION	25,000	49.870	1,246,750.000	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	9,500	83.050	788,975.000	
	CONOCOPHILLIPS	15,900	52.850	840,315.000	
	CHEVRON CORP	22,700	77.660	1,762,882.000	
	SOUTHERN CO	7,200	32.090	231,048.000	
	AT&T INC	37,500	26.340	987,750.000	
	SEMPRA ENERGY	5,800	51.940	301,252.000	
	MARATHON OIL CORP	27,300	34.590	944,307.000	
	UNITED PARCEL SERVICE-B	1,300	56.200	73,060.000	
	WELLS FARGO & CO	29,800	28.400	846,320.000	
	TJX COMPANIES INC	9,900	39.170	387,783.000	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	6,400	31.120	199,168.000	
	VISA INC-CLASS A SHS	5,800	81.160	470,728.000	
	NATIONAL FUEL GAS CO	4,000	48.010	192,040.000	

	ONEOK INC	5,000	38.510	192,550.000	
	CENTURYTEL INC	10,727	34.990	375,337.730	
	NOBLE ENERGY INC	6,700	69.190	463,573.000	
	BANK OF AMERICA CORP	15,000	15.770	236,550.000	
	NORDSTROM INC	9,900	35.160	348,084.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	13,300	39.050	519,365.000	
	EMERSON ELECTRIC CO	12,100	41.860	506,506.000	
	SUNTRUST BANKS INC	5,300	21.000	111,300.000	
	BAXTER INTL INC	9,900	56.290	557,271.000	
	FEDEX CORP	900	81.220	73,098.000	
	INTEL CORP	41,000	19.460	797,860.000	
	JOHNSON CONTROLS INC	11,700	26.620	311,454.000	
	MICROSOFT CORP	40,000	28.990	1,159,600.000	
	KRAFT FOODS INC-A	8,500	26.530	225,505.000	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	22,400	27.370	613,088.000	
	VF CORP	4,400	76.600	337,040.000	
アメリカ・ドル 小計		株 759,527		アメリカ・ドル 31,068,383.730 (2,795,843,851)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	139,800	5.952	832,089.600	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	95,000	3.747	355,965.000	
	PRUDENTIAL PLC	62,800	6.080	381,824.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	30,000	12.340	370,200.000	
	BG GROUP PLC	22,300	10.870	242,401.000	
	DIAGEO PLC	40,000	10.100	404,000.000	
	STANDARD CHARTERED PLC	35,200	16.190	569,888.000	
	TESCO PLC	74,000	4.188	309,912.000	
	VODAFONE GROUP PLC	228,200	1.379	314,687.800	
	WPP PLC	29,600	5.685	168,276.000	
	ASTRAZENECA PLC	5,300	27.380	145,114.000	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	364,500	0.832	303,264.000	
	CENTRICA PLC	69,000	2.427	167,463.000	
	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	45,000	19.630	883,350.000	
	BHP BILLITON PLC	34,300	17.755	608,996.500	
	HSBC HOLDINGS PLC	94,500	6.922	654,129.000	
	CAPITA GROUP PLC	14,800	7.685	113,738.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	10,900	18.490	201,541.000	
	ANTOFAGASTA PLC	30,100	8.930	268,793.000	
イギリス・ポンド 小計		株 1,425,300		イギリス・ポンド 7,295,631.900 (1,100,619,029)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP BILLITON LTD	59,300	37.610	2,230,273.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	5,300	48.510	257,103.000	
	WESTPAC BANKING	76,200	26.280	2,002,536.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	68,900	22.660	1,561,274.000	
	RIO TINTO LTD	17,400	65.750	1,144,050.000	
	ADELAIDE BRIGHTON LIMITED	31,400	2.770	86,978.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	25,500	55.080	1,404,540.000	
	QBE INSURANCE	25,000	22.530	563,250.000	
	WOOLWORTHS	22,700	28.400	644,680.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	52,600	10.200	536,520.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	5,000	7.140	35,700.000	
	TELSTRA CORPORATION	63,000	3.230	203,490.000	

	MACQUARIE GROUP LIMITED	9,500	49.840	473,480.000	
	CSL LIMITED	12,000	31.380	376,560.000	
	ONESTEEL LIMITED	108,700	3.110	338,057.000	
	WESFARMERS LIMITED	24,300	26.690	648,567.000	
	COCHLEAR LIMITED	5,500	63.000	346,500.000	
	SUNCORP-METWAY LIMITED	46,700	8.820	411,894.000	
	ASX LTD	12,000	33.510	402,120.000	
	JB HI-FI LTD	17,200	21.700	373,240.000	
オーストラリア・ドル 小計		株 688,200		オーストラリア・ドル 14,040,812.000 (1,175,215,964)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	BANK OF NOVA SCOTIA	13,500	47.490	641,115.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	10,900	56.440	615,196.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	14,500	21.040	305,080.000	
カナダ・ドル 小計		株 38,900		カナダ・ドル 1,561,391.000 (133,014,900)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK	53,000	18.000	954,000.000	
	FRASER & NEAVE LTD	139,000	3.780	525,420.000	
	KEPPEL CORP	61,000	8.170	498,370.000	
	O.C.B.C.	79,000	7.900	624,100.000	
	SINGAPORE TELECOM	180,000	2.910	523,800.000	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	139,000	3.350	465,650.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	294,000	1.050	308,700.000	
シンガポール・ドル 小計		株 945,000		シンガポール・ドル 3,900,040.000 (253,151,596)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	NESTLE SA-REGISTERED	10,000	47.990	479,900.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	2,600	230.700	599,820.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	17,200	53.900	927,080.000	
	SWISSCOM AG-REG	1,100	372.000	409,200.000	
	SYNGENTA AG	900	262.300	236,070.000	
スイス・フラン 小計		株 31,800		スイス・フラン 2,652,070.000 (236,697,247)	
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	S.K.F. AB-B SHS	45,000	116.600	5,247,000.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	4,900	432.000	2,116,800.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	50,000	100.000	5,000,000.000	
スウェーデン・クローナ 小計		株 99,900		スウェーデン・クローナ 12,363,800.000 (162,336,694)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	3,500	323.500	1,132,250.000	
デンマーク・クローネ 小計		株 3,500		デンマーク・クローネ 1,132,250.000 (20,527,693)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	8,100	49.650	402,165.000	
	SIEMENS AG	6,800	63.700	433,160.000	
	E.ON AG	9,500	27.050	256,975.000	

	BASF SE	10,900	38.500	419,650.000	
	ALLIANZ SE-REG	4,000	82.700	330,800.000	
	R.W.E. AG	10,800	60.490	653,292.000	
	HOCHTIEF AG	4,500	57.000	256,500.000	
	MUNCHENER RUECK AG-REG	2,000	106.490	212,980.000	
	MERCK KGAA	4,500	65.880	296,460.000	
	DAIMLER AG	9,900	33.945	336,055.500	
	DEUTSCHE BOERSE AG	3,300	56.420	186,186.000	
	WACKER CHEMIE AG	900	110.850	99,765.000	
	HEINEKEN NV	8,500	30.255	257,167.500	
	KONINKLIJKE KPN NV	20,000	12.300	246,000.000	
	TOTAL SA	17,600	42.910	755,216.000	
	AIR LIQUIDE	2,100	78.330	164,493.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	10,000	74.480	744,800.000	
	LAFARGE SA	2,700	56.830	153,441.000	
	BNP PARIBAS	18,000	56.710	1,020,780.000	
	LVMH	5,400	74.900	404,460.000	
	CREDIT AGRICOLE SA	65,500	14.610	956,955.000	
	GDF SUEZ	19,100	29.350	560,585.000	
	ENI SPA	37,100	17.530	650,363.000	
	TELEFONICA S.A.	57,600	19.540	1,125,504.000	
	BANCO SANTANDER SA	82,901	11.475	951,288.970	
	NOKIA OYJ	19,700	9.100	179,270.000	
ユーロ 小計		株 441,401		ユーロ 12,054,311.970 (1,626,126,685)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,500	220,000.000	330,000,000.000	
	DAEGU BANK	10,900	15,250.000	166,225,000.000	
	POSCO	1,000	533,000.000	533,000,000.000	
	GS ENGINEERING&CONSTRUCT	3,900	111,500.000	434,850,000.000	
	HYUNDAI MOBIS	3,300	157,500.000	519,750,000.000	
	KANGWON LAND INC	17,500	16,700.000	292,250,000.000	
	LG CHEMICAL LTD	2,400	201,000.000	482,400,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS	1,600	724,000.000	1,158,400,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,500	179,000.000	268,500,000.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	6,900	34,900.000	240,810,000.000	
韓国・ウォン 小計		株 50,500		韓国・ウォン 4,426,185,000.000 (344,799,812)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	20,000	118.100	2,362,000.000	
	CHEUNG KONG	41,000	98.100	4,022,100.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	92.800	1,856,000.000	
	CHINA MERCHANTS HLDGS	94,000	25.350	2,382,900.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	62,000	51.850	3,214,700.000	
	JIANGSU EXPRESS CO LTD -H	208,000	7.180	1,493,440.000	
	HK & CHINA GAS	127,990	18.260	2,337,097.400	
	HANG SENG BANK	44,300	115.600	5,121,080.000	
	JIANGXI COPPER COMPANY	80,000	18.680	1,494,400.000	
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG	66,000	38.250	2,524,500.000	
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL	464,000	6.820	3,164,480.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	68,700	62.750	4,310,925.000	
	CNOOC LTD	626,000	12.420	7,774,920.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	347,000	6.980	2,422,060.000	
	CHINA MOBILE LTD	33,500	73.350	2,457,225.000	

	CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR	87,000	27.650	2,405,550.000	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	274,000	13.780	3,775,720.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-H	603,000	6.660	4,015,980.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INV	164,000	17.360	2,847,040.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	105,000	38.400	4,032,000.000	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	117,000	6.650	778,050.000	
香港・ドル 小計		株 3,652,490		香港・ドル 64,792,167.400 (752,237,064)	
台湾・ドル	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	株 54,000	台湾・ドル 111.000	台湾・ドル 5,994,000.000	
	CHINA STEEL CORP	440,975	29.700	13,096,957.500	
	DELTA ELECTRONICS INC	177,700	87.700	15,584,290.000	
	ACER INC	178,770	76.400	13,658,028.000	
	MEDIATEK INC	34,062	485.000	16,520,070.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS	82,620	74.600	6,163,452.000	
	POU CHEN	395,432	24.450	9,668,312.400	
	SILICONWARE PRECISION IND	326,000	43.950	14,327,700.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	528,333	60.000	31,699,980.000	
	HON HAI PRECISION INDUS	168,141	134.500	22,614,964.500	
	PRESIDENT CHAIN STORE COR	114,960	76.900	8,840,424.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY	411,362	40.100	16,495,616.200	
台湾・ドル 小計		株 2,912,355		台湾・ドル 174,663,794.600 (487,311,988)	
合計		株 11,048,873		9,087,882,523 [9,087,882,523]	

- (2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

[次へ](#)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 61銘柄	100%	30.8%
イギリス・ポンド	株式 19銘柄	100%	12.1%
オーストラリア・ドル	株式 20銘柄	100%	12.9%
カナダ・ドル	株式 3銘柄	100%	1.5%
シンガポール・ドル	株式 7銘柄	100%	2.8%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	2.6%
スウェーデン・クローナ	株式 3銘柄	100%	1.8%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	100%	0.2%
ユーロ	株式 26銘柄	100%	17.9%
韓国・ウォン	株式 10銘柄	100%	3.8%
香港・ドル	株式 21銘柄	100%	8.3%
台湾・ドル	株式 12銘柄	100%	5.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成21年5月11日現在 金 額（円）	平成21年11月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	261,773,845	329,376,801
投資証券	14,325,941,600	15,421,017,800
未収入金	148,954,538	—
未収配当金	252,353,293	246,959,041
流動資産合計	14,989,023,276	15,997,353,642
資産合計	14,989,023,276	15,997,353,642
負債の部		
流動負債		
未払金	81,471,277	—
未払解約金	—	12,000,000
流動負債合計	81,471,277	12,000,000
負債合計	81,471,277	12,000,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	19,558,667,731	19,683,314,514
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△4,651,115,732	△3,697,960,872
元本等合計	14,907,551,999	15,985,353,642
純資産合計	14,907,551,999	15,985,353,642
負債純資産合計	14,989,023,276	15,997,353,642

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20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	22,402,040,628円	19,558,667,731円
同期中における追加設定元本額	507,089,932円	2,347,862,234円
同期中における一部解約元本額	3,350,462,829円	2,223,215,451円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	105,034,149円	103,382,740円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	259,185,372円	246,018,562円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	314,796,796円	291,968,221円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,096,688,057円	1,023,921,164円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	8,200,926円	8,200,926円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	7,600,465円	7,600,465円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	21,944,642円	21,939,071円
6資産バランスファンド（分配型）	3,432,923,327円	2,637,796,313円
6資産バランスファンド（成長型）	3,017,087,882円	2,864,020,536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）	275,097,450円	219,638,035円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	2,934,949,808円	2,523,284,434円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	33,632,195円	32,407,155円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	758,254,363円	711,317,209円
ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）	1,433,707円	1,329,347円
ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）	95,363円	95,363円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	63,246,286円	78,583,145円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	95,111,796円	107,652,586円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	71,375,120円	83,710,711円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	65,307,501円	75,410,003円
ダイワファンドラップ J-REITセレクト	3,695,205,149円	5,896,890,582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）	936,245,622円	785,649,107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）	295,222,346円	247,925,638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）	1,743,119,418円	1,428,099,977円
ダイワJリート・ファンド	326,909,991円	286,473,224円

計	19,558,667,731円	19,683,314,514円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 特定期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	19,558,667,731口	19,683,314,514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4,651,115,732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3,697,960,872円でありま す。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年5月11日現在		平成21年11月10日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
投資証券	14,325,941,600	449,898,974	15,421,017,800	427,403,520
合計	14,325,941,600	449,898,974	15,421,017,800	427,403,520

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末
日までの期間（平成20年11月11日から平成21年5月11日まで、及び平成21年5月12日から平成21年11
月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
本報告書における開示対象ファン ドの期末における当該親投資信託 の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7622円 (7,622円)	0.8121円 (8,121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	800	376,800,000	
	M I Dリート投資法人	1,100	230,450,000	
	日本コマーシャル投資	1,600	237,440,000	
	森ヒルズリート	310	85,870,000	
	野村不レジデンシャル	600	253,200,000	
	産業ファンド	500	123,500,000	
	日本ビルファンド	3,100	2,343,600,000	
	ジャパンリアルエステイト	2,670	1,946,430,000	
	日本リテールファンド	2,250	931,500,000	
	オリックス不動産投資	1,650	691,350,000	
	日本プライムリアルティ	3,663	709,156,800	

プレミア投資法人	580	202,420,000	
東急リアル・エステート	800	381,600,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	550	326,150,000	
野村不動産オフィスF	1,765	954,865,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,300	660,400,000	
森トラスト総合リート	1,100	771,100,000	
日本レジデンシャル	1,400	327,600,000	
フロンティア不動産投資	1,094	701,254,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	700	478,100,000	
福岡リート投資法人	333	167,832,000	
ケネディクス不動産投資法人	1,400	359,520,000	
ジョイントリート投資法人	800	154,720,000	
ラサールジャパン投資法人	1,050	123,270,000	
DAオフィス投資法人	2,000	492,600,000	
阪急リート投資法人	150	57,450,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	750	274,500,000	
ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	200	25,640,000	
トップリート投資法人	950	376,200,000	
ビ・ライフ投資法人	450	189,000,000	
ジャパンエクセレント投資法人	1,100	467,500,000	
投資証券 合計	36,715	15,421,017,800	
合計	36,715	15,421,017,800	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成21年5月11日現在 金 額（円）	平成21年11月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,135,259,517	8,056,472,711
コール・ローン	485,620,619	2,960,958,866
投資証券	75,249,307,251	156,612,674,790
派生商品評価勘定	15,854	9,990,237
未収入金	773,383,271	287,927,592
未収配当金	333,575,275	376,770,363
流動資産合計	79,977,161,787	168,304,794,559
資産合計	79,977,161,787	168,304,794,559
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,711,572	252,234
未払金	852,159,382	4,354,458,235
未払解約金	159,055,000	75,700,000
流動負債合計	1,012,925,954	4,430,410,469
負債合計	1,012,925,954	4,430,410,469
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	127,533,374,652	216,472,472,131
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△48,569,138,819	△52,598,088,041
元本等合計	78,964,235,833	163,874,384,090
純資産合計	78,964,235,833	163,874,384,090
負債純資産合計	79,977,161,787	168,304,794,559

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20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	121,201,599,376円	127,533,374,652円
同期中における追加設定元本額	17,052,374,521円	97,706,063,640円
同期中における一部解約元本額	10,720,599,245円	8,766,966,161円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREIT・オープン（毎月分配型）	69,724,503,405円	141,049,047,448円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	275,609,050円	208,901,438円

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	352,805,124円	287,006,457円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	417,784,754円	345,342,011円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,385,513,814円	1,168,013,982円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	11,561,728円	8,922,760円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	10,629,115円	8,148,996円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	26,932,246円	24,871,921円
6資産バランスファンド（分配型）	4,485,753,218円	2,933,208,660円
6資産バランスファンド（成長型）	4,376,161,608円	3,277,286,844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）	365,591,229円	244,948,694円
りそな ワールド・リート・ファンド	24,016,672,458円	50,088,160,384円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	3,865,348,408円	2,855,452,056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）	98,560,083円	73,026,179円
日の出・3資産バランスファンド	536,721,669円	266,853,064円
常陽3分法ファンド	5,072,698,965円	4,479,041,154円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	1,050,981,219円	832,155,548円
ダイワ・海外株式& R E I Tファンド（毎月分配型）	286,562,563円	261,779,277円
ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）	2,141,833円	1,498,935円
ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）	134,400円	105,926円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	94,733,122円	89,693,192円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	138,872,940円	116,940,184円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	93,855,201円	97,020,749円
ダイワ・グローバルR E I Tファンド（ダイワSMA専用）	1,916,081,020円	1,874,418,524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）	8,927,165,480円	5,880,627,748円
計	127,533,374,652円	216,472,472,131円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	127,533,374,652口	216,472,472,131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48,569,138,819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52,598,088,041円であります。

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種 類	平成21年5月11日現在		平成21年11月10日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
投資証券	75,249,307,251	15,619,972,474	156,612,674,790	475,556,272
合計	75,249,307,251	15,619,972,474	156,612,674,790	475,556,272

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年3月17日から平成21年5月11日まで、及び平成21年9月16日から平成21年11月10日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成20年11月11日 至 平成21年5月11日	自 平成21年5月12日 至 平成21年11月10日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、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。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成21年5月11日 現在				平成21年11月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								

為替予約取引								
売 建	136,824,123	—	136,808,269	15,854	421,756,324	—	421,384,712	371,612
アメリカ・ドル	—	—	—	—	417,823,243	—	417,452,092	371,151
イギリス・ポンド	12,576,947	—	12,576,107	840	—	—	—	—
オーストラリア・ドル	99,810,371	—	99,797,176	13,195	—	—	—	—
カナダ・ドル	—	—	—	—	3,933,081	—	3,932,620	461
ユーロ	24,436,805	—	24,434,986	1,819	—	—	—	—
買 建	136,824,123	—	135,112,551	△1,711,572	1,771,193,824	—	1,780,560,215	9,366,391
アメリカ・ドル	136,824,123	—	135,112,551	△1,711,572	1,353,370,581	—	1,353,628,347	257,766
オーストラリア・ドル	—	—	—	—	417,823,243	—	426,931,868	9,108,625
合計	273,648,246	—	271,920,820	△1,695,718	2,192,950,148	—	2,201,944,927	9,738,003

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成21年5月11日現在	平成21年11月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6192円 (6,192円)	0.7570円 (7,570円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		UDR 6.750 G	92,125.000	1,934,625.000	
		PUBLIC STORAGE INC N	66,889.000	1,534,433.660	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	255,959.000	18,152,612.280
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,054,876.000	75,655,706.720
BOSTON PROPERTIES INC	537,010.000	34,057,174.200
BIOMED REALTY TRUST INC	834,677.000	11,743,905.390
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	691,809.000	9,228,732.060
VORNADO REALTY TRUST	659,767.000	42,350,443.730
EQUITY RESIDENTIAL	955,747.000	28,739,312.290
HOST HOTELS&RESORTS INC	2,648,554.000	27,995,215.780
KIMCO REALTY CORP	529,543.000	6,783,445.830
SOVRAN SELF STORAGE INC	528,278.000	15,953,995.600
VENTAS INC	398,812.000	16,331,351.400
AMB PROPERTY CORP	369,708.000	8,702,926.320
BRANDYWINE REALTY TRUST	710,087.000	7,044,063.040
BRE PROPERTIES-CL A	122,098.000	3,664,160.980
MACK-CALI REALTY CORP	637,597.000	20,097,057.440
COLONIAL PROPERTIES TRUST	704,554.000	7,433,044.700
COUSINS PROPERTIES INC	632,988.000	4,696,770.960
DEVELOPERS DIV REALTY	1,874,892.000	16,217,815.800
FEDERAL REALTY INVS TRUST	142,579.000	9,549,941.420
HEALTH CARE REIT INC	183,683.000	8,030,620.760
HCP INC	804,481.000	23,209,276.850
HOSPITALITY PROPERTIES	907,829.000	17,176,124.680
KILROY REALTY CORP	308,430.000	8,910,542.700
LIBERTY PROPERTY TRUST	667,966.000	20,419,720.620
LEXINGTON REALTY TRUST	1,921,993.000	8,514,428.990
MACERICH CO/THE	858,437.000	27,341,218.450
NATIONWIDE HEALTH PPTYS	257,014.000	8,751,326.700
PROLOGIS	3,246,331.000	40,741,454.050
POST PROPERTIES INC	506,122.000	8,806,522.800
PUBLIC STORAGE	523,385.000	41,425,922.750
REGENCY CENTERS CORP	230,792.000	7,950,784.400
SL GREEN REALTY CORP	229,130.000	9,362,251.800
SENIOR HOUSING PROP TRUST	950,550.000	18,193,527.000
UDR INC	1,238,810.000	18,284,835.600
WEINGARTEN REALTY INVESTO	427,587.000	8,149,808.220
DEVELOP DIV RLTY 7.375% H	108,276.000	1,809,291.960
PS BUSINESS PARK 7% H	163,800.000	3,433,248.000
PS BUSINESS PARK 6.875% I	104,200.000	2,146,520.000
DEVELOP DIV RLTY 8% G	105,293.000	1,927,914.830
APARTMENT INVEST 8% T	179,000.000	3,759,000.000
APARTMENT INVEST 7.75% U	98,650.000	1,985,824.500
DUKE REALTY CORP 6.5% K	235,125.000	4,453,267.500
HCP INC 7.1% F	250,000.000	5,375,000.000
KIMCO REALTY 6.65% F	89,244.000	1,775,955.600
PROLOGIS TRUST 6.75% F	183,922.000	3,448,537.500
WEINGARTEN RLTY 6.75% D	174,173.000	3,363,280.630
ALEXANDRIA RE EQ 8.375% C	82,025.000	1,994,848.000
KIMCO REALTY 7.75% G	346,042.000	7,855,153.400
DUKE REALTY CORP 8.375 O	328,521.000	7,713,673.080
APARTMENT INVEST 8% V	87,547.000	1,834,985.120
PS BUSINESS PARK 7.6% L	48,818.000	1,165,773.840
U-STORE-IT TRUST	842,000.000	5,397,220.000
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	1,121,746.000	8,895,445.780
TANGER FACTORY 7.50% C	75,000.000	1,708,500.000
VORNADO RLTY TST 6.625% G	204,542.000	4,203,338.100
AMERICAN CAMPUS COMMUNITI	250,286.000	6,727,687.680
EDUCATION REALTY TRUST	639,991.000	3,321,553.290

	DIGITAL REALTY 7.875% B	2,245.000	53,296.300
	REGENCY CENTERS 7.25% D	65,312.000	1,427,067.200
	REGENCY CENTERS 6.7% E	73,886.000	1,510,968.700
	VORNADO REALTY TST 6.75%F	182,907.000	3,841,047.000
	VORNADO REALTY TST 6.75%H	169,703.000	3,521,337.250
	LASALLE HOTEL 8% E	85,280.000	1,803,672.000
	HRPT PROPERTIES 7.125% C	105,169.000	2,058,157.330
	AMB PROPERTY 7.0% O	57,644.000	1,216,288.400
	PUBLIC STORAGE 6.95% H	179,402.000	4,018,604.800
	PUBLIC STORAGE INC I	140,000.000	3,430,000.000
	VORNADO RLTY TST 7.0% E	51,663.000	1,115,404.170
	VORNADO RLTY TST 6.625% I	225,477.000	4,624,533.270
	PS BUSINESS PARK 7.375% O	16,800.000	371,280.000
	DUKE REALTY CORP 7.25% N	85,159.000	1,686,148.200
	PUBLIC STORAGE INC -K	205,400.000	4,948,086.000
	DUKE REALTY CORP 6.60% L	241,600.000	4,498,592.000
	NAT'L RETAIL PROP CL C	80,500.000	1,827,350.000
	DOUGLAS EMMETT	862,083.000	11,146,733.190
	PUBLIC STORAGE INC L	297,000.000	6,545,880.000
	REALTY INCOME PFD E	60,000.000	1,380,000.000
	BRE PROPERTIES 6.75 D	84,800.000	1,779,952.000
	PUBLIC STORAGE INC M	345,000.000	7,438,200.000
	PS BUSINESS PARK P	299,975.000	6,149,487.500
	BIOMED REALTY 7.375 A	209,375.000	4,465,968.750
	WEINGARTEN RLTY F	378,247.000	7,035,394.200
	LEXINGTON REALTY D	282,943.000	4,838,325.300
	HOSPITALITY PROP C	367,000.000	6,976,670.000
	DUKE REALTY CORP 6.95% M	117,094.000	2,224,786.000
アメリカ・ドル 小計		38,700,954.000	アメリカ・ドル 829,364,349.340 (74,634,497,797)
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES PLC	3,683,020.000	イギリス・ポンド 25,725,894.700
	SEGRO PLC	5,901,294.000	20,436,181.120
	HAMMERSON PLC	5,281,325.000	22,387,536.670
	BRITISH LAND CO PLC	4,872,948.000	22,863,872.010
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	3,010,861.000	7,927,597.010
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	1,285,000.000	5,858,315.000
	DERWENT LONDON PLC	882,618.000	11,050,377.360
イギリス・ポンド 小計		24,917,066.000	イギリス・ポンド 116,249,773.870 (17,537,440,886)
オーストラリア・ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	4,424,361.000	オーストラリア・ドル 8,561,138.530
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	21,172,979.000	20,220,194.940
	DEXUS PROPERTY GROUP	49,816,633.000	40,102,389.560
	GPT GROUP	56,003,809.000	33,882,304.440
	ING INDUSTRIAL FUND	10,634,163.000	5,104,398.240
	ING OFFICE FUND	36,299,938.000	19,601,966.520
	MIRVAC GROUP	18,749,482.000	26,436,769.620
	STOCKLAND	15,549,756.000	57,223,102.080
	WESTFIELD GROUP	10,951,063.000	135,136,117.420
	GOODMAN GROUP	46,922,825.000	28,622,923.250
オーストラリア・ドル 小計		270,525,009.000	オーストラリア・ドル 374,891,304.600 (31,378,402,195)
カナダ・ドル			カナダ・ドル

	CAN REAL ESTATE INVEST TR	653,204.000	17,153,137.040	
	BOARDWALK REAL ESTATE INV	365,359.000	13,646,158.650	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA	1,193,761.000	19,112,113.610	
カナダ・ドル 小計		2,212,324.000	カナダ・ドル 49,911,409.300 (4,251,952,958)	
シンガポール・ドル	CAPITACOMMERCIAL TRUST	22,975,000.000	シンガポール・ドル 24,583,250.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	2,847,000.000	5,352,360.000	
	CAPITAMALL TRUST	6,645,000.000	11,163,600.000	
	SUNTEC REIT	4,728,000.000	5,626,320.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	6,725,000.000	4,909,250.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	3,818,000.000	5,765,180.000	
シンガポール・ドル 小計		47,738,000.000	シンガポール・ドル 57,399,960.000 (3,725,831,403)	
ニュージーランド・ドル	KIWI INCOME PROPERTY TRU	2,640,363.000	ニュージーランド・ドル 2,719,573.890	
	AMP NZ OFFICE TRUST	6,829,158.000	5,395,034.820	
ニュージーランド・ドル 小計		9,469,521.000	ニュージーランド・ドル 8,114,608.710 (542,218,154)	
ユーロ	CORIO NV	436,109.000	ユーロ 20,771,871.670	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-C	171,936.000	4,917,369.600	
	VASTNED RETAIL NV	173,666.000	8,162,302.000	
	ICADE	178,894.000	12,790,921.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	499,867.000	77,129,478.100	
	GECINA SA	76,500.000	5,976,180.000	
	KLEPIERRE	277,300.000	7,989,013.000	
	FONCIERE DES REGIONS	115,172.000	8,698,941.160	
	SILIC	47,746.000	4,106,156.000	
ユーロ 小計		1,977,190.000	ユーロ 150,542,232.530 (20,308,147,169)	
香港・ドル	LINK REIT	17,452,756.000	香港・ドル 302,281,733.920	
	CHAMPION REIT	19,325,000.000	62,419,750.000	
香港・ドル 小計		36,777,756.000	香港・ドル 364,701,483.920 (4,234,184,228)	
投資証券 合計			156,612,674,790 [156,612,674,790]	
合計			156,612,674,790 [156,612,674,790]	

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 87銘柄	100%	47.7%

イギリス・ポンド	投資証券	7銘柄	100%	11.2%
オーストラリア・ドル	投資証券	10銘柄	100%	20.0%
カナダ・ドル	投資証券	3銘柄	100%	2.7%
シンガポール・ドル	投資証券	6銘柄	100%	2.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券	2銘柄	100%	0.3%
ユーロ	投資証券	9銘柄	100%	13.0%
香港・ドル	投資証券	2銘柄	100%	2.7%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年11月30日

I 資産総額	22,638,516円
II 負債総額	8,455円
III 純資産総額（I－II）	22,630,061円
IV 発行済数量	25,304,559口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.8943円

（参考）ダイワ日本債券アクティブ・マザーファンド
純資産額計算書

平成21年11月30日

I 資産総額	568,843,359円
II 負債総額	33,883,308円
III 純資産総額（I－II）	534,960,051円
IV 発行済数量	507,160,299口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.0548円

（参考）ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド
純資産額計算書

平成21年11月30日

I 資産総額	344,716,339円
II 負債総額	30,233,425円
III 純資産総額（I－II）	314,482,914円
IV 発行済数量	302,723,336口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.0388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21年11月30日

I 資産総額	291,938,289,516円
II 負債総額	14,480,315,738円
III 純資産総額（I－II）	277,457,973,778円
IV 発行済数量	246,362,504,683口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.1262円

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド
純資産額計算書

平成21年11月30日

I 資産総額	27,104,641,332円
II 負債総額	372,736,197円

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,731,905,135円
Ⅳ 発行済数量	28,735,051,437口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9303円

（参考）ダイワ海外好配当株マザーファンド

純資産額計算書

平成21年11月30日

Ⅰ 資産総額	8,884,950,998円
Ⅱ 負債総額	36,446,398円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	8,848,504,600円
Ⅳ 発行済数量	12,643,079,188口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6999円

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

平成21年11月30日

Ⅰ 資産総額	14,852,606,287円
Ⅱ 負債総額	70,047,791円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,782,558,496円
Ⅳ 発行済数量	19,799,065,496口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.7466円

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

純資産額計算書

平成21年11月30日

Ⅰ 資産総額	162,572,726,158円
Ⅱ 負債総額	772,730,906円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	161,799,995,252円
Ⅳ 発行済数量	224,801,306,495口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.7197円

第5 【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	6,517,360	0
第2特定期間	9,263,155	0
第3特定期間	7,713,997	0
第4特定期間	814,578	0
第5特定期間	1,089,759	1,094,290

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

第三部 【特別情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成21年11月末日現在、資本金の額は151億7,427万2,500円です。なお、発行可能株式総数は799万9,980株であり、260万8,525株を発行済みです。

b. 委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

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

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

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

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

けて、必要事項を審議・決定します。

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成21年11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（公募）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	13	43,121
追加型株式投資信託	262	5,384,281
株式投資信託 合計	275	5,427,402
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,918,974
公社債投資信託 合計	17	2,918,974
総合計	292	8,346,377

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、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しており、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）の財務諸表及び第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第51期事業年度に係る中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）の中間財務諸表について、あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,398,882	3,961,462
有価証券	32,206,041	28,233,112
前払金	3,357	453
前払費用	96,205	84,549
未収入金	75,494	20,722
未収消費税等	—	27,138
未収委託者報酬	8,899,037	5,273,080
未収収益	136,888	25,476
貯蔵品	83,453	38,909
繰延税金資産	779,955	227,536
デリバティブ資産	1,172,830	—
その他	30,104	2,030
流動資産計	46,882,252	37,894,473
固定資産		
有形固定資産	※1 1,618,595	※1 1,252,162
建物（純額）	388,414	349,484
器具備品（純額）	1,229,446	900,893

建設仮勘定	735	1,785
無形固定資産	1,989,254	1,980,730
ソフトウェア	1,976,209	1,967,944
電話加入権	11,850	11,850
その他	1,194	936
投資その他の資産	8,890,810	8,317,769
投資有価証券	7,690,544	7,780,508
関係会社株式	737,012	737,012
出資金	166,719	178,806
従業員に対する長期貸付金	176,298	155,692
差入保証金	633,855	618,264
長期前払費用	10,039	8,394
投資不動産（純額）	593,270	579,162
その他	43	—
貸倒引当金	※3 △1,116,972	※3 △1,740,069
固定資産計	12,498,661	11,550,663
資産合計	59,380,914	49,445,137

(単位:千円)

	前事業年度 (平成20年 3月31日現在)	当事業年度 (平成21年 3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	50,693	48,999
未払金	10,302,751	5,335,193
未払収益分配金	27,011	32,233
未払償還金	332,721	278,950
未払手数料	4,943,985	2,896,691
その他未払金	※2 4,999,033	※2 2,127,318
未払費用	2,177,782	1,528,570
未払法人税等	1,402,832	442,052
未払消費税等	425,013	—
前受収益	39,700	—
賞与引当金	480,300	223,000
その他	22,096	1,951
流動負債計	14,901,170	7,579,766
固定負債		
退職給付引当金	988,898	1,150,011
役員退職慰労引当金	46,260	62,520
繰延税金負債	2,300,289	1,767,537
固定負債計	3,335,448	2,980,068
負債合計	18,236,618	10,559,835
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		
別途積立金	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金	11,702,152	9,659,553
利益剰余金合計	14,876,450	12,833,851
株主資本合計	41,546,450	39,503,851
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△402,154	△618,549
評価・換算差額等合計	△402,154	△618,549
純資産合計	41,144,295	38,885,301
負債・純資産合計	59,380,914	49,445,137

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成19年 4 月 1 日 至 平成20年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,506,998	67,765,880
その他営業収益	572,557	391,449
営業収益計	83,079,556	68,157,330
営業費用		
支払手数料	48,784,763	40,411,927
広告宣伝費	1,542,009	836,270
公告費	9,189	2,131
受益証券発行費	41,501	4,887
調査費	4,197,737	4,089,629
調査費	672,732	752,522
委託調査費	3,525,004	3,337,107
委託計算費	642,326	657,069
営業雑経費	2,103,482	1,828,907
通信費	283,069	264,500
印刷費	918,929	908,407
協会費	40,717	49,882
諸会費	10,258	11,279
その他営業雑経費	850,507	594,837
営業費用計	57,321,011	47,830,823
一般管理費		
給料	4,208,378	3,940,850
役員報酬	185,100	149,400
給料・手当	3,139,424	3,408,724
賞与	403,553	159,726
賞与引当金繰入額	480,300	223,000
福利厚生費	548,953	573,052
交際費	85,291	89,101
寄付金	1,796	630
旅費交通費	231,428	233,872
租税公課	427,247	328,325
不動産賃借料	666,919	730,467
退職給付費用	309,416	310,345
役員退職慰労引当金繰入額	33,405	26,700
固定資産減価償却費	713,538	1,012,489
諸経費	1,349,328	904,760
一般管理費計	8,575,704	8,150,595
営業利益	17,182,840	12,175,911

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成19年 4 月 1 日 至 平成20年 3 月31日)		当事業年度 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	
営業外収益				
受取配当金		205,108		33,852
有価証券利息		473,605		350,432
受取利息		4,674		4,904
時効成立分配金・償還金		117,919		38,525
有価証券償還益		226,585		26,762
為替差益		—		721,935
デリバティブ評価益		1,150,268		—
その他		27,266		20,641
営業外収益計		2,205,428		1,197,054
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		58,372		127,439
貯蔵品廃棄損		161,462		74,887
為替差損		1,632,650		—
デリバティブ損失		—		885,196
貸倒引当金繰入額		—	※3	621,387
その他		41,095		50,066
営業外費用計		1,893,580		1,758,977
経常利益		17,494,688		11,613,987
特別利益				
投資有価証券売却益	※1	2,241,103		2,157
ゴルフ会員権売却益		13,021		—
特別利益計		2,254,124		2,157
特別損失				
投資有価証券売却損		21,921		2,298
投資有価証券評価損		—		218,872
投資有価証券清算損		—		10,639
固定資産除売却損	※2	44,642	※2	11,886
貸倒引当金繰入額	※3	1,113,972		—
その他	※4	3,737	※4	42,274
特別損失計		1,184,273		285,971
税引前当期純利益		18,564,539		11,330,173
法人税、住民税及び事業税		6,901,995		4,648,684
法人税等調整額		997,192		168,125
法人税等合計		7,899,187		4,816,810
当期純利益		10,665,351		6,513,363

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
特別償却準備金		
前期末残高	2,261	—
当期変動額		
特別償却準備金の取崩	△2,261	—
当期変動額合計	△2,261	—
当期末残高	—	—
別途積立金		
前期末残高	2,800,000	2,800,000
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	8,834,028	11,702,152
当期変動額		
特別償却準備金の取崩	2,261	—
剰余金の配当	△7,799,489	△8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363

当期変動額合計	2,868,123	△2,042,599
当期末残高	11,702,152	9,659,553

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
利益剰余金合計		
前期末残高	12,010,588	14,876,450
当期変動額		
剰余金の配当	△7,799,489	△8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
当期変動額合計	2,865,862	△2,042,599
当期末残高	14,876,450	12,833,851
株主資本合計		
前期末残高	38,680,588	41,546,450
当期変動額		
剰余金の配当	△7,799,489	△8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
当期変動額合計	2,865,862	△2,042,599
当期末残高	41,546,450	39,503,851
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	562,216	△402,154
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	△964,370	△216,395
当期変動額合計	△964,370	△216,395
当期末残高	△402,154	△618,549
評価・換算差額等合計		
前期末残高	562,216	△402,154
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	△964,370	△216,395
当期変動額合計	△964,370	△216,395
当期末残高	△402,154	△618,549
純資産合計		
前期末残高	39,242,804	41,144,295
当期変動額		
剰余金の配当	△7,799,489	△8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	△964,370	△216,395
当期変動額合計	1,901,491	△2,258,994
当期末残高	41,144,295	38,885,301

重要な会計方針

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	(1) 子会社及び関連会社株式 移動平均法による原価法によ り計上しております。	(1) 子会社及び関連会社株式 同左
	(2) その他有価証券 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) その他有価証券 同左
2. デリバティブの評価 基準及び評価方法	時価法により計上しておりま す。	同左
3. 固定資産の減価償却 の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通 りであります。 建物 7～50年 器具備品 5～10年 (会計方針の変更) 法人税法の改正（（所得税法等 の一部を改正する法律 平成19年 3月30日 法律第6号）及び（法 人税法施行令の一部を改正する政 令 平成19年3月30日 政令第83 号））に伴い、当事業年度より、 平成19年4月1日以降に取得した ものについては、改正後の法人税 法に基づく方法に変更しておりま す。 当該変更に伴う損益に与える影 響は、軽微であります。	(1) 有形固定資産及び投資不動産 (リース資産を除く) 同左
	(追加情報) 当事業年度より、平成19年3月 31日以前に取得したものについ ては、償却可能限度額まで償却が終 了した翌年から5年間で均等償却 する方法によっております。 当該変更に伴う損益に与える影 響は、軽微であります。	-----
	(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアに ついては、社内における利用可能 期間（5年）に基づいておりま す。	(2) 無形固定資産（リース資産を除 く） 同左
	(3) 長期前払費用 定額法によっております。	(3) 長期前払費用 同左

4. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額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。	(1) 貸倒引当金 同左 (2) 賞与引当金 同左 (3) 退職給付引当金 同左 (4) 役員退職慰労引当金 同左 -----
5. リース取引の処理方法	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	
6. その他財務諸表作成のための重要な事項	(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。ただし、固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は投資その他の資産に計上し、5年間で均等償却を行っております。 (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。	(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 同左

会計方針の変更

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
---	---

-----	（リース取引に関する会計基準） 当事業年度より、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成5年6月17日（企業会計審議会第一部会）、平成19年3月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成6年1月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年3月30日改正））を適用しております。 なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理を適用しております。 当該変更に伴う損益に与える影響はありません。
-------	---

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成20年3月31日現在）	当事業年度 （平成21年3月31日現在）
※1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 建物 735,161千円 器具備品 1,604,537千円 投資建物 662,012千円 投資器具備品 26,457千円 ※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。 未払金 4,620,908千円 ※3 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。 4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務145,120千円に対して保証を行っております。	※1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 建物 776,838千円 器具備品 1,691,069千円 投資建物 675,647千円 投資器具備品 26,929千円 ※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。 未払金 1,848,998千円 ※3 同左 4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務711,260千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

前事業年度 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	当事業年度 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
※1 関係会社との取引 投資有価証券売却益 2,067,950千円 ※2 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 固定資産除却損 器具備品 44,642千円	----- ※2 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 固定資産除却損 器具備品 11,886千円

※3 貸倒引当金繰入額に関する注記 保有している外貨建資産担保債券の1銘柄について、清算事象が生じているため、当該銘柄の回収不能見込額を算定し、その見積金額を貸倒引当金として計上しております。 なお、貸倒引当金の計上基準については重要な会計方針に記載しております。 ※4 特別損失の「その他」の主な内訳 会社清算損 3,069千円 保証金の返還に伴う損失 668千円	※3 同左 ※4 特別損失の「その他」の主な内訳 受益証券予備廃棄損 21,160千円 ゴルフ会員権評価損 19,403千円
---	--

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成19年6月22日 定時株主総会	普通株式	7,799	2,990	平成19年 3月31日	平成19年 6月25日

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

平成20年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

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

当事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	前事業年度末 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				

普通株式	2,608	—	—	2,608
合 計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成20年6月20日 定時株主総会	普通株式	8,555	3,280	平成20年 3月31日	平成20年 6月23日

(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21年6月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

- ①剰余金の配当の総額 6,495百万円
- ②配当の原資 利益剰余金
- ③1株当たり配当額 2,490円
- ④基準日 平成21年3月31日
- ⑤効力発生日 平成21年6月22日

(リース取引関係)

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)																												
(借主側) リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 <table> <tr> <td></td><td>器具備品</td></tr> <tr> <td>取得価額相当額</td><td>4,599千円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td><td>2,299</td></tr> <tr> <td>期末残高相当額</td><td>2,299</td></tr> </table> なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。 (2)未経過リース料期末残高相当額 <table> <tr> <td>1年以内</td><td>1,314千円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>985</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>2,299</td></tr> </table> なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。		器具備品	取得価額相当額	4,599千円	減価償却累計額相当額	2,299	期末残高相当額	2,299	1年以内	1,314千円	1年超	985	合計	2,299	(借主側) リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 (1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 <table> <tr> <td></td><td>器具備品</td></tr> <tr> <td>取得価額相当額</td><td>4,599千円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td><td>3,613</td></tr> <tr> <td>期末残高相当額</td><td>985</td></tr> </table> なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。 (2)未経過リース料期末残高相当額 <table> <tr> <td>1年以内</td><td>985千円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>-</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>985</td></tr> </table> なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。		器具備品	取得価額相当額	4,599千円	減価償却累計額相当額	3,613	期末残高相当額	985	1年以内	985千円	1年超	-	合計	985
	器具備品																												
取得価額相当額	4,599千円																												
減価償却累計額相当額	2,299																												
期末残高相当額	2,299																												
1年以内	1,314千円																												
1年超	985																												
合計	2,299																												
	器具備品																												
取得価額相当額	4,599千円																												
減価償却累計額相当額	3,613																												
期末残高相当額	985																												
1年以内	985千円																												
1年超	-																												
合計	985																												

(3)支払リース料及び減価償却費相当額 支払リース料 1,314千円 減価償却費相当額 1,314千円 (4)減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	(3)支払リース料及び減価償却費相当額 支払リース料 1,314千円 減価償却費相当額 1,314千円 (4)減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。
---	---

(有価証券関係)

1. その他有価証券で時価のあるもの

種類	前事業年度 (平成20年3月31日現在)			当事業年度 (平成21年3月31日現在)		
	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの						
(1)株式	55,101	73,804	18,702	55,101	67,520	12,418
(2)債券	50,000	50,105	105	—	—	—
(3)その他						
証券投資信託の受 益証券	3,110,512	3,238,991	128,479	1,732,000	1,815,427	83,427
小計	3,215,614	3,362,900	147,286	1,787,101	1,882,948	95,846
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの						
(1)債券	13,669,870	11,886,801	△1,783,068	—	—	—
(2)その他						
証券投資信託の受 益証券	2,816,910	2,591,485	△225,424	3,766,074	2,627,319	△1,138,755
小計	16,486,780	14,478,287	△2,008,493	3,766,074	2,627,319	△1,138,755
合計	19,702,395	17,841,188	△1,861,206	5,553,176	4,510,267	△1,042,909

(注) その他有価証券で時価のあるものについて、当事業年度において218,872千円の減損処理を行っております。

なお、有価証券の減損にあたって、当事業年度末における時価の下落率が取得原価の50%以上の場合は、著しい下落かつ回復する見込みがないと判断して、減損処理を行っております。また、時価の下落率が取得原価の30%以上50%未満の場合は、時価の推移及び発行会社の財政状態等を総合的に勘案して回復可能性を検討し、回復見込みがないと判断されたものについては、減損処理を行っております。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
売却額 (千円)	3,892,206	190,340
売却益の合計額 (千円)	2,241,103	2,157
売却損の合計額 (千円)	21,921	2,298

3. 時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

種類	前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
	貸借対照表計上額 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)
子会社株式及び関連会社株式		
子会社株式	737,012	737,012
小計	737,012	737,012
その他有価証券		
非上場株式	1,314,612	1,172,137
外貨建資産担保債券	2,504,860	2,098,103
MMF・中期国債ファンド	18,235,925	28,233,112
小計	22,055,397	31,503,352
合計	22,792,409	32,240,364

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

	1年以内（千円）	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超（千円）
(1)債券				
社債	150,000	—	—	—
その他	13,569,000	—	—	—
(2)その他				
証券投資信託 の受益証券	1,023,578	434,463	1,611,490	86,955
合計	14,742,578	434,463	1,611,490	86,955

当事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

	1年以内（千円）	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超（千円）
その他				
証券投資信託の 受益証券	—	376,553	1,729,191	—
合計	—	376,553	1,729,191	—

(デリバティブ取引関係)

1. 取引の状況に関する事項

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
--	--

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

2. 取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	前事業年度 (平成20年3月31日現在)				当事業年度 (平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額等 のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)	契約額等 (千円)	契約額等 のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	16,334,748	-	1,150,268	1,150,268	410,852	-	△1,622	△1,622

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

(退職給付関係)

前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。 2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 988,898千円 退職給付引当金 988,898千円	1. 採用している退職給付制度の概要 同左 2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,150,011千円 退職給付引当金 1,150,011千円

3. 退職給付費用に関する事項		3. 退職給付費用に関する事項	
勤務費用	152,041千円	勤務費用	168,703千円
その他	157,375	その他	141,642
退職給付費用	309,416	退職給付費用	310,345
なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は106,630千円であります。		なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は118,690千円であります。	

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成20年3月31日現在)		当事業年度 (平成21年3月31日現在)	
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳	
繰延税金資産	千円	繰延税金資産	千円
減損損失	887,301	減損損失	886,012
貸倒引当金	454,496	貸倒引当金	708,034
退職給付引当金	402,382	退職給付引当金	467,939
未払事業税	332,390	その他有価証券評価差額金	424,359
株式譲渡損繰延	287,965	投資有価証券評価損	303,843
その他有価証券評価差額金	275,900	株式譲渡損繰延	287,965
投資有価証券評価損	214,784	出資金評価損	126,163
賞与引当金	168,660	未払事業税	108,049
出資金評価損	118,268	賞与引当金	90,738
器具備品	38,093	器具備品	38,093
役員退職慰労引当金	18,823	役員退職慰労引当金	25,439
未払社会保険料	18,208	未払社会保険料	11,283
前受収益	16,153	その他	31,981
一括償却資産	10,048	繰延税金資産小計	3,509,905
その他	23,392	評価性引当額	△2,210,636
繰延税金資産小計	3,266,871	繰延税金資産合計	1,299,269
評価性引当額	△1,947,529	繰延税金負債	
繰延税金資産合計	1,319,341	株式譲渡益繰延	2,837,113
繰延税金負債		その他	2,156
株式譲渡益繰延	2,837,113	繰延税金負債合計	2,839,269
その他	2,562	繰延税金負債の純額	1,540,000
繰延税金負債合計	2,839,675		
繰延税金負債の純額	1,520,333		
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率 (調整)	40.69%	法定実効税率 (調整)	40.69%
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.20	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.35
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.52	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.13
住民税均等割	0.02	住民税均等割	0.03
評価性引当額	2.45	評価性引当額	2.32

その他	$\triangle 0.29$	その他	$\triangle 0.74$
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.55	税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.52

(関連当事者情報)

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1. 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	178,324	持ち株会社	100.0	役員2人	経営管理	有価証券の売却 売却代金 売却益	3,153,487 2,067,950	— —	— —

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の 子会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	なし	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	31,893,085	未払手数料	3,927,855
親会社の 子会社	大和証券エスエムビーシー(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	—	なし	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	1,197,059	未払手数料	82,472
								為替予約	25,434,342	—	—
親会社の 子会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	—	なし	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,074,141	その他未払金	321,615

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

(追加情報)

当事業年度より、平成18年10月17日公表の「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号）を適用しております。

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

1. 関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

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	100.0	経営管理	債務保証	711,260	—	—

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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）
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	25,915,828	未払手数料	2,154,948
同一の親会社をもつ会社	大和証券エスエムビーシー(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	—	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	980,553	未払手数料	58,506
							為替予約	17,314,889	—	—
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	1,000	情報サービス業	—	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	544,950	その他未払金	197,190

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- （1）証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- （2）為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。
- （3）ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- （4）(株)大和総研との取引金額には、(株)大和総研ホールディングス（旧・(株)大和総研）分社化前の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
1株当たり純資産額 15,773.01円 1株当たり当期純利益 4,088.65円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額 については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。	1株当たり純資産額 14,907.00円 1株当たり当期純利益 2,496.95円 同左

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
当期純利益（千円）	10,665,351	6,513,363
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)

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
該当事項はありません。	同左

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

当中間会計期間末 (平成21年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,276,319
有価証券		22,256,096
未収委託者報酬		6,213,110
貯蔵品		26,368
繰延税金資産		321,833
その他		424,869
流動資産計		33,518,597
固定資産		
有形固定資産	※ 1	1,168,979
無形固定資産		1,801,825
投資その他の資産		
投資有価証券		10,148,103
その他	※ 1	1,503,398
貸倒引当金	※ 2	△1,538,999
投資その他の資産合計		10,112,502
固定資産計		13,083,307
資産合計		46,601,904

(単位:千円)

当中間会計期間末 (平成21年9月30日)		
負債の部		
流動負債		
未払金		5,163,439
未払法人税等		722,692
賞与引当金		410,700
その他	※ 4	1,613,671
流動負債計		7,910,503
固定負債		
繰延税金負債		1,926,552
退職給付引当金		1,163,635
役員退職慰労引当金		43,950
固定負債計		3,134,137
負債合計		11,044,641
純資産の部		

株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
別途積立金	2,800,000
繰越利益剰余金	5,993,148
利益剰余金合計	9,167,446
株主資本合計	35,837,446
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△338,935
繰延ヘッジ損益	58,751
評価・換算差額等合計	△280,183
純資産合計	35,557,263
負債・純資産合計	46,601,904

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	29,980,874
その他営業収益	212,747
営業収益計	30,193,621
営業費用	
支払手数料	17,787,239
その他営業費用	3,452,353
営業費用計	21,239,592
一般管理費	※ 1 4,221,719
営業利益	4,732,309
営業外収益	※ 2 394,870
営業外費用	※ 1 , ※ 3 265,780
経常利益	4,861,399
特別利益	※ 4 64,666
特別損失	1,221
税引前中間純利益	4,924,844
法人税、住民税及び事業税	2,263,441
法人税等調整額	△167,419
中間純利益	2,828,822

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)
株主資本	
資本金	
前期末残高	15,174,272
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
資本剰余金合計	
前期末残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	374,297
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	374,297
その他利益剰余金	
別途積立金	
前期末残高	2,800,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,800,000
繰越利益剰余金	
前期末残高	9,659,553
当中間期変動額	
剰余金の配当	△6,495,227
中間純利益	2,828,822
当中間期変動額合計	△3,666,404
当中間期末残高	5,993,148
利益剰余金合計	
前期末残高	12,833,851
当中間期変動額	
剰余金の配当	△6,495,227
中間純利益	2,828,822
当中間期変動額合計	△3,666,404

当中間期末残高

9,167,446

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)
株主資本合計	
前期末残高	39,503,851
当中間期変動額	
剰余金の配当	△6,495,227
中間純利益	2,828,822
当中間期変動額合計	△3,666,404
当中間期末残高	35,837,446
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	△618,549
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	279,614
当中間期変動額合計	279,614
当中間期末残高	△338,935
繰延ヘッジ損益	
前期末残高	-
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	58,751
当中間期変動額合計	58,751
当中間期末残高	58,751
評価・換算差額等合計	
前期末残高	△618,549
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	338,366
当中間期変動額合計	338,366
当中間期末残高	△280,183
純資産合計	
前期末残高	38,885,301
当中間期変動額	
剰余金の配当	△6,495,227
中間純利益	2,828,822
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	338,366
当中間期変動額合計	△3,328,038
当中間期末残高	35,557,263

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

	当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 其他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部 純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算 定）を採用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。 (2) デリバティブ 時価法により計上しております。
2. 固定資産の減価償却 の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く） 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利 用可能期間（5年）に基づいております。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。
3. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実 績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財 務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見 込額の当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく 当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社 の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、 能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が 確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づ く当中間会計期間末要支給額を計上しております。 (4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程 に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券 (3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。
5. リース取引の処理方法	リース取引開始日が平成20年3月31日以前の、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
6. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。 (2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)	
※1. 減価償却累計額	
有形固定資産	2,603,477千円
投資不動産	709,109千円
※2. 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。	
3. 債務保証	
子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務573,210千円に対して保証を行っております。	
※4. 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)	
※1. 減価償却実施額	

有形固定資産	141,608千円
無形固定資産	325,480千円
投資不動産	6,532千円
※ 2. 営業外収益の主要項目	
有価証券利息	67,638千円
投資有価証券売却益	188,494千円
デリバティブ利益	29,286千円
※ 3. 営業外費用の主要項目	
投資有価証券売却損	161,780千円
有価証券償還損	26,776千円
※ 4. 特別利益の主要項目	
貸倒引当金戻入額	64,666千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数（千株）	当中間会計期間 増加株式数（千株）	当中間会計期間 減少株式数（千株）	当中間会計期間末 株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	2,608	—	—	2,608
合計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年6月19日 定時株主総会	普通株式	6,495	2,490	平成21年 3月31日	平成21年 6月22日

(リース取引関係)

当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)		
(借主側) リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 (通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの)		
1. リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額		
	有形固定資産 (工具、器具 及び備品)	合計
	千円	千円
取得価額相当額	4,599	4,599

減価償却累計額相当額	4,270	4,270
中間期末残高相当額	328	328

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

2. 未経過リース料中間期末残高相当額

1 年 内	328千円
1 年 超	一千円
合 計	328千円

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

3. 支払リース料及び減価償却費相当額

支払リース料	657千円
減価償却費相当額	657千円

4. 減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

（有価証券関係）

当中間会計期間末（平成21年9月30日現在）

1. 時価のある有価証券

	取得原価 (千円)	中間貸借対照表計上額 (千円)	差額 (千円)
(1) 其他有価証券			
① 株 式	55,101	73,537	18,435
② そ の 他 証券投資信託の受益証券	6,900,314	6,310,414	△589,899
計	6,955,416	6,383,952	△571,464

2. 時価評価されていない主な有価証券

	中間貸借対照表計上額 (千円)
(1) 其他有価証券	
① 非上場株式	1,172,137
② 外貨建資産担保債券	1,855,002
③ MMF・FFF・中期国債ファンド	22,256,096
計	25,283,235
(2) 子会社株式及び関連会社株式	737,012
計	737,012

（デリバティブ取引関係）

1. 取引の状況に関する事項

当中間会計期間
(自 平成21年 4 月 1 日
至 平成21年 9 月30日)

(1) 取引の内容

当社が利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。

(2) 取引に対する取組方針

デリバティブ取引については、将来の為替変動リスク及び価格変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

(3) 取引の利用目的

当社のデリバティブ取引は、当社が保有する投資有価証券に係る為替変動リスク、及び価格変動リスクを軽減する目的で利用しております。

なお、一部の投資有価証券を対象に、デリバティブ取引を利用してヘッジ会計を行っております。

① ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

② ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

③ ヘッジ方針

価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。

④ ヘッジ有効性評価の方法

原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。

(4) 取引に係るリスクの内容

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

(5) 取引に係るリスク管理体制

デリバティブ取引にあたっては、事前に取締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。取引の実行及び管理については、取引権限及び取引限度額等を定めた社内ルール等に従い、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理を行っております。

なお、財務部長はデリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を、執行役員会議及び財務会議で行っております。

2. デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

対象物の種類	取引の種類	当中間会計期間末 (平成21年 9 月30日現在)		
		契約額等 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
通貨	為替予約取引	320,616	△4,055	△4,055

(注) 1. 時価の算定方法は、各通貨のキャッシュ・フローを計算し、現在価値に割り引き邦貨換算した額となっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は除いております。

(1株当たり情報)

当中間会計期間
(自 平成21年4月1日
至 平成21年9月30日)

1株当たり純資産額 13,631.17円

1株当たり中間純利益金額 1,084.45円

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

2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

中間純利益(千円)	2,828,822
普通株式に係る中間純利益(千円)	2,828,822
普通株主に帰属しない金額(千円)	—
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成21年4月2日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 株主名簿管理人の廃止

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実

提出日前1年以内において、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ① 名称 住友信託銀行株式会社
- ② 資本金の額 287,537百万円（平成21年3月末日現在）
- ③ 事業の内容

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

(2) 販売会社

- ① 名称 湘南信用金庫
- ② 資本金の額 26,301百万円（平成21年4月7日現在）
- ③ 事業の内容 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

<参考>「ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド」の投資顧問会社

- ① 名称 コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク
- ② 資本金の額 442千米ドル（約40百万円）（平成20年12月末日現在）
- ③ 事業の内容 資産運用業務を行なっています。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当ありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成21年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産

のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
平成21年5月21日	臨時報告書
平成21年7月21日	臨時報告書
平成21年8月4日	有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第4特定期間）・同添付書類
平成21年9月24日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成21年12月11日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）の平成21年5月12日から平成21年11月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）の平成21年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年12月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社
員 公認会計士 堀 内 巧 印
業務執行社員

指 定 社
員 公認会計士 小 澤 陽 一 印
業務執行社員

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21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成21年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成21年6月26日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）の平成20年11月11日から平成21年5月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）の平成21年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月20日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社
員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員

指 定 社
員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以 上

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