

【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8月3日提出  
【計算期間】 第6特定期間  
（自 平成21年11月11日 至 平成22年5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。

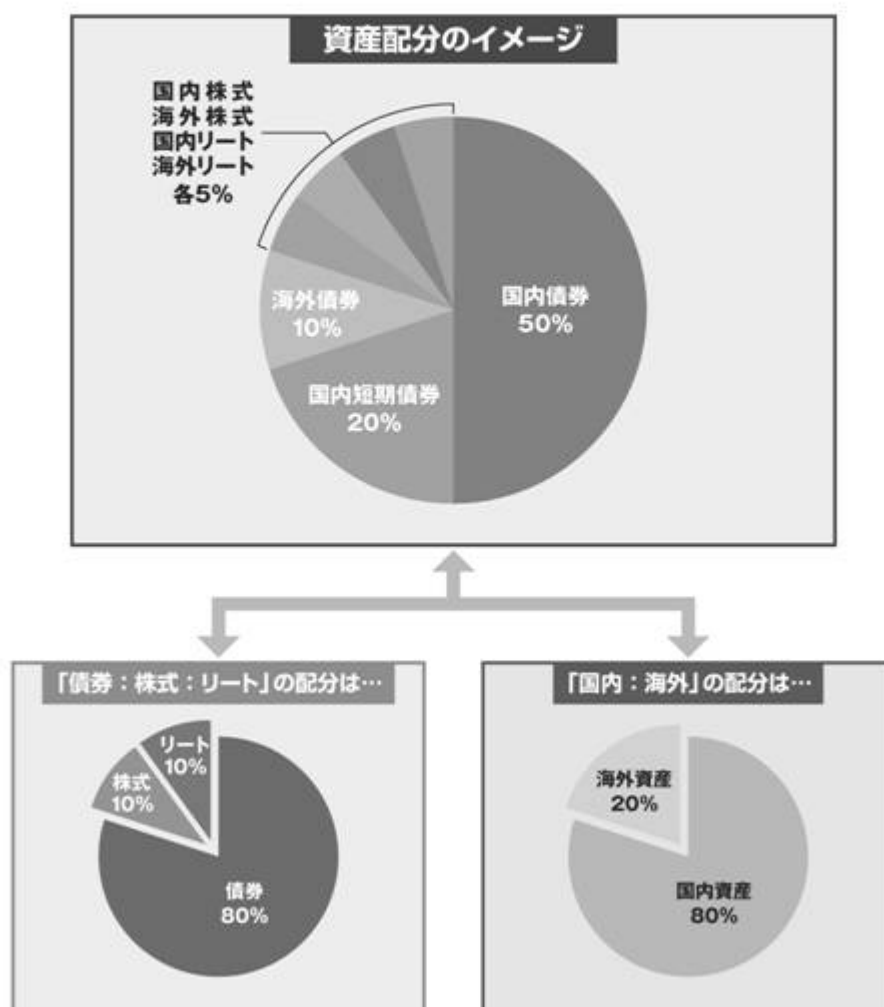
#### <ファンドの特色>

## 1

内外の公社債、株式およびリートに投資します。

- 各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処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）上記は、イメージであり、実際の組入比率とは異なります。

## ファンドの仕組み

### ●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



(注)「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。

## 2 わが国の公社債等への投資にあたっては、ベンチマーク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。

- わが国の円建ての公社債等への投資にあたっては、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。

### NOMURA-BPI 総合指数とは…

NOMURA-BPIは、野村証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、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

- わが国の円建ての短期公社債等への投資にあたっては、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。

### NOMURA-BPI 総合短期指数とは…

NOMURA-BPIは、野村証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、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

- 運用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。

## 3

海外の公社債への投資にあたっては、信用力の高いソブリン債等に投資し、バランスのとれた通貨配分を基本とします。

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

### 投資対象の通貨別構成（イメージ図）

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

※欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、欧州通貨圏内のユーロおよびユーロ以外の通貨への配分比率を見直します。

### 投資対象の格付け

- 国債：取得時においてA格相当以上<sup>\*1</sup>
- 国債以外の債券：取得時においてAA格相当以上<sup>\*2</sup>

| ムーディーズ |     |  | S&P |     |
|--------|-----|--|-----|-----|
| Aaa    |     |  | AAA |     |
| Aa     | Aa1 |  | AA  | AA+ |
|        | Aa2 |  |     | AA  |
|        | Aa3 |  |     | AA- |
| A      |     |  | A   |     |
| Baa    |     |  | BBB |     |
| Ba     |     |  | BB  |     |
| B      |     |  | B   |     |
| Caa    |     |  | CCC |     |

※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

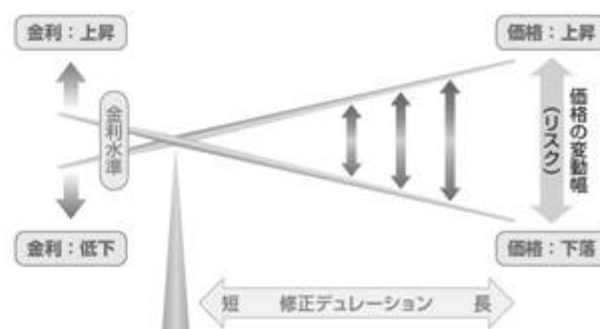
※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

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

### 修正デュレーションについて

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

#### 金利変動と修正デュレーションの関係（イメージ図）

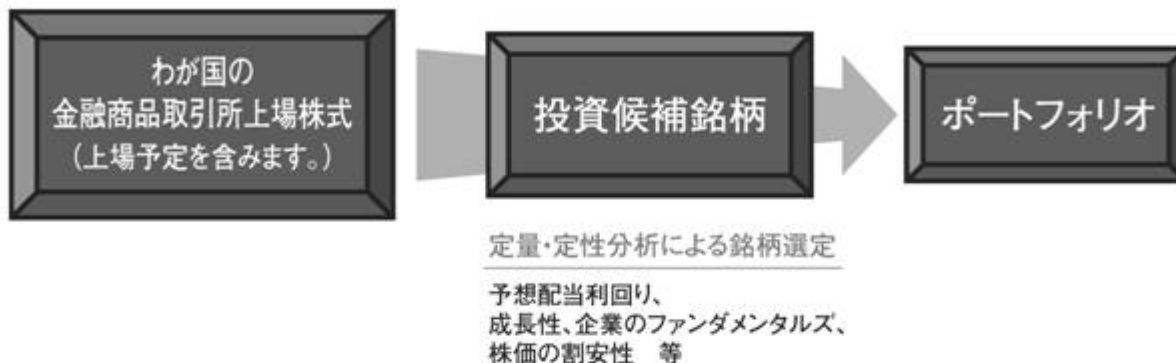


- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

## 4

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

## 銘柄選定プロセス



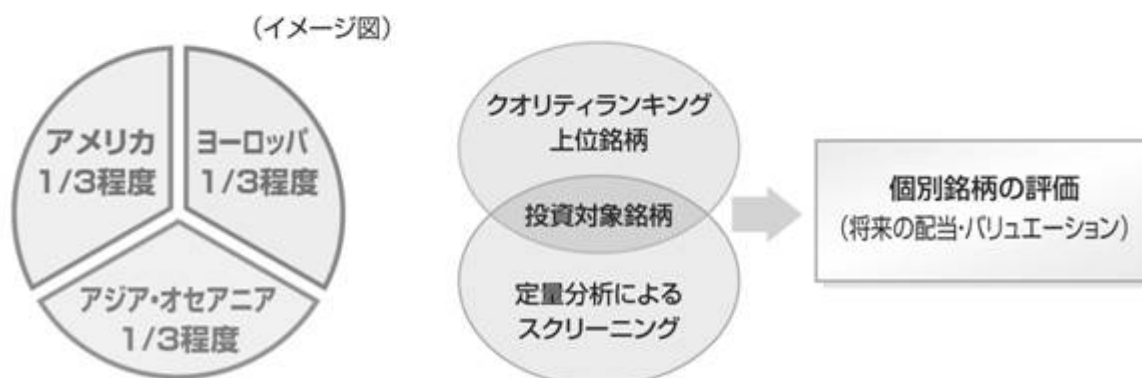
## 5

海外の株式への投資にあたっては、配当の質の高い企業を選定し、3つの地域に均等に投資することを基本とします。

- 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。
- 配当利回りの水準、時価総額規模、流動性を勘案します。
- 定性分析に基づき利益や配当の継続性を考慮します。

## 投資対象の地域別構成

## 銘柄選定のイメージ



## ■ S&amp;P社クオリティランキングとは

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、企業の収益及び配当の安定性と成長性を評価する指標で、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 Rankings] 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 Rankings及びS&P International Quality Rankings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 Rankings及びS&P International Quality Rankings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 リートへの投資にあたっては、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

### 【わが国のリートに投資する場合】

投資対象銘柄の業種（イメージ図）



- 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

### 【海外のリートに投資する場合】

投資対象地域（イメージ図）



- ダイワ・グローバル REIT・マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン・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。
- 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。

#### 〈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

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

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

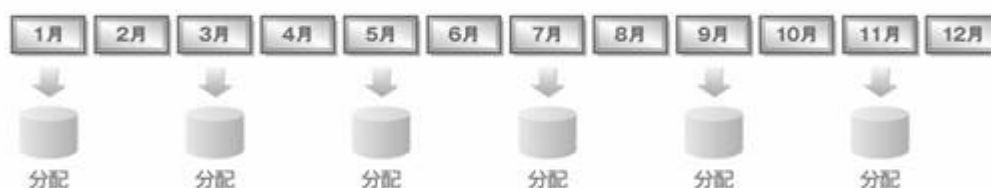
## 7

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

## 〈分配方針〉

- 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。
- ③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。
- ④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。

## 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。

## (2) 【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

## (3) 【ファンドの仕組み】

|       |                           |                                                                                                                  |
|-------|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 受益者   | お申込者                      |                                                                                                                  |
| お取扱窓口 | 収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金（※5） |                                                                                                                  |
|       | 販売会社                      | 受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。<br>①受益権の募集の取扱い<br>②一部解約請求に関する事務<br>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  |
| 委託会社  | 収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※5）     |                                                                                                                  |
|       | 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。<br>①受益権の募集・発行<br>②信託財産の運用指図<br>③信託財産の計算<br>④運用報告書の作成 など |

↑↓※1

↓運用指図 ↑ ↓ ※2

損益 ↑ ↓ 信託金（※5）

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 受託会社 | 住友信託銀行<br>株式会社<br>再信託受託会社：<br>日本トラスティ・<br>サービス信託銀行株<br>式会社<br>信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ない<br>ます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ<br>・サービス信託銀行株式会社に委託することがで<br>きます。また、外国における資産の保管は、その業務<br>を行なうに十分な能力を有すると認められる外国<br>の金融機関が行なう場合があります。<br>①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分<br>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<br>・ファミリーファンド方式で運用を行ないます。<br>・なお、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」における外<br>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<br>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<br>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22年5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<br>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」に基づき投資一<br>任契約にかかる業務の認可を受ける。 |

平成19年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。  
（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）

・大株主の状況

| 名 称            | 住 所               | 所有<br>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<br>2,608,525 | %<br>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

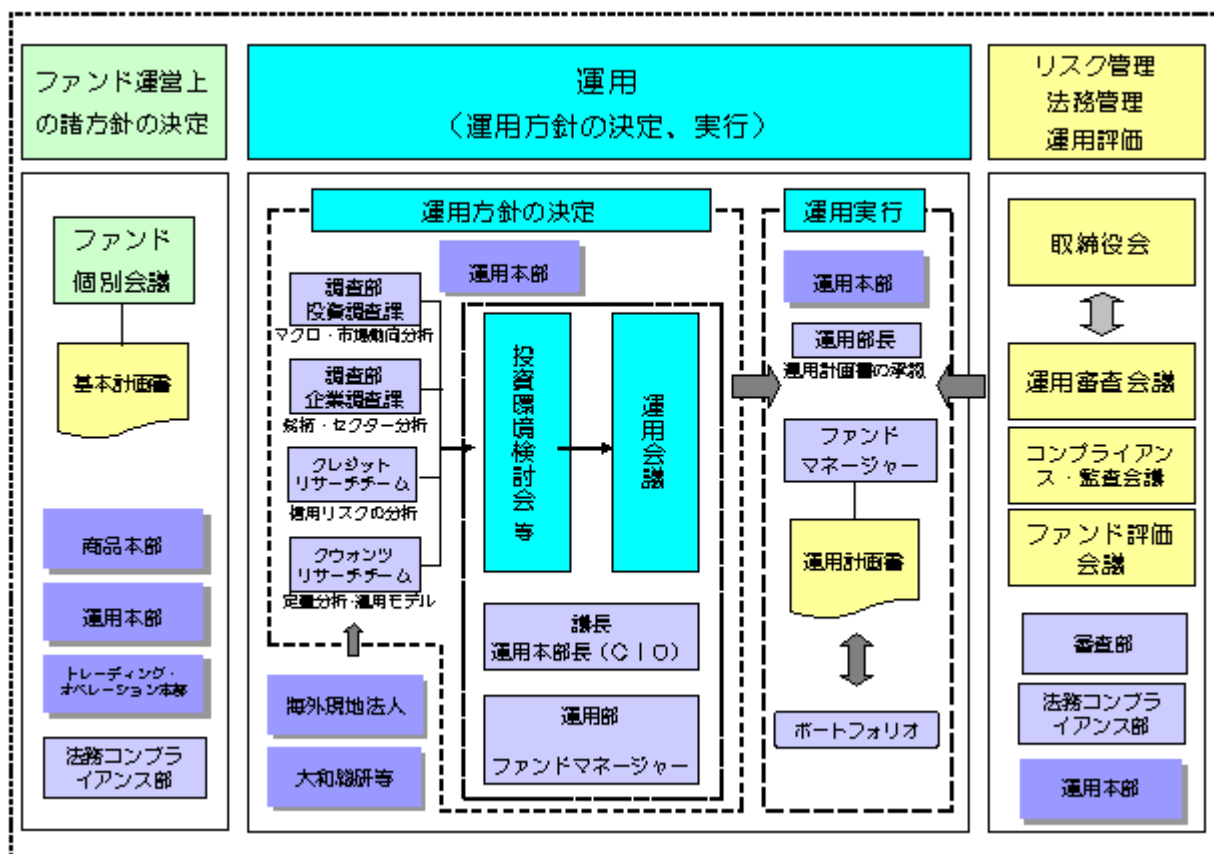
き、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (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（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. 基本的な運用方針の決定

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

### ニ. 運用計画書の作成・承認

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

## ③ 職務権限

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。

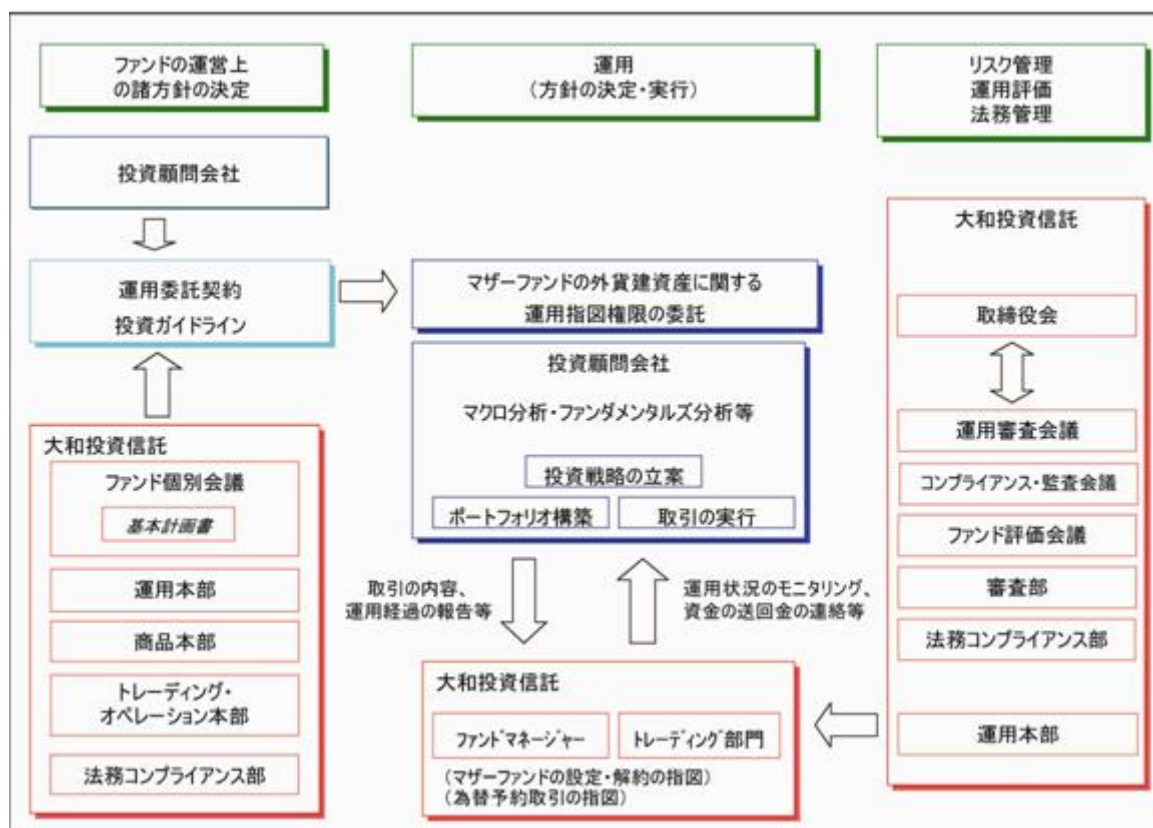
これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は20～30名程度です。

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22年5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。

## &lt;ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド&gt;

## 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

## &lt;各ファンド共通&gt;

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

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)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

## &lt;各ファンド共通&gt;

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外国通貨表示の株券または新株引受権証書

### 2. 国債証券

### 3. 地方債証券

### 4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

### 7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

### 13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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<br>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<br>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<br>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、リーの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リーの収益は、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。

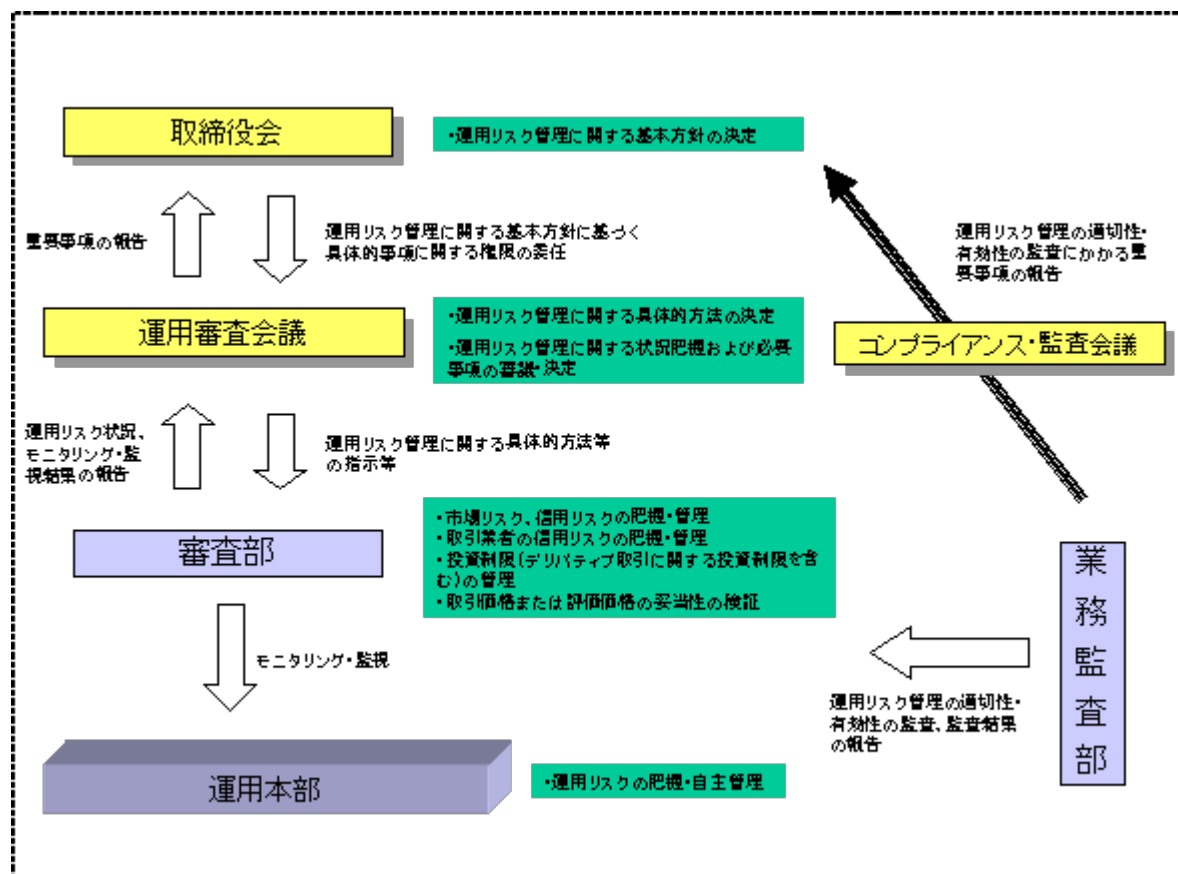
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

## (3) その他の留意点

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

用はありません。

#### (4) リスク管理体制



#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

- 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】

- ① 換金手数料

ありません。

- ② 信託財産留保額

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率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                  |
|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 年率0.315%<br>(税抜0.30%) | 年率0.315%<br>(税抜0.30%) | 年率0.042%<br>(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REIT・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           | 年率0.57% |
| 275億円超1,000億円以下の部分   | 年率0.47% |
| 1,000億円超2,500億円以下の部分 | 年率0.37% |
| 2,500億円超の部分          | 年率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。

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

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

**<マザーファンドより支弁する手数料等>**

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

## (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

### 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。

（※）上記は、平成22年5月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成22年5月31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             | 22,744,593 | 99.06   |
| 内 日本                  | 22,744,593 | 99.06   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 215,646    | 0.94    |
| 純資産総額                 | 22,960,239 | 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                  | 312,125,170 | 57.58   |
| 内 日本                  | 312,125,170 | 57.58   |
| 地方債証券                 | 10,502,070  | 1.94    |
| 内 日本                  | 10,502,070  | 1.94    |
| 特殊債券                  | 75,497,000  | 13.93   |
| 内 日本                  | 75,497,000  | 13.93   |
| 社債券                   | 124,547,472 | 22.98   |
| 内 日本                  | 124,547,472 | 22.98   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 19,403,644  | 3.58    |
| 純資産総額                 | 542,075,356 | 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                  | 209,007,050 | 65.27   |
| 内 日本                  | 209,007,050 | 65.27   |
| 社債券                   | 100,670,800 | 31.44   |
| 内 日本                  | 100,670,800 | 31.44   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 10,554,963  | 3.30    |
| 純資産総額                 | 320,232,813 | 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      | 203,295,927,501 | 96.79   |
| 内 オーストラリア | 27,735,843,800  | 13.21   |
| 内 カナダ     | 27,101,223,622  | 12.90   |
| 内 チェコ     | 4,272,367,226   | 2.03    |
| 内 デンマーク   | 1,739,001,351   | 0.83    |
| 内 ユーロ     | 46,237,145,394  | 22.01   |
| 内 英国      | 22,054,254,646  | 10.50   |

|                       |                 |        |
|-----------------------|-----------------|--------|
| 内 ノルウェー               | 4,251,080,909   | 2.02   |
| 内 ポーランド               | 8,736,148,572   | 4.16   |
| 内 スウェーデン              | 6,370,214,175   | 3.03   |
| 内 米国                  | 54,798,647,805  | 26.09  |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 6,741,472,510   | 3.21   |
| 純資産総額                 | 210,037,400,011 | 100.00 |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類    | 時価（円）         | 投資比率（％） |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 3,122,280,000 | △1.49   |
| 内 日本       | 3,122,280,000 | △1.49   |

（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                    | 24,929,044,000 | 93.66   |
| 内 日本                  | 24,929,044,000 | 93.66   |
| 投資証券                  | 787,132,100    | 2.96    |
| 内 日本                  | 787,132,100    | 2.96    |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 901,773,682    | 3.39    |
| 純資産総額                 | 26,617,949,782 | 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                    | 8,418,574,517 | 95.75   |
| 内 オーストラリア             | 1,133,169,357 | 12.89   |
| 内 カナダ                 | 173,666,491   | 1.98    |
| 内 スイス                 | 229,242,077   | 2.61    |
| 内 デンマーク               | 49,349,300    | 0.56    |
| 内 ユーロ                 | 1,147,308,191 | 13.05   |
| 内 英国                  | 1,071,819,216 | 12.19   |
| 内 香港                  | 621,812,101   | 7.07    |
| 内 韓国                  | 295,323,084   | 3.36    |
| 内 スウェーデン              | 220,745,365   | 2.51    |
| 内 シンガポール              | 266,914,556   | 3.04    |
| 内 台湾                  | 460,776,712   | 5.24    |
| 内 米国                  | 2,748,448,067 | 31.26   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 373,722,603   | 4.25    |
| 純資産総額                 | 8,792,297,120 | 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） | 1,121,900 | 0.01    |
| 内 日本       | 1,121,900 | 0.01    |

|            |           |       |
|------------|-----------|-------|
| 為替予約取引（売建） | 1,121,524 | △0.01 |
| 内 日本       | 1,121,524 | △0.01 |

（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                  | 14,691,318,000 | 97.78   |
| 内 日本                  | 14,691,318,000 | 97.78   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 333,447,111    | 2.22    |
| 純資産総額                 | 15,024,765,111 | 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                  | 303,411,382,087 | 96.16   |
| 内 オーストラリア             | 63,574,570,156  | 20.15   |
| 内 カナダ                 | 4,690,109,965   | 1.49    |
| 内 ユーロ                 | 31,738,301,796  | 10.06   |
| 内 英国                  | 31,089,670,728  | 9.85    |
| 内 香港                  | 7,065,047,081   | 2.24    |
| 内 ニュージーランド            | 678,418,350     | 0.22    |
| 内 シンガポール              | 9,087,033,068   | 2.88    |
| 内 米国                  | 155,488,230,942 | 49.28   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 12,116,628,169  | 3.84    |
| 純資産総額                 | 315,528,010,256 | 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） | 6,845,714,341 | 2.17    |
| 内 日本       | 6,845,714,341 | 2.17    |
| 為替予約取引（売建） | 915,746,027   | △0.29   |
| 内 日本       | 915,746,027   | △0.29   |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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22年5月31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<br>地域                      | 種類<br>業種           | 株数、口数<br>または額面金<br>額 | 簿価単価<br>簿価            | 評価単価<br>時価           | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|---|--------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|--------------------------|----------|
| 1 | ダイワ日本債券アクティブ・<br>マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受<br>益証券<br>— | 10,783,612           | 1.06690<br>11,505,035 | 1.0710<br>11,549,248 | —<br>—                   | 50.30%   |

|   |                              |                |           |                      |                     |        |        |
|---|------------------------------|----------------|-----------|----------------------|---------------------|--------|--------|
| 2 | ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券<br>— | 4,330,197 | 1.05850<br>4,583,513 | 1.0594<br>4,587,410 | —<br>— | 19.98% |
| 3 | ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド<br>日本     | 親投資信託受益証券<br>— | 1,974,637 | 1.13870<br>2,248,519 | 1.1080<br>2,187,897 | —<br>— | 9.53%  |
| 4 | ダイワ好配当日本株マザーファンド<br>日本       | 親投資信託受益証券<br>— | 1,095,294 | 1.09370<br>1,197,923 | 1.0222<br>1,119,609 | —<br>— | 4.88%  |
| 5 | ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド<br>日本 | 親投資信託受益証券<br>— | 1,329,347 | 0.89740<br>1,192,955 | 0.8410<br>1,117,980 | —<br>— | 4.87%  |
| 6 | ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド<br>日本  | 親投資信託受益証券<br>— | 1,395,456 | 0.81030<br>1,130,737 | 0.7918<br>1,104,922 | —<br>— | 4.81%  |
| 7 | ダイワ海外好配当株マザーファンド<br>日本       | 親投資信託受益証券<br>— | 1,558,697 | 0.71710<br>1,117,741 | 0.6913<br>1,077,527 | —<br>— | 4.69%  |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.06% |
| 合計        | 99.06% |

（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<br>地域              | 種類<br>業種  | 株数、口数<br>または額面金額 | 簿価単価<br>簿価            | 評価単価<br>時価            | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|---|------------------------|-----------|------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|----------|
| 1 | 1 バークレイズバンク<br>日本      | 社債券<br>—  | 100,000,000      | 100.65<br>100,650,000 | 100.57<br>100,570,800 | 1.410000<br>11/12/21     | 18.55%   |
| 2 | 3 0 1 1 0年国債<br>日本     | 国債証券<br>— | 36,000,000       | 102.09<br>36,754,100  | 103.20<br>37,154,160  | 1.500000<br>19/06/20     | 6.85%    |
| 3 | 1 アフリカ開発銀行 S U B<br>日本 | 特殊債券<br>— | 30,000,000       | 115.84<br>34,754,910  | 113.83<br>34,151,640  | 5.100000<br>13/10/04     | 6.30%    |
| 4 | 2 8 7 1 0年国債<br>日本     | 国債証券<br>— | 28,000,000       | 107.33<br>30,055,000  | 107.98<br>30,235,800  | 1.900000<br>17/06/20     | 5.58%    |
| 5 | 6 4 2 0年国債<br>日本       | 国債証券<br>— | 27,000,000       | 101.60<br>27,432,500  | 103.34<br>27,903,420  | 1.900000<br>23/09/20     | 5.15%    |
| 6 | 1 0 8 2 0年国債<br>日本     | 国債証券<br>— | 25,000,000       | 97.36<br>24,340,940   | 98.84<br>24,711,750   | 1.900000<br>28/12/20     | 4.56%    |

|    |             |    |       |   |            |                      |                      |                      |       |
|----|-------------|----|-------|---|------------|----------------------|----------------------|----------------------|-------|
| 7  | 5 1 6 東京電力  | 日本 | 社債券   | — | 23,000,000 | 103.02<br>23,695,520 | 104.24<br>23,976,672 | 1.420000<br>15/04/27 | 4.42% |
| 8  | 1 1 4 20年国債 | 日本 | 国債証券  | — | 23,000,000 | 99.76<br>22,946,770  | 101.26<br>23,290,490 | 2.100000<br>29/12/20 | 4.30% |
| 9  | 2 6 8 10年国債 | 日本 | 国債証券  | — | 22,000,000 | 104.58<br>23,009,760 | 105.10<br>23,122,000 | 1.500000<br>15/03/20 | 4.27% |
| 10 | 1 4 政保国民生活  | 日本 | 特殊債券  | — | 20,000,000 | 103.37<br>20,675,580 | 104.71<br>20,942,880 | 1.500000<br>14/09/17 | 3.86% |
| 11 | 7 0 20年国債   | 日本 | 国債証券  | — | 19,000,000 | 107.85<br>20,492,570 | 108.98<br>20,707,530 | 2.400000<br>24/06/20 | 3.82% |
| 12 | 3 1 9 政保道路債 | 日本 | 特殊債券  | — | 20,000,000 | 100.99<br>20,198,460 | 102.01<br>20,402,480 | 0.900000<br>13/08/22 | 3.76% |
| 13 | 9 6 20年国債   | 日本 | 国債証券  | — | 16,000,000 | 103.04<br>16,486,440 | 102.97<br>16,475,680 | 2.100000<br>27/06/20 | 3.04% |
| 14 | 8 2 5年国債    | 日本 | 国債証券  | — | 16,000,000 | 102.01<br>16,321,730 | 102.30<br>16,369,280 | 0.900000<br>14/03/20 | 3.02% |
| 15 | 9 4 20年国債   | 日本 | 国債証券  | — | 13,000,000 | 99.87<br>12,983,210  | 103.07<br>13,399,230 | 2.100000<br>27/03/20 | 2.47% |
| 16 | 2 8 0 10年国債 | 日本 | 国債証券  | — | 12,000,000 | 107.08<br>12,850,320 | 107.80<br>12,936,600 | 1.900000<br>16/06/20 | 2.39% |
| 17 | 2 5 15年国債FR | 日本 | 国債証券  | — | 11,000,000 | 98.35<br>10,818,500  | 99.75<br>10,972,500  | 0.630000<br>18/11/20 | 2.02% |
| 18 | 2 6 15年国債FR | 日本 | 国債証券  | — | 11,000,000 | 97.75<br>10,752,500  | 99.15<br>10,906,500  | 0.590000<br>19/01/20 | 2.01% |
| 19 | 1 8 共同発行地方  | 日本 | 地方債証券 | — | 10,000,000 | 103.52<br>10,352,630 | 105.02<br>10,502,070 | 1.600000<br>14/09/25 | 1.94% |
| 20 | 3 7 15年国債FR | 日本 | 国債証券  | — | 10,000,000 | 96.20<br>9,620,000   | 98.55<br>9,855,000   | 0.570000<br>20/11/20 | 1.82% |
| 21 | 2 9 6 10年国債 | 日本 | 国債証券  | — | 9,000,000  | 103.24<br>9,292,250  | 104.11<br>9,369,900  | 1.500000<br>18/09/20 | 1.73% |
| 22 | 2 6 30年国債   | 日本 | 国債証券  | — | 8,000,000  | 103.04<br>8,243,880  | 105.87<br>8,469,600  | 2.400000<br>37/03/20 | 1.56% |
| 23 | 2 8 30年国債   | 日本 | 国債証券  | — | 7,000,000  | 103.88<br>7,271,980  | 108.06<br>7,564,410  | 2.500000<br>38/03/20 | 1.40% |
| 24 | 1 30年国債     | 日本 | 国債証券  | — | 5,000,000  | 109.97<br>5,498,600  | 112.86<br>5,643,400  | 2.800000<br>29/09/20 | 1.04% |
| 25 | 3 0 6 10年国債 | 日本 | 国債証券  | — | 3,000,000  | 101.30<br>3,039,270  | 101.26<br>3,037,920  | 1.400000<br>20/03/20 | 0.56% |

（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      | 57.58% |
| 地方債証券     | 1.94%  |
| 特殊債券      | 13.93% |
| 社債券       | 22.98% |
| 合計        | 96.42% |

（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<br>地域      | 種類<br>業種  | 株数、口数<br>または額面金額 | 簿価単価<br>簿価            | 評価単価<br>時価            | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|---|----------------|-----------|------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|----------|
| 1 | 1 住友生命基金<br>日本 | 社債券<br>—  | 100,000,000      | 101.08<br>101,085,000 | 100.67<br>100,670,800 | 1.580000<br>11/08/15     | 31.44%   |
| 2 | 7 0 5年国債<br>日本 | 国債証券<br>— | 90,000,000       | 101.67<br>91,503,600  | 101.66<br>91,500,300  | 0.800000<br>13/03/20     | 28.57%   |
| 3 | 6 9 5年国債<br>日本 | 国債証券<br>— | 40,000,000       | 101.79<br>40,719,600  | 101.80<br>40,720,000  | 0.900000<br>12/12/20     | 12.72%   |
| 4 | 6 5 5年国債<br>日本 | 国債証券<br>— | 35,000,000       | 102.58<br>35,905,100  | 102.52<br>35,885,150  | 1.400000<br>12/06/20     | 11.21%   |
| 5 | 7 4 5年国債<br>日本 | 国債証券<br>— | 25,000,000       | 102.36<br>25,590,500  | 102.37<br>25,593,750  | 1.000000<br>13/06/20     | 7.99%    |
| 6 | 6 2 5年国債<br>日本 | 国債証券<br>— | 10,000,000       | 101.84<br>10,184,500  | 101.79<br>10,179,100  | 1.300000<br>11/12/20     | 3.18%    |
| 7 | 6 7 5年国債<br>日本 | 国債証券<br>— | 5,000,000        | 102.77<br>5,138,500   | 102.57<br>5,128,750   | 1.300000<br>12/09/20     | 1.60%    |

（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      | 65.27% |
| 社債券       | 31.44% |
| 合計        | 96.70% |

（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<br>地域                             | 種類<br>業種  | 株数、口数<br>または額面金額 | 簿価単価<br>簿価               | 評価単価<br>時価               | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|---|---------------------------------------|-----------|------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|----------|
| 1 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>オーストラリア | 国債証券<br>— | 27,062,000,000   | 99.22<br>26,852,269,500  | 102.49<br>27,735,843,800 | 5.750000<br>21/05/15     | 13.21%   |
| 2 | U.S. TREASURY BOND<br>米国              | 国債証券<br>— | 17,029,315,000   | 133.63<br>22,756,614,221 | 140.60<br>23,944,749,528 | 7.500000<br>24/11/15     | 11.40%   |

|    |                                          |           |                |                          |                          |                       |       |
|----|------------------------------------------|-----------|----------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|-------|
| 3  | ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>ユーロ           | 国債証券<br>— | 14,249,400,000 | 104.39<br>14,876,204,178 | 102.78<br>14,646,388,284 | 4.250000<br>19/02/01  | 6.97% |
| 4  | UNITED KINGDOM GILT BOND<br>英国           | 国債証券<br>— | 10,045,446,000 | 133.70<br>13,430,761,302 | 139.53<br>14,016,410,804 | 8.000000<br>21/06/07  | 6.67% |
| 5  | GERMAN GOVERNMENT BOND<br>ユーロ            | 国債証券<br>— | 10,659,000,000 | 115.43<br>12,304,323,240 | 125.38<br>13,365,000,330 | 4.750000<br>40/07/04  | 6.36% |
| 6  | U.S. TREASURY BOND<br>米国                 | 国債証券<br>— | 9,313,620,000  | 139.66<br>13,007,774,237 | 141.68<br>13,196,188,769 | 11.250000<br>15/02/15 | 6.28% |
| 7  | CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>カナダ          | 国債証券<br>— | 8,812,784,000  | 104.88<br>9,242,935,987  | 108.06<br>9,523,182,518  | 4.250000<br>18/06/01  | 4.53% |
| 8  | POLAND GOVERNMENT BOND<br>ポーランド          | 国債証券<br>— | 8,039,570,000  | 104.95<br>8,437,689,506  | 104.12<br>8,371,363,054  | 6.250000<br>15/10/24  | 3.99% |
| 9  | BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>ユーロ           | 国債証券<br>— | 5,576,340,000  | 125.78<br>7,014,199,269  | 127.21<br>7,093,885,168  | 8.000000<br>15/03/28  | 3.38% |
| 10 | U.S. TREASURY BOND<br>米国                 | 国債証券<br>— | 4,492,452,000  | 136.64<br>6,138,845,809  | 142.22<br>6,389,434,782  | 8.125000<br>21/08/15  | 3.04% |
| 11 | FRENCH GOVERNMENT BOND<br>ユーロ            | 国債証券<br>— | 3,927,000,000  | 142.51<br>5,596,367,700  | 147.16<br>5,779,051,740  | 8.500000<br>19/10/25  | 2.75% |
| 12 | UNITED KINGDOM GILT BOND<br>英国           | 国債証券<br>— | 4,192,194,000  | 133.60<br>5,600,771,184  | 137.23<br>5,752,947,826  | 8.750000<br>17/08/25  | 2.74% |
| 13 | U.S. TREASURY BOND<br>米国                 | 国債証券<br>— | 3,743,710,000  | 135.11<br>5,058,388,641  | 142.30<br>5,327,449,078  | 7.625000<br>25/02/15  | 2.54% |
| 14 | CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>カナダ          | 国債証券<br>— | 3,261,424,000  | 156.41<br>5,101,291,121  | 162.55<br>5,301,542,555  | 9.000000<br>25/06/01  | 2.52% |
| 15 | CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>カナダ          | 国債証券<br>— | 3,937,649,040  | 127.54<br>5,022,431,974  | 128.06<br>5,042,789,620  | 10.250000<br>14/03/15 | 2.40% |
| 16 | U.S. TREASURY BOND<br>米国                 | 国債証券<br>— | 4,565,500,000  | 94.16<br>4,299,057,420   | 102.59<br>4,683,883,415  | 4.375000<br>39/11/15  | 2.23% |
| 17 | CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>カナダ          | 国債証券<br>— | 3,018,552,000  | 148.61<br>4,485,960,684  | 154.52<br>4,664,508,035  | 8.000000<br>27/06/01  | 2.22% |
| 18 | ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>ユーロ           | 国債証券<br>— | 4,600,200,000  | 104.35<br>4,800,446,706  | 101.08<br>4,650,112,170  | 5.000000<br>39/08/01  | 2.21% |
| 19 | Czech Republic Government<br>Bond<br>チェコ | 国債証券<br>— | 3,570,840,000  | 121.39<br>4,334,821,218  | 119.64<br>4,272,367,226  | 6.950000<br>16/01/26  | 2.03% |
| 20 | SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>スウェーデン        | 国債証券<br>— | 3,203,750,000  | 117.58<br>3,767,129,438  | 118.93<br>3,810,219,875  | 6.750000<br>14/05/05  | 1.81% |
| 21 | SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>スウェーデン        | 国債証券<br>— | 2,330,000,000  | 109.52<br>2,552,025,700  | 109.87<br>2,559,994,300  | 5.500000<br>12/10/08  | 1.22% |
| 22 | UNITED KINGDOM GILT BOND<br>英国           | 国債証券<br>— | 1,977,450,000  | 89.57<br>1,771,201,965   | 95.01<br>1,878,775,245   | 4.000000<br>60/01/22  | 0.89% |
| 23 | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>ノルウェー       | 国債証券<br>— | 1,668,480,000  | 108.90<br>1,817,091,514  | 112.27<br>1,873,352,659  | 5.000000<br>15/05/15  | 0.89% |
| 24 | DANISH GOVERNMENT BOND<br>デンマーク          | 国債証券<br>— | 1,541,176,000  | 110.27<br>1,699,562,658  | 112.83<br>1,739,001,351  | 5.000000<br>13/11/15  | 0.83% |
| 25 | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>ノルウェー       | 国債証券<br>— | 1,288,320,000  | 111.70<br>1,439,070,266  | 112.68<br>1,451,717,626  | 6.500000<br>13/05/15  | 0.69% |
| 26 | CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>カナダ          | 国債証券<br>— | 1,127,620,000  | 115.27<br>1,299,830,126  | 121.85<br>1,374,038,799  | 5.000000<br>37/06/01  | 0.65% |
| 27 | U.S. TREASURY BOND<br>米国                 | 国債証券<br>— | 885,707,000    | 136.32<br>1,207,466,639  | 141.91<br>1,256,942,232  | 8.125000<br>21/05/15  | 0.60% |
| 28 | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>ノルウェー       | 国債証券<br>— | 844,800,000    | 104.90<br>886,237,440    | 109.61<br>926,010,624    | 4.250000<br>17/05/19  | 0.44% |
| 29 | GERMAN GOVERNMENT BOND<br>ユーロ            | 国債証券<br>— | 516,120,000    | 129.35<br>667,611,542    | 136.15<br>702,707,702    | 6.250000<br>24/01/04  | 0.33% |
| 30 | CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>カナダ          | 国債証券<br>— | 390,330,000    | 141.87<br>553,792,397    | 147.13<br>574,315,949    | 8.000000<br>23/06/01  | 0.27% |

（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      | 96.79% |
| 合計        | 96.79% |

(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/<br>売建 | 数量         | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|--------|----|----------------------|-----------|------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | カナダドル売/円買<br>2010年6月 | 売建        | 36,000,000 | 3,061,720,000 | 3,122,280,000 | △1.49%   |

(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<br>地域           | 種類<br>業種          | 株数、口数<br>または額面金<br>額 | 簿価単価<br>簿価           | 評価単価<br>時価           | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|----|---------------------|-------------------|----------------------|----------------------|----------------------|--------------------------|----------|
| 1  | 三菱UFJフィナンシャルG<br>日本 | 株式<br>銀行業         | 1,264,800            | 517<br>653,901,600   | 441<br>557,776,800   | —<br>—                   | 2.10%    |
| 2  | 本田技研<br>日本          | 株式<br>輸送用機器       | 201,000              | 3,265<br>656,265,000 | 2,770<br>556,770,000 | —<br>—                   | 2.09%    |
| 3  | トヨタ自動車<br>日本        | 株式<br>輸送用機器       | 152,000              | 3,710<br>563,920,000 | 3,280<br>498,560,000 | —<br>—                   | 1.87%    |
| 4  | 三井物産<br>日本          | 株式<br>卸売業         | 380,000              | 1,634<br>621,025,335 | 1,294<br>491,720,000 | —<br>—                   | 1.85%    |
| 5  | 商船三井<br>日本          | 株式<br>海運業         | 735,000              | 676<br>497,584,943   | 648<br>476,280,000   | —<br>—                   | 1.79%    |
| 6  | キャノン<br>日本          | 株式<br>電気機器        | 123,500              | 4,410<br>544,635,000 | 3,745<br>462,507,500 | —<br>—                   | 1.74%    |
| 7  | 三井住友フィナンシャルG<br>日本  | 株式<br>銀行業         | 162,600              | 3,309<br>538,050,757 | 2,703<br>439,507,800 | —<br>—                   | 1.65%    |
| 8  | 日本電信電話<br>日本        | 株式<br>情報・通信業      | 115,000              | 3,940<br>453,100,000 | 3,685<br>423,775,000 | —<br>—                   | 1.59%    |
| 9  | 綜研化学<br>日本          | 株式<br>化学          | 281,300              | 1,405<br>395,226,500 | 1,440<br>405,072,000 | —<br>—                   | 1.52%    |
| 10 | JXホールディングス<br>日本    | 株式<br>石油・石炭製<br>品 | 777,300              | 552<br>429,681,382   | 497<br>386,318,100   | —<br>—                   | 1.45%    |
| 11 | パイオニア<br>日本         | 株式<br>電気機器        | 974,000              | 349<br>339,965,048   | 337<br>328,238,000   | —<br>—                   | 1.23%    |

|    |                             |                    |         |                        |                        |        |       |
|----|-----------------------------|--------------------|---------|------------------------|------------------------|--------|-------|
| 12 | 日本ロジスティクスファンド<br>投資法人<br>日本 | 投資証券<br>—          | 460     | 727,000<br>334,420,000 | 684,000<br>314,640,000 | —<br>— | 1.18% |
| 13 | ファースト住建<br>日本               | 株式<br>不動産業         | 441,500 | 645<br>284,836,645     | 679<br>299,778,500     | —<br>— | 1.13% |
| 14 | 富士通<br>日本                   | 株式<br>電気機器         | 500,000 | 648<br>324,088,040     | 585<br>292,500,000     | —<br>— | 1.10% |
| 15 | 日東電工<br>日本                  | 株式<br>化学           | 90,000  | 3,745<br>337,050,000   | 3,250<br>292,500,000   | —<br>— | 1.10% |
| 16 | アルプス物流<br>日本                | 株式<br>陸運業          | 310,800 | 1,002<br>311,698,707   | 940<br>292,152,000     | —<br>— | 1.10% |
| 17 | 日本発条<br>日本                  | 株式<br>金属製品         | 333,000 | 842<br>280,614,194     | 860<br>286,380,000     | —<br>— | 1.08% |
| 18 | 村上開明堂<br>日本                 | 株式<br>輸送用機器        | 277,000 | 1,028<br>284,969,190   | 1,010<br>279,770,000   | —<br>— | 1.05% |
| 19 | 日立<br>日本                    | 株式<br>電気機器         | 750,000 | 381<br>286,399,539     | 372<br>279,000,000     | —<br>— | 1.05% |
| 20 | 日本ハウズイング<br>日本              | 株式<br>サービス業        | 231,200 | 1,200<br>277,440,000   | 1,190<br>275,128,000   | —<br>— | 1.03% |
| 21 | 日神不動産<br>日本                 | 株式<br>不動産業         | 423,600 | 575<br>243,570,000     | 615<br>260,514,000     | —<br>— | 0.98% |
| 22 | T D K<br>日本                 | 株式<br>電気機器         | 48,000  | 6,365<br>305,531,805   | 5,300<br>254,400,000   | —<br>— | 0.96% |
| 23 | スミダコーポレーション<br>日本           | 株式<br>電気機器         | 217,000 | 1,218<br>264,313,839   | 1,110<br>240,870,000   | —<br>— | 0.90% |
| 24 | エディオン<br>日本                 | 株式<br>小売業          | 298,500 | 955<br>285,067,500     | 802<br>239,397,000     | —<br>— | 0.90% |
| 25 | パイオラックス<br>日本               | 株式<br>金属製品         | 135,500 | 1,854<br>251,349,011   | 1,709<br>231,569,500   | —<br>— | 0.87% |
| 26 | 日本化学産業<br>日本                | 株式<br>化学           | 357,000 | 694<br>247,758,000     | 646<br>230,622,000     | —<br>— | 0.87% |
| 27 | 日鐵商事<br>日本                  | 株式<br>卸売業          | 806,000 | 248<br>200,037,455     | 282<br>227,292,000     | —<br>— | 0.85% |
| 28 | NECキャピタルソリュー<br>ション<br>日本   | 株式<br>その他金融業       | 200,700 | 1,226<br>246,162,694   | 1,096<br>219,967,200   | —<br>— | 0.83% |
| 29 | プレミアム投資法人<br>日本             | 投資証券<br>—          | 580     | 373,000<br>216,340,000 | 376,500<br>218,370,000 | —<br>— | 0.82% |
| 30 | 旭硝子<br>日本                   | 株式<br>ガラス・土石<br>製品 | 223,000 | 1,069<br>238,503,249   | 964<br>214,972,000     | —<br>— | 0.81% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 株式        | 93.66% |
| 投資証券      | 2.96%  |
| 合計        | 96.61% |

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

| 業種  | 投資比率  |
|-----|-------|
| 鉱業  | 0.34% |
| 建設業 | 1.76% |

|            |        |
|------------|--------|
| 食料品        | 0.36%  |
| 繊維製品       | 1.59%  |
| パルプ・紙      | 1.04%  |
| 化学         | 8.77%  |
| 石油・石炭製品    | 2.11%  |
| ゴム製品       | 0.97%  |
| ガラス・土石製品   | 2.10%  |
| 鉄鋼         | 3.35%  |
| 非鉄金属       | 1.11%  |
| 金属製品       | 4.06%  |
| 機械         | 3.53%  |
| 電気機器       | 12.67% |
| 輸送用機器      | 9.64%  |
| 精密機器       | 0.79%  |
| その他製品      | 1.29%  |
| 陸運業        | 2.19%  |
| 海運業        | 3.03%  |
| 倉庫・運輸関連業   | 0.90%  |
| 情報・通信業     | 3.23%  |
| 卸売業        | 6.47%  |
| 小売業        | 4.87%  |
| 銀行業        | 5.25%  |
| 証券・商品先物取引業 | 1.43%  |
| 保険業        | 1.23%  |
| その他金融業     | 0.83%  |
| 不動産業       | 5.24%  |
| サービス業      | 3.51%  |
| 合計         | 93.66% |

（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<br>地域                        | 種類<br>業種  | 株数、口数<br>または額面金<br>額 | 簿価単価<br>簿価           | 評価単価<br>時価           | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|---|----------------------------------|-----------|----------------------|----------------------|----------------------|--------------------------|----------|
| 1 | BHP BILLITON LTD<br>オーストラリア      | 株式<br>鉱業  | 62,000               | 3,364<br>208,579,978 | 3,013<br>186,815,945 | —<br>—                   | 2.12%    |
| 2 | AUSTRALIA & NZLAND BK<br>オーストラリア | 株式<br>銀行業 | 89,700               | 1,840<br>165,067,375 | 1,741<br>156,189,802 | —<br>—                   | 1.78%    |
| 3 | WESTPAC BANKING<br>オーストラリア       | 株式<br>銀行業 | 83,000               | 2,074<br>172,183,135 | 1,809<br>150,170,904 | —<br>—                   | 1.71%    |

|    |                                      |               |         |                       |                       |        |       |
|----|--------------------------------------|---------------|---------|-----------------------|-----------------------|--------|-------|
| 4  | CHEVRON CORP<br>米国                   | 株式<br>石油・石炭製品 | 20,000  | 6,815<br>136,307,568  | 6,745<br>134,901,394  | —<br>— | 1.53% |
| 5  | BRIT AMERICAN TOBACCO PLC<br>英国      | 株式<br>食料品     | 49,500  | 3,061<br>151,524,084  | 2,692<br>133,285,074  | —<br>— | 1.52% |
| 6  | COMMONWEALTH BANK OF AUST<br>オーストラリア | 株式<br>銀行業     | 32,500  | 4,238<br>137,757,178  | 4,029<br>130,972,348  | —<br>— | 1.49% |
| 7  | INT'L BUSINESS MACHINES<br>米国        | 株式<br>電気機器    | 11,000  | 11,542<br>126,967,468 | 11,437<br>125,812,397 | —<br>— | 1.43% |
| 8  | MICROSOFT CORP<br>米国                 | 株式<br>サービス業   | 47,000  | 2,614<br>122,867,649  | 2,355<br>110,722,506  | —<br>— | 1.26% |
| 9  | HSBC HOLDINGS PLC<br>英国              | 株式<br>銀行業     | 127,000 | 928<br>117,919,781    | 827<br>105,108,850    | —<br>— | 1.20% |
| 10 | BNP PARIBAS<br>ユーロ                   | 株式<br>銀行業     | 18,600  | 6,232<br>115,931,720  | 5,270<br>98,022,632   | —<br>— | 1.11% |
| 11 | INTEL CORP<br>米国                     | 株式<br>電気機器    | 50,100  | 1,896<br>95,015,086   | 1,955<br>97,988,596   | —<br>— | 1.11% |
| 12 | BANCO SANTANDER SA<br>ユーロ            | 株式<br>銀行業     | 102,901 | 1,170<br>120,419,484  | 942<br>96,982,134     | —<br>— | 1.10% |
| 13 | TOTAL SA<br>ユーロ                      | 株式<br>石油・石炭製品 | 22,000  | 4,748<br>104,475,481  | 4,278<br>94,132,434   | —<br>— | 1.07% |
| 14 | TAIWAN SEMICONDUCTOR<br>台湾           | 株式<br>電気機器    | 528,333 | 174<br>92,151,842     | 167<br>88,387,469     | —<br>— | 1.01% |
| 15 | BHP BILLITON PLC<br>英国               | 株式<br>鉱業      | 35,000  | 2,943<br>103,031,737  | 2,521<br>88,266,777   | —<br>— | 1.00% |
| 16 | RIO TINTO LTD<br>オーストラリア             | 株式<br>鉱業      | 16,700  | 5,949<br>99,348,313   | 5,273<br>88,062,841   | —<br>— | 1.00% |
| 17 | M & T BANK CORP<br>米国                | 株式<br>銀行業     | 12,000  | 7,188<br>86,266,036   | 7,235<br>86,824,853   | —<br>— | 0.99% |
| 18 | STANDARD CHARTERED PLC<br>英国         | 株式<br>銀行業     | 40,000  | 2,339<br>93,579,286   | 2,158<br>86,322,284   | —<br>— | 0.98% |
| 19 | DIAGEO PLC<br>英国                     | 株式<br>食料品     | 61,600  | 1,432<br>88,250,182   | 1,390<br>85,673,680   | —<br>— | 0.97% |
| 20 | OCCIDENTAL PETROLEUM<br>米国           | 株式<br>石油・石炭製品 | 11,000  | 7,440<br>81,849,371   | 7,533<br>82,873,869   | —<br>— | 0.94% |
| 21 | PHILIP MORRIS INTERNATION<br>米国      | 株式<br>食料品     | 20,000  | 4,637<br>92,752,698   | 4,028<br>80,571,944   | —<br>— | 0.92% |
| 22 | NOVARTIS AG-REG SHS<br>スイス           | 株式<br>医薬品     | 18,000  | 4,609<br>82,968,606   | 4,148<br>74,664,648   | —<br>— | 0.85% |
| 23 | BASF SE<br>ユーロ                       | 株式<br>化学      | 15,300  | 4,865<br>74,445,038   | 4,807<br>73,558,881   | —<br>— | 0.84% |
| 24 | LINEAR TECHNOLOGY CORP<br>米国         | 株式<br>電気機器    | 28,000  | 2,487<br>69,643,963   | 2,553<br>71,484,773   | —<br>— | 0.81% |
| 25 | PRAXAIR INC<br>米国                    | 株式<br>化学      | 10,000  | 7,240<br>72,402,890   | 7,085<br>70,856,560   | —<br>— | 0.81% |
| 26 | TELEFONICA S.A.<br>ユーロ               | 株式<br>情報・通信業  | 39,900  | 2,026<br>80,850,647   | 1,761<br>70,285,446   | —<br>— | 0.80% |
| 27 | UNITED OVERSEAS BANK<br>シンガポール       | 株式<br>銀行業     | 59,000  | 1,184<br>69,882,904   | 1,181<br>69,729,315   | —<br>— | 0.79% |
| 28 | SCHNEIDER ELECTRIC SA<br>ユーロ         | 株式<br>機械      | 7,600   | 9,311<br>70,765,157   | 9,144<br>69,496,680   | —<br>— | 0.79% |
| 29 | GLAXOSMITHKLINE PLC<br>英国            | 株式<br>医薬品     | 45,000  | 1,630<br>73,363,556   | 1,525<br>68,637,290   | —<br>— | 0.78% |
| 30 | BRISTOL MYERS SQUIBB<br>米国           | 株式<br>医薬品     | 32,100  | 2,311<br>74,184,901   | 2,119<br>68,029,694   | —<br>— | 0.77% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 株式        | 95.75% |
| 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

| 業種         | 投資比率   |
|------------|--------|
| 鉱業         | 5.54%  |
| 建設業        | 0.74%  |
| 食料品        | 6.81%  |
| 繊維製品       | 0.59%  |
| 化学         | 5.50%  |
| 医薬品        | 4.84%  |
| 石油・石炭製品    | 7.25%  |
| ガラス・土石製品   | 0.18%  |
| 鉄鋼         | 1.28%  |
| 非鉄金属       | 0.30%  |
| 金属製品       | 0.33%  |
| 機械         | 3.26%  |
| 電気機器       | 10.61% |
| 輸送用機器      | 1.58%  |
| 精密機器       | 0.39%  |
| その他製品      | 0.53%  |
| 電気・ガス業     | 2.74%  |
| 情報・通信業     | 3.78%  |
| 卸売業        | 0.24%  |
| 小売業        | 4.04%  |
| 銀行業        | 18.40% |
| 証券・商品先物取引業 | 0.21%  |
| 保険業        | 4.00%  |
| その他金融業     | 1.49%  |
| 不動産業       | 0.60%  |
| サービス業      | 3.80%  |
| 消費材        | 0.72%  |
| 石油他        | 1.54%  |
| 建設資材       | 0.10%  |
| コンク`ロマリット  | 3.15%  |
| 電力         | 0.32%  |
| その他製造      | 0.90%  |
| 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業種の時価の比率です。

## ② 投資不動産物件

該当事項はありません。

### ③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類     | 地域 | 資産名              | 買建/<br>売建 | 数量     | 簿価        | 時価        | 投資<br>比率 |
|--------|----|------------------|-----------|--------|-----------|-----------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | 英ポンド売/円買 2010年6月 | 売建        | 8,508  | 1,121,609 | 1,121,524 | △0.01%   |
|        |    | ユーロ買/円売 2010年6月  | 買建        | 10,000 | 1,121,609 | 1,121,900 | 0.01%    |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### (参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

#### ① 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

|    | 銘柄名<br>地域                    | 種類<br>業種  | 株数、口数<br>または額面金<br>額 | 簿価単価<br>簿価               | 評価単価<br>時価               | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|----|------------------------------|-----------|----------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|----------|
| 1  | 日本ビルファンド<br>日本               | 投資証券<br>— | 3,100                | 781,000<br>2,421,100,000 | 738,000<br>2,287,800,000 | —<br>—                   | 15.23%   |
| 2  | ジャパンリアルエステイト<br>日本           | 投資証券<br>— | 2,700                | 801,000<br>2,162,700,000 | 738,000<br>1,992,600,000 | —<br>—                   | 13.26%   |
| 3  | 日本リテールファンド<br>日本             | 投資証券<br>— | 12,100               | 122,300<br>1,479,830,000 | 109,200<br>1,321,320,000 | —<br>—                   | 8.79%    |
| 4  | 森トラスト総合リート<br>日本             | 投資証券<br>— | 1,352                | 721,592<br>975,593,600   | 683,000<br>923,416,000   | —<br>—                   | 6.15%    |
| 5  | 日本プライムリアルティ<br>日本            | 投資証券<br>— | 3,850                | 223,700<br>861,245,000   | 207,600<br>799,260,000   | —<br>—                   | 5.32%    |
| 6  | 野村不動産オフィスF<br>日本             | 投資証券<br>— | 1,500                | 527,000<br>790,500,000   | 480,000<br>720,000,000   | —<br>—                   | 4.79%    |
| 7  | ユナイテッド・アーバン投資<br>法人<br>日本    | 投資証券<br>— | 1,300                | 599,000<br>778,700,000   | 533,000<br>692,900,000   | —<br>—                   | 4.61%    |
| 8  | アドバンス・レジデンス<br>日本            | 投資証券<br>— | 4,624                | 127,200<br>588,172,800   | 122,100<br>564,590,400   | —<br>—                   | 3.76%    |
| 9  | フロンティア不動産投資<br>日本            | 投資証券<br>— | 800                  | 710,000<br>568,000,000   | 666,000<br>532,800,000   | —<br>—                   | 3.55%    |
| 10 | オリックス不動産投資<br>日本             | 投資証券<br>— | 1,200                | 446,000<br>535,200,000   | 400,000<br>480,000,000   | —<br>—                   | 3.19%    |
| 11 | ジャパンエクセレント投資法<br>人<br>日本     | 投資証券<br>— | 1,000                | 476,000<br>476,000,000   | 462,000<br>462,000,000   | —<br>—                   | 3.07%    |
| 12 | 日本ロジスティクスファンド<br>投資法人<br>日本  | 投資証券<br>— | 650                  | 743,000<br>482,950,000   | 684,000<br>444,600,000   | —<br>—                   | 2.96%    |
| 13 | ケネディクス不動産投資法人<br>日本          | 投資証券<br>— | 1,500                | 289,394<br>434,092,278   | 264,600<br>396,900,000   | —<br>—                   | 2.64%    |
| 14 | DAオフィス投資法人<br>日本             | 投資証券<br>— | 1,700                | 218,200<br>370,940,000   | 222,300<br>377,910,000   | —<br>—                   | 2.52%    |
| 15 | 東急リアル・エステート<br>日本            | 投資証券<br>— | 700                  | 503,000<br>352,100,000   | 490,500<br>343,350,000   | —<br>—                   | 2.29%    |
| 16 | 日本アコモデーションファン<br>ド投資法人<br>日本 | 投資証券<br>— | 700                  | 486,000<br>340,200,000   | 455,000<br>318,500,000   | —<br>—                   | 2.12%    |
| 17 | トップリート投資法人<br>日本             | 投資証券<br>— | 700                  | 429,000<br>300,300,000   | 430,000<br>301,000,000   | —<br>—                   | 2.00%    |

|    |                                 |           |       |                        |                        |        |       |
|----|---------------------------------|-----------|-------|------------------------|------------------------|--------|-------|
| 18 | ビ・ライフ投資法人<br>日本                 | 投資証券<br>— | 650   | 429,000<br>278,850,000 | 432,500<br>281,125,000 | —<br>— | 1.87% |
| 19 | M I Dリート投資法人<br>日本              | 投資証券<br>— | 1,353 | 214,000<br>289,542,000 | 197,200<br>266,811,600 | —<br>— | 1.78% |
| 20 | グローバル・ワン不動産投資<br>法人<br>日本       | 投資証券<br>— | 368   | 604,000<br>222,272,000 | 599,000<br>220,432,000 | —<br>— | 1.47% |
| 21 | 野村不レジデンシャル<br>日本                | 投資証券<br>— | 600   | 390,000<br>234,000,000 | 338,500<br>203,100,000 | —<br>— | 1.35% |
| 22 | 福岡リート投資法人<br>日本                 | 投資証券<br>— | 333   | 593,000<br>197,469,000 | 552,000<br>183,816,000 | —<br>— | 1.22% |
| 23 | 産業ファンド<br>日本                    | 投資証券<br>— | 410   | 375,000<br>153,750,000 | 374,000<br>153,340,000 | —<br>— | 1.02% |
| 24 | プレミアム投資法人<br>日本                 | 投資証券<br>— | 352   | 380,000<br>133,760,000 | 376,500<br>132,528,000 | —<br>— | 0.88% |
| 25 | クレッシェンド投資法人<br>日本               | 投資証券<br>— | 800   | 158,470<br>126,776,042 | 151,300<br>121,040,000 | —<br>— | 0.81% |
| 26 | ジョイントリート投資法人<br>日本              | 投資証券<br>— | 370   | 262,300<br>97,051,000  | 237,200<br>87,764,000  | —<br>— | 0.58% |
| 27 | 森ヒルズリート<br>日本                   | 投資証券<br>— | 310   | 202,600<br>62,806,000  | 182,000<br>56,420,000  | —<br>— | 0.38% |
| 28 | ジャパン・ホテル・アンド・<br>リゾート投資法人<br>日本 | 投資証券<br>— | 150   | 163,061<br>24,459,236  | 173,300<br>25,995,000  | —<br>— | 0.17% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 投資証券      | 97.78% |
| 合計        | 97.78% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 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<br>地域                      | 種類<br>業種  | 株数、口数<br>または額面金<br>額 | 簿価単価<br>簿価               | 評価単価<br>時価               | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|---|--------------------------------|-----------|----------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|----------|
| 1 | WESTFIELD GROUP<br>オーストラリア     | 投資証券<br>— | 22,533,427           | 934<br>21,050,234,419    | 989<br>22,301,242,568    | —<br>—                   | 7.07%    |
| 2 | UNIBAIL-RODAMCO SE<br>ユーロ      | 投資証券<br>— | 1,224,991            | 15,625<br>19,141,329,570 | 14,114<br>17,290,453,967 | —<br>—                   | 5.48%    |
| 3 | SIMON PROPERTY GROUP INC<br>米国 | 投資証券<br>— | 2,035,401            | 7,546<br>15,360,520,454  | 7,764<br>15,803,035,125  | —<br>—                   | 5.01%    |

|    |                                      |      |   |             |                        |                        |        |       |
|----|--------------------------------------|------|---|-------------|------------------------|------------------------|--------|-------|
| 4  | STOCKLAND<br>オーストラリア                 | 投資証券 | — | 37,144,384  | 309<br>11,501,754,008  | 298<br>11,085,934,556  | —<br>— | 3.51% |
| 5  | LAND SECURITIES PLC<br>英国            | 投資証券 | — | 11,840,649  | 883<br>10,456,274,597  | 792<br>9,381,326,074   | —<br>— | 2.97% |
| 6  | PUBLIC STORAGE<br>米国                 | 投資証券 | — | 836,567     | 8,159<br>6,825,716,715 | 8,463<br>7,080,304,798 | —<br>— | 2.24% |
| 7  | BRITISH LAND CO PLC<br>英国            | 投資証券 | — | 10,756,236  | 611<br>6,580,121,542   | 593<br>6,383,811,652   | —<br>— | 2.02% |
| 8  | HAMMERSON PLC<br>英国                  | 投資証券 | — | 13,351,138  | 506<br>6,762,252,752   | 474<br>6,339,810,041   | —<br>— | 2.01% |
| 9  | DEXUS PROPERTY GROUP<br>オーストラリア      | 投資証券 | — | 104,645,372 | 61<br>6,435,460,780    | 59<br>6,270,664,626    | —<br>— | 1.99% |
| 10 | EQUITY RESIDENTIAL<br>米国             | 投資証券 | — | 1,454,914   | 3,664<br>5,331,621,757 | 4,120<br>5,995,439,146 | —<br>— | 1.90% |
| 11 | VORNADO REALTY TRUST<br>米国           | 投資証券 | — | 783,468     | 6,837<br>5,356,672,365 | 7,092<br>5,557,107,812 | —<br>— | 1.76% |
| 12 | HOST HOTELS&RESORTS INC<br>米国        | 投資証券 | — | 4,176,662   | 1,232<br>5,148,039,590 | 1,302<br>5,438,350,563 | —<br>— | 1.72% |
| 13 | GOODMAN GROUP<br>オーストラリア             | 投資証券 | — | 103,973,662 | 47<br>4,954,850,833    | 47<br>4,984,330,998    | —<br>— | 1.58% |
| 14 | LINK REIT<br>香港                      | 投資証券 | — | 21,991,325  | 218<br>4,814,551,986   | 218<br>4,799,087,686   | —<br>— | 1.52% |
| 15 | BOSTON PROPERTIES INC<br>米国          | 投資証券 | — | 670,886     | 6,850<br>4,595,777,471 | 7,001<br>4,697,309,499 | —<br>— | 1.49% |
| 16 | GPT GROUP<br>オーストラリア                 | 投資証券 | — | 22,635,838  | 218<br>4,946,664,857   | 207<br>4,690,544,024   | —<br>— | 1.49% |
| 17 | CORIO NV<br>ユーロ                      | 投資証券 | — | 1,075,533   | 5,000<br>5,377,924,915 | 4,353<br>4,682,182,341 | —<br>— | 1.48% |
| 18 | MIRVAC GROUP<br>オーストラリア              | 投資証券 | — | 45,748,538  | 111<br>5,101,984,087   | 99<br>4,563,087,276    | —<br>— | 1.45% |
| 19 | MACERICH CO/THE<br>米国                | 投資証券 | — | 1,202,649   | 3,661<br>4,403,266,462 | 3,776<br>4,541,902,085 | —<br>— | 1.44% |
| 20 | PROLOGIS<br>米国                       | 投資証券 | — | 4,368,202   | 1,287<br>5,625,533,670 | 1,039<br>4,539,032,770 | —<br>— | 1.44% |
| 21 | SEGRO PLC<br>英国                      | 投資証券 | — | 11,569,923  | 426<br>4,937,330,402   | 377<br>4,363,777,297   | —<br>— | 1.38% |
| 22 | BRE PROPERTIES-CL A<br>米国            | 投資証券 | — | 1,026,278   | 3,219<br>3,304,610,828 | 3,730<br>3,828,967,889 | —<br>— | 1.21% |
| 23 | LIBERTY PROPERTY TRUST<br>米国         | 投資証券 | — | 1,352,249   | 2,989<br>4,043,090,167 | 2,813<br>3,804,229,509 | —<br>— | 1.21% |
| 24 | ICADE<br>ユーロ                         | 投資証券 | — | 507,342     | 8,407<br>4,265,650,879 | 7,448<br>3,779,169,250 | —<br>— | 1.20% |
| 25 | CAPITACOMMERCIAL TRUST<br>シンガポール     | 投資証券 | — | 50,381,000  | 74<br>3,756,625,790    | 73<br>3,705,038,892    | —<br>— | 1.17% |
| 26 | AVALONBAY COMMUNITIES INC<br>米国      | 投資証券 | — | 387,860     | 8,089<br>3,137,452,075 | 8,953<br>3,472,843,597 | —<br>— | 1.10% |
| 27 | COMMONWEALTH PROPERTY OFF<br>オーストラリア | 投資証券 | — | 44,188,929  | 71<br>3,175,341,311    | 72<br>3,211,686,711    | —<br>— | 1.02% |
| 28 | KIMCO REALTY CORP<br>米国              | 投資証券 | — | 2,274,017   | 1,396<br>3,174,892,241 | 1,305<br>2,969,259,039 | —<br>— | 0.94% |
| 29 | UDR INC<br>米国                        | 投資証券 | — | 1,584,827   | 1,608<br>2,549,072,477 | 1,856<br>2,941,965,550 | —<br>— | 0.93% |
| 30 | VENTAS INC<br>米国                     | 投資証券 | — | 606,723     | 4,263<br>2,586,977,413 | 4,287<br>2,601,024,231 | —<br>— | 0.82% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 投資証券      | 96.16% |
| 合計        | 96.16% |

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

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/<br>売建 | 数量         | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|--------|----|-----------------------|-----------|------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | 米ドル売/円買 2010年6月       | 売建        | 9,299,439  | 848,632,131   | 849,038,784   | △0.27%   |
|        |    | 米ドル買/円売 2010年6月       | 買建        | 65,733,191 | 5,974,447,189 | 6,001,440,341 | 1.90%    |
|        |    | 英ポンド買/円売 2010年6月      | 買建        | 3,816,077  | 506,419,623   | 503,035,312   | 0.16%    |
|        |    | ユーロ売/円買 2010年6月       | 売建        | 594,592    | 66,713,189    | 66,707,243    | △0.02%   |
|        |    | カナダドル買/円売 2010年6月     | 買建        | 1,177,717  | 102,602,146   | 102,143,367   | 0.03%    |
|        |    | オーストラリアドル買/円売 2010年6月 | 買建        | 3,092,683  | 239,610,362   | 239,095,321   | 0.08%    |

（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<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)<br>(円) |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 設定時<br>(平成19年9月28日)      | 1,000,000             | —                     | 1.0000                         | —                              |
| 第1特定期間末<br>(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<br>(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<br>(平成20年11月10日) | 21,221,012            | 21,270,001            | 0.8664                         | 0.8684                         |
| 第4特定期間末<br>(平成21年5月11日)  | 22,258,538            | 22,309,044            | 0.8795                         | 0.8815                         |
| 平成21年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<br>(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 | —      |
| 12月末日                    | 23,069,678 | —          | 0.9117 | —      |
| 平成22年1月末日                | 22,817,748 | —          | 0.9017 | —      |
| 2月末日                     | 22,805,399 | —          | 0.9012 | —      |
| 3月末日                     | 23,272,267 | —          | 0.9197 | —      |
| 4月末日                     | 23,649,950 | —          | 0.9346 | —      |
| 第6特定期間末<br>(平成22年5月10日)  | 23,201,059 | 23,251,668 | 0.9169 | 0.9189 |
| 5月末日                     | 22,960,239 | —          | 0.9074 | —      |

## 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      |
| 第6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6特定期間 | 2.4    |

[次へ](#)

## (参考情報)

2010年5月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 9,074円 |
| 純資産総額 | 22百万円  |

| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月      | -2.7% |
| 3カ月      | 1.1%  |
| 6カ月      | 2.1%  |
| 1年間      | 5.0%  |
| 3年間      | -     |
| 5年間      | -     |
| 設定来      | -6.2% |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 120円 設定来分配金合計額: 300円

| 決算期 | 第5期   | 第6期   | 第7期    | 第8期   | 第9期   | 第10期  | 第11期  | 第12期  | 第13期   | 第14期  | 第15期  | 第16期  |
|-----|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|
|     | 08年7月 | 08年9月 | 08年11月 | 09年1月 | 09年3月 | 09年5月 | 09年7月 | 09年9月 | 09年11月 | 10年1月 | 10年3月 | 10年5月 |
| 分配金 | 20円   | 20円   | 20円    | 20円   | 20円   | 20円   | 20円   | 20円   | 20円    | 20円   | 20円   | 20円   |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

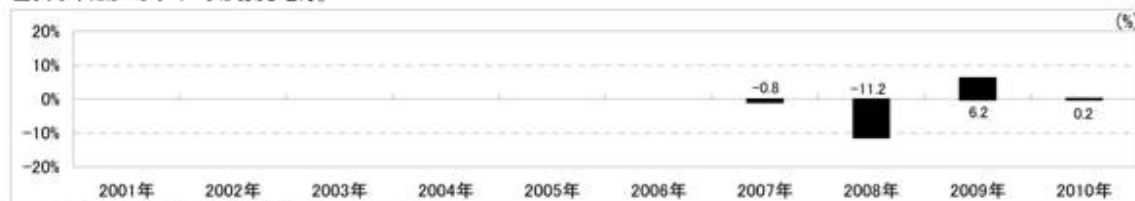
| 資産別構成       |     |        | 銘柄数         |        | 比率        |        | 通貨別構成                 |                  | 比率      |      | 債券ポートフォリオ特性値 |  | 組入上位銘柄 |  | 国・地域名 |  | 比率 |  |
|-------------|-----|--------|-------------|--------|-----------|--------|-----------------------|------------------|---------|------|--------------|--|--------|--|-------|--|----|--|
| 国内債券        | 32  | 67.8%  | 日本円         | 81.1%  | 直接利回り(%)  | 2.0    | 株<br>式<br>リ<br>ー<br>ト | 三菱UFJフィナンシャルG    | 日本      | 0.1% |              |  |        |  |       |  |    |  |
| 外国債券        | 34  | 9.2%   | 米ドル         | 6.6%   | 最終利回り(%)  | 1.2    |                       | 本田技研             | 日本      | 0.1% |              |  |        |  |       |  |    |  |
| 国内リート       | 29  | 4.9%   | ユーロ         | 3.3%   | 修正デュレーション | 5.8    |                       | BHP BILLITON LTD | オーストラリア | 0.1% |              |  |        |  |       |  |    |  |
| 外国リート       | 133 | 4.6%   | 豪ドル         | 2.8%   | 残存年数      | 7.3    |                       | トヨタ自動車           | 日本      | 0.1% |              |  |        |  |       |  |    |  |
| 国内株式        | 177 | 4.6%   | 英ポンド        | 2.1%   | 債券格付別構成   | 比率     |                       | 三井物産             | 日本      | 0.1% |              |  |        |  |       |  |    |  |
| 外国株式        | 184 | 4.5%   | カナダ・ドル      | 1.4%   | AAA       | 69.1%  |                       | 日本ビルファンド         | 日本      | 0.7% |              |  |        |  |       |  |    |  |
|             |     |        | 香港ドル        | 0.5%   | AA        | 20.7%  |                       | ジャパンリアルエステイト     | 日本      | 0.6% |              |  |        |  |       |  |    |  |
|             |     |        | スウェーデン・クローネ | 0.4%   | A         | 8.9%   |                       | 日本リテールファンド       | 日本      | 0.4% |              |  |        |  |       |  |    |  |
|             |     |        | ポーランド・ズロチ   | 0.4%   | BBB       | -      |                       | WESTFIELD GROUP  | オーストラリア | 0.3% |              |  |        |  |       |  |    |  |
| コール・ローン、その他 |     | 4.4%   | その他         | 1.4%   | BB以下・無格付  | 1.3%   |                       | 森トラスト総合リート       | 日本      | 0.3% |              |  |        |  |       |  |    |  |
| 合計          | 589 | 100.0% | 合計          | 100.0% | 合計        | 100.0% | 合計                    |                  |         | 2.9% |              |  |        |  |       |  |    |  |

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.3%保有しています。

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

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2007年は設定日(9月28日)から年末、2010年は5月31日までの騰落率を表しています。

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量（口）   | 解約数量（口）   |
|--------|-----------|-----------|
| 第1特定期間 | 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 |
| 第6特定期間 | 0         | 0         |

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および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、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

### ③ 反対者の買取請求権

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

### ④ 運用報告書

委託会社は、毎年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。

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

### 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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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

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

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

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

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

## 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、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

### 第3 【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）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。以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

ただし、前特定期間（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）については、改正前の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づき、当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）については、改正後の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則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21年5月12日から平成21年11月10日まで）及び当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5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<br>平成21年11月10日現在 | 当 期<br>平成22年5月10日現在 |
|-----------------|----------------------|---------------------|
| 資産の部            |                      |                     |
| 流動資産            |                      |                     |
| コール・ローン         | 359,029              | 302,187             |
| 親投資信託受益証券       | 22,474,283           | 22,976,423          |
| 未収入金            | 51,000               | —                   |
| 流動資産合計          | 22,884,312           | 23,278,610          |
| 資産合計            | 22,884,312           | 23,278,610          |
| 負債の部            |                      |                     |
| 流動負債            |                      |                     |
| 未払収益分配金         | 49,960               | 50,609              |
| 未払受託者報酬         | 1,575                | 1,623               |
| 未払委託者報酬         | 23,922               | 24,553              |
| その他未払費用         | 732                  | 766                 |
| 流動負債合計          | 76,189               | 77,551              |
| 負債合計            | 76,189               | 77,551              |
| 純資産の部           |                      |                     |
| 元本等             |                      |                     |
| 元本              | ※ 1 25,304,559       | ※ 1 25,304,559      |
| 剰余金             |                      |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | ※ 2 △2,496,436       | ※ 2 △2,103,500      |
| （分配準備積立金）       | 192,490              | 276,976             |
| 元本等合計           | 22,808,123           | 23,201,059          |
| 純資産合計           | 22,808,123           | 23,201,059          |
| 負債純資産合計         | 22,884,312           | 23,278,610          |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 前 期<br>自 平成21年5月12日<br>至 平成21年11月10日 | 当 期<br>自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日 |
|-------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益                    |                                      |                                      |
| 受取利息                    | 103                                  | 66                                   |
| 有価証券売買等損益               | 779,282                              | 622,140                              |
| 営業収益合計                  | 779,385                              | 622,206                              |
| 営業費用                    |                                      |                                      |
| 受託者報酬                   | 4,696                                | 4,745                                |
| 委託者報酬                   | ※ 1 71,088                           | ※ 1 71,932                           |
| その他費用                   | 732                                  | 766                                  |
| 営業費用合計                  | 76,516                               | 77,443                               |
| 営業利益                    | 702,869                              | 544,763                              |
| 経常利益                    | 702,869                              | 544,763                              |
| 当期純利益                   | 702,869                              | 544,763                              |
| 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（△）         | △3,050,552                           | △2,496,436                           |
| 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          | 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 | 100,149                              | —                                    |
| 分配金                     | ※ 2 149,329                          | ※ 2 151,827                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）         | △2,496,436                           | △2,103,500                           |

## (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<br>自 平成21年5月12日<br>至 平成21年11月10日                                                  | 当 期<br>自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5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<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br><br>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<br><br>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<br>平成21年11月10日現在                          | 当 期<br>平成22年5月10日現在                           |
|---------------------------------------|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 1. ※1 期首元本額<br>期中追加設定元本額<br>期中一部解約元本額 | 25,309,090円<br>1,089,759円<br>1,094,290円       | 25,304,559円<br>—円<br>—円                       |
| 2. 特定期間末日における受益権の総数                   | 25,304,559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2,496,436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2,103,500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<br>自 平成21年5月12日<br>至 平成21年11月10日 | 当 期<br>自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5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 | 2,924円                               | 2,492円                               |

## 2. ※2 分配金の計算過程

（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11月11日 至平成22年1月12日）  
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（79,269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（192,490円）より分配対象額は384,061円（1万口当たり151.78円）であり、うち50,609円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

（自平成22年1月13日 至平成22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（60,981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（221,150円）より分配対象額は394,433円（1万口当たり155.87円）であり、うち50,609円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>（自平成21年9月11日 至平成21年11月10日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（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。</p> | <p>（自平成22年3月11日 至平成22年5月10日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（96,063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（231,522円）より分配対象額は439,887円（1万口当たり173.84円）であり、うち50,609円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

| 区 分             | 当 期<br>自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日                                                                                                                                  |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。                                                                                            |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |

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

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 当 期<br>平成22年5月10日現在                                                                                                                  |
|--------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                          |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種 類       | 前 期<br>平成21年11月10日現在 |                                 | 当 期<br>平成22年5月10日現在             |
|-----------|----------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|           | 貸借対照表計上額<br>(円)      | 最終の計算期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) | 最終の計算期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) |
| 親投資信託受益証券 | 22,474,283           | △103,552                        | 303,396                         |
| 合計        | 22,474,283           | △103,552                        | 303,396                         |

### （デリバティブ取引に関する注記）

#### 前特定期間（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）

|                                               |
|-----------------------------------------------|
| <p>前 期<br/>自 平成21年5月12日<br/>至 平成21年11月10日</p> |
| 該当事項はありません。                                   |

#### 当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）

#### ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

|                                                         |
|---------------------------------------------------------|
| <p style="text-align: center;">当 期<br/>平成22年5月10日現在</p> |
| 該当事項はありません。                                             |

## (関連当事者との取引に関する注記)

| <p style="text-align: center;">前 期<br/>自 平成21年5月12日<br/>至 平成21年11月10日</p> | <p style="text-align: center;">当 期<br/>自 平成21年11月11日<br/>至 平成22年5月10日</p> |
|---------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|
| 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)

|                           | <p style="text-align: center;">前 期<br/>平成21年11月10日現在</p> | <p style="text-align: center;">当 期<br/>平成22年5月10日現在</p> |
|---------------------------|----------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | <p style="text-align: right;">0.9013円<br/>(9,013円)</p>   | <p style="text-align: right;">0.9169円<br/>(9,169円)</p>  |

## (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<br>(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 | 11,505,035 |    |
|              | ダイワ短期日本債券アクティブ・マザーファンド | 4,330,197  | 4,583,513  |    |
|              | ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド     | 1,974,637  | 2,248,519  |    |
|              | ダイワ好配当日本株マザーファンド       | 1,095,294  | 1,197,923  |    |
|              | ダイワ海外好配当株マザーファンド       | 1,558,697  | 1,117,741  |    |
|              | ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 1,329,347  | 1,192,955  |    |
|              | ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド  | 1,395,456  | 1,130,737  |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                        | 22,467,240 | 22,976,423 |    |
| 合計           |                        | 22,467,240 | 22,976,423 |    |

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11月10日現在 | 平成22年5月10日現在 |
|-----------------|---------------|--------------|
|                 | 金 額（円）        | 金 額（円）       |
| 資産の部            |               |              |
| 流動資産            |               |              |
| コール・ローン         | 16,189,095    | 23,024,201   |
| 国債証券            | 422,145,220   | 319,498,830  |
| 地方債証券           | 10,384,150    | 10,488,250   |
| 特殊債券            | 75,563,040    | 75,516,780   |
| 社債券             | —             | 124,542,270  |
| 未収入金            | 27,958,585    | 19,662,000   |
| 未収利息            | 1,286,815     | 1,623,366    |
| 前払費用            | 669,646       | 776,333      |
| 流動資産合計          | 554,196,551   | 575,132,030  |
| 資産合計            | 554,196,551   | 575,132,030  |
| 負債の部            |               |              |
| 流動負債            |               |              |
| 未払金             | 24,898,400    | 35,024,080   |
| 未払解約金           | 13,620        | 4,636        |
| 流動負債合計          | 24,912,020    | 35,028,716   |
| 負債合計            | 24,912,020    | 35,028,716   |
| 純資産の部           |               |              |
| 元本等             |               |              |
| 元本 ※1           | 507,238,479   | 506,249,149  |
| 剰余金             |               |              |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 22,046,052    | 33,854,165   |
| 元本等合計           | 529,284,531   | 540,103,314  |
| 純資産合計           | 529,284,531   | 540,103,314  |
| 負債純資産合計         | 554,196,551   | 575,132,030  |

## 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21年5月12日<br>至 平成21年11月10日                                                                                                               | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5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<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分 | 平成21年11月10日現在 | 平成22年5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     | 507,747,086円 | 507,238,479円 |
| 同期中における追加設定元本額                               | 537,163円     | 24,443円      |
| 同期中における一部解約元本額                               | 1,045,770円   | 1,013,773円   |
| 同期末における元本の内訳<br>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）               | 495,784,478円 | 494,770,705円 |
| ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）                      | 10,783,612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）                       | 670,389円     | 694,832円     |
| 計                                            | 507,238,479円 | 506,249,149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 | 507,238,479口 | 506,249,149口 |

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

## I 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日                                                                                      |
|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。                                         |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。                                         |

|                            |                                                                                                                        |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成22年5月10日現在                                                                                                                         |
|--------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ                                                                                            |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種 類   | 平成21年11月10日現在   |                             | 平成22年5月10日現在                |
|-------|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
|       | 貸借対照表計上額<br>(円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) |
| 国債証券  | 422,145,220     | 26,180                      | 2,367,360                   |
| 地方債証券 | 10,384,150      | 31,520                      | 135,620                     |
| 特殊債券  | 75,563,040      | △65,910                     | △112,170                    |
| 社債券   | —               | —                           | 196,750                     |
| 合計    | 508,092,410     | △8,210                      | 2,587,560                   |

（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8月11日から平成21年11月10日まで、及び平成21年8月11日から平成22年5月10日まで）を指しております。

### （デリバティブ取引に関する注記）

（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）

|                               |
|-------------------------------|
| 自 平成21年5月12日<br>至 平成21年11月10日 |
| 該当事項はありません。                   |

（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

|              |
|--------------|
| 平成22年5月10日現在 |
| 該当事項はありません。  |

## (1口当たり情報)

|                                                          | 平成21年11月10日現在        | 平成22年5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<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0435円<br>(10,435円) | 1.0669円<br>(10,669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<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 備考 |
|----------|-----------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券     | 6 7 5年国債        | 2,000,000   | 2,052,540   |    |
|          | 8 2 5年国債        | 16,000,000  | 16,346,880  |    |
|          | 2 5 15年国債F R    | 11,000,000  | 10,928,500  |    |
|          | 2 6 15年国債F R    | 11,000,000  | 10,862,500  |    |
|          | 3 7 15年国債F R    | 10,000,000  | 9,790,000   |    |
|          | 2 6 8 10年国債     | 18,000,000  | 18,883,980  |    |
|          | 2 8 0 10年国債     | 12,000,000  | 12,907,080  |    |
|          | 2 8 7 10年国債     | 28,000,000  | 30,110,640  |    |
|          | 2 9 6 10年国債     | 9,000,000   | 9,325,440   |    |
|          | 3 0 1 10年国債     | 71,000,000  | 72,957,470  |    |
|          | 1 30年国債         | 5,000,000   | 5,601,150   |    |
|          | 2 6 30年国債       | 6,000,000   | 6,276,720   |    |
|          | 2 8 30年国債       | 7,000,000   | 7,478,870   |    |
|          | 6 4 20年国債       | 27,000,000  | 27,829,980  |    |
|          | 7 0 20年国債       | 19,000,000  | 20,653,950  |    |
|          | 9 4 20年国債       | 13,000,000  | 13,331,760  |    |
|          | 9 6 20年国債       | 16,000,000  | 16,381,280  |    |
|          | 1 0 8 20年国債     | 15,000,000  | 14,716,650  |    |
|          | 1 1 4 20年国債     | 13,000,000  | 13,063,440  |    |
| 国債証券 合計  |                 | 309,000,000 | 319,498,830 |    |
| 地方債証券    | 1 8 共同発行地方      | 10,000,000  | 10,488,250  |    |
| 地方債証券 合計 |                 | 10,000,000  | 10,488,250  |    |
| 特殊債券     | 3 1 9 政保道路債     | 20,000,000  | 20,404,680  |    |
|          | 1 4 政保国民生活      | 20,000,000  | 20,920,440  |    |
|          | 1 アフリカ開発銀行S U B | 30,000,000  | 34,191,660  |    |
| 特殊債券 合計  |                 | 70,000,000  | 75,516,780  |    |
| 社債券      | 1 バークレイズバンク     | 100,000,000 | 100,599,500 |    |
|          | 5 1 6 東京電力      | 23,000,000  | 23,942,770  |    |
| 社債券 合計   |                 | 123,000,000 | 124,542,270 |    |
| 合計       |                 | 512,000,000 | 530,046,130 |    |

## 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11月10日現在 | 平成22年5月10日現在 |
|-----------------|---------------|--------------|
|                 | 金 額（円）        | 金 額（円）       |
| 資産の部            |               |              |
| 流動資産            |               |              |
| コール・ローン         | 23,886,854    | 12,081,830   |
| 国債証券            | 89,322,070    | 102,265,530  |
| 社債券             | 200,786,600   | 203,816,000  |
| 未収入金            | 9,314,305     | —            |
| 未収利息            | 421,656       | 666,774      |
| 前払費用            | 282,250       | 1,159,849    |
| 流動資産合計          | 324,013,735   | 319,989,983  |
| 資産合計            | 324,013,735   | 319,989,983  |
| 負債の部            |               |              |
| 流動負債            |               |              |
| 未払金             | 10,118,600    | —            |
| 未払解約金           | 5,464         | 1,857        |
| 流動負債合計          | 10,124,064    | 1,857        |
| 負債合計            | 10,124,064    | 1,857        |
| 純資産の部           |               |              |
| 元本等             |               |              |
| 元本 ※1           | 302,754,960   | 302,309,417  |
| 剰余金             |               |              |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 11,134,711    | 17,678,709   |
| 元本等合計           | 313,889,671   | 319,988,126  |
| 純資産合計           | 313,889,671   | 319,988,126  |
| 負債純資産合計         | 324,013,735   | 319,989,983  |

## 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21年5月12日<br>至 平成21年11月10日                                                                                                                 | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5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<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。 | 国債証券及び社債券<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分                                      | 平成21年11月10日現在 | 平成22年5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 | 303,078,563円  | 302,754,960円 |
| 同期中における追加設定元本額                           | 243,258円      | 12,429円      |

|                                                      |              |              |
|------------------------------------------------------|--------------|--------------|
| 同期中における一部解約元本額                                       | 566,861円     | 457,972円     |
| 同期末における元本の内訳<br>ファンド名                                |              |              |
| ダイワ短期日本債券アクティブ<br>（F0Fs用）（適格機関投資家専<br>用）             | 298,154,032円 | 297,696,060円 |
| ダイワ円債重視バランスファンド<br>（奇数月決算型）                          | 4,330,197円   | 4,330,197円   |
| ダイワ円債重視バランスファンド<br>（資産形成型）                           | 270,731円     | 283,160円     |
| 計                                                    | 302,754,960円 | 302,309,417円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>特定期間末日における当該親投資信託<br>の受益権の総数 | 302,754,960口 | 302,309,417口 |

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

## I 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日                                                                                      |
|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。                                         |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。                                         |

|                            |                                                                                                                        |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成22年5月10日現在                                                                                                                         |
|--------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ                                                                                            |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成21年11月10日現在   |                             | 平成22年5月10日現在                |
|------|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
|      | 貸借対照表計上額<br>(円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) |
| 国債証券 | 89,322,070      | △179,850                    | 154,060                     |
| 社債券  | 200,786,600     | 235,800                     | 2,731,000                   |
| 合計   | 290,108,670     | 55,950                      | 2,885,060                   |

（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8月11日から平成21年11月10日まで、及び平成21年8月11日から平成22年5月10日まで）を指しております。

### （デリバティブ取引に関する注記）

（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）

|                               |
|-------------------------------|
| 自 平成21年5月12日<br>至 平成21年11月10日 |
| 該当事項はありません。                   |

（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）

#### ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

|              |
|--------------|
| 平成22年5月10日現在 |
| 該当事項はありません。  |

### （1口当たり情報）

|  |               |              |
|--|---------------|--------------|
|  | 平成21年11月10日現在 | 平成22年5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<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0368円<br>(10,368円) | 1.0585円<br>(10,585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<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 備考 |
|---------|-------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券    | 2 8 0 2年国債  | 40,000,000  | 40,108,400  |    |
|         | 5 7 5年国債    | 7,000,000   | 7,098,000   |    |
|         | 6 7 5年国債    | 5,000,000   | 5,131,350   |    |
|         | 7 0 5年国債    | 39,000,000  | 39,652,080  |    |
|         | 3 0 1 10年国債 | 10,000,000  | 10,275,700  |    |
| 国債証券 合計 |             | 101,000,000 | 102,265,530 |    |
| 社債券     | 1 3 1 オリックス | 100,000,000 | 103,099,900 |    |
|         | 1 住友生命基金    | 100,000,000 | 100,716,100 |    |
| 社債券 合計  |             | 200,000,000 | 203,816,000 |    |
| 合計      |             | 301,000,000 | 306,081,530 |    |

### 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11月10日現在   | 平成22年5月10日現在    |
|-----------------|-----------------|-----------------|
|                 | 金 額（円）          | 金 額（円）          |
| 資産の部            |                 |                 |
| 流動資産            |                 |                 |
| 預金              | 1,489,619,923   | 2,157,910,535   |
| コール・ローン         | 2,591,425,981   | 1,509,157,920   |
| 国債証券            | 280,796,882,084 | 215,417,991,328 |
| 派生商品評価勘定        | 50,848,912      | —               |
| 未収入金            | 11,075,178,976  | —               |
| 未収利息            | 4,451,948,700   | 4,061,715,105   |
| 前払費用            | 770,747,626     | 744,759,350     |
| 流動資産合計          | 301,226,652,202 | 223,891,534,238 |
| 資産合計            | 301,226,652,202 | 223,891,534,238 |
| 負債の部            |                 |                 |
| 流動負債            |                 |                 |
| 未払金             | 11,548,494,829  | —               |
| 未払解約金           | 465,040,000     | 342,000,000     |
| 流動負債合計          | 12,013,534,829  | 342,000,000     |
| 負債合計            | 12,013,534,829  | 342,000,000     |
| 純資産の部           |                 |                 |
| 元本等             |                 |                 |
| 元本 ※1           | 251,561,559,287 | 196,327,796,902 |
| 剰余金             |                 |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 37,651,558,086  | 27,221,737,336  |
| 元本等合計           | 289,213,117,373 | 223,549,534,238 |
| 純資産合計           | 289,213,117,373 | 223,549,534,238 |
| 負債純資産合計         | 301,226,652,202 | 223,891,534,238 |

## 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21年5月12日<br>至 平成21年11月10日                                                                                 | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日 |
|------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 国債証券<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br><br>同左                |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引                                                                                                        | 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。<br>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<br><br>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<br><br>同左 |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分                                      | 平成21年11月10日現在    | 平成22年5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 | 272,157,961,376円 | 251,561,559,287円 |
| 同期中における追加設定元本額                           | 3,022,667,003円   | 27,103,147円      |
| 同期中における一部解約元本額                           | 23,619,069,092円  | 55,260,865,532円  |
| 同期末における元本の内訳<br>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）           | 22,226,759,410円  | 18,328,733,904円  |
| ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）               | 147,094,231円     | 149,731,653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）             | 4,452,939,403円   | 3,844,387,299円   |
| 北海道応援・外債バランスファンド（毎月分配型）                  | 3,530,637,741円   | 3,275,131,406円   |
| 福島応援・外債バランスファンド（毎月分配型）                   | 2,335,319,984円   | 2,090,707,386円   |
| ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）                    | 10,595,914,454円  | 9,633,622,847円   |

|                                          |                  |                  |
|------------------------------------------|------------------|------------------|
| ダイワ・バランス２資産（外債・好配当日本株）（毎月分配型）            | 89,682,672円      | 88,334,915円      |
| ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）             | 135,916,483円     | 127,979,298円     |
| 新潟県応援ファンド（外債バランス・毎月分配型）                  | 1,884,090,206円   | 1,778,780,230円   |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                      | 1,268,250,886円   | 1,227,783,915円   |
| インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                    | 3,080,399,991円   | 2,951,512,629円   |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                      | 2,875,888,103円   | 2,846,231,253円   |
| F I T ネット・三県応援ファンド（毎月分配型）                | 2,169,005,890円   | 1,906,029,692円   |
| 長野応援ファンド（毎月分配型）                          | 1,239,939,778円   | 1,160,996,488円   |
| 安定重視ポートフォリオ（資産形成型）                       | 38,555,175円      | 32,871,459円      |
| インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）                     | 76,957,359円      | 72,267,739円      |
| 成長重視ポートフォリオ（資産形成型）                       | 61,784,204円      | 63,553,803円      |
| 栃木応援・外債バランスファンド（毎月分配型）                   | 1,937,344,969円   | 1,749,716,110円   |
| 京都応援バランスファンド（隔月分配型）                      | 1,106,089,956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）                | 1,821,524,771円   | 1,751,028,238円   |
| ６資産バランスファンド（分配型）                         | 9,585,118,045円   | 8,161,564,099円   |
| ６資産バランスファンド（成長型）                         | 492,525,179円     | 479,197,813円     |
| ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）                    | 153,360,477,045円 | 109,555,432,480円 |
| 富山応援ファンド P A R T 2（地域企業株・外債バランス／隔月分配型）   | 1,086,284,898円   | 1,045,924,696円   |
| 奈良応援ファンド（外債バランス・毎月分配型）                   | 530,657,996円     | 495,251,159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） | 1,582,084,718円   | 1,367,433,168円   |
| 世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）                     | 1,854,487,771円   | 1,445,839,079円   |
| ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）                    | 8,954,212,262円   | 7,407,931,773円   |
| 兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）                      | 750,468,857円     | 684,925,805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）        | 191,748,736円     | 164,295,673円     |
| 日の出・３資産バランスファンド                          | 431,708,321円     | 233,005,051円     |
| ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド                 | 1,335,530,104円   | 1,331,643,846円   |
| 紀陽地域株式・外債バランスファンド（隔月分配型）                 | 628,679,232円     | 555,840,373円     |
| 愛媛県応援ファンド（外債バランス・毎月分配型）                  | 1,388,556,821円   | 1,250,918,328円   |
| ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）                  | 7,441,218,355円   | 7,161,904,844円   |

|                                                      |                  |                  |
|------------------------------------------------------|------------------|------------------|
| 地球環境株・外債バランス・ファンド                                    | 828,016,007円     | 758,063,901円     |
| ダイワ円債重視バランスファンド<br>（奇数月決算型）                          | 1,974,637円       | 1,974,637円       |
| ダイワ円債重視バランスファンド<br>（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<br>年決算型）                            | 43,584,888円      | 41,030,208円      |
| 計                                                    | 251,561,559,287円 | 196,327,796,902円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>特定期間末日における当該親投資信託<br>の受益権の総数 | 251,561,559,287口 | 196,327,796,902口 |

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

## I 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日                                                                                                                    |
|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。                                                                       |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。                                                                       |

|                            |                                                                                                                        |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成22年5月10日現在                                                                                                                         |
|--------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ                                                                                            |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成21年11月10日現在   |                             | 平成22年5月10日現在                |
|------|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
|      | 貸借対照表計上額<br>(円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) |
| 国債証券 | 280,796,882,084 | △2,676,505,435              | 4,353,649,268               |
| 合計   | 280,796,882,084 | △2,676,505,435              | 4,353,649,268               |

（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10月14日から平成21年11月10日まで、及び平成22年4月13日から平成22年5月10日まで）を指しております。

### （デリバティブ取引に関する注記）

（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）

#### I 取引の状況に関する事項

| 区 分                   | 自 平成21年5月12日<br>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。                                                 |
| 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。 |

|                          |                                                                                                                              |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。                                                        |
| 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。 |
| 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。                           |

## II 取引の時価等に関する事項

### 通貨関連

| 種 類         | 平成21年11月10日 現在 |           |                |             |
|-------------|----------------|-----------|----------------|-------------|
|             | 契約額等<br>(円)    | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)      | 評価損益<br>(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。

(平成21年11月11日から平成22年5月10日まで)  
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

|              |
|--------------|
| 平成22年5月10日現在 |
| 該当事項はありません。  |

(1口当たり情報)

|                                                          | 平成21年11月10日現在        | 平成22年5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<br>(1万口当たり純資産額) | 1.1497円<br>(11,497円) | 1.1387円<br>(11,387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<br>20150215      | アメリカ・ドル<br>102,000,000.000                     | アメリカ・ドル<br>144,528,900.000                     |    |
|      |             | 8.125% U.S. TREASURY BOND<br>20210515      | 9,700,000.000                                  | 13,657,212.000                                 |    |
|      |             | 8.125% U.S. TREASURY BOND<br>20210815      | 49,200,000.000                                 | 69,433,500.000                                 |    |
|      |             | 7.5% U.S. TREASURY BOND<br>20241115        | 186,500,000.000                                | 260,574,070.000                                |    |
|      |             | 7.625% U.S. TREASURY BOND<br>20250215      | 41,000,000.000                                 | 57,989,170.000                                 |    |
|      |             | 4.375% U.S. TREASURY BOND<br>20391115      | 50,000,000.000                                 | 50,777,000.000                                 |    |
|      | アメリカ・ドル 小計  |                                            | アメリカ・ドル<br>438,400,000.000<br>(40,490,624,000) | アメリカ・ドル<br>596,959,852.000<br>(55,135,211,930) |    |
|      | イギリス・ポンド    | 8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20170825 | イギリス・ポンド<br>31,800,000.000                     | イギリス・ポンド<br>43,031,760.000                     |    |
|      |             | 8% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20151207    | 2,400,000.000                                  | 3,043,680.000                                  |    |
|      |             | 8% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20210607    | 76,200,000.000                                 | 104,127,300.000                                |    |
|      |             | 4% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20600122    | 15,000,000.000                                 | 14,002,500.000                                 |    |
|      | イギリス・ポンド 小計 |                                            | イギリス・ポンド                                       | イギリス・ポンド                                       |    |

|                |                                               |                                                   |                                                   |  |
|----------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--|
|                |                                               | 125,400,000.000<br>(17,177,292,000)               | 164,205,240.000<br>(22,492,833,775)               |  |
| オーストラリア・ドル     | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515     | オーストラリア・ドル<br>350,000,000.000                     | オーストラリア・ドル<br>357,007,000.000                     |  |
| オーストラリア・ドル 小計  |                                               | オーストラリア・ドル<br>350,000,000.000<br>(28,997,500,000) | オーストラリア・ドル<br>357,007,000.000<br>(29,578,029,950) |  |
| カナダ・ドル         | 10.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140315      | カナダ・ドル<br>45,396,000.000                          | カナダ・ドル<br>58,107,787.920                          |  |
|                | 10.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210315       | 1,700,000.000                                     | 2,762,534.000                                     |  |
|                | 8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601          | 4,500,000.000                                     | 6,512,445.000                                     |  |
|                | 9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601          | 37,600,000.000                                    | 60,060,360.000                                    |  |
|                | 8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601          | 34,800,000.000                                    | 52,740,792.000                                    |  |
|                | 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601          | 13,000,000.000                                    | 15,412,930.000                                    |  |
|                | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601          | 4,100,000.000                                     | 4,313,487.000                                     |  |
|                | 4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601       | 136,600,000.000                                   | 145,768,592.000                                   |  |
| カナダ・ドル 小計      |                                               | カナダ・ドル<br>277,696,000.000<br>(24,770,483,200)     | カナダ・ドル<br>345,678,927.920<br>(30,834,560,370)     |  |
| スウェーデン・クローナ    | 6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505        | スウェーデン・クローナ<br>275,000,000.000                    | スウェーデン・クローナ<br>326,958,500.000                    |  |
|                | 5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008         | 200,000,000.000                                   | 219,960,000.000                                   |  |
| スウェーデン・クローナ 小計 |                                               | スウェーデン・クローナ<br>475,000,000.000<br>(5,780,750,000) | スウェーデン・クローナ<br>546,918,500.000<br>(6,655,998,145) |  |
| チェコ・コルナ        | 6.95% Czech Republic Government Bond 20160126 | チェコ・コルナ<br>819,000,000.000                        | チェコ・コルナ<br>989,106,300.000                        |  |
| チェコ・コルナ 小計     |                                               | チェコ・コルナ<br>819,000,000.000<br>(3,726,450,000)     | チェコ・コルナ<br>989,106,300.000<br>(4,500,433,665)     |  |
| デンマーク・クローネ     | 5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115            | デンマーク・クローネ<br>102,200,000.000                     | デンマーク・クローネ<br>114,467,066.000                     |  |
| デンマーク・クローネ 小計  |                                               | デンマーク・クローネ<br>102,200,000.000<br>(1,628,046,000)  | デンマーク・クローネ<br>114,467,066.000<br>(1,823,460,361)  |  |
| ノルウェー・クローネ     | 6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515       | ノルウェー・クローネ<br>66,500,000.000                      | ノルウェー・クローネ<br>74,918,235.000                      |  |
|                | 5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515         | 118,500,000.000                                   | 133,089,720.000                                   |  |
|                | 4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519      | 60,000,000.000                                    | 65,688,000.000                                    |  |
| ノルウェー・クローネ 小計  |                                               | ノルウェー・クローネ<br>245,000,000.000<br>(3,655,400,000)  | ノルウェー・クローネ<br>273,695,955.000<br>(4,083,543,649)  |  |

|              |                                        |                                                  |                                                  |
|--------------|----------------------------------------|--------------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| ポーランド・ズロチ    | 6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024  | ポーランド・ズロチ<br>361,500,000.000                     | ポーランド・ズロチ<br>374,130,810.000                     |
|              | 5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923  | 13,300,000.000                                   | 13,089,062.000                                   |
| ポーランド・ズロチ 小計 |                                        | ポーランド・ズロチ<br>374,800,000.000<br>(10,633,076,000) | ポーランド・ズロチ<br>387,219,872.000<br>(10,985,427,769) |
| ユーロ          | 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104  | ユーロ<br>4,600,000.000                             | ユーロ<br>6,189,622.000                             |
|              | 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704  | 120,000,000.000                                  | 146,036,400.000                                  |
|              | 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104  | 50,000,000.000                                   | 52,191,000.000                                   |
|              | 8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025   | 35,000,000.000                                   | 50,608,600.000                                   |
|              | 4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201 | 57,000,000.000                                   | 57,445,170.000                                   |
|              | 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801    | 41,000,000.000                                   | 41,081,180.000                                   |
|              | 8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328    | 49,700,000.000                                   | 62,406,302.000                                   |
| ユーロ 小計       |                                        | ユーロ<br>357,300,000.000<br>(42,372,207,000)       | ユーロ<br>415,958,274.000<br>(49,328,491,714)       |
| 国債証券 合計      |                                        | 179,231,828,200<br>[179,231,828,200]             | 215,417,991,328<br>[215,417,991,328]             |
| 合計           |                                        | 179,231,828,200<br>[179,231,828,200]             | 215,417,991,328<br>[215,417,991,328]             |

- (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<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|-------------|----------|--------------|----------------|
| アメリカ・ドル     | 国債証券 6銘柄 | 100%         | 25.7%          |
| イギリス・ポンド    | 国債証券 4銘柄 | 100%         | 10.4%          |
| オーストラリア・ドル  | 国債証券 1銘柄 | 100%         | 13.7%          |
| カナダ・ドル      | 国債証券 8銘柄 | 100%         | 14.3%          |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 2銘柄 | 100%         | 3.1%           |
| チェコ・コルナ     | 国債証券 1銘柄 | 100%         | 2.1%           |
| デンマーク・クローネ  | 国債証券 1銘柄 | 100%         | 0.8%           |
| ノルウェー・クローネ  | 国債証券 3銘柄 | 100%         | 1.9%           |
| ポーランド・ズロチ   | 国債証券 2銘柄 | 100%         | 5.1%           |
| ユーロ         | 国債証券 7銘柄 | 100%         | 22.9%          |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

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

### 貸借対照表

|                    | 平成21年11月10日現在  | 平成22年5月10日現在   |
|--------------------|----------------|----------------|
|                    | 金 額（円）         | 金 額（円）         |
| 資産の部               |                |                |
| 流動資産               |                |                |
| コール・ローン            | 1,285,402,481  | 616,035,840    |
| 株式                 | 25,664,322,800 | 27,233,985,400 |
| 投資証券               | 955,413,200    | 825,984,900    |
| 派生商品評価勘定           | 258,672        | —              |
| 未収入金               | 456,209,590    | 1,042,844,378  |
| 未収配当金              | 260,057,280    | 356,258,900    |
| 前払金                | 8,900,000      | —              |
| 差入委託証拠金            | 13,200,000     | —              |
| 流動資産合計             | 28,643,764,023 | 30,075,109,418 |
| 資産合計               | 28,643,764,023 | 30,075,109,418 |
| 負債の部               |                |                |
| 流動負債               |                |                |
| 派生商品評価勘定           | 6,495,009      | —              |
| 未払金                | 435,859,555    | 1,266,926,396  |
| 未払解約金              | 14,000,000     | 114,600,000    |
| 流動負債合計             | 456,354,564    | 1,381,526,396  |
| 負債合計               | 456,354,564    | 1,381,526,396  |
| 純資産の部              |                |                |
| 元本等                |                |                |
| 元本 ※1              | 28,664,772,142 | 26,234,518,416 |
| 剰余金                |                |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2 | △477,362,683   | 2,459,064,606  |
| 元本等合計              | 28,187,409,459 | 28,693,583,022 |
| 純資産合計              | 28,187,409,459 | 28,693,583,022 |
| 負債純資産合計            | 28,643,764,023 | 30,075,109,418 |

### 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21年5月12日<br>至 平成21年11月10日                                                                                                                   | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日  |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br><br>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。<br><br>(2)投資証券 | (1)株式<br><br>同左<br><br>(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。<br>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。 | 同左             |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br><br>同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準         | 受取配当金<br>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<br>同左    |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分                                      | 平成21年11月10日現在   | 平成22年5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 | 29,343,214,150円 | 28,664,772,142円 |
| 同期中における追加設定元本額                           | 1,005,539,121円  | 542,053,827円    |
| 同期中における一部解約元本額                           | 1,683,981,129円  | 2,972,307,553円  |
| 同期末における元本の内訳<br>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）               | 82,477,093円     | 84,978,160円     |
| ダイワ好配当日本株投信Q（F0Fs用）（適格機関投資家専用）           | 2,338,683,594円  | 2,484,441,893円  |
| ダイワ好配当日本株投信（季節点描）                        | 16,907,605,574円 | 15,214,535,103円 |
| ダイワ・バランス2資産（外債・好配当日本株）（毎月分配型）            | 42,171,054円     | 40,887,842円     |
| ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）             | 146,117,964円    | 135,288,643円    |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                      | 399,600,125円    | 363,619,251円    |
| インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                    | 490,636,432円    | 424,708,586円    |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                      | 5,862,001,403円  | 5,241,953,383円  |
| 安定重視ポートフォリオ（資産形成型）                       | 11,887,561円     | 9,838,012円      |
| インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）                     | 12,352,485円     | 10,457,648円     |
| 成長重視ポートフォリオ（資産形成型）                       | 124,628,315円    | 119,694,790円    |

|                                              |                                                 |                 |
|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------------|
| ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド                     | 843,453,212円                                    | 806,923,721円    |
| ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）                      | 1,186,902,537円                                  | 1,057,170,721円  |
| ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）                      | 1,095,294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                                         | 70,685円         |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）                   | 43,011,325円                                     | 47,660,518円     |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）                  | 86,688,406円                                     | 93,918,304円     |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）                   | 85,385,566円                                     | 97,275,862円     |
| 計                                            | 28,664,772,142円                                 | 26,234,518,416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 | 28,664,772,142口                                 | 26,234,518,416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477,362,683円であります。 | —————           |

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

## I 金融商品の状況に関する事項

| 区 分             | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日                                                                                                               |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。                                                                  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |

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

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成22年5月10日現在                                                                                                                         |
|--------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                          |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成21年11月10日現在   |                             | 平成22年5月10日現在                |
|------|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
|      | 貸借対照表計上額<br>(円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) |
| 株式   | 25,664,322,800  | △1,053,973,106              | △743,002,145                |
| 投資証券 | 955,413,200     | △67,722,500                 | 6,104,200                   |
| 合計   | 26,619,736,000  | △1,121,695,606              | △736,897,945                |

（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10月16日から平成21年11月10日まで、及び平成22年4月16日から平成22年5月10日まで）を指しております。

### （デリバティブ取引に関する注記）

（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）

#### I 取引の状況に関する事項

| 区 分      | 自 平成21年5月12日<br>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。 |

|                          |                                                                                                                              |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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おります。                                                          |
| 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。                                                                                     |
| 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。 |
| 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。                           |

## II 取引の時価等に関する事項

### 株式関連

| 種 類      | 平成21年11月10日 現在 |           |             |             |
|----------|----------------|-----------|-------------|-------------|
|          | 契約額等<br>(円)    | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(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。

（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成22年5月10日現在

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

|                                                          | 平成21年11月10日現在       | 平成22年5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<br>（1万口当たり純資産額） | 0.9833円<br>(9,833円) | 1.0937円<br>(10,937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           | 471,000   | 381     | 179,451,000 |     |
| 田辺工業           | 149,000   | 664     | 98,936,000  |     |
| 大東建託           | 23,000    | 5,130   | 117,990,000 |     |
| 新日本建設          | 493,800   | 243     | 119,993,400 |     |
| 大林道路           | 434,000   | 210     | 91,140,000  |     |
| ライト工業          | 639,000   | 261     | 166,779,000 |     |
| 高田工業所          | 178,500   | 379     | 67,651,500  |     |
| 高橋カーテンウォール     | 203,000   | 195     | 39,585,000  |     |
| シイエム・シイ        | 3,600     | 2,050   | 7,380,000   |     |
| フレンテ           | 14,000    | 2,086   | 29,204,000  |     |
| スタジオアリス        | 160,800   | 848     | 136,358,400 |     |
| 新日鉄ソリューションズ    | 42,000    | 2,042   | 85,764,000  |     |
| KG情報           | 51,000    | 361     | 18,411,000  |     |
| エディオン          | 298,500   | 934     | 278,799,000 |     |
| トーマンデバイス       | 23,200    | 1,751   | 40,623,200  |     |
| セリア            | 879       | 145,300 | 127,718,700 |     |
| サッポロドラッグストアー   | 154       | 142,000 | 21,868,000  |     |
| ナフコ            | 83,900    | 1,650   | 138,435,000 |     |
| フジフーズ          | 384,000   | 296     | 113,664,000 |     |
| アルコニックス        | 18,800    | 3,460   | 65,048,000  |     |
| ココカラファイン HD    | 97,600    | 1,776   | 173,337,600 |     |
| 三越伊勢丹HD        | 109,000   | 1,041   | 113,469,000 |     |
| 富士紡ホールディングス    | 1,000,000 | 140     | 140,000,000 |     |
| 倉敷紡績           | 78,000    | 160     | 12,480,000  |     |
| サイボー           | 99,000    | 500     | 49,500,000  |     |
| 旭 化 成          | 305,000   | 523     | 159,515,000 |     |
| 日本バイリーン        | 310,000   | 424     | 131,440,000 |     |
| セーレン           | 80,000    | 570     | 45,600,000  |     |
| MINORIソリューションズ | 164,900   | 509     | 83,934,100  |     |
| ニフティ           | 637       | 71,200  | 45,354,400  |     |
| ニッポン高度紙工業      | 98,100    | 1,060   | 103,986,000 |     |
| 日本製紙G本社        | 74,200    | 2,697   | 200,117,400 |     |
| トーモク           | 238,000   | 250     | 59,500,000  |     |
| 日本化学産業         | 385,000   | 690     | 265,650,000 |     |
| 日本ピグメント        | 419,000   | 250     | 104,750,000 |     |
| 東京応化工業         | 65,000    | 1,827   | 118,755,000 |     |
| 大阪有機化学         | 261,200   | 750     | 195,900,000 |     |
| 日本合成化学         | 220,000   | 662     | 145,640,000 |     |
| 積水化学           | 120,000   | 619     | 74,280,000  |     |
| サンエー化研         | 147,500   | 620     | 91,450,000  |     |

|                 |         |        |             |
|-----------------|---------|--------|-------------|
| プロトコーポレーション     | 32,500  | 3,290  | 106,925,000 |
| インテージ           | 30,000  | 1,730  | 51,900,000  |
| 武田薬品            | 57,000  | 3,910  | 222,870,000 |
| キョーリン           | 70,000  | 1,318  | 92,260,000  |
| 太陽インキ製造         | 49,000  | 2,680  | 131,320,000 |
| 東洋インキ           | 179,000 | 385    | 68,915,000  |
| T & K T O K A   | 192,400 | 1,361  | 261,856,400 |
| 秀英予備校           | 190,000 | 628    | 119,320,000 |
| インフォメーションディベロ   | 18,500  | 560    | 10,360,000  |
| 日本ハウズイング        | 231,200 | 1,259  | 291,080,800 |
| 電通国際情報S         | 273,500 | 700    | 191,450,000 |
| 富士フイルムH L D G S | 45,700  | 3,040  | 138,928,000 |
| 綜研化学            | 281,300 | 1,370  | 385,381,000 |
| 東燃ゼネラル石油        | 210,000 | 797    | 167,370,000 |
| J Xホールディングス     | 777,300 | 538    | 418,187,400 |
| フ コ ク           | 112,400 | 747    | 83,962,800  |
| 旭 硝 子           | 117,000 | 1,057  | 123,669,000 |
| 日本電気硝子          | 162,000 | 1,326  | 214,812,000 |
| 住友大阪セメント        | 600,000 | 170    | 102,000,000 |
| 日本ヒューム          | 590,000 | 284    | 167,560,000 |
| J F Eホールディングス   | 51,000  | 3,275  | 167,025,000 |
| モリ工業            | 120,000 | 365    | 43,800,000  |
| 山陽特殊鋼           | 450,000 | 468    | 210,600,000 |
| 大平洋金属           | 231,000 | 733    | 169,323,000 |
| 川金ホールディングス      | 286,000 | 260    | 74,360,000  |
| 住友鉱山            | 71,000  | 1,360  | 96,560,000  |
| オーナンバ           | 308,300 | 632    | 194,845,600 |
| 川岸工業            | 822,000 | 282    | 231,804,000 |
| 那須電機            | 406,000 | 340    | 138,040,000 |
| 高田機工            | 438,000 | 251    | 109,938,000 |
| 菊池プレス工業         | 66,600  | 1,548  | 103,096,800 |
| パイオラックス         | 100,900 | 1,926  | 194,333,400 |
| 日本発条            | 219,000 | 869    | 190,311,000 |
| 阪神内燃機           | 410,000 | 184    | 75,440,000  |
| ア マ ダ           | 150,000 | 719    | 107,850,000 |
| オカダアイヨン         | 383,000 | 139    | 53,237,000  |
| ワイエイシイ          | 118,300 | 914    | 108,126,200 |
| フロイント産業         | 219,100 | 529    | 115,903,900 |
| シンニッタン          | 345,900 | 353    | 122,102,700 |
| フジテック           | 50,000  | 515    | 25,750,000  |
| モリタホールディングス     | 330,000 | 456    | 150,480,000 |
| 東亜バルブエンジニア      | 49,500  | 2,430  | 120,285,000 |
| 日本トムソン          | 451,000 | 598    | 269,698,000 |
| 日本ピラー工業         | 82,000  | 708    | 58,056,000  |
| 中北製作所           | 116,000 | 675    | 78,300,000  |
| 愛知電機            | 532,000 | 275    | 146,300,000 |
| 日東工業            | 191,300 | 1,027  | 196,465,100 |
| MC J            | 8,400   | 12,300 | 103,320,000 |
| メルコホールディングス     | 20,000  | 2,722  | 54,440,000  |
| エスケーエレクトロニクス    | 148     | 86,300 | 12,772,400  |
| 富 士 通           | 500,000 | 650    | 325,000,000 |
| 富士通ゼネラル         | 70,000  | 511    | 35,770,000  |
| T D K           | 54,100  | 6,080  | 328,928,000 |
| フオスター電機         | 20,000  | 2,439  | 48,780,000  |
| スミダコーポレーション     | 29,500  | 1,286  | 37,937,000  |

|                |           |        |             |
|----------------|-----------|--------|-------------|
| エスベック          | 60,000    | 733    | 43,980,000  |
| 三社電機製作所        | 232,000   | 522    | 121,104,000 |
| ジオマテック         | 100,900   | 959    | 96,763,100  |
| 芝浦電子           | 25,800    | 1,231  | 31,759,800  |
| 大真空            | 335,000   | 511    | 171,185,000 |
| 京 セ ラ          | 16,000    | 8,870  | 141,920,000 |
| 日東電工           | 90,000    | 3,460  | 311,400,000 |
| ニッチツ           | 679,000   | 241    | 163,639,000 |
| 日産自動車          | 340,000   | 762    | 259,080,000 |
| トヨタ自動車         | 152,000   | 3,520  | 535,040,000 |
| GMB            | 20,300    | 1,111  | 22,553,300  |
| エッチ・ケー・エス      | 30,000    | 339    | 10,170,000  |
| 自動車部品          | 251,000   | 299    | 75,049,000  |
| 東京ラヂエーター       | 100,000   | 282    | 28,200,000  |
| タチエス           | 52,000    | 1,085  | 56,420,000  |
| アイシン精機         | 33,000    | 2,818  | 92,994,000  |
| 今仙電機製作所        | 158,700   | 1,450  | 230,115,000 |
| 本田技研           | 201,000   | 3,055  | 614,055,000 |
| ショーワ           | 338,600   | 613    | 207,561,800 |
| T B K          | 215,000   | 307    | 66,005,000  |
| ハイレックスコーポレーション | 129,500   | 1,123  | 145,428,500 |
| 愛三工業           | 77,800    | 743    | 57,805,400  |
| 村上開明堂          | 181,000   | 1,199  | 217,019,000 |
| フジオーゼックス       | 180,000   | 320    | 57,600,000  |
| 伯東             | 154,700   | 929    | 143,716,300 |
| コ ジ マ          | 295,000   | 760    | 224,200,000 |
| コーナン商事         | 137,000   | 1,158  | 158,646,000 |
| サイゼリヤ          | 122,100   | 1,823  | 222,588,300 |
| フジ・コーポレーション    | 53,200    | 370    | 19,684,000  |
| ハイデイ日高         | 105,000   | 1,091  | 114,555,000 |
| オーエムツネットワーク    | 54,600    | 545    | 29,757,000  |
| 川澄化学工業         | 185,000   | 706    | 130,610,000 |
| 理研計器           | 155,900   | 633    | 98,684,700  |
| キヤノン           | 151,000   | 4,135  | 624,385,000 |
| 遠藤製作所          | 121,900   | 487    | 59,365,300  |
| 萩原工業           | 67,000    | 984    | 65,928,000  |
| 桑山             | 23,700    | 480    | 11,376,000  |
| 大日本印刷          | 128,000   | 1,232  | 157,696,000 |
| ムトー精工          | 146,300   | 1,000  | 146,300,000 |
| リンテック          | 40,000    | 1,728  | 69,120,000  |
| 任 天 堂          | 3,800     | 28,500 | 108,300,000 |
| 伊 藤 忠          | 100,000   | 788    | 78,800,000  |
| 三陽商会           | 230,000   | 330    | 75,900,000  |
| 三井物産           | 417,000   | 1,374  | 572,958,000 |
| 住友商事           | 175,000   | 1,089  | 190,575,000 |
| 三菱商事           | 79,000    | 2,129  | 168,191,000 |
| 佐藤商事           | 79,300    | 542    | 42,980,600  |
| ナガホリ           | 172,000   | 205    | 35,260,000  |
| 新光商事           | 114,000   | 948    | 108,072,000 |
| P a l t a c    | 44,000    | 1,930  | 84,920,000  |
| 三菱UFJフィナンシャルG  | 1,264,800 | 468    | 591,926,400 |
| 三井住友フィナンシャルG   | 162,600   | 2,921  | 474,954,600 |
| 北越銀行           | 789,000   | 149    | 117,561,000 |
| 西日本シティ銀行       | 747,000   | 267    | 199,449,000 |
| 沖縄銀行           | 26,000    | 3,800  | 98,800,000  |

|                   |            |         |                |
|-------------------|------------|---------|----------------|
| 住友信託              | 280,000    | 539     | 150,920,000    |
| 野村ホールディングス        | 253,900    | 618     | 156,910,200    |
| 東海東京HD            | 394,000    | 346     | 136,324,000    |
| 極東証券              | 145,000    | 757     | 109,765,000    |
| MS & A D          | 95,300     | 2,501   | 238,345,300    |
| 東京海上HD            | 44,000     | 2,696   | 118,624,000    |
| N E Cキャピタルソリューション | 190,700    | 1,199   | 228,649,300    |
| 東京建物              | 610,000    | 387     | 236,070,000    |
| 京阪神不動産            | 151,700    | 435     | 65,989,500     |
| フジ住宅              | 307,100    | 335     | 102,878,500    |
| 日本エスリード           | 191,700    | 909     | 174,255,300    |
| 日神不動産             | 423,600    | 662     | 280,423,200    |
| リベレステ             | 1,401      | 138,700 | 194,318,700    |
| サンヨーハウジ 名古屋       | 1,600      | 82,900  | 132,640,000    |
| ファースト住建           | 419,600    | 720     | 302,112,000    |
| トーセイ              | 960        | 39,600  | 38,016,000     |
| サカイ引越センター         | 70,000     | 1,892   | 132,440,000    |
| アルプス物流            | 310,800    | 985     | 306,138,000    |
| ヒューテックノオリン        | 262,700    | 731     | 192,033,700    |
| 商船三井              | 895,000    | 661     | 591,595,000    |
| 乾 汽 船             | 166,700    | 675     | 112,522,500    |
| 川崎近海汽船            | 528,000    | 297     | 156,816,000    |
| 住友倉庫              | 334,000    | 440     | 146,960,000    |
| 東陽倉庫              | 542,000    | 202     | 109,484,000    |
| 日本電信電話            | 151,000    | 3,730   | 563,230,000    |
| 日本医療事務センター        | 569,300    | 387     | 220,319,100    |
| K S K             | 43,500     | 649     | 28,231,500     |
| トーカイ              | 26,300     | 1,220   | 32,086,000     |
| ワオ・コーポレーション       | 170,900    | 235     | 40,161,500     |
| ステップ              | 177,000    | 480     | 84,960,000     |
| 日鐵商事              | 920,000    | 257     | 236,440,000    |
| 日立機材              | 339,000    | 412     | 139,668,000    |
| 因幡電機産業            | 34,800     | 2,263   | 78,752,400     |
| 王将フードサービス         | 55,600     | 2,369   | 131,716,400    |
| バイテック             | 89,000     | 767     | 68,263,000     |
| や ま や             | 132,400    | 795     | 105,258,000    |
| 合計                | 39,534,179 |         | 27,233,985,400 |

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類     | 銘 柄               | 券面総額  | 評価額<br>(円)  | 備考 |
|---------|-------------------|-------|-------------|----|
| 投資証券    | プレミアム投資法人         | 580   | 220,400,000 |    |
|         | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 460   | 341,780,000 |    |
|         | ジョイントリート投資法人      | 558   | 146,363,400 |    |
|         | ジャパン・オフィス投資法人     | 1,441 | 117,441,500 |    |
| 投資証券 合計 |                   | 3,039 | 825,984,900 |    |
| 合計      |                   | 3,039 | 825,984,900 |    |

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11月10日現在  | 平成22年5月10日現在   |
|--------------------|----------------|----------------|
|                    | 金 額（円）         | 金 額（円）         |
| 資産の部               |                |                |
| 流動資産               |                |                |
| 預金                 | 166,005,156    | 222,726,986    |
| コール・ローン            | 112,204,739    | 167,932,074    |
| 株式                 | 9,087,882,523  | 8,698,307,536  |
| 未収入金               | 55,785,048     | 40,714,765     |
| 未収配当金              | 16,201,545     | 38,186,593     |
| 流動資産合計             | 9,438,079,011  | 9,167,867,954  |
| 資産合計               | 9,438,079,011  | 9,167,867,954  |
| 負債の部               |                |                |
| 流動負債               |                |                |
| 未払金                | 19,732,604     | —              |
| 未払解約金              | 11,000         | 60,000,000     |
| 流動負債合計             | 19,743,604     | 60,000,000     |
| 負債合計               | 19,743,604     | 60,000,000     |
| 純資産の部              |                |                |
| 元本等                |                |                |
| 元本 ※1              | 12,850,107,987 | 12,701,204,681 |
| 剰余金                |                |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2 | △3,431,772,580 | △3,593,336,727 |
| 元本等合計              | 9,418,335,407  | 9,107,867,954  |
| 純資産合計              | 9,418,335,407  | 9,107,867,954  |
| 負債純資産合計            | 9,438,079,011  | 9,167,867,954  |

#### 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21年5月12日<br>至 平成21年11月10日                                                                                                        | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日 |
|------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 株式<br><br>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<br><br>同左                  |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引                                                                                                                               | 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。<br>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<br>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<br>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<br><br>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<br><br>同左 |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                                      | 平成21年11月10日現在   | 平成22年5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 | 16,398,328,959円 | 12,850,107,987円 |
| 同期中における追加設定元本額                           | 914,259,831円    | 1,832,446,859円  |
| 同期中における一部解約元本額                           | 4,462,480,803円  | 1,981,350,165円  |
| 同期末における元本の内訳<br>ファンド名                    |                 |                 |
| ダイワ海外好配当株ファンドM<br>(FOFs用)（適格機関投資家専用）     | 12,496,013,057円 | 12,288,624,373円 |
| ダイワ・海外株式&REITファンド（毎月分配型）                 | 273,825,957円    | 235,557,408円    |

|                                                      |                                                               |                                                               |
|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|
| ダイワ円債重視バランスファンド<br>（奇数月決算型）                          | 1,597,134円                                                    | 1,558,697円                                                    |
| ダイワ円債重視バランスファンド<br>（資産形成型）                           | 112,530円                                                      | 95,935円                                                       |
| ダイワ外国好配当株ファンド（ダイワSMA専用）                              | 78,559,309円                                                   | 175,368,268円                                                  |
| 計                                                    | 12,850,107,987円                                               | 12,701,204,681円                                               |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>特定期間末日における当該親投資信託<br>の受益権の総数 | 12,850,107,987口                                               | 12,701,204,681口                                               |
| 3. ※2 元本の欠損                                          | 貸借対照表上の純資産額が元<br>本総額を下回っており、その差<br>額は3,431,772,580円でありま<br>す。 | 貸借対照表上の純資産額が元<br>本総額を下回っており、その差<br>額は3,593,336,727円でありま<br>す。 |

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

## I 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日                                                                                                                    |
|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。                                                                       |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。                                                                       |

|                            |                                                                                                                        |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成22年5月10日現在                                                                                                                         |
|--------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ                                                                                            |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種 類 | 平成21年11月10日現在   |                             | 平成22年5月10日現在                |
|-----|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
|     | 貸借対照表計上額<br>(円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) |
| 株式  | 9,087,882,523   | 452,452,665                 | △473,737,885                |
| 合計  | 9,087,882,523   | 452,452,665                 | △473,737,885                |

（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9月10日から平成21年11月10日まで、及び平成22年3月10日から平成22年5月10日まで）を指しております。

### （デリバティブ取引に関する注記）

（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）

#### I 取引の状況に関する事項

| 区 分                   | 自 平成21年5月12日<br>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。                         |
| 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。 |

|                          |                                                                                                                              |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。                                                        |
| 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。 |
| 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。                           |

## II 取引の時価等に関する事項

### 通貨関連

該当事項はありません。

（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）  
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

|              |
|--------------|
| 平成22年5月10日現在 |
| 該当事項はありません。  |

### （1口当たり情報）

|                                                          | 平成21年11月10日現在       | 平成22年5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<br>（1万口当たり純資産額） | 0.7329円<br>(7,329円) | 0.7171円<br>(7,171円) |

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### （1）株式

| 通貨      | 銘柄                        | 株式数    | 評価額     |             | 備考 |
|---------|---------------------------|--------|---------|-------------|----|
|         |                           |        | 単価      | 金額          |    |
| アメリカ・ドル |                           | 株      | アメリカ・ドル | アメリカ・ドル     |    |
|         | ABBOTT LABS               | 3,200  | 48.720  | 155,904.000 |    |
|         | AGL RESOURCES INC         | 6,200  | 37.530  | 232,686.000 |    |
|         | D.R.HORTON INC            | 23,200 | 13.060  | 302,992.000 |    |
|         | BECTON DICKINSON & CO     | 8,000  | 73.660  | 589,280.000 |    |
|         | BRISTOL MYERS SQUIBB      | 32,100 | 24.340  | 781,314.000 |    |
|         | CATERPILLAR INC DEL       | 7,800  | 62.100  | 484,380.000 |    |
|         | DOMINION RESOURCES INC/VA | 3,000  | 40.220  | 120,660.000 |    |
|         | COLGATE PALMOLIVE CO      | 8,000  | 80.210  | 641,680.000 |    |
|         | CUMMINS INC               | 6,700  | 65.310  | 437,577.000 |    |

|            |                             |              |          |                                              |  |
|------------|-----------------------------|--------------|----------|----------------------------------------------|--|
|            | COCA COLA CO                | 10,500       | 52.670   | 553,035.000                                  |  |
|            | EXXON MOBIL CORP            | 11,000       | 63.700   | 700,700.000                                  |  |
|            | US BANCORP                  | 18,300       | 25.150   | 460,245.000                                  |  |
|            | FAMILY DOLLAR STORES        | 8,100        | 38.960   | 315,576.000                                  |  |
|            | FASTENAL CO                 | 4,500        | 50.220   | 225,990.000                                  |  |
|            | GENERAL ELECTRIC CO         | 31,900       | 16.880   | 538,472.000                                  |  |
|            | GENERAL DYNAMICS CORP       | 4,600        | 70.500   | 324,300.000                                  |  |
|            | GOLDMAN SACHS GROUP INC     | 1,400        | 142.990  | 200,186.000                                  |  |
|            | FIFTH THIRD BANCORP         | 11,500       | 13.310   | 153,065.000                                  |  |
|            | HEWLETT-PACKARD CO          | 6,800        | 46.730   | 317,764.000                                  |  |
|            | INT'L BUSINESS MACHINES     | 11,000       | 122.100  | 1,343,100.000                                |  |
|            | JOHNSON & JOHNSON           | 10,000       | 63.310   | 633,100.000                                  |  |
|            | LOWE'S COS INC              | 9,300        | 25.310   | 235,383.000                                  |  |
|            | ELI LILLY & CO              | 17,000       | 34.620   | 588,540.000                                  |  |
|            | LUBRIZOL CORP               | 7,000        | 84.640   | 592,480.000                                  |  |
|            | LINCOLN NATIONAL CORP       | 8,600        | 26.640   | 229,104.000                                  |  |
|            | MCDONALD'S CORP             | 7,300        | 68.010   | 496,473.000                                  |  |
|            | 3M CO                       | 7,400        | 82.630   | 611,462.000                                  |  |
|            | METLIFE INC                 | 17,800       | 40.710   | 724,638.000                                  |  |
|            | M & T BANK CORP             | 12,000       | 84.070   | 1,008,840.000                                |  |
|            | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 20,000       | 46.420   | 928,400.000                                  |  |
|            | OCCIDENTAL PETROLEUM        | 11,000       | 80.610   | 886,710.000                                  |  |
|            | ALTRIA GROUP INC            | 14,000       | 20.760   | 290,640.000                                  |  |
|            | PROCTER & GAMBLE CO         | 8,900        | 60.310   | 536,759.000                                  |  |
|            | CONOCOPHILLIPS              | 12,400       | 54.680   | 678,032.000                                  |  |
|            | CHEVRON CORP                | 20,000       | 77.100   | 1,542,000.000                                |  |
|            | AT&T INC                    | 18,000       | 25.100   | 451,800.000                                  |  |
|            | UNITED PARCEL SERVICE-B     | 6,000        | 63.930   | 383,580.000                                  |  |
|            | UNITEDHEALTH GROUP INC      | 6,800        | 29.020   | 197,336.000                                  |  |
|            | WELLS FARGO & CO            | 16,900       | 30.820   | 520,858.000                                  |  |
|            | TJX COMPANIES INC           | 9,700        | 43.670   | 423,599.000                                  |  |
|            | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE   | 6,400        | 30.700   | 196,480.000                                  |  |
|            | VISA INC-CLASS A SHS        | 6,500        | 82.290   | 534,885.000                                  |  |
|            | ONEOK INC                   | 3,400        | 45.990   | 156,366.000                                  |  |
|            | CENTURYTEL INC              | 17,027       | 33.030   | 562,401.810                                  |  |
|            | NOBLE ENERGY INC            | 6,500        | 70.800   | 460,200.000                                  |  |
|            | BANK OF AMERICA CORP        | 17,100       | 16.180   | 276,678.000                                  |  |
|            | NORDSTROM INC               | 11,500       | 40.060   | 460,690.000                                  |  |
|            | AMERICAN EXPRESS CO         | 15,000       | 40.600   | 609,000.000                                  |  |
|            | EMERSON ELECTRIC CO         | 12,000       | 48.470   | 581,640.000                                  |  |
|            | SUNTRUST BANKS INC          | 7,800        | 27.460   | 214,188.000                                  |  |
|            | BAXTER INTL INC             | 12,000       | 45.120   | 541,440.000                                  |  |
|            | FEDEX CORP                  | 2,600        | 83.140   | 216,164.000                                  |  |
|            | INTEL CORP                  | 50,100       | 21.310   | 1,067,631.000                                |  |
|            | JOHNSON CONTROLS INC        | 12,500       | 29.680   | 371,000.000                                  |  |
|            | CONAGRA INC                 | 16,300       | 23.580   | 384,354.000                                  |  |
|            | MICROSOFT CORP              | 47,000       | 28.210   | 1,325,870.000                                |  |
|            | LINEAR TECHNOLOGY CORP      | 28,000       | 28.230   | 790,440.000                                  |  |
|            | PRAXAIR INC                 | 10,000       | 78.880   | 788,800.000                                  |  |
|            | VF CORP                     | 5,300        | 78.890   | 418,117.000                                  |  |
| アメリカ・ドル 小計 |                             | 株<br>744,927 |          | アメリカ・ドル<br>30,794,984.810<br>(2,844,224,797) |  |
| イギリス・ポンド   |                             | 株            | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド                                     |  |
|            | BP PLC                      | 160,000      | 5.539    | 886,240.000                                  |  |
|            | MARKS & SPENCER GROUP PLC   | 65,000       | 3.297    | 214,305.000                                  |  |

|               |                           |                |            |                                                 |  |
|---------------|---------------------------|----------------|------------|-------------------------------------------------|--|
|               | PRUDENTIAL PLC            | 35,600         | 5.430      | 193,308.000                                     |  |
|               | GLAXOSMITHKLINE PLC       | 45,000         | 11.485     | 516,825.000                                     |  |
|               | BG GROUP PLC              | 30,000         | 10.170     | 305,100.000                                     |  |
|               | DIAGEO PLC                | 61,600         | 10.540     | 649,264.000                                     |  |
|               | STANDARD CHARTERED PLC    | 40,000         | 15.720     | 628,800.000                                     |  |
|               | TESCO PLC                 | 85,000         | 4.090      | 347,650.000                                     |  |
|               | VODAFONE GROUP PLC        | 205,900        | 1.329      | 273,641.100                                     |  |
|               | WPP PLC                   | 43,600         | 6.355      | 277,078.000                                     |  |
|               | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 544,600        | 0.756      | 411,717.600                                     |  |
|               | CENTRICA PLC              | 107,000        | 2.758      | 295,106.000                                     |  |
|               | BRIT AMERICAN TOBACCO PLC | 49,500         | 20.050     | 992,475.000                                     |  |
|               | BHP BILLITON PLC          | 35,000         | 18.645     | 652,575.000                                     |  |
|               | HSBC HOLDINGS PLC         | 127,000        | 6.296      | 799,592.000                                     |  |
|               | CAPITA GROUP PLC          | 14,800         | 7.705      | 114,034.000                                     |  |
|               | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S | 18,700         | 18.330     | 342,771.000                                     |  |
|               | ANTOFAGASTA PLC           | 34,000         | 8.705      | 295,970.000                                     |  |
| イギリス・ポンド 小計   |                           | 株<br>1,702,300 |            | イギリス・ポンド<br>8,196,451.700<br>(1,122,749,953)    |  |
| 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          | 62,000         | 37.500     | 2,325,000.000                                   |  |
|               | WOODSIDE PETROLEUM        | 5,741          | 43.080     | 247,322.280                                     |  |
|               | WESTPAC BANKING           | 83,000         | 24.170     | 2,006,110.000                                   |  |
|               | AUSTRALIA & NZLAND BK     | 89,700         | 21.900     | 1,964,430.000                                   |  |
|               | RIO TINTO LTD             | 16,700         | 64.980     | 1,085,166.000                                   |  |
|               | ADELAIDE BRIGHTON LIMITED | 40,000         | 2.730      | 109,200.000                                     |  |
|               | COMMONWEALTH BANK OF AUST | 32,500         | 53.000     | 1,722,500.000                                   |  |
|               | QBE INSURANCE             | 27,000         | 20.510     | 553,770.000                                     |  |
|               | WOOLWORTHS                | 20,000         | 26.940     | 538,800.000                                     |  |
|               | COCA-COLA AMATIL LIMITED  | 59,400         | 11.010     | 653,994.000                                     |  |
|               | TABCORP HOLDINGS LIMITED  | 5,000          | 6.470      | 32,350.000                                      |  |
|               | TELSTRA CORPORATION       | 74,700         | 3.000      | 224,100.000                                     |  |
|               | MACQUARIE GROUP LIMITED   | 8,100          | 45.530     | 368,793.000                                     |  |
|               | CSL LIMITED               | 9,600          | 33.190     | 318,624.000                                     |  |
|               | ONESTEEL LIMITED          | 116,000        | 3.310      | 383,960.000                                     |  |
|               | WESFARMERS LIMITED        | 29,300         | 27.950     | 818,935.000                                     |  |
|               | COCHLEAR LIMITED          | 6,000          | 73.680     | 442,080.000                                     |  |
|               | ASX LTD                   | 14,000         | 31.600     | 442,400.000                                     |  |
|               | JB HI-FI LTD              | 20,000         | 18.980     | 379,600.000                                     |  |
| オーストラリア・ドル 小計 |                           | 株<br>718,741   |            | オーストラリア・ドル<br>14,617,134.280<br>(1,211,029,575) |  |
| カナダ・ドル        |                           | 株              | カナダ・ドル     | カナダ・ドル                                          |  |
|               | BANK OF NOVA SCOTIA       | 15,000         | 50.340     | 755,100.000                                     |  |
|               | ROYAL BANK OF CANADA      | 9,000          | 58.920     | 530,280.000                                     |  |
|               | ENBRIDGE INC              | 9,000          | 48.590     | 437,310.000                                     |  |
| カナダ・ドル 小計     |                           | 株<br>33,000    |            | カナダ・ドル<br>1,722,690.000<br>(153,663,948)        |  |
| 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      | 59,000         | 18.720     | 1,104,480.000                                   |  |
|               | FRASER & NEAVE LTD        | 99,000         | 4.650      | 460,350.000                                     |  |
|               | KEPPEL CORP               | 59,000         | 8.960      | 528,640.000                                     |  |
|               | O.C.B.C.                  | 122,000        | 8.550      | 1,043,100.000                                   |  |
|               | SINGAPORE TELECOM         | 174,000        | 2.980      | 518,520.000                                     |  |

|                 |                           |              |             |                                                |  |
|-----------------|---------------------------|--------------|-------------|------------------------------------------------|--|
|                 | SEBICORP INDUSTRIES LTD   | 128,000      | 3.910       | 500,480.000                                    |  |
| シンガポール・ドル 小計    |                           | 株<br>641,000 |             | シンガポール・ドル<br>4,155,570.000<br>(277,051,852)    |  |
| スイス・フラン         |                           | 株            | スイス・フラン     | スイス・フラン                                        |  |
|                 | NESTLE SA-REGISTERED      | 13,900       | 50.200      | 697,780.000                                    |  |
|                 | ZURICH FINANCIAL SERVICES | 2,500        | 225.800     | 564,500.000                                    |  |
|                 | NOVARTIS AG-REG SHS       | 18,000       | 52.100      | 937,800.000                                    |  |
|                 | SWISSCOM AG-REG           | 1,100        | 361.600     | 397,760.000                                    |  |
|                 | SYNGENTA AG               | 900          | 260.100     | 234,090.000                                    |  |
| スイス・フラン 小計      |                           | 株<br>36,400  |             | スイス・フラン<br>2,831,930.000<br>(236,947,583)      |  |
| スウェーデン・<br>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           | 41,700       | 134.000     | 5,587,800.000                                  |  |
|                 | SVENSKA HANDELSBANKEN-A   | 23,600       | 183.000     | 4,318,800.000                                  |  |
|                 | HENNES & MAURITZ AB-B     | 6,900        | 433.000     | 2,987,700.000                                  |  |
|                 | ATLAS COPCO AB-A SHS      | 50,800       | 104.800     | 5,323,840.000                                  |  |
| スウェーデン・クローナ 小計  |                           | 株<br>123,000 |             | スウェーデン・クローナ<br>18,218,140.000<br>(221,714,765) |  |
| デンマーク・ク<br>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        | 7,000        | 450.000     | 3,150,000.000                                  |  |
| デンマーク・クローネ 小計   |                           | 株<br>7,000   |             | デンマーク・クローネ<br>3,150,000.000<br>(50,179,500)    |  |
| ユーロ             |                           | 株            | ユーロ         | ユーロ                                            |  |
|                 | BAYER AG                  | 11,000       | 45.245      | 497,695.000                                    |  |
|                 | SIEMENS AG                | 4,000        | 68.250      | 273,000.000                                    |  |
|                 | E.ON AG                   | 13,900       | 24.660      | 342,774.000                                    |  |
|                 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE  | 11,000       | 35.480      | 390,280.000                                    |  |
|                 | BASF SE                   | 15,300       | 41.000      | 627,300.000                                    |  |
|                 | R.W.E. AG                 | 9,100        | 58.170      | 529,347.000                                    |  |
|                 | HOCHTIEF AG               | 4,500        | 54.850      | 246,825.000                                    |  |
|                 | MUNCHENER RUECK AG-REG    | 2,000        | 101.000     | 202,000.000                                    |  |
|                 | MERCK KGAA                | 3,500        | 59.530      | 208,355.000                                    |  |
|                 | WACKER CHEMIE AG          | 1,800        | 100.600     | 181,080.000                                    |  |
|                 | HEINEKEN NV               | 12,600       | 33.625      | 423,675.000                                    |  |
|                 | KONINKLIJKE KPN NV        | 26,100       | 10.490      | 273,789.000                                    |  |
|                 | TOTAL SA                  | 22,000       | 37.370      | 822,140.000                                    |  |
|                 | AIR LIQUIDE               | 2,100        | 80.430      | 168,903.000                                    |  |
|                 | SCHNEIDER ELECTRIC SA     | 7,600        | 75.620      | 574,712.000                                    |  |
|                 | LAFARGE SA                | 3,000        | 47.190      | 141,570.000                                    |  |
|                 | BNP PARIBAS               | 15,500       | 43.930      | 680,915.000                                    |  |
|                 | LVMH                      | 6,600        | 79.510      | 524,766.000                                    |  |
|                 | VALLOUREC                 | 1,700        | 134.750     | 229,075.000                                    |  |
|                 | CREDIT AGRICOLE SA        | 34,000       | 9.060       | 308,040.000                                    |  |
|                 | GDF SUEZ                  | 10,000       | 24.085      | 240,850.000                                    |  |
|                 | ENI SPA                   | 7,600        | 15.310      | 116,356.000                                    |  |
|                 | TELEFONICA S.A.           | 39,900       | 15.360      | 612,864.000                                    |  |
|                 | BANCO SANTANDER SA        | 102,901      | 7.710       | 793,366.710                                    |  |
|                 | NOKIA OYJ                 | 12,000       | 8.350       | 100,200.000                                    |  |
| ユーロ 小計          |                           | 株<br>379,701 |             | ユーロ<br>9,509,877.710<br>(1,127,776,398)        |  |

| 韓国・ウォン    |                           | 株               | 韓国・ウォン      | 韓国・ウォン                                       |  |
|-----------|---------------------------|-----------------|-------------|----------------------------------------------|--|
|           | SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 1,800           | 198,000.000 | 356,400,000.000                              |  |
|           | DAEGU BANK                | 13,500          | 13,950.000  | 188,325,000.000                              |  |
|           | POSCO                     | 1,200           | 472,500.000 | 567,000,000.000                              |  |
|           | GS ENGINEERING&CONSTRUCT  | 2,300           | 76,000.000  | 174,800,000.000                              |  |
|           | HYUNDAI MOBIS             | 1,800           | 177,500.000 | 319,500,000.000                              |  |
|           | KANGWON LAND INC          | 17,500          | 16,700.000  | 292,250,000.000                              |  |
|           | LG CHEMICAL LTD           | 2,300           | 278,500.000 | 640,550,000.000                              |  |
|           | SAMSUNG ELECTRONICS       | 1,100           | 794,000.000 | 873,400,000.000                              |  |
|           | SK TELECOM CO LTD         | 1,500           | 168,500.000 | 252,750,000.000                              |  |
|           | HANA FINANCIAL GROUP      | 10,000          | 31,800.000  | 318,000,000.000                              |  |
| 韓国・ウォン 小計 |                           | 株<br>53,000     |             | 韓国・ウォン<br>3,982,975,000.000<br>(324,214,165) |  |
| 香港・ドル     |                           | 株               | 香港・ドル       | 香港・ドル                                        |  |
|           | SUN HUNG KAI PROPERTIES   | 10,000          | 103.300     | 1,033,000.000                                |  |
|           | CHEUNG KONG               | 39,000          | 91.900      | 3,584,100.000                                |  |
|           | SWIRE PACIFIC LTD 'A'     | 20,000          | 85.200      | 1,704,000.000                                |  |
|           | CHINA MERCHANTS HLDGS     | 56,000          | 24.400      | 1,366,400.000                                |  |
|           | CLP HOLDINGS LIMITED      | 62,000          | 54.850      | 3,400,700.000                                |  |
|           | JIANGSU EXPRESS CO LTD -H | 348,000         | 7.160       | 2,491,680.000                                |  |
|           | HANG SENG BANK            | 54,000          | 106.400     | 5,745,600.000                                |  |
|           | JIANGXI COPPER COMPANY    | 100,000         | 14.680      | 1,468,000.000                                |  |
|           | SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG  | 70,000          | 31.200      | 2,184,000.000                                |  |
|           | DONGFENG MOTOR GRP CO-H   | 24,000          | 10.000      | 240,000.000                                  |  |
|           | ASM PACIFIC TECHNOLOGY    | 77,700          | 67.350      | 5,233,095.000                                |  |
|           | CNOOC LTD                 | 437,000         | 12.720      | 5,558,640.000                                |  |
|           | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 347,000         | 6.280       | 2,179,160.000                                |  |
|           | CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR | 90,000          | 28.350      | 2,551,500.000                                |  |
|           | YANZHOU COAL MINING CO-H  | 246,000         | 19.400      | 4,772,400.000                                |  |
|           | IND & COMM BK OF CHINA-H  | 660,000         | 5.560       | 3,669,600.000                                |  |
|           | DENWAY MOTORS LIMITED.    | 62,000          | 4.492       | 278,504.000                                  |  |
|           | CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 120,000         | 33.900      | 4,068,000.000                                |  |
|           | GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP | 120,000         | 14.400      | 1,728,000.000                                |  |
|           | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H | 140,000         | 5.330       | 746,200.000                                  |  |
| 香港・ドル 小計  |                           | 株<br>3,082,700  |             | 香港・ドル<br>54,002,579.000<br>(641,550,639)     |  |
| 台湾・ドル     |                           | 株               | 台湾・ドル       | 台湾・ドル                                        |  |
|           | TAIWAN FERTILIZER CO LTD  | 54,000          | 92.400      | 4,989,600.000                                |  |
|           | CHINA STEEL CORP          | 473,975         | 31.550      | 14,953,911.250                               |  |
|           | DELTA ELECTRONICS INC     | 177,700         | 98.500      | 17,503,450.000                               |  |
|           | ACER INC                  | 213,770         | 84.400      | 18,042,188.000                               |  |
|           | MEDIATEK INC              | 39,062          | 529.000     | 20,663,798.000                               |  |
|           | NOVATEK MICROELECTRONICS  | 27,620          | 101.000     | 2,789,620.000                                |  |
|           | POU CHEN                  | 395,432         | 25.400      | 10,043,972.800                               |  |
|           | SILICONWARE PRECISION IND | 323,000         | 37.200      | 12,015,600.000                               |  |
|           | TAIWAN SEMICONDUCTOR      | 528,333         | 59.400      | 31,382,980.200                               |  |
|           | HON HAI PRECISION INDUS   | 168,141         | 139.500     | 23,455,669.500                               |  |
|           | PRESIDENT CHAIN STORE COR | 74,960          | 83.700      | 6,274,152.000                                |  |
|           | FAR EASTERN NEW CENTURY   | 162,362         | 32.700      | 5,309,237.400                                |  |
| 台湾・ドル 小計  |                           | 株<br>2,638,355  |             | 台湾・ドル<br>167,424,179.150<br>(487,204,361)    |  |
| 合計        |                           | 株<br>10,160,124 |             | 8,698,307,536<br>[8,698,307,536]             |  |

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

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

| 通貨          | 銘柄数     | 組入株式<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|-------------|---------|--------------|----------------|
| アメリカ・ドル     | 株式 59銘柄 | 100%         | 32.7%          |
| イギリス・ポンド    | 株式 18銘柄 | 100%         | 12.9%          |
| オーストラリア・ドル  | 株式 19銘柄 | 100%         | 13.9%          |
| カナダ・ドル      | 株式 3銘柄  | 100%         | 1.8%           |
| シンガポール・ドル   | 株式 6銘柄  | 100%         | 3.2%           |
| スイス・フラン     | 株式 5銘柄  | 100%         | 2.7%           |
| スウェーデン・クローナ | 株式 4銘柄  | 100%         | 2.5%           |
| デンマーク・クローネ  | 株式 1銘柄  | 100%         | 0.6%           |
| ユーロ         | 株式 25銘柄 | 100%         | 13.0%          |
| 韓国・ウォン      | 株式 10銘柄 | 100%         | 3.7%           |
| 香港・ドル       | 株式 20銘柄 | 100%         | 7.4%           |
| 台湾・ドル       | 株式 12銘柄 | 100%         | 5.6%           |

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」－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11月10日現在  | 平成22年5月10日現在   |
|--------------------|----------------|----------------|
|                    | 金 額（円）         | 金 額（円）         |
| 資産の部               |                |                |
| 流動資産               |                |                |
| コール・ローン            | 329,376,801    | 189,275,295    |
| 投資証券               | 15,421,017,800 | 15,976,467,100 |
| 未収入金               | —              | 81,062,600     |
| 未収配当金              | 246,959,041    | 219,863,824    |
| 流動資産合計             | 15,997,353,642 | 16,466,668,819 |
| 資産合計               | 15,997,353,642 | 16,466,668,819 |
| 負債の部               |                |                |
| 流動負債               |                |                |
| 未払解約金              | 12,000,000     | 78,000,000     |
| 流動負債合計             | 12,000,000     | 78,000,000     |
| 負債合計               | 12,000,000     | 78,000,000     |
| 純資産の部              |                |                |
| 元本等                |                |                |
| 元本 ※1              | 19,683,314,514 | 18,262,264,942 |
| 剰余金                |                |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2 | △3,697,960,872 | △1,873,596,123 |
| 元本等合計              | 15,985,353,642 | 16,388,668,819 |
| 純資産合計              | 15,985,353,642 | 16,388,668,819 |
| 負債純資産合計            | 15,997,353,642 | 16,466,668,819 |

## 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21年5月12日<br>至 平成21年11月10日                                                                                                   | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日 |
|--------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br><br>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。 | 投資証券<br><br>同左                |
| 2. 収益及び費用の計上基準     | 受取配当金<br>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<br>同左                   |

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分                                      | 平成21年11月10日現在   | 平成22年5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 | 19,558,667,731円 | 19,683,314,514円 |
| 同期中における追加設定元本額                           | 2,347,862,234円  | 909,482,413円    |

|                                                      |                 |                 |
|------------------------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 同期中における一部解約元本額                                       | 2,223,215,451円  | 2,330,531,985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<br>（適格機関投資家専用）                       | 103,382,740円    | 100,974,842円    |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月<br>分配型）                              | 246,018,562円    | 226,559,758円    |
| インカム重視ポートフォリオ（奇<br>数月分配型）                            | 291,968,221円    | 258,724,094円    |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数月<br>分配型）                              | 1,023,921,164円  | 927,884,571円    |
| 安定重視ポートフォリオ（資産形<br>成型）                               | 8,200,926円      | 5,855,155円      |
| インカム重視ポートフォリオ（資<br>産形成型）                             | 7,600,465円      | 6,784,736円      |
| 成長重視ポートフォリオ（資産形<br>成型）                               | 21,939,071円     | 21,602,105円     |
| 6資産バランスファンド（分配<br>型）                                 | 2,637,796,313円  | 2,148,770,811円  |
| 6資産バランスファンド（成長<br>型）                                 | 2,864,020,536円  | 2,579,475,955円  |
| ダイワ三資産分散ファンド（イン<br>カム&キャッシュ、外債、内外リー<br>ト）（隔月分配型）     | 219,638,035円    | 177,121,058円    |
| 世界6資産均等分散ファンド（毎<br>月分配型）                             | 2,523,284,434円  | 1,860,682,303円  |
| 『しがぎん』S R I三資産バラン<br>ス・オープン（奇数月分配型）                  | 32,407,155円     | 25,798,298円     |
| ダイワ資産分散インカムオープン<br>（奇数月決算型）                          | 711,317,209円    | 664,025,283円    |
| ダイワ円債重視バランスファンド<br>（奇数月決算型）                          | 1,329,347円      | 1,329,347円      |
| ダイワ円債重視バランスファンド<br>（資産形成型）                           | 95,363円         | 83,157円         |
| D Cダイワ・ワールドアセット<br>（六つの羽／安定コース）                      | 78,583,145円     | 88,625,396円     |
| D Cダイワ・ワールドアセット<br>（六つの羽／6分散コース）                     | 107,652,586円    | 116,312,089円    |
| D Cダイワ・ワールドアセット<br>（六つの羽／成長コース）                      | 83,710,711円     | 98,359,188円     |
| D CダイワJ－R E I Tアクティ<br>ブファンド                         | 75,410,003円     | 79,160,146円     |
| ダイワファンドラップ J-REITセレ<br>クト                            | 5,896,890,582円  | 6,516,822,511円  |
| ライフハーモニー（ダイワ世界資<br>産分散ファンド）（成長型）                     | 785,649,107円    | 666,350,789円    |
| ライフハーモニー（ダイワ世界資<br>産分散ファンド）（安定型）                     | 247,925,638円    | 214,418,053円    |
| ライフハーモニー（ダイワ世界資<br>産分散ファンド）（分配型）                     | 1,428,099,977円  | 1,218,901,595円  |
| ダイワJリート・ファンド                                         | 286,473,224円    | 257,643,702円    |
| 計                                                    | 19,683,314,514円 | 18,262,264,942円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>特定期間末日における当該親投資信託<br>の受益権の総数 | 19,683,314,514口 | 18,262,264,942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3,697,960,872円であります。 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,873,596,123円であります。 |
|-------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日                                                                                          |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。                                             |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。     |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。                                             |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

II 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成22年5月10日現在                                |
|--------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

|                 |                                                                                                                                      |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成21年11月10日現在   |                             | 平成22年5月10日現在                |
|------|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
|      | 貸借対照表計上額<br>(円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) |
| 投資証券 | 15,421,017,800  | 427,403,520                 | 1,145,866,171               |
| 合計   | 15,421,017,800  | 427,403,520                 | 1,145,866,171               |

（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5月12日から平成21年11月10日まで、及び平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（平成21年5月12日から平成21年11月10日まで）

|                               |
|-------------------------------|
| 自 平成21年5月12日<br>至 平成21年11月10日 |
| 該当事項はありません。                   |

（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

|              |
|--------------|
| 平成22年5月10日現在 |
| 該当事項はありません。  |

## （1口当たり情報）

|                                                          | 平成21年11月10日現在       | 平成22年5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<br>(1万口当たり純資産額) | 0.8121円<br>(8,121円) | 0.8974円<br>(8,974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<br>(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 | 759   | 368,874,000 |    |
|      | M I Dリート投資法人       | 1,353 | 289,542,000 |    |
|      | 日本コマーシャル投資         | 500   | 50,550,000  |    |
|      | 森ヒルズリート            | 310   | 62,806,000  |    |

|                   |        |                |  |
|-------------------|--------|----------------|--|
| 野村不レジデンシャル        | 600    | 234,000,000    |  |
| 産業ファンド            | 410    | 153,750,000    |  |
| アドバンス・レジデンス       | 4,882  | 620,990,400    |  |
| 日本ビルファンド          | 3,100  | 2,421,100,000  |  |
| ジャパンリアルエステイト      | 2,700  | 2,162,700,000  |  |
| 日本リテールファンド        | 12,177 | 1,489,247,100  |  |
| オリックス不動産投資        | 1,200  | 535,200,000    |  |
| 日本プライムリアルティ       | 4,000  | 894,800,000    |  |
| プレミアム投資法人         | 352    | 133,760,000    |  |
| 東急リアル・エステート       | 900    | 452,700,000    |  |
| グローバル・ワン不動産投資法人   | 500    | 302,000,000    |  |
| 野村不動産オフィスF        | 1,500  | 790,500,000    |  |
| ユナイテッド・アーバン投資法人   | 1,300  | 778,700,000    |  |
| 森トラスト総合リート        | 1,160  | 846,800,000    |  |
| フロンティア不動産投資       | 950    | 674,500,000    |  |
| クレッシェンド投資法人       | 304    | 49,369,600     |  |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 736    | 546,848,000    |  |
| 福岡リート投資法人         | 333    | 197,469,000    |  |
| ケネディクス不動産投資法人     | 1,360  | 397,120,000    |  |
| ジョイントリート投資法人      | 370    | 97,051,000     |  |
| DAオフィス投資法人        | 1,700  | 370,940,000    |  |
| トップリート投資法人        | 700    | 300,300,000    |  |
| ビ・ライフ投資法人         | 650    | 278,850,000    |  |
| ジャパンエクセレント投資法人    | 1,000  | 476,000,000    |  |
| 投資証券 合計           | 45,806 | 15,976,467,100 |  |
| 合計                | 45,806 | 15,976,467,100 |  |

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11月10日現在   | 平成22年5月10日現在    |
|--------------------|-----------------|-----------------|
|                    | 金 額（円）          | 金 額（円）          |
| 資産の部               |                 |                 |
| 流動資産               |                 |                 |
| 預金                 | 8,056,472,711   | 9,049,567,404   |
| コール・ローン            | 2,960,958,866   | 4,432,107,734   |
| 投資証券               | 156,612,674,790 | 286,425,725,025 |
| 派生商品評価勘定           | 9,990,237       | 16,400,000      |
| 未収入金               | 287,927,592     | 1,717,263,779   |
| 未収配当金              | 376,770,363     | 812,649,815     |
| 流動資産合計             | 168,304,794,559 | 302,453,713,757 |
| 資産合計               | 168,304,794,559 | 302,453,713,757 |
| 負債の部               |                 |                 |
| 流動負債               |                 |                 |
| 派生商品評価勘定           | 252,234         | —               |
| 未払金                | 4,354,458,235   | 3,191,225,783   |
| 未払解約金              | 75,700,000      | 36,000,000      |
| 流動負債合計             | 4,430,410,469   | 3,227,225,783   |
| 負債合計               | 4,430,410,469   | 3,227,225,783   |
| 純資産の部              |                 |                 |
| 元本等                |                 |                 |
| 元本 ※1              | 216,472,472,131 | 369,282,686,283 |
| 剰余金                |                 |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2 | △52,598,088,041 | △70,056,198,309 |
| 元本等合計              | 163,874,384,090 | 299,226,487,974 |
| 純資産合計              | 163,874,384,090 | 299,226,487,974 |
| 負債純資産合計            | 168,304,794,559 | 302,453,713,757 |

## 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21年5月12日<br>至 平成21年11月10日                                                                                                          | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日 |
|------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 投資証券<br><br>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<br><br>同左                |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引                                                                                                                                 | 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。<br>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<br>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<br>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<br><br>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<br><br>同左 |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                                      | 平成21年11月10日現在    | 平成22年5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 | 127,533,374,652円 | 216,472,472,131円 |
| 同期中における追加設定元本額                           | 97,706,063,640円  | 162,570,606,152円 |
| 同期中における一部解約元本額                           | 8,766,966,161円   | 9,760,392,000円   |
| 同期末における元本の内訳<br>ファンド名                    |                  |                  |
| ダイワ・グローバルR E I T ・オープン（毎月分配型）            | 141,049,047,448円 | 294,798,261,023円 |
| ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）             | 208,901,438円     | 172,921,654円     |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                      | 287,006,457円     | 232,725,623円     |

|                                              |                                                    |                                                    |
|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------------------------------------------|
| インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                        | 345,342,011円                                       | 264,655,212円                                       |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）                          | 1,168,013,982円                                     | 946,002,888円                                       |
| 安定重視ポートフォリオ（資産形成型）                           | 8,922,760円                                         | 6,195,196円                                         |
| インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）                         | 8,148,996円                                         | 6,955,668円                                         |
| 成長重視ポートフォリオ（資産形成型）                           | 24,871,921円                                        | 19,289,276円                                        |
| 6資産バランスファンド（分配型）                             | 2,933,208,660円                                     | 2,136,542,981円                                     |
| 6資産バランスファンド（成長型）                             | 3,277,286,844円                                     | 2,638,551,842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）     | 244,948,694円                                       | 181,731,078円                                       |
| りそな ワールド・リート・ファンド                            | 50,088,160,384円                                    | 55,828,066,685円                                    |
| 世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）                         | 2,855,452,056円                                     | 1,878,299,091円                                     |
| 『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）                | 73,026,179円                                        | 53,569,761円                                        |
| 日の出・3資産バランスファンド                              | 266,853,064円                                       | 123,658,264円                                       |
| 常陽3分法ファンド                                    | 4,479,041,154円                                     | 3,489,445,634円                                     |
| ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）                      | 832,155,548円                                       | 671,032,403円                                       |
| ダイワ・海外株式&REITファンド（毎月分配型）                     | 261,779,277円                                       | 219,036,450円                                       |
| ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）                      | 1,498,935円                                         | 1,395,456円                                         |
| ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）                       | 105,926円                                           | 88,230円                                            |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）                   | 89,693,192円                                        | 91,176,624円                                        |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）                  | 116,940,184円                                       | 118,070,207円                                       |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）                   | 97,020,749円                                        | 99,488,642円                                        |
| ダイワ・グローバルREITファンド（ダイワSMA専用）                  | 1,874,418,524円                                     | 1,587,960,717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）                 | 5,880,627,748円                                     | 3,717,565,678円                                     |
| 計                                            | 216,472,472,131円                                   | 369,282,686,283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 | 216,472,472,131口                                   | 369,282,686,283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52,598,088,041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70,056,198,309円であります。 |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当特定期間（平成21年11月11日から平成22年5月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

## I 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 自 平成21年11月11日<br>至 平成22年5月10日                                                                                                                                                        |
|----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。                                                                                                           |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。                                     |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。                                                                                                           |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成22年5月10日現在                                |
|--------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券                                     |

|  |                                                                                                                                                                          |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成21年11月10日現在   |                             | 平成22年5月10日現在                |
|------|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
|      | 貸借対照表計上額<br>(円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) | 当期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額 (円) |
| 投資証券 | 156,612,674,790 | 475,556,272                 | △7,312,181,654              |
| 合計   | 156,612,674,790 | 475,556,272                 | △7,312,181,654              |

(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9月16日から平成21年11月10日まで、及び平成22年3月16日から平成22年5月10日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成21年5月12日から平成21年11月10日まで)

## I 取引の状況に関する事項

| 区 分                   | 自 平成21年5月12日<br>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。                                                                                           |
| 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。                                                                   |
| 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。                                                        |
| 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。 |

|                          |                                                                                                    |
|--------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。 |
|--------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|

## II 取引の時価等に関する事項

### 通貨関連

| 種 類                 | 平成21年11月10日 現在 |           |               |             |
|---------------------|----------------|-----------|---------------|-------------|
|                     | 契約額等<br>(円)    | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |                |           |               |             |
| 売 建                 | 421,756,324    | —         | 421,384,712   | 371,612     |
| アメリカ・ドル             | 417,823,243    | —         | 417,452,092   | 371,151     |
| カナダ・ドル              | 3,933,081      | —         | 3,932,620     | 461         |
| 買 建                 | 1,771,193,824  | —         | 1,780,560,215 | 9,366,391   |
| アメリカ・ドル             | 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                  | 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。

(平成21年11月11日から平成22年5月10日まで)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 通貨関連

| 種 類 | 平成22年5月10日 現在 |    |           |             |
|-----|---------------|----|-----------|-------------|
|     | 契約額等<br>(円)   | うち | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) |

|                     |               | 1 年超 |               |            |
|---------------------|---------------|------|---------------|------------|
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引 |               |      |               |            |
| 買 建                 | 3,677,600,000 | —    | 3,694,000,000 | 16,400,000 |
| アメリカ・ドル             | 3,677,600,000 | —    | 3,694,000,000 | 16,400,000 |
| 合計                  | 3,677,600,000 | —    | 3,694,000,000 | 16,400,000 |

## (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11月10日現在       | 平成22年5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<br>(1万口当たり純資産額) | 0.7570円<br>(7,570円) | 0.8103円<br>(8,103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 | PUBLIC STORAGE INC N      | 74,652    | アメリカ・ドル<br>1,862,567.400 |    |
|      |         | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 350,360   | 34,244,186.400           |    |
|      |         | SIMON PROPERTY GROUP INC  | 1,925,901 | 165,011,197.680          |    |
|      |         | BOSTON PROPERTIES INC     | 545,550   | 41,510,899.500           |    |
|      |         | BIOMED REALTY TRUST INC   | 1,015,820 | 16,954,035.800           |    |
|      |         | APARTMENT INVT&MGMT CO-A  | 847,466   | 17,991,703.180           |    |
|      |         | VORNADO REALTY TRUST      | 644,198   | 49,306,914.920           |    |
|      |         | EQUITY RESIDENTIAL        | 1,390,914 | 60,407,395.020           |    |
|      |         | HOST HOTELS&RESORTS INC   | 4,176,662 | 61,563,997.880           |    |
|      |         | KIMCO REALTY CORP         | 1,709,115 | 25,653,816.150           |    |
|      |         | SOVRAN SELF STORAGE INC   | 531,091   | 19,942,467.050           |    |

|                           |           |                |
|---------------------------|-----------|----------------|
| VENTAS INC                | 496,723   | 22,566,125.890 |
| AMB PROPERTY CORP         | 666,460   | 16,974,736.200 |
| BRE PROPERTIES-CL A       | 1,026,278 | 40,014,579.220 |
| MACK-CALI REALTY CORP     | 523,171   | 17,133,850.250 |
| COLONIAL PROPERTIES TRUST | 1,246,218 | 18,282,018.060 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST     | 184,145   | 8,441,206.800  |
| DEVELOPERS DIV REALTY     | 2,067,448 | 24,457,909.840 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC  | 331,497   | 12,401,302.770 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC  | 275,480   | 28,250,474.000 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 322,694   | 23,727,689.820 |
| HEALTH CARE REIT INC      | 330,546   | 13,403,640.300 |
| HCP INC                   | 524,842   | 16,280,598.840 |
| HOSPITALITY PROPERTIES    | 911,280   | 21,788,704.800 |
| KILROY REALTY CORP        | 499,340   | 16,083,741.400 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST    | 1,302,249 | 40,656,213.780 |
| LTC PROPERTIES INC        | 485,875   | 12,341,225.000 |
| LEXINGTON REALTY TRUST    | 2,358,663 | 15,260,549.610 |
| MACERICH CO/THE           | 1,102,649 | 44,932,946.750 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTI | 295,186   | 15,089,908.320 |
| NATIONWIDE HEALTH PPTYS   | 479,428   | 16,089,603.680 |
| PROLOGIS                  | 4,368,202 | 48,618,088.260 |
| POST PROPERTIES INC       | 834,276   | 22,116,656.760 |
| PUBLIC STORAGE            | 824,572   | 76,652,213.120 |
| REGENCY CENTERS CORP      | 603,804   | 23,512,127.760 |
| SL GREEN REALTY CORP      | 274,517   | 16,265,132.250 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 978,587   | 20,344,823.730 |
| UDR INC                   | 1,484,827 | 29,399,574.600 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTO | 1,087,822 | 23,235,877.920 |
| HEALTH CARE REIT 7.875% D | 115,262   | 2,858,497.600  |
| APARTMENT INVEST 9.375% G | 100,000   | 2,503,000.000  |
| DEVELOP DIV RLTY 7.375% H | 228,576   | 4,868,668.800  |
| SL GREEN REALTY 7.625% C  | 500,000   | 11,530,000.000 |
| PS BUSINESS PARK 7% H     | 166,095   | 3,742,120.350  |
| PS BUSINESS PARK 6.875% I | 131,085   | 3,008,400.750  |
| DEVELOP DIV RLTY 8% G     | 178,103   | 4,046,500.160  |
| DEVELOP DIV RLTY 7.5% I   | 238,800   | 5,076,888.000  |
| SL GREEN REALTY 7.875% D  | 145,294   | 3,399,879.600  |
| APARTMENT INVEST 8% T     | 179,000   | 4,152,800.000  |
| APARTMENT INVEST 7.75% U  | 113,895   | 2,591,111.250  |
| DUKE REALTY CORP 6.5% K   | 326,434   | 7,024,859.680  |
| EQUITY RES PROP 6.48% N   | 151,390   | 3,326,038.300  |
| HCP INC 7.1% F            | 250,000   | 5,580,000.000  |
| KIMCO REALTY 6.65% F      | 120,228   | 2,765,244.000  |
| PROLOGIS TRUST 6.75% F    | 204,672   | 4,195,776.000  |
| WEINGARTEN RLTY 6.75% D   | 202,129   | 4,376,092.850  |
| ALEXANDRIA RE EQ 8.375% C | 91,579    | 2,258,338.140  |
| KIMCO REALTY 7.75% G      | 622,824   | 15,389,981.040 |
| DUKE REALTY CORP 8.375 0  | 335,697   | 8,227,933.470  |
| APARTMENT INVEST 8% V     | 120,847   | 2,821,777.450  |
| PS BUSINESS PARK 7.6% L   | 228,818   | 5,725,026.360  |
| U-STORE-IT TRUST          | 1,512,900 | 12,315,006.000 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS  | 1,542,392 | 17,706,660.160 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC  | 309,278   | 17,189,671.240 |
| TANGER FACTORY 7.50% C    | 130,000   | 3,164,200.000  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC   | 1,182,646 | 17,798,822.300 |
| CBL&ASSOC PROP 7.375% D   | 279,980   | 5,988,772.200  |
| VORNADO RLTY TST 6.625% G | 470,995   | 10,173,492.000 |

|             |                           |            |                                                   |  |
|-------------|---------------------------|------------|---------------------------------------------------|--|
|             | EDUCATION REALTY TRUST    | 1,359,814  | 8,920,379.840                                     |  |
|             | DIGITAL REALTY 8.5% A     | 117,800    | 3,008,612.000                                     |  |
|             | SUNSTONE HOTEL 8% A       | 188,950    | 4,251,375.000                                     |  |
|             | TAUBMAN CENTERS 7.625% H  | 116,550    | 2,814,682.500                                     |  |
|             | REGENCY CENTERS 7.25% D   | 183,449    | 4,261,520.270                                     |  |
|             | REGENCY CENTERS 6.7% E    | 182,038    | 4,004,836.000                                     |  |
|             | VORNADO REALTY TST 6.75%F | 307,858    | 6,803,661.800                                     |  |
|             | VORNADO REALTY TST 6.75%H | 182,103    | 3,984,413.640                                     |  |
|             | LASALLE HOTEL 8% E        | 127,371    | 2,967,744.300                                     |  |
|             | HRPT PROPERTIES 7.125% C  | 145,161    | 3,244,348.350                                     |  |
|             | AMB PROPERTY 7.0% O       | 111,846    | 2,678,711.700                                     |  |
|             | PUBLIC STORAGE 6.95% H    | 249,372    | 5,974,953.120                                     |  |
|             | VORNADO RLTY TST 6.625% I | 377,939    | 8,193,717.520                                     |  |
|             | PS BUSINESS PARK 7.375% O | 156,800    | 3,791,424.000                                     |  |
|             | DUKE REALTY CORP 7.25% N  | 135,480    | 3,082,170.000                                     |  |
|             | PUBLIC STORAGE INC -K     | 180,400    | 4,374,700.000                                     |  |
|             | DUKE REALTY CORP 6.60% L  | 454,546    | 9,840,920.900                                     |  |
|             | NAT'L RETAIL PROP CL C    | 172,200    | 4,050,144.000                                     |  |
|             | DOUGLAS EMMETT            | 957,350    | 14,963,380.500                                    |  |
|             | PUBLIC STORAGE INC L      | 375,736    | 9,006,391.920                                     |  |
|             | REALTY INCOME PFD E       | 60,000     | 1,425,000.000                                     |  |
|             | BRE PROPERTIES 6.75 D     | 194,864    | 4,288,956.640                                     |  |
|             | PUBLIC STORAGE INC M      | 395,000    | 9,211,400.000                                     |  |
|             | PS BUSINESS PARK P        | 506,625    | 11,353,466.250                                    |  |
|             | BIOMED REALTY 7.375 A     | 378,375    | 8,683,706.250                                     |  |
|             | WEINGARTEN RLTY F         | 438,442    | 9,356,352.280                                     |  |
|             | LEXINGTON REALTY D        | 282,943    | 5,871,067.250                                     |  |
|             | HOSPITALITY PROP C        | 425,000    | 9,052,500.000                                     |  |
|             | PUBLIC STORAGE 6.875 O    | 275,000    | 6,462,500.000                                     |  |
|             | HRPT PROPERTIES 6.5% D    | 798,900    | 15,778,275.000                                    |  |
|             | DUKE REALTY CORP 6.95% M  | 412,094    | 8,872,383.820                                     |  |
| アメリカ・ドル 小計  |                           | 59,527,433 | アメリカ・ドル<br>1,573,149,953.260<br>(145,296,129,684) |  |
| イギリス・ポンド    | LAND SECURITIES PLC       | 11,506,748 | イギリス・ポンド<br>68,062,414.420                        |  |
|             | SEGRO PLC                 | 10,388,328 | 28,588,678.650                                    |  |
|             | HAMMERSON PLC             | 12,079,486 | 41,082,331.880                                    |  |
|             | BRITISH LAND CO PLC       | 9,807,454  | 41,358,033.510                                    |  |
|             | GREAT PORTLAND ESTATES PL | 5,729,919  | 16,330,269.150                                    |  |
|             | DERWENT LONDON PLC        | 1,477,272  | 19,027,263.360                                    |  |
| イギリス・ポンド 小計 |                           | 50,989,207 | イギリス・ポンド<br>214,448,990.970<br>(29,375,222,783)   |  |
| オーストラリア・ドル  | CFS RETAIL PROPERTY TRUST | 16,225,946 | オーストラリア・ドル<br>30,180,259.560                      |  |
|             | COMMONWEALTH PROPERTY OFF | 39,116,924 | 35,205,231.600                                    |  |
|             | DEXUS PROPERTY GROUP      | 93,682,421 | 73,072,288.380                                    |  |
|             | GPT GROUP                 | 87,393,614 | 47,629,519.630                                    |  |
|             | ING INDUSTRIAL FUND       | 40,820,551 | 17,348,734.170                                    |  |
|             | ING OFFICE FUND           | 47,663,971 | 28,598,382.600                                    |  |
|             | MIRVAC GROUP              | 36,248,176 | 48,935,037.600                                    |  |
|             | STOCKLAND                 | 32,380,533 | 124,341,246.720                                   |  |
|             | WESTFIELD GROUP           | 20,902,317 | 260,024,823.480                                   |  |
|             | GOODMAN GROUP             | 92,227,099 | 60,869,885.340                                    |  |

|                |                           |             |                                                   |
|----------------|---------------------------|-------------|---------------------------------------------------|
| オーストラリア・ドル 小計  |                           | 506,661,552 | オーストラリア・ドル<br>726,205,409.080<br>(60,166,118,142) |
| カナダ・ドル         | BOARDWALK REAL ESTATE INV | 575,359     | カナダ・ドル<br>23,014,360.000                          |
|                | PRIMARIS RETAIL REAL ESTA | 1,506,510   | 26,288,599.500                                    |
| カナダ・ドル 小計      |                           | 2,081,869   | カナダ・ドル<br>49,302,959.500<br>(4,397,823,988)       |
| シンガポール・ドル      | CAPITACOMMERCIAL TRUST    | 47,457,000  | シンガポール・ドル<br>54,100,980.000                       |
|                | CAPITAMALL TRUST          | 21,835,397  | 41,487,254.300                                    |
|                | SUNTEC REIT               | 15,694,000  | 20,245,260.000                                    |
|                | CDL HOSPITALITY TRUSTS    | 12,623,010  | 22,973,878.200                                    |
| シンガポール・ドル 小計   |                           | 97,609,407  | シンガポール・ドル<br>138,807,372.500<br>(9,254,287,524)   |
| ニュージーランド・ドル    | AMP NZ OFFICE TRUST       | 14,994,195  | ニュージーランド・ドル<br>11,395,588.200                     |
|                |                           |             |                                                   |
| ニュージーランド・ドル 小計 |                           | 14,994,195  | ニュージーランド・ドル<br>11,395,588.200<br>(754,501,895)    |
| ユーロ            | CORIO NV                  | 919,534     | ユーロ<br>36,018,146.780                             |
|                | EUROCOMMERCIAL -CVA       | 223,845     | 5,485,321.720                                     |
|                | VASTNED RETAIL NV         | 295,227     | 11,413,475.820                                    |
|                | ICADE                     | 372,342     | 24,582,018.840                                    |
|                | UNIBAIL-RODAMCO SE        | 1,077,154   | 130,820,353.300                                   |
|                | GECINA SA                 | 186,459     | 12,886,181.490                                    |
|                | KLEPIERRE                 | 360,790     | 8,226,012.000                                     |
|                | SILIC                     | 64,825      | 5,169,793.750                                     |
|                | MERCIALYS                 | 817,989     | 19,333,170.010                                    |
| ユーロ 小計         |                           | 4,318,165   | ユーロ<br>253,934,473.710<br>(30,114,089,238)        |
| 香港・ドル          | LINK REIT                 | 21,991,325  | 香港・ドル<br>417,835,175.000                          |
|                | CHAMPION REIT             | 50,449,171  | 177,076,590.210                                   |
| 香港・ドル 小計       |                           | 72,440,496  | 香港・ドル<br>594,911,765.210<br>(7,067,551,771)       |
| 投資証券 合計        |                           |             | 286,425,725,025<br>[286,425,725,025]              |
| 合計             |                           |             | 286,425,725,025<br>[286,425,725,025]              |

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<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---------|-----------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル | 投資証券 99銘柄 | 100%               | 50.7%          |

|             |      |      |      |       |
|-------------|------|------|------|-------|
| イギリス・ポンド    | 投資証券 | 6銘柄  | 100% | 10.3% |
| オーストラリア・ドル  | 投資証券 | 10銘柄 | 100% | 21.0% |
| カナダ・ドル      | 投資証券 | 2銘柄  | 100% | 1.5%  |
| シンガポール・ドル   | 投資証券 | 4銘柄  | 100% | 3.2%  |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 | 1銘柄  | 100% | 0.3%  |
| ユーロ         | 投資証券 | 9銘柄  | 100% | 10.5% |
| 香港・ドル       | 投資証券 | 2銘柄  | 100% | 2.5%  |

## 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22年5月31日

|                      |             |
|----------------------|-------------|
| I 資産総額               | 22,969,229円 |
| II 負債総額              | 8,990円      |
| III 純資産総額（I－II）      | 22,960,239円 |
| IV 発行済数量             | 25,304,559口 |
| V 1単位当たり純資産額（III／IV） | 0.9074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22年5月31日

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| I 資産総額               | 551,446,192円 |
| II 負債総額              | 9,370,836円   |
| III 純資産総額（I－II）      | 542,075,356円 |
| IV 発行済数量             | 506,158,059口 |
| V 1単位当たり純資産額（III／IV） | 1.0710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22年5月31日

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| I 資産総額               | 386,544,771円 |
| II 負債総額              | 66,311,958円  |
| III 純資産総額（I－II）      | 320,232,813円 |
| IV 発行済数量             | 302,272,579口 |
| V 1単位当たり純資産額（III／IV） | 1.0594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22年5月31日

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 212,221,460,011円 |
| II 負債総額              | 2,184,060,000円   |
| III 純資産総額（I－II）      | 210,037,400,011円 |
| IV 発行済数量             | 189,559,398,035口 |
| V 1単位当たり純資産額（III／IV） | 1.1080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22年5月31日

|         |                 |
|---------|-----------------|
| I 資産総額  | 27,013,922,874円 |
| II 負債総額 | 395,973,092円    |

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）      | 26,617,949,782円 |
| Ⅳ 発行済数量           | 26,039,058,179口 |
| Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0222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22年5月31日

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| Ⅰ 資産総額            | 8,825,311,676円  |
| Ⅱ 負債総額            | 33,014,556円     |
| Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）      | 8,792,297,120円  |
| Ⅳ 発行済数量           | 12,718,073,495口 |
| Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 0.6913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22年5月31日

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| Ⅰ 資産総額            | 15,077,011,229円 |
| Ⅱ 負債総額            | 52,246,118円     |
| Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）      | 15,024,765,111円 |
| Ⅳ 発行済数量           | 17,865,908,387口 |
| Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 0.8410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22年5月31日

|                   |                  |
|-------------------|------------------|
| Ⅰ 資産総額            | 323,250,155,601円 |
| Ⅱ 負債総額            | 7,722,145,345円   |
| Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）      | 315,528,010,256円 |
| Ⅳ 発行済数量           | 398,476,098,881口 |
| Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 0.7918円          |

## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

### (2) 受益者に対する特典

ありません。

### (3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

### (4) 受益証券の再発行

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

### (5) 受益権の譲渡

- ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (7) 受益権の再分割

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

### (8) 償還金

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

### (9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成22年5月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 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（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. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

**ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・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22年5月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

| 基本的性格      | 本数（本） | 純資産額の合計額（百万円） |
|------------|-------|---------------|
| 単位型株式投資信託  | 14    | 40,015        |
| 追加型株式投資信託  | 349   | 6,512,939     |
| 株式投資信託 合計  | 363   | 6,552,954     |
| 単位型公社債投資信託 | -     | -             |
| 追加型公社債投資信託 | 17    | 2,929,666     |
| 公社債投資信託 合計 | 17    | 2,929,666     |
| 総合計        | 380   | 9,482,620     |

## 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、前事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、当事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）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。

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、前事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び当事業年度（平成21年4月1日から平成22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。

3. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

|           | 前事業年度<br>(平成21年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成22年3月31日現在) |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部      |                         |                         |
| 流動資産      |                         |                         |
| 現金・預金     | 3,961,462               | 4,783,803               |
| 有価証券      | 28,233,112              | 26,970,072              |
| 前払金       | 453                     | 136                     |
| 前払費用      | 84,549                  | 77,248                  |
| 未収入金      | 20,722                  | 3,858                   |
| 未収消費税等    | 27,138                  | —                       |
| 未収委託者報酬   | 5,273,080               | 7,030,430               |
| 未収収益      | 25,476                  | 90,787                  |
| 貯蔵品       | 38,909                  | 30,324                  |
| 繰延税金資産    | 227,536                 | 566,334                 |
| その他       | 2,030                   | 256,955                 |
| 流動資産計     | 37,894,473              | 39,809,953              |
| 固定資産      |                         |                         |
| 有形固定資産    | ※1 1,252,162            | ※1 1,186,818            |
| 建物（純額）    | 349,484                 | 318,162                 |
| 器具備品（純額）  | 900,893                 | 757,333                 |
| 建設仮勘定     | 1,785                   | 111,322                 |
| 無形固定資産    | 1,980,730               | 1,751,209               |
| ソフトウェア    | 1,967,944               | 1,558,342               |
| ソフトウェア仮勘定 | —                       | 179,630                 |
| 電話加入権     | 11,850                  | 11,850                  |
| 商標権       | —                       | 660                     |
| その他       | 936                     | 725                     |
| 投資その他の資産  | 8,317,769               | 10,657,920              |

|              |    |            |    |            |
|--------------|----|------------|----|------------|
| 投資有価証券       |    | 7,780,508  |    | 10,018,677 |
| 関係会社株式       |    | 737,012    |    | 737,012    |
| 出資金          |    | 178,806    |    | 178,806    |
| 従業員に対する長期貸付金 |    | 155,692    |    | 104,419    |
| 差入保証金        |    | 618,264    |    | 617,615    |
| 長期前払費用       |    | 8,394      |    | 8,402      |
| 投資不動産（純額）    | ※1 | 579,162    | ※1 | 489,861    |
| 貸倒引当金        | ※3 | △1,740,069 | ※3 | △1,496,873 |
| 固定資産計        |    | 11,550,663 |    | 13,595,948 |
| 資産合計         |    | 49,445,137 |    | 53,405,901 |

(単位:千円)

|           | 前事業年度<br>(平成21年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成22年3月31日現在) |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 負債の部      |                         |                         |
| 流動負債      |                         |                         |
| 預り金       | 48,999                  | 46,289                  |
| 未払金       | 5,335,193               | 7,304,929               |
| 未払収益分配金   | 32,233                  | 31,110                  |
| 未払償還金     | 278,950                 | 261,645                 |
| 未払手数料     | 2,896,691               | 3,847,895               |
| その他未払金    | ※2 2,127,318            | ※2 3,164,277            |
| 未払費用      | 1,528,570               | 2,212,051               |
| 未払法人税等    | 442,052                 | 692,446                 |
| 未払消費税等    | —                       | 104,897                 |
| 賞与引当金     | 223,000                 | 838,400                 |
| その他       | 1,951                   | 168,621                 |
| 流動負債計     | 7,579,766               | 11,367,635              |
| 固定負債      |                         |                         |
| 退職給付引当金   | 1,150,011               | 1,179,482               |
| 役員退職慰労引当金 | 62,520                  | 39,300                  |
| 繰延税金負債    | 1,767,537               | 1,963,856               |
| 固定負債計     | 2,980,068               | 3,182,638               |
| 負債合計      | 10,559,835              | 14,550,274              |
| 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   | 9,659,553               | 9,085,103               |
| 利益剰余金合計   | 12,833,851              | 12,259,401              |

|              |            |            |
|--------------|------------|------------|
| 株主資本合計       | 39,503,851 | 38,929,401 |
| 評価・換算差額等     |            |            |
| その他有価証券評価差額金 | △618,549   | △18,061    |
| 繰延ヘッジ損益      | —          | △55,712    |
| 評価・換算差額等合計   | △618,549   | △73,774    |
| 純資産合計        | 38,885,301 | 38,855,627 |
| 負債・純資産合計     | 49,445,137 | 53,405,901 |

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

|              | 前事業年度<br>(自 平成20年 4 月 1 日<br>至 平成21年 3 月31日) | 当事業年度<br>(自 平成21年 4 月 1 日<br>至 平成22年 3 月31日) |
|--------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------|
| 営業収益         |                                              |                                              |
| 委託者報酬        | 67,765,880                                   | 63,362,142                                   |
| その他営業収益      | 391,449                                      | 432,889                                      |
| 営業収益計        | 68,157,330                                   | 63,795,032                                   |
| 営業費用         |                                              |                                              |
| 支払手数料        | 40,411,927                                   | 37,293,022                                   |
| 広告宣伝費        | 836,270                                      | 917,652                                      |
| 公告費          | 2,131                                        | 257                                          |
| 受益証券発行費      | 4,887                                        | 131                                          |
| 調査費          | 4,089,629                                    | 4,336,342                                    |
| 調査費          | 752,522                                      | 771,298                                      |
| 委託調査費        | 3,337,107                                    | 3,565,043                                    |
| 委託計算費        | 657,069                                      | 601,778                                      |
| 営業雑経費        | 1,828,907                                    | 1,793,369                                    |
| 通信費          | 264,500                                      | 284,273                                      |
| 印刷費          | 908,407                                      | 837,408                                      |
| 協会費          | 49,882                                       | 45,168                                       |
| 諸会費          | 11,279                                       | 11,118                                       |
| その他営業雑経費     | 594,837                                      | 615,400                                      |
| 営業費用計        | 47,830,823                                   | 44,942,552                                   |
| 一般管理費        |                                              |                                              |
| 給料           | 3,940,850                                    | 4,847,709                                    |
| 役員報酬         | 149,400                                      | 217,200                                      |
| 給料・手当        | 3,408,724                                    | 3,478,553                                    |
| 賞与           | 159,726                                      | 313,555                                      |
| 賞与引当金繰入額     | 223,000                                      | 838,400                                      |
| 福利厚生費        | 573,052                                      | 680,311                                      |
| 交際費          | 89,101                                       | 80,019                                       |
| 寄付金          | 630                                          | —                                            |
| 旅費交通費        | 233,872                                      | 178,718                                      |
| 租税公課         | 328,325                                      | 166,974                                      |
| 不動産賃借料       | 730,467                                      | 731,728                                      |
| 退職給付費用       | 310,345                                      | 303,972                                      |
| 役員退職慰労引当金繰入額 | 26,700                                       | 37,500                                       |
| 固定資産減価償却費    | 1,012,489                                    | 941,172                                      |
| 諸経費          | 904,760                                      | 990,534                                      |
| 一般管理費計       | 8,150,595                                    | 8,958,640                                    |
| 営業利益         | 12,175,911                                   | 9,893,838                                    |

(単位:千円)

|                | 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日) |
|----------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業外収益          |                                        |                                        |
| 受取配当金          | 33,852                                 | 61,884                                 |
| 有価証券利息         | 350,432                                | 87,447                                 |
| 受取利息           | 4,904                                  | 3,425                                  |
| 時効成立分配金・償還金    | 38,525                                 | 40,507                                 |
| 投資有価証券売却益      | —                                      | 213,196                                |
| 有価証券償還益        | 26,762                                 | 33,090                                 |
| 為替差益           | 721,935                                | —                                      |
| その他            | 20,641                                 | 82,595                                 |
| 営業外収益計         | 1,197,054                              | 522,147                                |
| 営業外費用          |                                        |                                        |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | 127,439                                | 101,945                                |
| 貯蔵品廃棄損         | 74,887                                 | 44,214                                 |
| 投資有価証券売却損      | —                                      | 263,840                                |
| 為替差損           | —                                      | 7,870                                  |
| デリバティブ損失       | 885,196                                | —                                      |
| 貸倒引当金繰入額 ※2    | 621,387                                | —                                      |
| その他            | 50,066                                 | 68,406                                 |
| 営業外費用計         | 1,758,977                              | 486,276                                |
| 経常利益           | 11,613,987                             | 9,929,709                              |
| 特別利益           |                                        |                                        |
| 投資有価証券売却益      | 2,157                                  | —                                      |
| 貸倒引当金戻入額       | —                                      | 159,959                                |
| 特別利益計          | 2,157                                  | 159,959                                |
| 特別損失           |                                        |                                        |
| 投資有価証券売却損      | 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 ※1    | 11,886                                 | ※1 16,233                              |
| 減損損失           | —                                      | ※3 76,450                              |
| その他 ※4         | 42,274                                 | —                                      |
| 特別損失計          | 285,971                                | 92,683                                 |
| 税引前当期純利益       | 11,330,173                             | 9,996,985                              |
| 法人税、住民税及び事業税   | 4,648,684                              | 4,592,433                              |
| 法人税等調整額        | 168,125                                | △516,225                               |
| 法人税等合計         | 4,816,810                              | 4,076,208                              |
| 当期純利益          | 6,513,363                              | 5,920,777                              |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

|          | 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22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 |                                        |                                        |
| 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    | 11,702,152                             | 9,659,553                              |
| 当期変動額    |                                        |                                        |
| 剰余金の配当   | △8,555,962                             | △6,495,227                             |
| 当期純利益    | 6,513,363                              | 5,920,777                              |
| 当期変動額合計  | △2,042,599                             | △574,450                               |
| 当期末残高    | 9,659,553                              | 9,085,103                              |
| 利益剰余金合計  |                                        |                                        |
| 前期末残高    | 14,876,450                             | 12,833,851                             |
| 当期変動額    |                                        |                                        |
| 剰余金の配当   | △8,555,962                             | △6,495,227                             |
| 当期純利益    | 6,513,363                              | 5,920,777                              |

|         |            |            |
|---------|------------|------------|
| 当期変動額合計 | △2,042,599 | △574,450   |
| 当期末残高   | 12,833,851 | 12,259,401 |

(単位:千円)

|                         | 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日) |
|-------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| <b>株主資本合計</b>           |                                        |                                        |
| 前期末残高                   | 41,546,450                             | 39,503,851                             |
| 当期変動額                   |                                        |                                        |
| 剰余金の配当                  | △8,555,962                             | △6,495,227                             |
| 当期純利益                   | 6,513,363                              | 5,920,777                              |
| 当期変動額合計                 | △2,042,599                             | △574,450                               |
| 当期末残高                   | 39,503,851                             | 38,929,401                             |
| <b>評価・換算差額等</b>         |                                        |                                        |
| <b>その他有価証券評価差額金</b>     |                                        |                                        |
| 前期末残高                   | △402,154                               | △618,549                               |
| 当期変動額                   |                                        |                                        |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | △216,395                               | 600,487                                |
| 当期変動額合計                 | △216,395                               | 600,487                                |
| 当期末残高                   | △618,549                               | △18,061                                |
| 繰延ヘッジ損益                 |                                        |                                        |
| 前期末残高                   | —                                      | —                                      |
| 当期変動額                   |                                        |                                        |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | —                                      | △55,712                                |
| 当期変動額合計                 | —                                      | △55,712                                |
| 当期末残高                   | —                                      | △55,712                                |
| <b>評価・換算差額等合計</b>       |                                        |                                        |
| 前期末残高                   | △402,154                               | △618,549                               |
| 当期変動額                   |                                        |                                        |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | △216,395                               | 544,775                                |
| 当期変動額合計                 | △216,395                               | 544,775                                |
| 当期末残高                   | △618,549                               | △73,774                                |
| <b>純資産合計</b>            |                                        |                                        |
| 前期末残高                   | 41,144,295                             | 38,885,301                             |
| 当期変動額                   |                                        |                                        |
| 剰余金の配当                  | △8,555,962                             | △6,495,227                             |
| 当期純利益                   | 6,513,363                              | 5,920,777                              |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | △216,395                               | 544,775                                |
| 当期変動額合計                 | △2,258,994                             | △29,674                                |
| 当期末残高                   | 38,885,301                             | 38,855,627                             |

## 重要な会計方針

|                          | 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日)                                                                                                                                                                                                         | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日)                                                      |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準<br>及び評価方法   | (1) 子会社及び関連会社株式<br>移動平均法による原価法によ<br>り計上しております。<br>(2) その他有価証券<br>時価のあるもの<br>決算日の市場価格等に基づく<br>時価法（評価差額は全部純資産<br>直入法により処理し、売却原価<br>は移動平均法により算定）を採<br>用しております。<br>時価のないもの<br>移動平均法による原価法を採<br>用しております。                                            | (1) 子会社及び関連会社株式<br>同左<br>(2) その他有価証券<br>同左                                                  |
| 2. デリバティブの評価<br>基準及び評価方法 | 時価法により計上しておりま<br>す。                                                                                                                                                                                                                            | 同左                                                                                          |
| 3. 固定資産の減価償却<br>の方法      | (1) 有形固定資産及び投資不動産<br>（リース資産を除く）<br>定率法によっております。<br>なお、主な耐用年数は以下の通<br>りであります。<br>建物 6～47年<br>器具備品 3～20年<br>(2) 無形固定資産（リース資産を除<br>く）<br>定額法によっております。<br>なお、自社利用のソフトウェアに<br>ついては、社内における利用可能<br>期間（5年）に基づいておりま<br>す。<br>(3) 長期前払費用<br>定額法によっております。 | (1) 有形固定資産及び投資不動産<br>（リース資産を除く）<br>同左<br>(2) 無形固定資産（リース資産を除<br>く）<br>同左<br>(3) 長期前払費用<br>同左 |
| 4. 引当金の計上基準              | (1) 貸倒引当金<br>債権等の貸倒損失に備えるため、<br>一般債権については貸倒実績率法<br>により、貸倒懸念債権及び破産更<br>生債権等については財務内容評価<br>法により計上しております。<br>(2) 賞与引当金<br>役員および従業員に対する賞与<br>の支給に備えるため、支給見込額<br>を計上しております。                                                                         | (1) 貸倒引当金<br>同左<br>(2) 賞与引当金<br>同左                                                          |

|                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 5. ヘッジ会計の方法                | <p>(3) 退職給付引当金<br/>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。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金<br/>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。</p> <p>-----</p> | <p>(3) 退職給付引当金<br/>同左</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金<br/>同左</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法<br/>繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象<br/>ヘッジ手段・・・株価指数先物<br/>ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針<br/>価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法<br/>原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p> |
| 6. リース取引の処理方法              | <p>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。</p>                                                                                                                                                                                    | 同左                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(1) 消費税等の会計処理<br/>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。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用<br/>連結納税制度を適用しております。</p>                                                                                                                                                                                              | <p>(1) 消費税等の会計処理<br/>同左</p> <p>(2) 連結納税制度の適用<br/>同左</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

## 会計方針の変更

|                                                 |                                                 |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------|
| <p>前事業年度<br/>(自 平成20年4月1日<br/>至 平成21年3月31日)</p> | <p>当事業年度<br/>(自 平成21年4月1日<br/>至 平成22年3月31日)</p> |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------|

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |       |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|
| <p>（リース取引に関する会計基準）</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p> | ----- |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|

## 追加情報

| 前事業年度<br>（自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日） | 当事業年度<br>（自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日）                                                                                                                                                                                                                       |
|----------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| -----                                  | <p>（投資有価証券売却損益の計上区分の変更）</p> <p>従来、投資有価証券売却損益は、特別利益又は特別損失の区分において処理しておりましたが、投資有価証券の保有方針等を勘案し、今後、経常的に発生すると見込まれるものについては、実態をより適切に表示するため、当事業年度より営業外収益又は営業外費用の区分において処理しております。</p> <p>この結果、従来の方法と同一の方法によった場合と比べ、経常利益は50,644千円少なく計上されておりますが、税引前当期純利益に与える影響はありません。</p> |

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

| 前事業年度<br>（平成21年3月31日現在）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 当事業年度<br>（平成22年3月31日現在） |           |      |             |      |           |        |          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |    |           |      |             |      |           |        |          |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------|------|-------------|------|-----------|--------|----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|-----------|------|-------------|------|-----------|--------|----------|
| <p>※1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table> <tr> <td>建物</td><td>776,838千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>1,691,069千円</td></tr> <tr> <td>投資建物</td><td>675,647千円</td></tr> <tr> <td>投資器具備品</td><td>26,929千円</td></tr> </table> <p>※2 関係会社項目<br/>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。<br/>未払金 1,848,998千円</p> <p>※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。</p> <p>4 保証債務<br/>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。</p> | 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 | <p>※1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table> <tr> <td>建物</td><td>815,365千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>1,938,369千円</td></tr> <tr> <td>投資建物</td><td>688,305千円</td></tr> <tr> <td>投資器具備品</td><td>27,339千円</td></tr> </table> <p>※2 関係会社項目<br/>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。<br/>未払金 3,002,391千円</p> <p>※3 同左</p> <p>4 保証債務<br/>子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。</p> | 建物 | 815,365千円 | 器具備品 | 1,938,369千円 | 投資建物 | 688,305千円 | 投資器具備品 | 27,339千円 |
| 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                |           |      |             |      |           |        |          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 建物                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 815,365千円               |           |      |             |      |           |        |          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 器具備品                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 1,938,369千円             |           |      |             |      |           |        |          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 投資建物                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 688,305千円               |           |      |             |      |           |        |          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 投資器具備品                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 27,339千円                |           |      |             |      |           |        |          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |    |           |      |             |      |           |        |          |

## (損益計算書関係)

| 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日)                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>※1 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>固定資産除却損</p> <p>器具備品 11,886千円</p> <p>-----</p> <p>※2 貸倒引当金繰入額に関する注記</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>-----</p> <p>※4 特別損失の「その他」の主な内訳</p> <p>受益証券予備券廃棄損 21,160千円</p> <p>ゴルフ会員権評価損 19,403千円</p> | <p>※1 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>固定資産除却損</p> <p>器具備品 1,439千円</p> <p>ソフトウェア 14,793千円</p> <p>-----</p> <p>※3 減損損失に関する注記</p> <p>当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。</p> <p>場所 千葉県浦安市</p> <p>用途 賃貸等不動産（浦安寮）</p> <p>種類 建物及び土地</p> <p>当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグルーピングとしております。</p> <p>浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,450千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物7,750千円及び土地68,700千円であります。</p> <p>なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。</p> <p>-----</p> |

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成20年6月20日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 8,555                  | 3,280               | 平成20年<br>3月31日 | 平成20年<br>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

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成21年6月19日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 6,495                  | 2,490               | 平成21年<br>3月31日 | 平成21年<br>6月22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22年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

- ①剰余金の配当の総額 11,216百万円
- ②配当の原資 利益剰余金
- ③1株当たり配当額 4,300円
- ④基準日 平成22年3月31日

⑤効力発生日

平成22年6月28日

(リース取引関係)

| 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日) |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|---------|------------|---------|---------|-------|------|-------|-----|------|----|-------|--------|---------|----------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|-------|----------|-------|
| <p>(借主側)<br/>リース取引開始日が平成20年3月31日以前の<br/>所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額<br/>相当額及び期末残高相当額</p> <p style="text-align: right;">器具備品</p> <table> <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>3,613千円</td></tr> <tr> <td>期末残高相当額</td><td>985千円</td></tr> </table> <p>なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残<br/>高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低<br/>いため、支払利子込み法により算定しております。</p> <p>(2)未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <tr> <td>1年以内</td><td>985千円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>- 千円</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>985千円</td></tr> </table> <p>なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過<br/>リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に<br/>占める割合が低いため、支払利子込み法により算<br/>定しております。</p> <p>(3)支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table> <tr> <td>支払リース料</td><td>1,314千円</td></tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td><td>1,314千円</td></tr> </table> <p>(4)減価償却費相当額の算定方法</p> <p>リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とす<br/>る定額法によっております。</p> | 取得価額相当額                                | 4,599千円 | 減価償却累計額相当額 | 3,613千円 | 期末残高相当額 | 985千円 | 1年以内 | 985千円 | 1年超 | - 千円 | 合計 | 985千円 | 支払リース料 | 1,314千円 | 減価償却費相当額 | 1,314千円 | <p>(借主側)<br/>リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所<br/>有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額<br/>相当額及び期末残高相当額</p> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p>(2)未経過リース料期末残高相当額</p> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p>(3)支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table> <tr> <td>支払リース料</td><td>985千円</td></tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td><td>985千円</td></tr> </table> <p>(4)減価償却費相当額の算定方法</p> <p style="text-align: center;">同左</p> | 支払リース料 | 985千円 | 減価償却費相当額 | 985千円 |
| 取得価額相当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 4,599千円                                |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 減価償却累計額相当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 3,613千円                                |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 期末残高相当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 985千円                                  |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 1年以内                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 985千円                                  |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 1年超                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | - 千円                                   |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 合計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 985千円                                  |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 支払リース料                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 1,314千円                                |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 減価償却費相当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 1,314千円                                |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 支払リース料                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 985千円                                  |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |
| 減価償却費相当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 985千円                                  |         |            |         |         |       |      |       |     |      |    |       |        |         |          |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |        |       |          |       |

(金融商品関係)

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託され  
ており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられて  
いるためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式、債券であり

ます。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。債券は外貨建資産担保債券を保有しており、発行体の信用リスク及び為替変動リスクに晒されております。

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

デリバティブ取引は為替予約及び株式先物取引を行っております。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。このうち株式先物取引についてはヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5. ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### ①市場リスクの管理

##### (i) 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っており、外貨建資産担保債券について為替予約を利用してヘッジしております。

##### (ii) 価格変動リスクの管理

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

##### (iii) デリバティブ取引

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

#### ②信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（＜注2＞参照のこと）。

(単位：千円)

|                             | 貸借対照表 計上<br>額 | 時価         | 差額 |
|-----------------------------|---------------|------------|----|
| (1) 現金・預金                   | 4,783,803     | 4,783,803  | —  |
| (2) 未収委託者報酬                 | 7,030,430     | 7,030,430  | —  |
| (3) 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券 | 34,012,542    | 34,012,542 | —  |
| 資産計                         | 45,826,776    | 45,826,776 | —  |
| (1) 未払手数料                   | 3,847,895     | 3,847,895  | —  |
| (2) その他未払金                  | 3,164,277     | 3,164,277  | —  |
| (3) 未払費用（*1）                | 1,696,832     | 1,696,832  | —  |
| 負債計                         | 8,709,004     | 8,709,004  | —  |
| デリバティブ取引（*2）                |               |            |    |
| ①ヘッジ会計が適用されていないもの           | (7,985)       | (7,985)    | —  |
| ②ヘッジ会計が適用されているもの            | (159,516)     | (159,516)  | —  |
| デリバティブ取引計                   | (167,501)     | (167,501)  | —  |

（\*1）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（\*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

#### <注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

##### 資 産

##### （1）現金・預金、及び（2）未収委託者報酬

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

##### （3）有価証券及び投資有価証券

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

##### 負 債

##### （1）未払手数料、（2）その他未払金、並びに（3）未払費用

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

##### デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

#### <注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

| 区分          | 貸借対照表計上額 |
|-------------|----------|
| (1) その他有価証券 |          |

|                   |           |
|-------------------|-----------|
| 外貨建資産担保債券（*1）     | 311,905   |
| 非上場株式             | 1,172,137 |
| (2) 子会社株式及び関連会社株式 |           |
| 子会社株式             | 737,012   |
| (3) 長期差入保証金       | 617,615   |

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

（\*1）外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

|                       | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|-----------------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金                 | 4,783,803  | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬               | 7,030,430  | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券          |            |             |              |      |
| その他有価証券のうち満期<br>があるもの | -          | 746,330     | 1,547,596    | -    |
| 合計                    | 11,814,233 | 746,330     | 1,547,596    | -    |

外貨建資産担保債券311,905千円は清算事象が生じており、償還予定額を見込めないため上記表には含めておりません。

（追加情報）

当事業年度より、平成20年3月10日公表の「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第10号）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第19号）を適用しております。

（有価証券関係）

前事業年度（平成21年3月31日現在）

1. その他有価証券で時価のあるもの

|                          | 取得原価<br>（千円） | 貸借対照表計上額<br>（千円） | 差額<br>（千円） |
|--------------------------|--------------|------------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの  |              |                  |            |
| (1)株式                    | 55,101       | 67,520           | 12,418     |
| (2)その他                   |              |                  |            |
| 証券投資信託の受益証券              | 1,732,000    | 1,815,427        | 83,427     |
| 小計                       | 1,787,101    | 1,882,948        | 95,846     |
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えないもの |              |                  |            |
| その他                      |              |                  |            |
| 証券投資信託の受益証券              | 3,766,074    | 2,627,319        | △1,138,755 |

|    |           |           |            |
|----|-----------|-----------|------------|
| 小計 | 3,766,074 | 2,627,319 | △1,138,755 |
| 合計 | 5,553,176 | 4,510,267 | △1,042,909 |

## 2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

|             | 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日) |
|-------------|----------------------------------------|
| 売却額（千円）     | 190,340                                |
| 売却益の合計額（千円） | 2,157                                  |
| 売却損の合計額（千円） | 2,298                                  |

## 3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

|                        | 貸借対照表計上額<br>(千円) |
|------------------------|------------------|
| 子会社株式及び関連会社株式<br>子会社株式 | 737,012          |
| 小計                     | 737,012          |
| その他有価証券<br>非上場株式       | 1,172,137        |
| 外貨建資産担保債券              | 2,098,103        |
| MMF・中期国債ファンド           | 28,233,112       |
| 小計                     | 31,503,352       |
| 合計                     | 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

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

当事業年度（平成22年3月31日現在）

### 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（貸借対照表計上額 737,012千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

### 2. その他有価証券

|                                  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|----------------------------------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの<br>(1)株式 | 76,077           | 55,101       | 20,975     |

|                                                |            |            |          |
|------------------------------------------------|------------|------------|----------|
| (2)その他<br>証券投資信託の受益証券                          | 4,728,727  | 4,379,317  | 349,410  |
| 小計                                             | 4,804,805  | 4,434,419  | 370,385  |
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えないもの<br>その他<br>証券投資信託の受益証券 | 29,207,737 | 29,608,576 | △400,839 |
| 小計                                             | 29,207,737 | 29,608,576 | △400,839 |
| 合計                                             | 34,012,542 | 34,042,996 | △30,453  |

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,172,137千円）、外貨建資産担保債券（貸借対照表計上額（貸倒引当金控除前） 1,804,069千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

| 種類                 | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|
| その他<br>証券投資信託の受益証券 | 13,871,201  | 213,196         | 263,840         |
| 合計                 | 13,871,201  | 213,196         | 263,840         |

(デリバティブ取引関係)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

#### 1. 取引の状況に関する事項

| 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>(1) 取引の内容及び利用目的<br/>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。</p> <p>(2) 取引に対する取組方針<br/>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。</p> <p>(3) 取引に係るリスクの内容<br/>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。</p> <p>(4) 取引に係るリスク管理体制<br/>為替予約取引開始にあたっては、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。<br/>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。</p> |

#### 2. 取引の時価等に関する事項（平成21年3月31日現在）

## 通貨関連

(単位：千

円)

| 区分            | デリバティブ<br>取引の種類         | 契約額等    |           | 時価     | 評価損益   |
|---------------|-------------------------|---------|-----------|--------|--------|
|               |                         |         | うち1<br>年超 |        |        |
| 市場取引<br>以外の取引 | 為替予約<br>取引<br>売建<br>米ドル | 410,852 | —         | △1,622 | △1,622 |
| 合計            |                         | 410,852 | —         | △1,622 | △1,622 |

(注) 時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

## 通貨関連

(単位：千円)

| 区分            | デリバティブ<br>取引の種類等    | 契約額等    |       | 時価     | 評価損益   |
|---------------|---------------------|---------|-------|--------|--------|
|               |                     |         | うち1年超 |        |        |
| 市場取引<br>以外の取引 | 為替予約取引<br>売建<br>米ドル | 280,388 | —     | △7,985 | △7,985 |
| 合計            |                     | 280,388 | —     | △7,985 | △7,985 |

(注) 時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

## 株式関連

(単位：千円)

| ヘッジ会<br>計の方法 | デリバティブ<br>取引の種類等        | 主な<br>ヘッジ<br>対象 | 契約額等      |       | 時価       | 当該時価の<br>算定方法                       |
|--------------|-------------------------|-----------------|-----------|-------|----------|-------------------------------------|
|              |                         |                 |           | うち1年超 |          |                                     |
| 繰延ヘッ<br>ジ処理  | 株価指数先物取引<br>売建<br>TOPIX | 投資<br>有価証券      | 2,303,784 | —     | △159,516 | 東京証券取引所<br>から公表された<br>価格によってい<br>る。 |
| 合計           |                         |                 | 2,303,784 | —     | △159,516 |                                     |

(退職給付関係)

| 前事業年度<br>(平成21年3月31日現在)                                                                                                                                                                                                                                               | 当事業年度<br>(平成22年3月31日現在)                                                                                                                                                                                                             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 採用している退職給付制度の概要<br/>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。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項<br/>退職給付債務 1,150,011千円<br/>退職給付引当金 1,150,011千円</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項<br/>勤務費用 168,703千円<br/>その他 141,642千円<br/>退職給付費用 310,345千円<br/>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。</p> | <p>1. 採用している退職給付制度の概要<br/>同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項<br/>退職給付債務 1,179,482千円<br/>退職給付引当金 1,179,482千円</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項<br/>勤務費用 175,249千円<br/>その他 128,723千円<br/>退職給付費用 303,972千円<br/>なお、「その他」の128,723千円は、確定拠出年金への掛金支払額であります。</p> |

(税効果会計関係)

| 前事業年度<br>(平成21年3月31日現在)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 当事業年度<br>(平成22年3月31日現在)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>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</p> <p>繰延税金資産 千円</p> <p>減損損失 886,012</p> <p>貸倒引当金 708,034</p> <p>退職給付引当金 467,939</p> <p>その他有価証券評価差額金 424,359</p> <p>投資有価証券評価損 303,843</p> <p>株式譲渡損繰延 287,965</p> <p>出資金評価損 126,163</p> <p>未払事業税 108,049</p> <p>賞与引当金 90,738</p> <p>器具備品 38,093</p> <p>役員退職慰労引当金 25,439</p> <p>未払社会保険料 11,283</p> <p>その他 31,981</p> <p>繰延税金資産小計 3,509,905</p> <p>評価性引当額 △2,210,636</p> <p>繰延税金資産合計 1,299,269</p> <p>繰延税金負債</p> <p>株式譲渡益繰延 2,837,113</p> <p>その他 2,156</p> <p>繰延税金負債合計 2,839,269</p> <p>繰延税金負債の純額 1,540,000</p> | <p>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</p> <p>繰延税金資産 千円</p> <p>減損損失 915,392</p> <p>貸倒引当金 609,077</p> <p>退職給付引当金 479,931</p> <p>賞与引当金 302,163</p> <p>株式譲渡損繰延 287,965</p> <p>投資有価証券評価損 225,062</p> <p>外貨建有価証券換算差額 176,654</p> <p>未払事業税 163,956</p> <p>出資金評価損 126,163</p> <p>その他有価証券評価差額金 65,652</p> <p>未払社会保険料 44,836</p> <p>繰延ヘッジ損益 38,221</p> <p>器具備品 38,093</p> <p>役員退職慰労引当金 15,991</p> <p>その他 27,316</p> <p>繰延税金資産小計 3,516,480</p> <p>評価性引当額 △2,139,543</p> <p>繰延税金資産合計 1,376,937</p> <p>繰延税金負債</p> <p>株式譲渡益繰延 2,772,301</p> <p>その他 2,156</p> <p>繰延税金負債合計 2,774,458</p> <p>繰延税金負債の純額 1,397,521</p> |

|                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                               |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>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</p> <p>法定実効税率<br/>(調整) 40.69%</p> <p>交際費等永久に損金に算入されない項目 0.35</p> <p>受取配当金等永久に益金に算入されない項目 △0.13</p> <p>住民税均等割 0.03</p> <p>評価性引当額 2.32</p> <p>その他 △0.74</p> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 42.52</p> | <p>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</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p> |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## (関連当事者情報)

前事業年度（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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(千円) | 科目 | 期末残高<br>(千円) |
|-----|-------------------------------------------|-----------|-------------------|---------|---------------------------|-----------|-------|--------------|----|--------------|
| 子会社 | Daiwa Asset Management<br>(Singapore)Ltd. | Singapore | 133               | 金融商品取引業 | (所有)直接<br>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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係       | 取引の内容        | 取引金額<br>(千円) | 科目    | 期末残高<br>(千円) |
|-------------|-----------------------------|---------|-------------------|---------|---------------------------|-----------------|--------------|--------------|-------|--------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券<br>(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<br>エスエム<br>ピーシー<br>(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）

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

### 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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(千円) | 科目 | 期末残高<br>(千円) |
|-----|----------------------------------------|-----------|-------------------|---------|-----------------------|-----------|-------|--------------|----|--------------|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd. | Singapore | 133               | 金融商品取引業 | (所有)直接100.0           | 経営管理      | 債務保証  | 598,500      | —  | —            |

(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             | 住所      | 資本金または出資金<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係       | 取引の内容        | 取引金額<br>(千円) | 科目    | 期末残高<br>(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 | 22,043,473   | 未払手数料 | 2,870,857    |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券キャピタル・マーケット(株) | 東京都千代田区 | 255,700            | 金融商品取引業 | —                     | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料 | 676,687      | 未払手数料 | 64,597       |
|             |                    |         |                    |         |                       |                 | 為替予約         | 3,946,508    | —     | —            |

(注) 1. 上記金額のうち、証券投資信託の代行手数料の取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として、代行手数料を支払っております。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. 大和証券エスエムビーシー(株)は、平成22年1月1日付で、大和証券キャピタル・マーケット(株)に商号変更しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

| 前事業年度<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日)                                                            | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日)             |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 14,907.00円<br>1株当たり当期純利益 2,496.95円<br>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。 | 1株当たり純資産額 14,895.63円<br>1株当たり当期純利益 2,269.77円<br>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<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日) |
|-----------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 当期純利益（千円）       | 6,513,363                              | 5,920,777                              |
| 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<br>(自 平成20年4月1日<br>至 平成21年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日) |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 該当事項はありません。                            | 同左                                     |

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5 【その他】

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

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

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼ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 342,037百万円（平成22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 26,140百万円（平成22年3月末日現在）
- 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REIT・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 448千米ドル（約41百万円）（平成21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22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11月20日 | 臨時報告書                               |
| 平成22年1月22日  | 臨時報告書                               |
| 平成22年2月4日   | 有価証券報告書（第5特定期間）・同添付書類、有価証券届出書の訂正届出書 |
| 平成22年3月23日  | 臨時報告書                               |

## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月18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11月11日から平成22年5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22年5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22年6月25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22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。

## 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（前期）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。