

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成24年9月12日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 白川 真

【本店の所在の場所】 東京都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 本店の所在の場所に同じ

【電話番号】 03-5695-2111

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 DCダイワ・ターゲットイヤー2040

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 継続申込期間（平成24年3月13日から平成25年3月11日まで）
10兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成24年3月12日付で提出した「DCダイワ・ターゲットイヤー2040」有価証券届出書（以下「原有有価証券届出書」）の記載事項を、半期報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

（ 下線部____は訂正部分を示します。）

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

< 略 >

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 資産配分変更型(株式、債券、不動産投信)))
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル(含む日本)
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

(注1) 商品分類の定義

< 略 >

< ファンドの特色 >

1 < 略 >

< 略 >

< 2011年12月時点の基本配分比率 >

	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	46%	30%	7%	6%	6%	5%

< 略 >

ファンドの基本配分比率のイメージ

< 略 >

(注1) 2011年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2010年以前は過去の基本配分比率を示しています。

< 略 >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

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 資産配分変更型（株式、債券、不動産投信）））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

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

（注1）商品分類の定義

< 略 >

< ファンドの特色 >

1 < 略 >

< 略 >

< 2012年6月時点の基本配分比率 >

	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	45%	30%	7%	6%	6%	6%

< 略 >

ファンドの基本配分比率のイメージ

< 略 >

（注1）2012年6月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2011年以前は過去の基本配分比率を示しています。

< 略 >

< 略 >

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

受託会社	住友信託銀行 株式会社 (4) 再信託受託会社： 日本トラスティ・ サービス信託銀行株 式会社	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ない ます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ ・サービス信託銀行株式会社に委託することがで きます。また、外国における資産の保管は、その業務 を行なうに十分な能力を有すると認められる外国 の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 　　　　　　　　など
------	--	---

< 略 >

3：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。

4：関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセツト信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

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23年12月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

受託会社	三井住友信託銀行 株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・ サービス信託銀行株 式会社	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ない ます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ ・サービス信託銀行株式会社に委託することがで きます。また、外国における資産の保管は、その業務 を行なうに十分な能力を有すると認められる外国 の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 　　　　　　　　など
------	--	---

< 略 >

3：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24年6月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

< 訂正前 >

< 略 >

委託会社は、信託金を、主として、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。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

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

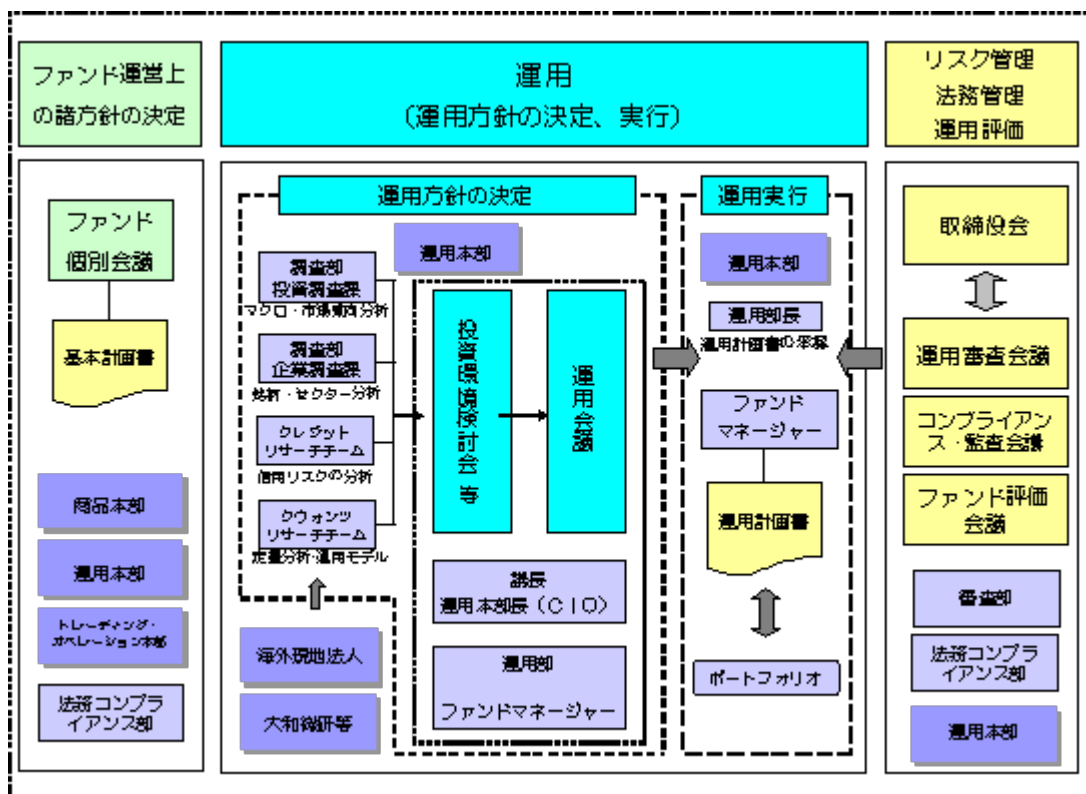
< 略 >

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

運用体制

< 略 >



運用方針の決定にかかる過程

< 略 >

ロ．投資環境の検討

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

< 略 >

職務権限

< 略 >

イ．運用本部長（C I O）（1名）

< 略 >

ロ．運用副本部長（1～5名程度）

< 略 >

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

< 略 >

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。

受託会社に対する管理体制

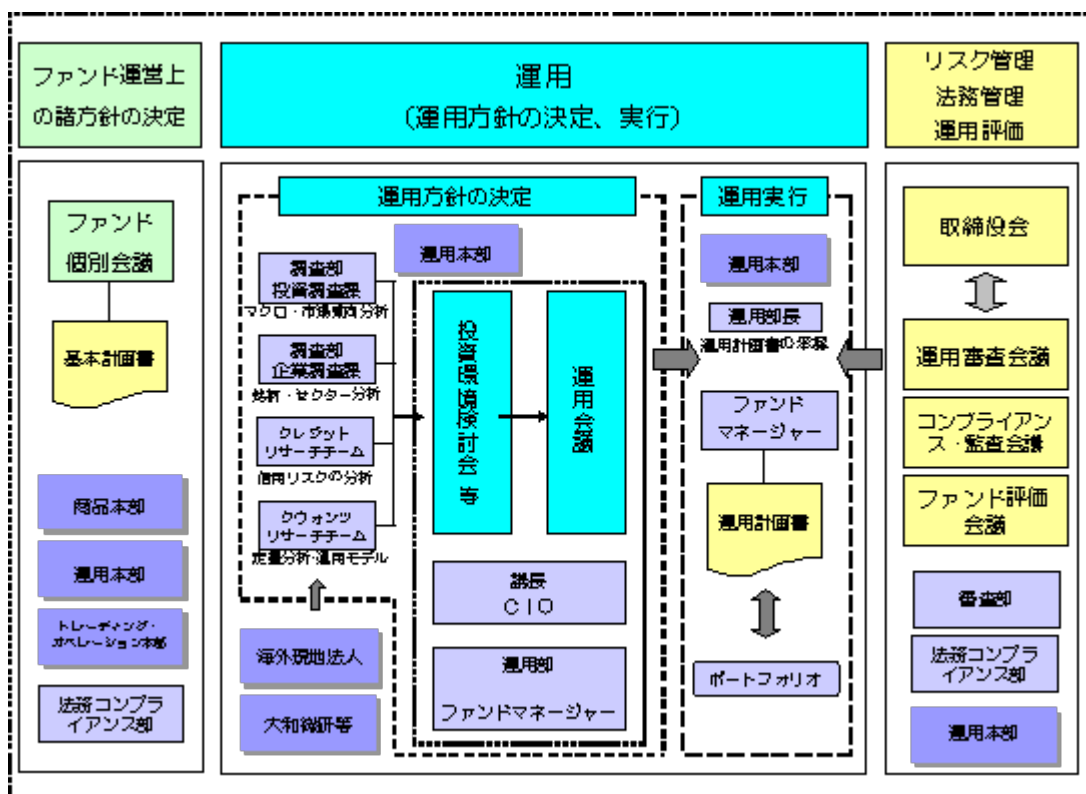
< 略 >

上記の運用体制は平成23年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

< 訂正後 >

運用体制

< 略 >



運用方針の決定にかかる過程

< 略 >

ロ．投資環境の検討

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

< 略 >

職務権限

< 略 >

イ．C I O (Chief Investment Officer) (1名)

< 略 >

ロ．インベストメント・オフィサー (1~5名程度)

< 略 >

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

< 略 >

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25~35名程度です。

受託会社に対する管理体制

< 略 >

上記の運用体制は平成24年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

< 略 >

() 上記は、平成23年12月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

() 上記は、平成24年6月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

(1) 【投資状況】（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,396,642	99.87
内 日本	3,396,642	99.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,278	0.13
純資産総額	3,400,920	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（平成24年6月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	3,671,527	0.4318 1,585,564	0.4281 1,571,780	46.22
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,141,917	0.8843 1,009,822	0.8637 986,273	29.00
3	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	217,317	1.0410 226,235	1.1183 243,025	7.15
4	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザー ファンド	日本	親投資信託 受益証券	195,663	0.9694 189,689	1.0265 200,848	5.91
5	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）	日本	親投資信託 受益証券	174,759	1.1278 197,103	1.1414 199,469	5.87
6	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	110,328	1.8118 199,896	1.7697 195,247	5.74

(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	99.87%
合計	99.87%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年12月18日)	681,848	681,848	0.6054	0.6054
第2計算期間末 (平成21年12月18日)	1,176,672	1,176,672	0.6991	0.6991
第3計算期間末 (平成22年12月20日)	952,605	952,605	0.7319	0.7319
平成23年6月末日	1,227,906	-	0.7280	-
7月末日	1,200,201	-	0.7116	-
8月末日	1,233,376	-	0.6600	-
9月末日	1,256,083	-	0.6401	-
10月末日	1,316,109	-	0.6707	-
11月末日	1,360,550	-	0.6324	-
第4計算期間末 (平成23年12月19日)	1,354,908	1,354,908	0.6293	0.6293
12月末日	1,462,446	-	0.6416	-
平成24年1月末日	1,506,919	-	0.6611	-
2月末日	1,743,924	-	0.7270	-
3月末日	3,513,988	-	0.7470	-
4月末日	3,319,372	-	0.7222	-
5月末日	3,258,468	-	0.6570	-
6月末日	3,400,920	-	0.6858	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
平成23年12月20日～ 平成24年6月19日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	39.5
第2計算期間	15.5
第3計算期間	4.7
第4計算期間	14.0
平成23年12月20日～ 平成24年6月19日	6.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	126,328	0
第2計算期間	556,781	0
第3計算期間	701,153	1,082,781
第4計算期間	974,376	122,837
平成23年12月20日～ 平成24年6月19日	2,931,902	125,661

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	86,224,731,430	96.99
内 日本	86,224,731,430	96.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,677,128,460	3.01
純資産総額	88,901,859,890	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(%)
株価指数先物取引（買建）	2,553,080,000	2.87
内 日本	2,553,080,000	2.87

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該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います。

(2) 投資資産（平成24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,063,400	2,685.27 2,855,522,762	3,190.00 3,392,246,000	3.82
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,125,900	335.24 2,053,707,292	378.00 2,315,590,200	2.60
3	本田技研	日本	株式	輸送用機器	691,600	2,374.98 1,642,536,651	2,749.00 1,901,208,400	2.14
4	キヤノン	日本	株式	電気機器	509,000	3,378.33 1,719,573,077	3,165.00 1,610,985,000	1.81
5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	614,600	2,126.64 1,307,037,697	2,612.00 1,605,335,200	1.81
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	10,406,300	112.82 1,174,058,153	134.00 1,394,444,200	1.57
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	373,300	3,758.12 1,402,906,366	3,700.00 1,381,210,000	1.55
8	武田薬品	日本	株式	医薬品	321,000	3,653.98 1,172,929,267	3,615.00 1,160,415,000	1.31
9	ファナック	日本	株式	電気機器	85,500	11,176.01 955,549,611	12,950.00 1,107,225,000	1.25
10	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	366,100	2,699.02 988,112,095	2,953.00 1,081,093,300	1.22
11	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	408,400	1,853.97 757,163,847	2,361.00 964,232,400	1.08
12	三菱商事	日本	株式	卸売業	588,700	1,737.64 1,022,950,475	1,596.00 939,565,200	1.06
13	日立	日本	株式	電気機器	1,886,000	392.54 740,336,320	487.00 918,482,000	1.03
14	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	6,662	146,041.53 972,928,707	132,700.00 884,047,400	0.99
15	三井物産	日本	株式	卸売業	697,400	1,273.53 888,164,242	1,174.00 818,747,600	0.92
16	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	338,100	2,153.56 728,119,762	2,397.00 810,425,700	0.91
17	三菱地所	日本	株式	不動産業	565,000	1,236.32 698,525,760	1,418.00 801,170,000	0.90
18	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	1,044,200	666.25 695,707,222	748.00 781,061,600	0.88
19	小松製作所	日本	株式	機械	400,200	1,736.74 695,047,097	1,878.00 751,575,600	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	141,500	4,558.72 645,059,572	5,000.00 707,500,000	0.80
21	信越化学	日本	株式	化学	154,000	3,907.80 601,801,836	4,360.00 671,440,000	0.76
22	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	190,600	2,897.43 552,250,186	3,465.00 660,429,000	0.74

23	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,252	622,732.95 779,661,664	513,000.00 642,276,000	0.72
24	東京海上HD	日本	株式	保険業	307,900	1,902.53 585,790,079	1,986.00 611,489,400	0.69
25	パナソニック	日本	株式	電気機器	930,300	751.47 699,100,375	643.00 598,182,900	0.67
26	ソニー	日本	株式	電気機器	509,200	1,529.04 778,592,048	1,123.00 571,831,600	0.64
27	三井不動産	日本	株式	不動産業	358,000	1,209.19 432,890,260	1,530.00 547,740,000	0.62
28	デンソー	日本	株式	輸送用機器	201,900	2,424.05 489,416,726	2,693.00 543,716,700	0.61
29	三菱電機	日本	株式	電気機器	817,000	685.56 560,110,330	660.00 539,220,000	0.61
30	伊藤忠	日本	株式	卸売業	648,100	815.17 528,317,768	832.00 539,219,200	0.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.99%
合計	96.99%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.64%
建設業	2.43%
食料品	3.83%
繊維製品	0.88%
パルプ・紙	0.33%
化学	5.61%
医薬品	5.04%
石油・石炭製品	0.74%
ゴム製品	0.78%
ガラス・土石製品	0.97%
鉄鋼	1.60%
非鉄金属	1.09%
金属製品	0.68%
機械	4.81%
電気機器	12.46%
輸送用機器	10.25%
精密機器	1.42%
その他製品	1.45%
電気・ガス業	2.80%
陸運業	3.98%
海運業	0.38%
空運業	0.28%

倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.49%
卸売業	5.33%
小売業	4.24%
銀行業	9.53%
証券、商品先物取引業	1.07%
保険業	2.22%
その他金融業	0.83%
不動産業	2.59%
サービス業	1.93%
合計	96.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2012年9月	買建	332	2,389,404,7172	553,080,000	2.87%

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該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います。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		44,785,720,778	96.34
	内 香港	606,889,941	1.31
	内 シンガポール	370,475,380	0.80
	内 イスラエル	123,550,350	0.27
	内 ノルウェー	184,037,855	0.40
	内 スウェーデン	633,431,819	1.36
	内 デンマーク	235,954,426	0.51
	内 イギリス	4,805,153,157	10.34
	内 アイルランド	60,735,270	0.13
	内 オランダ	480,722,843	1.03
	内 ベルギー	225,465,995	0.48
	内 フランス	1,788,995,201	3.85
	内 ドイツ	1,619,783,482	3.48
	内 スイス	1,774,076,958	3.82

	内 ポルトガル	34,612,990	0.07
	内 スペイン	536,652,066	1.15
	内 イタリア	431,608,112	0.93
	内 フィンランド	145,925,402	0.31
	内 オーストリア	52,491,911	0.11
	内 ギリシャ	9,299,136	0.02
	内 カナダ	2,495,004,529	5.37
	内 アメリカ	26,483,945,724	56.97
	内 オーストラリア	1,669,647,979	3.59
	内 ニュージーランド	17,260,252	0.04
投資証券		1,004,946,741	2.16
	内 香港	23,142,168	0.05
	内 シンガポール	9,274,225	0.02
	内 イギリス	59,123,111	0.13
	内 オランダ	5,727,313	0.01
	内 フランス	58,717,864	0.13
	内 アメリカ	709,433,977	1.53
	内 オーストラリア	139,528,083	0.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		698,452,957	1.50
純資産総額		46,489,120,476	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(%)
株価指数先物取引（買建）	681,717,036	1.47
内 アメリカ	681,717,036	1.47
為替予約取引（買建）	79,300,000	0.17
内 日本	79,300,000	0.17

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該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います。

(注4) 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24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	25,700 779,288,536	30,322.43	45,131.35 1,159,875,836	2.49
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	130,655 798,776,467	6,113.61	6,590.66 861,102,813	1.85

3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	206,100 408,668,806	1,982.82 14,367.87	2,372.16 488,902,609	1.05
4	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	31,800 456,899,763	1,196.47 2,236.14	1,602.06 463,476,537	1.04
5	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	289,300 346,154,681	2,236.14 7,737.08	2,806.78 448,163,225	0.99
6	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	163,195 364,927,810	4,174.54 7,737.08	4,599.64 428,227,368	0.96
7	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	54,618 422,588,410	4,981.77 1,542.34	5,309.01 398,175,855	0.86
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	93,100 388,652,043	1,542.34 4,953.46	1,786.85 369,812,726	0.80
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	75,000 373,637,888	4,953.46 1,930.32	4,781.59 364,056,672	0.78
10	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	206,963 319,209,751	1,930.32 5,257.22	2,575.98 334,609,445	0.76
11	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	76,137 377,145,271	5,905.42 46,277.46	6,790.52 319,833,596	0.69
12	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	136,972 264,406,300	7,100 328,570,147	44,755.42 317,763,525	0.68
13	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	504,800 302,826,059	209.05 288,402,914	222.60 307,086,260	0.66
14	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	55,100 289,676,333	2,301.02 4,014.97	2,845.64 298,849,407	0.64
15	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	47,100 278,145,404	4,014.97 1,872.90	4,336.57 285,346,800	0.61
16	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	7,100 328,570,147	1,872.90 255,662,090	2,048.57 279,630,801	0.60
17	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	1,379,537 288,402,914	4,613.46 233,902,559	5,416.87 274,635,461	0.59
18	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	105,020 241,653,700	2,928.91 229,627,353	3,487.26 273,401,239	0.59
19	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	65,800 264,189,909	540.12 290,643,368	507.74 273,167,821	0.59
20	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	136,500 255,662,090	2,633.90 271,040,075	2,613.83 268,963,889	0.58
21	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	生活必需品	50,700 233,902,559	11,669.95 232,816,370	13,392.00 267,170,580	0.57
22	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	78,400 229,627,353	2,744.83 225,961,152	3,226.33 265,594,778	0.57
23	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	538,000 290,643,368			
24	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	イギリス	株式	エネルギー	102,900 271,040,075			
25	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,950 232,816,370			
26	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	82,321 225,961,152			

27	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	143,402 241,752,522	1,685.75 1,780.31	255,300,760	0.55
28	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	108,083 253,845,322	2,348.60 2,234.16	241,475,007	0.52
29	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	42,300 213,903,194	5,056.80 5,519.97	233,494,985	0.50
30	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	株式	素材	89,500 250,028,529	2,793.56 2,447.64	219,064,183	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.34%
投資証券	2.16%
合計	98.50%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	11.26%
素材	6.69%
資本財・サービス	9.75%
一般消費財・サービス	9.78%
生活必需品	11.38%
ヘルスケア	10.97%
金融	16.14%
情報技術	12.43%
電気通信サービス	4.16%
公益事業	3.77%
その他	0.00%
合計	96.34%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2012年9月	買建	26	681,332,977	681,717,036	1.47%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2012年7月	買建	1,000,000	79,465,000	79,300,000	0.17%

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該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います。

(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。

(注4) 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マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	21,342,248,270	97.81
内 日本	21,342,248,270	97.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	477,262,333	2.19
純資産総額	21,819,510,603	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	3,745 2,995,824,222	799,953.06	771,000.00 2,887,395,000	13.23
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	3,354 2,587,827,129	771,564.43	731,000.00 2,451,774,000	11.24
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	11,487 1,427,653,756	124,284.30	126,500.00 1,453,105,500	6.66
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	12,851 1,208,903,392	94,070.76	85,900.00 1,103,900,900	5.06
5	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	6,720 1,028,448,667	153,042.95	154,900.00 1,040,928,000	4.77
6	森トラスト総合リート	日本	投資証券	1,479 1,142,795,950	772,681.50	699,000.00 1,033,821,000	4.74
7	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	4,368 1,039,881,265	238,068.05	224,200.00 979,305,600	4.49
8	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	1,864 893,831,061	479,523.10	449,500.00 837,868,000	3.84
9	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	1,185 793,900,469	669,958.20	640,000.00 758,400,000	3.48
10	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	904 638,345,141	706,134.00	707,000.00 639,128,000	2.93
11	オリックス不動産投資	日本	投資証券	1,738 669,086,260	384,974.83	358,000.00 622,204,000	2.85
12	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	1,190 623,608,298	524,040.58	517,000.00 615,230,000	2.82
13	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	981 520,462,861	530,543.18	557,000.00 546,417,000	2.50

14	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,418 529,543,533	219,000.63 210,100.00	508,021,800	2.33
15	森ヒルズリート	日本	投資証券	1,414 421,683,166	298,220.06 344,000.00	486,416,000	2.23
16	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	1,153 471,743,217	409,144.16 397,000.00	457,741,000	2.10
17	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	1,751 513,533,852	293,280.32 257,300.00	450,532,300	2.06
18	産業ファンド	日本	投資証券	859 382,537,986	445,329.43 515,000.00	442,385,000	2.03
19	トップリート投資法人	日本	投資証券	947 432,982,951	457,215.36 445,500.00	421,888,500	1.93
20	福岡リート投資法人	日本	投資証券	752 409,118,052	544,039.96 549,000.00	412,848,000	1.89
21	東急リアル・エステート	日本	投資証券	1,035 461,546,690	445,938.83 391,000.00	404,685,000	1.85
22	野村不レジデンシャル	日本	投資証券	922 367,939,151	399,066.32 409,000.00	377,098,000	1.73
23	プレミア投資法人	日本	投資証券	1,202 377,027,146	313,666.51 279,900.00	336,439,800	1.54
24	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	8,131 310,448,042	38,180.79 38,050.00	309,384,550	1.42
25	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	592 351,662,019	594,023.68 517,000.00	306,064,000	1.40
26	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	11,359 214,270,535	18,863.50 21,250.00	241,378,750	1.11
27	積水ハウス・S I 投資法人	日本	投資証券	703 243,913,113	346,960.33 338,500.00	237,965,500	1.09
28	M I Dリート投資法人	日本	投資証券	1,122 241,841,175	215,544.71 201,700.00	226,307,400	1.04
29	平和不動産リート	日本	投資証券	4,252 193,660,670	45,545.78 46,400.00	197,292,800	0.90
30	いちご不動産投資法人	日本	投資証券	5,149 185,431,691	36,013.14 36,650.00	188,710,850	0.86

(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	97.81%
合計	97.81%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	550,806,345	98.10
内 香港	10,386,689	1.85
内 シンガポール	19,014,525	3.39
内 イスラエル	126,004	0.02
内 イギリス	32,424,187	5.77
内 オランダ	6,887,524	1.23
内 ベルギー	3,081,147	0.55
内 フランス	25,495,730	4.54
内 ドイツ	805,284	0.14
内 イタリア	423,347	0.08
内 カナダ	16,868,787	3.00
内 アメリカ	369,953,788	65.89
内 オーストラリア	63,425,681	11.30
内 ニュージーランド	1,913,652	0.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,678,068	1.90
純資産総額	561,484,413	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）	1,744,600	0.31
内 日本	1,744,600	0.31
為替予約取引（売建）	955,440	0.17
内 日本	955,440	0.17

(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24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面 金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
-----	----	----	--------------------------	-----------------------	-------------------	-----------------

1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	3,447 9,504.51 32,762,204	12,031.32 41,471,984	7.39
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	1,600 10,041.43 16,066,303	11,180.33 17,888,529	3.19
3	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	投資証券	23,400 641.97 15,022,309	755.87 17,687,557	3.15
4	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	3,400 4,195.49 14,264,697	4,800.63 16,322,157	2.91
5	HCP INC	アメリカ	投資証券	4,700 2,926.53 13,754,813	3,434.12 16,140,378	2.87
6	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	3,279 3,991.67 13,088,693	4,905.32 16,084,556	2.86
7	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	1,050 13,112.67 13,768,306	13,868.03 14,561,435	2.59
8	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	1,700 7,134.72 12,129,037	8,316.44 14,137,959	2.52
9	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	2,064 5,638.94 11,638,774	6,460.59 13,334,663	2.37
10	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	5,146 2,066.81 10,635,849	2,503.02 12,880,559	2.29
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	1,100 9,422.82 10,365,103	10,945.57 12,040,130	2.14
12	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	2,400 3,904.51 9,370,873	4,552.39 10,925,746	1.95
13	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	8,000 1,046.89 8,375,136	1,207.09 9,656,786	1.72
14	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	6,677 1,045.46 6,980,716	1,394.26 9,309,539	1.66
15	LINK REIT	香港	投資証券	26,000 281.56 7,320,586	321.41 8,356,894	1.49
16	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	8,950 823.67 7,371,872	896.92 8,027,516	1.43
17	WESTFIELD RETAIL TRUST	オーストラリア	投資証券	31,700 199.12 6,312,263	231.78 7,347,474	1.31
18	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,200 5,007.63 6,009,160	5,838.00 7,005,611	1.25
19	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	4,700 1,180.92 5,550,352	1,463.26 6,877,367	1.22
20	MACERICH CO	アメリカ	投資証券	1,500 3,784.67 5,677,010	4,561.11 6,841,677	1.22
21	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	10,350 587.65 6,082,196	615.60 6,371,460	1.13
22	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	24,900 264.43 6,584,506	246.91 6,148,184	1.09
23	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	1,000 4,808.56 4,808,565	6,126.69 6,126,698	1.09
24	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	700 6,769.90 4,738,931	8,100.72 5,670,506	1.01

25	UDR INC	アメリカ	投資証券	2,800	1,814.85 5,081,635	1,991.47 5,576,127	0.99
26	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	18,900	250.10 4,726,909	259.65 4,907,555	0.87
27	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	1,500	2,620.40 3,930,604	3,269.95 4,904,927	0.87
28	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	400	9,990.68 3,996,272	11,952.81 4,781,124	0.85
29	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	900	4,426.29 3,983,662	5,260.63 4,734,569	0.84
30	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	8,250	464.40 3,831,371	527.81 4,354,477	0.78

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.10%
合計	98.10%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2012年7月	買建	22,000	1,744,540	1,744,600	0.31%
		豪ドル売/円買 2012年7月	売建	12,000	955,363	955,440	0.17%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

(1) 投資状況 (平成24年6月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		8,639,855,900	67.54
	内 日本	8,639,855,900	67.54
地方債証券		1,163,359,454	9.09
	内 日本	1,163,359,454	9.09

特殊債券		1,271,268,759	9.94
	内 日本	1,271,268,759	9.94
社債券		1,642,998,654	12.84
	内 日本	1,642,998,654	12.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		74,157,267	0.58
純資産総額		12,791,640,034	100.00

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

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

(2) 投資資産(平成24年6月29日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	3 1 2 10年国債	日本	国債証券	177,000,000	102.04 180,620,980	104.58 108,370	1.200000 2020/12/20	1.45
2	2 8 8 10年国債	日本	国債証券	148,000,000	106.84 158,129,150	107.60 125,920	1.700000 2017/09/20	1.24
3	3 1 0 10年国債	日本	国債証券	138,000,000	100.66 138,911,960	103.13 132,160	1.000000 2020/09/20	1.11
4	2 9 9 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	104.45 135,795,280	105.91 109,100	1.300000 2019/03/20	1.08
5	3 0 3 10年国債	日本	国債証券	125,000,000	104.92 131,157,780	106.63 129,750	1.400000 2019/09/20	1.04
6	2 8 7 10年国債	日本	国債証券	121,000,000	107.95 130,620,830	108.32 107,090	1.900000 2017/06/20	1.02
7	3 0 9 10年国債	日本	国債証券	122,000,000	101.95 124,388,680	104.11 102,740	1.100000 2020/06/20	0.99
8	8 6 5年国債	日本	国債証券	125,000,000	101.15 126,437,520	101.10 131,250	0.600000 2014/09/20	0.99
9	3 1 8 10年国債	日本	国債証券	115,000,000	99.38 114,295,650	102.24 107,450	1.000000 2021/09/20	0.92
10	9 2 5年国債	日本	国債証券	114,000,000	100.01 114,020,520	100.64 107,740	0.300000 2015/09/20	0.90
11	3 7 8 東北電力	日本	社債券	100,000,000	113.12 113,126,600	112.13 134,800	3.850000 2016/04/25	0.88
12	9 5 5年国債	日本	国債証券	109,000,000	101.25 110,366,840	101.77 103,660	0.600000 2016/03/20	0.87
13	2 7 2 10年国債	日本	国債証券	105,000,000	104.18 109,391,100	104.16 107,350	1.400000 2015/09/20	0.86
14	2 0 - 6 北海道公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.97 106,979,000	107.69 109,500	1.720000 2018/08/29	0.84
15	2 9 3 大阪府公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.52 107,520,200	107.61 112,000	2.100000 2016/08/30	0.84
16	2 政保地方公営機	日本	特殊債券	100,000,000	106.14 106,143,400	107.57 107,300	1.600000 2018/11/16	0.84

17	2 1 - 2 埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.74 105,745,000	107.42 107,421,100	1.570000 2019/05/27	0.84
18	2 6 公営企業	日本	特殊債券	100,000,000	106.73 106,734,000	107.21 107,212,800	1.780000 2017/03/24	0.84
19	2 1 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.11 106,116,000	107.00 107,004,600	1.570000 2019/11/25	0.84
20	1 8 - 2 北九州市債	日本	地方債証券	100,000,000	106.52 106,528,000	106.91 106,912,400	1.790000 2016/12/20	0.84
21	2 7 国際協力銀行	日本	特殊債券	100,000,000	106.34 106,344,000	106.85 106,854,300	1.770000 2017/03/17	0.84
22	1 8 - 4 札幌市公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.46 106,460,000	106.70 106,707,100	1.800000 2016/09/20	0.83
23	6 5 3 東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.24 106,247,000	106.68 106,681,300	1.540000 2017/12/20	0.83
24	5 6 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	104.90 104,904,000	106.15 106,158,400	1.400000 2018/04/20	0.83
25	2 成田国際空港	日本	特殊債券	100,000,000	104.38 104,388,000	104.60 104,601,000	1.660000 2015/12/18	0.82
26	6 2 4 東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.21 104,215,000	104.02 104,029,000	1.500000 2015/06/19	0.81
27	8 7 5年国債	日本	国債証券	103,000,000	100.94 103,972,000	100.98 100,981,490	0.500000 2014/12/20	0.81
28	1 7 ソニー	日本	社債券	100,000,000	103.89 103,896,000	103.44 103,449,200	1.570000 2015/06/19	0.81
29	1 3 首都高速道路	日本	特殊債券	100,000,000	103.62 103,623,000	103.38 103,388,500	1.480000 2015/03/20	0.81
30	4 住友信託 劣後	日本	社債券	100,000,000	103.25 103,252,000	103.27 103,279,400	1.670000 2015/04/28	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
国債証券	67.54%
地方債証券	9.09%
特殊債券	9.94%
社債券	12.84%
合計	99.42%

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	108,819,362,904	98.26
内 ユーロ	42,332,609,270	38.22
内 シンガポール	450,359,845	0.41
内 マレーシア	588,724,075	0.53
内 ノルウェー	268,567,316	0.24
内 スウェーデン	664,082,991	0.60
内 デンマーク	971,319,332	0.88
内 イギリス	9,059,397,112	8.18
内 スイス	451,801,739	0.41
内 ポーランド	787,473,002	0.71
内 カナダ	3,257,513,646	2.94
内 アメリカ	47,280,304,551	42.69
内 メキシコ	1,039,221,985	0.94
内 オーストラリア	1,667,988,040	1.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,931,240,591	1.74
純資産総額	110,750,603,495	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）	940,042,765	0.85
内 日本	940,042,765	0.85

(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24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,999,000	115.52 641,257,432	117.60 792,202	3.750000 2018/11/15	0.59
2	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,947,000	108.55 598,096,450	111.42 914,500	2.750000 2019/02/15	0.55
3	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,144,000	111.15 541,641,556	114.19 450,126	3.125000 2019/05/15	0.50

4	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,842,000	114.79 531,883,446	117.84 1,000,817	3.625000 2019/08/15	0.49
5	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,630,000	114.97 513,385,821	118.23 932,899	3.625000 2020/02/15	0.48
6	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,259,000	113.96 475,350,489	117.44 852,865	3.500000 2020/05/15	0.44
7	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,554,000	128.27 463,293,482	135.57 677,556	4.375000 2039/11/15	0.44
8	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,202,000	133.31 444,276,469	140.85 427,576	4.625000 2040/02/15	0.42
9	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,929,000	106.68 417,059,732	110.67 633,955	2.625000 2020/08/15	0.39
10	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,184,000	118.35 392,754,266	125.41 165,088	3.875000 2040/08/15	0.38
11	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,635,000	111.55 410,074,567	112.00 714,072	3.250000 2017/03/31	0.37
12	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,180,000	100.24 411,836,451	100.12 322,899	0.375000 2013/06/30	0.37
13	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,930,000	104.74 409,539,409	103.68 398,767	2.250000 2014/05/31	0.37
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,585,000	105.13 372,170,401	113.76 715,725	4.250000 2023/10/25	0.36
15	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,417,000	110.42 386,846,405	114.53 244,170	3.125000 2021/05/15	0.36
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,712,000	102.46 375,560,318	108.71 480,009	3.500000 2020/04/25	0.36
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,752,000	102.50 379,763,929	106.69 290,431	3.000000 2015/10/25	0.36
18	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,509,000	106.46 380,710,395	110.53 268,571	2.625000 2020/11/15	0.36
19	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	2,873,000	112.27 397,125,605	110.36 369,541	5.000000 2014/09/07	0.35
20	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	3,537,000	130.65 366,515,388	138.07 313,232	4.500000 2039/08/15	0.35
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,430,000	106.36 360,231,686	113.98 105,893	4.250000 2019/04/25	0.35
22	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,658,000	104.68 386,726,188	104.30 311,297	1.875000 2015/06/30	0.35
23	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,076,000	114.88 371,376,388	118.69 702,430	3.625000 2021/02/15	0.35
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,841,000	92.61 351,255,382	100.78 222,363	2.500000 2020/10/25	0.35
25	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,827,000	99.53 381,034,887	99.76 914,407	0.250000 2014/12/15	0.34
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,722,000	102.20 375,619,506	103.26 524,191	2.500000 2014/01/12	0.34
27	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	3,025,000	155.25 372,481,378	158.01 109,131	8.000000 2021/11/15	0.34

28	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,760,000	99.91 377,176,377	99.91 175,835	0.250000 2014/02/28	0.34
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,622,000	103.98 371,880,377	105.08 832,813	3.000000 2014/07/12	0.34
30	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,256,000	110.84 356,370,377	116.79 489,720	3.500000 2019/07/04	0.34

(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	98.26%
合計	98.26%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2012年7月	買建	3,725,000	363,618,927	367,769,265	0.33%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2012年7月	買建	303,000	6,731,684	6,968,994	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2012 年7月	買建	387,000	29,688,588	29,702,250	0.03%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2012年7月	買建	508,000	5,531,612	5,725,160	0.01%
		英ポンド買/円売 2012年7 月	買建	649,000	79,377,185	79,891,841	0.07%
		メキシコ・ペソ買/円売 2012年7月	買建	1,618,000	9,009,543	9,432,940	0.01%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2012年7月	買建	669,000	8,816,775	8,884,313	0.01%
		米ドル買/円売 2012年7月	買建	5,209,000	408,356,281	413,073,682	0.37%
		スイス・フラン買/円売 2012年7月	買建	48,000	3,912,931	3,946,080	0.00%
		豪ドル買/円売 2012年7月	買建	184,000	14,107,482	14,648,240	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。

[次へ](#)

(参考情報)

2012年6月29日現在
基準価額・純資産の推移

※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	6,858円
純資産総額	3百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.4%
3カ月間	-8.2%
6カ月間	6.9%
1年間	-5.8%
3年間	0.6%
5年間	-
設定来	-31.4%



※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: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 08年12月	第2期 09年12月	第3期 10年12月	第4期 11年12月				
分配金	0円	0円	0円	0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を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
国内株式・先物	1,299	46.2%	日本円	59.5%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.8%
外国株式・先物	1,196	28.4%	米ドル	23.7%	最終利回り(%)	TOPIX先物 2409月	日本	1.3%
国内リート	34	7.0%	ユーロ	6.1%	修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.2%
外国リート	235	6.4%	英ポンド	3.9%	残存年数	本田技研	日本	1.0%
国内債券	278	5.8%	カナダドル	1.9%	債券格付別構成	キャノン	日本	0.8%
外国債券	638	5.6%	豪ドル	1.9%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.9%
			スイス・フラン	1.1%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.8%
			香港ドル	0.5%	A	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.5%
			シンガポール・ドル	0.5%	BBB	日本リテールファンド	日本	0.5%
コール・ローン、その他		2.4%	その他	1.0%	BB以下・無格付	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.4%
合計	3,680	-	合計	100.0%	合計	合計		9.2%

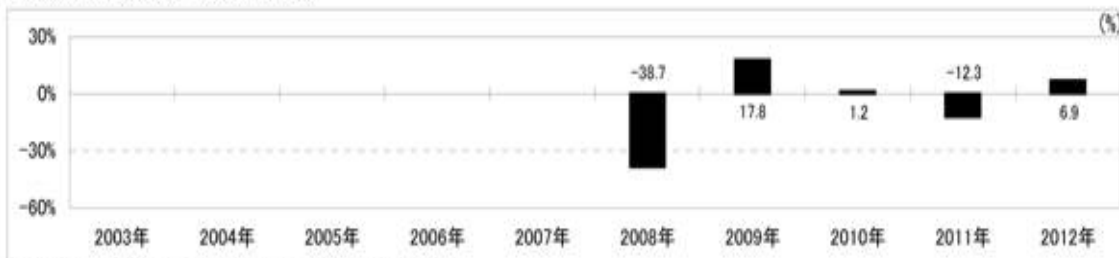
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.4%保有しております。

※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。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

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。

※2008年は設定日(2月28日)から年末、2012年は6月29日までの騰落率を表しています。

第3 【ファンドの経理状況】

1 【財務諸表】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」の末尾に、以下の中間財務諸表を追加します。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成23年12月20日から平成24年6月19日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成24年6月19日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		13,077
親投資信託受益証券		3,323,435
流動資産合計		3,336,512
資産合計		3,336,512
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		578
未払委託者報酬		7,406
その他未払費用		183
流動負債合計		8,167
負債合計		8,167
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,959,261
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2	1,630,916
元本等合計		3,328,345
純資産合計		3,328,345
負債純資産合計		3,336,512

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間 自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
	金額（円）
営業収益	
有価証券売買等損益	72,272
営業収益合計	72,272
営業費用	
受託者報酬	578
委託者報酬	7,406
その他費用	183
営業費用合計	8,167
営業損失（ ）	80,439
経常損失（ ）	80,439
中間純損失（ ）	80,439
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	7,003
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	798,112
剰余金増加額又は欠損金減少額	39,950
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	39,950
剰余金減少額又は欠損金増加額	785,312
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	785,312
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,630,916

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(追加情報)

当中間計算期間 自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 平成24年6月19日現在
1. 1 期首元本額	2,153,020円
期中追加設定元本額	2,931,902円
期中一部解約元本額	125,661円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,959,261口
3. 2 元本の欠損	中間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1,630,916円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 平成24年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成24年6月19日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 平成24年6月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6711円 (6,711円)

（参考）

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバル R E I Tインデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ B P I）」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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](#)

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

貸借対照表

		平成24年6月19日現在
		金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,553,372,455
株式	3	82,282,286,475
派生商品評価勘定		60,949,582
未収配当金		847,087,842
流動資産合計		84,743,696,354
資産合計		84,743,696,354
負債の部		
流動負債		
前受金		77,223,000
未払解約金		47,666,000
流動負債合計		124,889,000
負債合計		124,889,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	207,294,559,457
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	122,675,752,103
元本等合計		84,618,807,354
純資産合計		84,618,807,354
負債純資産合計		84,743,696,354

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23年12月20日 至 平成24年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（追加情報）

自 平成23年12月20日
至 平成24年6月19日

本報告書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成24年6月19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	204,724,819,772円
同期中における追加設定元本額	10,079,137,305円
同期中における一部解約元本額	7,509,397,620円
同中間期末における元本の内訳 ファンド名	
適格機関投資家専用投信1号	2,284,609,246円
トピックス・インデックスファンド	10,210,375,267円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	32,755,391,153円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	807,509,520円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	399,582,196円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	6,715,313,880円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	392,917,402円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	8,790,707,274円
DCダイワ日本株式インデックス	63,217,827,944円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,586,841,026円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,805,115,786円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,343,707,297円
年金ダイワ日本株式インデックス	2,008,397,155円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	19,215,480円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	21,612,083円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,671,527円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	500,946,820円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	3,592,764,232円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	2,122,141,271円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	122,374,344円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	821,876,905円

ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)	381,668,121円
ダイワ世界バランスファンド40VA	4,221,244,020円
ダイワ世界バランスファンド60VA	626,555,892円
ダイワ・バランスファンド35VA	32,575,018,842円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	2,604,615,080円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	5,466,433,908円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	2,923,310,487円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	558,011,518円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	657,487,509円
ダイワライフスタイル25	225,944,062円
ダイワライフスタイル50	614,510,965円
ダイワライフスタイル75	468,258,221円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	15,448,603,024円
計	207,294,559,457円
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	207,294,559,457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122,675,752,103円であります。
4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 517,500,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	平成24年6月19日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	2,277,567,000	-	2,338,890,000	61,323,000
合計	2,277,567,000	-	2,338,890,000	61,323,000

(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中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

(1口当たり情報)

	平成24年6月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4082円 (4,082円)

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成24年6月19日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		297,045,405
コール・ローン		118,902,227
株式		45,056,571,876
投資証券		987,497,094
派生商品評価勘定		10,275,200
未収入金		809,081
未収配当金		102,076,470
差入委託証拠金		284,673,903
流動資産合計		46,857,851,256
資産合計		46,857,851,256
負債の部		
流動負債		
未払金		12,320,122
未払解約金		2,581,000
流動負債合計		14,901,122
負債合計		14,901,122
純資産の部		
元本等		
元本	1	53,775,863,919
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	6,932,913,785
元本等合計		46,842,950,134
純資産合計		46,842,950,134
負債純資産合計		46,857,851,256

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（追加情報）

自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
本報告書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成24年6月19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 同期中における追加設定元本額 同期中における一部解約元本額	53,616,195,771円 3,503,007,714円 3,343,339,566円
同中間期末における元本の内訳 ファンド名 ダイワ外国株式インデックスV A ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,931,507,798円 97,361,825円 1,392,514,397円

ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	186,826,450円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	4,429,377,141円
DCダイワ外国株式インデックス	17,185,748,661円
ダイワ・ライフ・バランス30	630,727,111円
ダイワ・ライフ・バランス50	582,655,061円
ダイワ・ライフ・バランス70	355,047,688円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,559,941,591円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	6,117,614円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	5,674,098円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,141,917円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	120,285,152円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	1,730,766,631円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	39,713,199円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	396,068,579円
ダイワ世界バランスファンド40VA	5,990,964,554円
ダイワ世界バランスファンド60VA	1,482,010,457円
ダイワ・バランスファンド35VA	11,845,270,700円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	607,085,949円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,044,132,139円
ダイワライフスタイル25	26,606,676円
ダイワライフスタイル50	72,953,958円
ダイワライフスタイル75	55,364,573円
計	53,775,863,919円
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	53,775,863,919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6,932,913,785円であります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	平成24年6月19日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	705,121,768	-	715,396,968	10,275,200
合計	705,121,768	-	715,396,968	10,275,200

(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中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成24年6月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8711円 (8,711円)

[次へ](#)

「ダイワ」-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24年6月19日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	181,794,061
投資証券	20,369,263,890
未収配当金	150,232,198
流動資産合計	20,701,290,149
資産合計	20,701,290,149
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	1 19,187,676,904
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,513,613,245
元本等合計	20,701,290,149
純資産合計	20,701,290,149
負債純資産合計	20,701,290,149

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23年12月20日 至 平成24年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（追加情報）

自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
本報告書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成24年6月19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	19,205,025,479円
	同期中における追加設定元本額	934,112,869円
	同期中における一部解約元本額	951,461,444円
	同中間期末における元本の内訳	
	ファンド名	
	ダイワJ-REITオープン	5,700,636,550円
	ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	12,628,730,399円
	DC・ダイワJ-REITオープン	854,288,283円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	2,039,069円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	1,765,286円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	217,317円
	計	19,187,676,904円
2.	本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	19,187,676,904口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成24年6月19日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成24年6月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0789円 (10,789円)

[次へ](#)

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成24年6月19日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		2,318,686
コール・ローン		6,250,074
投資証券		549,378,137
未収入金		958,995
未収配当金		893,661
流動資産合計		559,799,553
資産合計		559,799,553
負債の部		
流動負債		
未払金		587,632
流動負債合計		587,632
負債合計		587,632
純資産の部		
元本等		
元本	1	546,946,738
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,265,183
元本等合計		559,211,921
純資産合計		559,211,921
負債純資産合計		559,799,553

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23年12月20日 至 平成24年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

(追加情報)

自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
本報告書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成24年6月19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 同期中における追加設定元本額 同期中における一部解約元本額	554,892,740円 60,402,379円 68,348,381円
同中間期末における元本の内訳 ファンド名 ダイワ・グローバルREITインデックスファンド（適格機関投資家専用） DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド DCダイワ・ターゲットイヤー2020 DCダイワ・ターゲットイヤー2030 DCダイワ・ターゲットイヤー2040 計	127,332,460円 415,389,454円 2,160,408円 1,868,753円 195,663円 546,946,738円
2. 本報告書における開示対象ファンド	546,946,738円

の中間計算期間末日における当該親
投資信託の受益権の総数

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成24年6月19日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成24年6月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0224円 (10,224円)

[次へ](#)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成24年6月19日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		54,803,106
国債証券		8,656,632,250
地方債証券		1,164,168,998
特殊債券		1,271,842,334
社債券		1,643,435,259
未収利息		54,442,381
前払費用		3,067,483
流動資産合計		12,848,391,811
資産合計		12,848,391,811
負債の部		
流動負債		
未払解約金		13,026,000
流動負債合計		13,026,000
負債合計		13,026,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,235,502,846
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,599,862,965
元本等合計		12,835,365,811
純資産合計		12,835,365,811
負債純資産合計		12,848,391,811

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23年12月20日 至 平成24年6月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（追加情報）

自 平成23年12月20日 至 平成24年6月19日
本報告書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成24年6月19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	10,296,043,254円
同期中における追加設定元本額	1,797,882,143円
同期中における一部解約元本額	858,422,551円
同中間期末における元本の内訳	
ファンド名	
ダイワ・ライフ・バランス30	2,804,301,317円
ダイワ・ライフ・バランス50	923,419,870円
ダイワ・ライフ・バランス70	228,098,652円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/安定コース）	216,555,936円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/6分散コース）	137,869,518円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/成長コース）	32,423,432円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	13,973,818円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	4,614,236円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	174,759円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	3,694,962,315円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	329,077,826円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	921,289,240円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,928,741,927円
計	11,235,502,846円
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	11,235,502,846口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成24年6月19日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成24年6月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1424円 (11,424円)

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成24年6月19日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		27,225,078
コール・ローン		897,285,138
国債証券		108,915,859,747
派生商品評価勘定		14,006,375
未収利息		1,183,151,120
前払費用		42,436,521
流動資産合計		111,079,963,979
資産合計		111,079,963,979
負債の部		
流動負債		
未払解約金		26,559,000
流動負債合計		26,559,000
負債合計		26,559,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	62,561,611,103
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		48,491,793,876
元本等合計		111,053,404,979
純資産合計		111,053,404,979
負債純資産合計		111,079,963,979

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23年12月20日 至 平成24年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

(追加情報)

自 平成23年12月20日
至 平成24年6月19日

本報告書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成24年6月19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	61,598,892,147円
同期中における追加設定元本額	3,416,882,501円
同期中における一部解約元本額	2,454,163,545円
同中間期末における元本の内訳 ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスV A	3,058,392,135円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	98,485,796円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	694,809,550円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	208,290,960円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	2,198,753,747円
DCダイワ外国債券インデックス	30,125,950,924円
ダイワ・ライフ・バランス30	469,978,357円
ダイワ・ライフ・バランス50	143,467,724円
ダイワ・ライフ・バランス70	70,079,424円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	139,479,045円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	91,081,729円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	20,485,475円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	5,566,190円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	2,220,746円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	110,328円

ダイワ世界バランスファンド40VA	3,357,711,745円
ダイワ世界バランスファンド60VA	355,994,088円
ダイワ・バランスファンド35VA	11,884,183,001円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	2,353,443,946円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	1,848,580,751円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	717,840,202円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	4,646,341,671円
ダイワライフスタイル25	25,567,581円
ダイワライフスタイル50	35,724,584円
ダイワライフスタイル75	9,071,404円
計	62,561,611,103円
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	62,561,611,103口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	平成24年6月19日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	973,025,148	-	987,031,523	14,006,375
アメリカ・ドル	422,858,801	-	426,233,861	3,375,060
イギリス・ポンド	79,377,185	-	80,443,491	1,066,306
オーストラリア・ドル	14,107,482	-	14,690,560	583,078
カナダ・ドル	29,688,588	-	29,907,360	218,772

スイス・フラン	3,912,931	-	3,980,640	67,709
スウェーデン ・クローナ	5,531,612	-	5,709,920	178,308
デンマーク・クローネ	8,816,775	-	8,964,593	147,818
ポーランド・ズロチ	6,731,684	-	7,068,983	337,299
メキシコ・ペソ	9,009,543	-	9,222,600	213,057
ユーロ	392,990,547	-	400,809,515	7,818,968
合計	973,025,148	-	987,031,523	14,006,375

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成24年6月19日現在
本報告書における開示対象ファンドの中間期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7751円 (17,751円)

2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

【純資産額計算書】

平成24年6月29日

資産総額	3,401,552円
負債総額	632円
純資産総額（ - ）	3,400,920円
発行済数量	4,959,261口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6858円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成24年6月29日

資産総額	89,136,263,890円
負債総額	234,404,000円
純資産総額（ - ）	88,901,859,890円
発行済数量	207,654,434,485口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.4281円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成24年6月29日

資産総額	46,693,119,428円
負債総額	203,998,952円
純資産総額（ - ）	46,489,120,476円
発行済数量	53,827,245,046口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8637円

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

平成24年6月29日

資産総額	21,972,676,728円
負債総額	153,166,125円
純資産総額（ - ）	21,819,510,603円
発行済数量	19,512,168,855口

1 単位当たり純資産額（ / ） 1.1183円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成24年6月29日

資産総額	562,426,936円
負債総額	942,523円
純資産総額（ - ）	561,484,413円
発行済数量	546,986,237口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0265円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

純資産額計算書

平成24年6月29日

資産総額	12,812,432,034円
負債総額	20,792,000円
純資産総額（ - ）	12,791,640,034円
発行済数量	11,206,947,244口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1414円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成24年6月29日

資産総額	111,458,734,206円
負債総額	708,130,711円
純資産総額（ - ）	110,750,603,495円
発行済数量	62,583,206,175口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.7697円

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

 原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況

および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成24年6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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成24年6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	4	11,343
追加型株式投資信託	408	6,873,121
株式投資信託 合計	412	6,884,463
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,358,384
公社債投資信託 合計	17	2,358,384
総合計	429	9,242,847

3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

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。
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、事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,820,358	3,745,233
有価証券	18,987,155	19,655,070
前払金	579	314
前払費用	24,840	90,562
未収入金	6,925	11,931
未収委託者報酬	6,933,076	6,516,540
未収収益	41,963	55,102
貯蔵品	23,337	11,888
繰延税金資産	286,080	630,508
その他	501,484	190,450
流動資産計	28,625,803	30,907,602
固定資産		
有形固定資産	1	1,003,450
建物（純額）	332,407	513,162
器具備品（純額）	634,782	484,571
建設仮勘定	-	5,715
無形固定資産	2,414,530	2,870,849
ソフトウェア	1,364,617	2,173,517
ソフトウェア仮勘定	1,037,069	684,878
電話加入権	11,850	11,850
商標権	396	132
その他	596	471
投資その他の資産	18,825,476	16,375,520

投資有価証券		12,339,547		10,034,136
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		142,215		136,315
従業員に対する長期貸付金		99,889		112,674
差入保証金		609,781		542,920
長期前払費用		7,607		8,478
投資不動産（純額）	1	490,114	1	409,876
貸倒引当金		4,750		9,950
固定資産計		22,207,196		20,249,820
資産合計		50,833,000		51,157,423

(単位:千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	46,454	55,551
未払金	6,501,119	7,194,946
未払収益分配金	27,599	17,954
未払償還金	119,838	88,334
未払手数料	3,725,807	3,386,380
その他未払金	2,627,872	3,702,277
未払費用	2,395,029	3,313,011
未払法人税等	895,379	963,539
未払消費税等	383,973	229,365
賞与引当金	263,000	307,000
本社移転関連費用引当金	-	346,425
資産除去債務	-	292,000
その他	-	87,535
流動負債計	10,484,955	12,789,375
固定負債		
退職給付引当金	1,410,635	1,670,344
役員退職慰労引当金	59,160	68,068
繰延税金負債	1,977,913	1,782,558
固定負債計	3,447,708	3,520,970
負債合計	13,932,663	16,310,345
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計	10,248,473	8,089,414

株主資本合計	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益	85,902	53,783
評価・換算差額等合計	18,137	87,663
純資産合計	36,900,336	34,847,077
負債・純資産合計	50,833,000	51,157,423

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,303,483	72,931,048
その他営業収益	345,390	401,212
営業収益計	72,648,873	73,332,260
営業費用		
支払手数料	41,437,322	41,050,089
広告宣伝費	967,991	709,853
公告費	1,256	699
受益証券発行費	3	74
調査費	6,192,360	7,993,144
調査費	831,159	878,635
委託調査費	5,361,200	7,114,509
委託計算費	718,414	733,156
営業雑経費	1,806,147	1,651,996
通信費	287,454	205,421
印刷費	674,758	472,511
協会費	47,465	52,117
諸会費	10,778	11,971
その他営業雑経費	785,691	909,973
営業費用計	51,123,496	52,139,015
一般管理費		
給料	4,192,794	4,452,711
役員報酬	157,200	209,630
給料・手当	3,545,655	3,646,155
賞与	226,939	289,926
賞与引当金繰入額	263,000	307,000
福利厚生費	619,459	728,342
交際費	68,476	71,356
寄付金	638	591
旅費交通費	266,082	215,939
租税公課	169,305	171,533
不動産賃借料	680,147	727,939
退職給付費用	334,864	422,030
役員退職慰労引当金繰入額	28,500	27,988
固定資産減価償却費	897,352	1,107,222
諸経費	1,170,318	1,077,041
一般管理費計	8,427,939	9,002,696
営業利益	13,097,437	12,190,548

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	573,514		74,753
有価証券利息		23,029		13,537
受取利息		2,673		2,771
時効成立分配金・償還金		149,120		42,189
投資有価証券売却益		38,591		117,695
有価証券償還益		3,185		68,106
その他		41,908		54,685
営業外収益計		832,022		373,739
営業外費用				
投資有価証券売却損		7,515		95,389
有価証券償還損		277		67,873
その他		180,501		67,829
営業外費用計		188,294		231,091
経常利益		13,741,165		12,333,196
特別利益				
貸倒引当金戻入額		614,232		-
特別利益計		614,232		-
特別損失				
固定資産除却損	2	1,067	2	4,871
減損損失	3	35,468	3	76,217
有価証券評価損		-		211,376
本社移転関連費用		-		346,425
その他		22,059		19,547
特別損失計		58,595		658,438
税引前当期純利益		14,296,802		11,674,757
法人税、住民税及び事業税		4,834,931		5,254,642
法人税等調整額		256,140		602,832
法人税等合計		5,091,072		4,651,809
当期純利益		9,205,730		7,022,948

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	2,800,000	-
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
当期変動額合計	2,800,000	-
当期末残高	-	-
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,085,103	9,874,176
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	789,072	2,159,059
当期末残高	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計		
当期首残高	12,259,401	10,248,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008

当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	10,248,473	8,089,414

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
株主資本合計		
当期首残高	38,929,401	36,918,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	18,061	104,040
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	85,978	137,920
当期変動額合計	85,978	137,920
当期末残高	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	55,712	85,902
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	141,615	32,119
当期変動額合計	141,615	32,119
当期末残高	85,902	53,783
評価・換算差額等合計		
当期首残高	73,774	18,137
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	55,636	105,800
当期末残高	18,137	87,663
純資産合計		
当期首残高	38,855,627	36,900,336
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	1,955,290	2,053,258
当期末残高	36,900,336	34,847,077

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法により計上しております。

3．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産及び投資不動産

（リース資産を除く）

定率法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	6～47年
器具備品	3～20年

（2）無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。

（3）長期前払費用

定額法によっております。

4．引当金の計上基準

（1）貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

（2）賞与引当金

従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（3）退職給付引当金

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

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

（４）役員退職慰労引当金

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

（５）本社移転関連費用引当金

本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。

５．ヘッジ会計の方法

（１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。

（２）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

（３）ヘッジ方針

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

（４）ヘッジ有効性評価の方法

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

６．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

表示方法の変更

（損益計算書）

１．前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めていた「有価証券償還益」は重要性が増し

たため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた45,094千円は、「有価証券償還益」3,185千円、「その他」41,908千円として組替えております。

2. 前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「有価証券償還損」は重要性が増したため、当事業年度より区分掲記することとしました。また、前事業年度において区分掲記していた「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」、「貯蔵品廃棄損」及び「投資不動産管理費用」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」に表示していた98,613千円、「貯蔵品廃棄損」に表示していた25,533千円、「投資不動産管理費用」に表示していた20,028千円、及び「その他」に表示していた36,603千円は、「有価証券償還損」277千円、「その他」180,501千円として組替えております。

3. 前事業年度において区分掲記していた「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」に表示していた21,290千円は、「その他」として組替えております。

追加情報

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
建物	854,118千円	986,089千円
器具備品	2,129,756千円	2,234,738千円
投資建物	700,991千円	712,587千円
投資器具備品	28,141千円	22,398千円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
未払金	2,591,913千円	3,577,654千円

3 保証債務

前事業年度（平成23年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,372,770千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
受取配当金	460,584千円	-

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
器具備品	1,067千円	4,812千円
投資不動産	-	59千円
計	1,067千円	4,871千円

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

場所 千葉県浦安市

用途 賃貸等不動産（浦安寮）

種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグループングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（35,468千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物26,868千円及び土地8,600千円です。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により

評価しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグループピ
ングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の
兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失
（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円で
あります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により
評価しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成22年6月25日 定時株主総会	普通株式	11,216	4,300	平成22年 3月31日	平成22年 6月28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23年6月24日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提
案しております。

剰余金の配当の総額 9,182百万円
配当の原資 利益剰余金
1株当たり配当額 3,520円
基準日 平成23年3月31日

効力発生日 平成23年6月27日

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

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

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

剰余金の配当の総額 7,022百万円
 配当の原資 利益剰余金
 1株当たり配当額 2,692円
 基準日 平成24年3月31日
 効力発生日 平成24年6月26日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

おります。

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

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止し、中止時点までのヘッジ手段に係る損益は、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで繰り延べております。

（ ）デリバティブ取引

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

信用リスクの管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,820,358	1,820,358	-
(2) 未収委託者報酬	6,933,076	6,933,076	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	30,154,565	30,154,565	-
資産計	38,908,001	38,908,001	-
(1) 未払手数料	3,725,807	3,725,807	-
(2) その他未払金	2,627,872	2,627,872	-
(3) 未払費用(*1)	1,951,710	1,951,710	-
負債計	8,305,391	8,305,391	-
デリバティブ取引(*2)	183,430	183,430	-

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

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

当事業年度(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	3,745,233	3,745,233	-
(2) 未収委託者報酬	6,516,540	6,516,540	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	28,525,516	28,525,516	-
資産計	38,787,291	38,787,291	-
(1) 未払手数料	3,386,380	3,386,380	-
(2) その他未払金	3,702,277	3,702,277	-
(3) 未払費用(*1)	2,764,494	2,764,494	-
負債計	9,853,152	9,853,152	-
デリバティブ取引(*2)	(87,535)	(87,535)	-

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

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

<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	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
(1) その他有価証券 非上場株式	1,172,137	1,163,689
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	609,781	542,920

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	1,820,358	-	-	-
未収委託者報酬	6,933,076	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,588,634	4,868,529	-
合計	8,753,434	1,588,634	4,868,529	-

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	3,745,233	-	-	-
未収委託者報酬	6,516,540	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	836,311	2,069,432	4,320,954	-
合計	11,098,084	2,069,432	4,320,954	-

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

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

2．その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	4,822,299	4,383,992	438,306
小計	4,822,299	4,383,992	438,306
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
（1）株式	54,283	55,101	818
（2）その他			
証券投資信託の受益証券	25,277,982	25,890,888	612,906
小計	25,332,266	25,945,990	613,724
合計	30,154,565	30,329,983	175,417

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	6,864,572	6,497,516	367,056
小計	6,864,572	6,497,516	367,056
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
（1）株式	49,871	55,101	5,230

(2) その他 証券投資信託の受益証券	21,611,072	21,918,194	307,122
小計	21,660,944	21,973,296	312,352
合計	28,525,516	28,470,813	54,703

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,163,689千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他 証券投資信託の受益証券	21,607,835	38,591	7,515
合計	21,607,835	38,591	7,515

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他 証券投資信託の受益証券	16,215,351	117,695	95,389
合計	16,215,351	117,695	95,389

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、その他有価証券（その他）について211,376千円の減損処理を行っておりません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

該当事項はありません。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

株式関連

(単位：千円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等	時価	評価損益
		うち1年超		

市場取引 以外の 取引	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	1,669,315	-	87,535	87,535
合計		1,669,315	-	87,535	87,535

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

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。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価
				うち1年超	
原則的 処理 方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,435,030	-	183,430
合計			2,435,030	-	183,430

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
退職給付債務	1,410,635千円	1,670,344千円
退職給付引当金	1,410,635千円	1,670,344千円

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
勤務費用	191,300千円	261,341千円
その他	143,564千円	160,689千円
退職給付費用	334,864千円	422,030千円

（注）「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：千円）

	前事業年度（平成23年3月31日現在）	当事業年度（平成24年3月31日現在）
繰延税金資産		
減損損失	928,499	838,826
退職給付引当金	573,987	599,247
連結法人間取引（譲渡損）	294,850	258,256
未払事業税	212,062	212,753
投資有価証券評価損	216,468	191,138
本社移転関連費用引当金	-	131,676
賞与引当金	107,014	116,690
出資金評価損	128,238	114,425
資産除去債務	-	110,989
有価証券評価損	-	80,344
器具備品	38,093	33,365
その他有価証券評価差額金	125,395	27,099
役員退職慰労引当金	24,072	25,804
未払社会保険料	11,722	14,071
その他	28,763	27,487
繰延税金資産小計	2,689,169	2,782,177
評価性引当額	1,547,609	1,379,241
繰延税金資産合計	1,141,560	1,402,935
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301	2,428,233
建物（資産除去債務）	-	76,837
繰延ヘッジ損益	58,934	29,783
その他有価証券評価差額金	-	18,241
その他	2,156	1,888
繰延税金負債合計	2,833,392	2,554,985
繰延税金負債の純額	1,691,832	1,152,049

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

（単位：%）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
法定実効税率	40.69	-
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.21	-
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.25	-
住民税均等割	0.02	-
評価性引当額	4.14	-

その他	0.07	-
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.60	-

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

3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率の変更により繰延税金負債の純額（繰延税金資産の金額を控除した金額）が211,604千円減少し、法人税等調整額が205,949千円減少しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

変動の内容	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
期首残高	-	-
見積りの変更に伴う増加額	-	292,000
期末残高	-	292,000

4．当該資産除去債務の金額の見積りの変更

当事業年度において、平成24年度中に予定している本社移転計画により、合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	35,468	35,468

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	76,217	76,217

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証	1,384,110	-	-
子会社	Daiwa Asset Management (India) Private Limited	India	1,128	金融商品取引業	(所有) 直接 91.0	経営管理	増資の引受	3,204,985	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 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。
- (2) インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management(India)Private Limited社の行った増資を1株につき72円86銭で引き受けております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,372,770	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	21,941,957	未払手数料	2,760,790
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケッツ(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	666,862	未払手数料	70,947
							為替予約	1,160,187	-	-

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	1,085,626	未払費用	129,623
-------------	---------	--------	-------	---------	---	-----------	-----------	-----------	------	---------

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 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。

当事業年度(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	19,792,278	未払手数料	2,376,978
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	595,391	未払手数料	76,686
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,233,996	未払費用	245,735

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3) 大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成24年4月1日をもって合併いたしました。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
1株当たり純資産額 14,146.05円 1株当たり当期純利益 3,529.09円	1株当たり純資産額 13,358.92円 1株当たり当期純利益 2,692.30円

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

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

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
当期純利益(千円)	9,205,730	7,022,948
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(追加情報)

前事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

当社及び株式会社大和証券グループ本社(以下、総称して「大和証券グループ」)は、株式会社新生銀行傘下で、インド共和国においてアセットマネジメント事業を行っているShinsei Asset Management (India) Private Limited(以下、「SAMI」)及びShinsei Trustee Company (India) Private Limited(以下、「STC」)の全株式を株式会社新生銀行及びその他の株主から取得いたしました。

本件について、平成22年12月20日に買収手続きを完了した後、「SAMI」及び「STC」は、Daiwa Asset Management (India) Private Limited(以下、「DAMI」)及びDaiwa Trustee Company (India) Private Limited(以下、「DTC」)として商号を変更しました。その後、インドにおける外国資本規制上の最低払込金額を満たすために、平成23年1月31日に増資を行っております。「DAMI」及び「DTC」は大和証券グループの100%子会社であり、当社の取得原価、増資の引受、貸借対照表計上額並びに出資比率は下記のとおりであります。

(単位：千円)

	DAMI	DTC
取得原価	1,059,552	2,717
増資の引受	3,204,985	9,944
貸借対照表計上額(注) 関係会社株式	4,391,020	13,037
出資比率	91.0%	99.9%

(注) 取得付随費用を算入した後の金額になります。

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

原簿原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成24年4月1日現在）

事業の内容 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

< 略 >

< 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24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。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年7月20日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成23年12月20日から平成24年6月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成24年6月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年12月20日から平成24年6月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

（注2）中間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24年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森 公高	印
--------------------	-------	------	---

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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成24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。

利害関係

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

以上

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