

**【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

**【提出日】** 平成28年2月9日

**【発行者名】** D I A Mアセットマネジメント株式会社

**【代表者の役職氏名】** 代表取締役社長 西 惠正

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

**【事務連絡者氏名】** 上野 圭子

**【電話番号】** 03-3287-3110

**【届出の対象とした募集内国 世界6資産アクティブ・バランス・ファンド  
投資信託受益証券に係るファ  
ンドの名称】**

**【届出の対象とした募集内国 500億円を上限とします。  
投資信託受益証券の金額】**

**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

有価証券報告書の提出に伴い、平成27年8月7日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

**2【訂正の内容】**

\_\_\_\_\_の部分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】

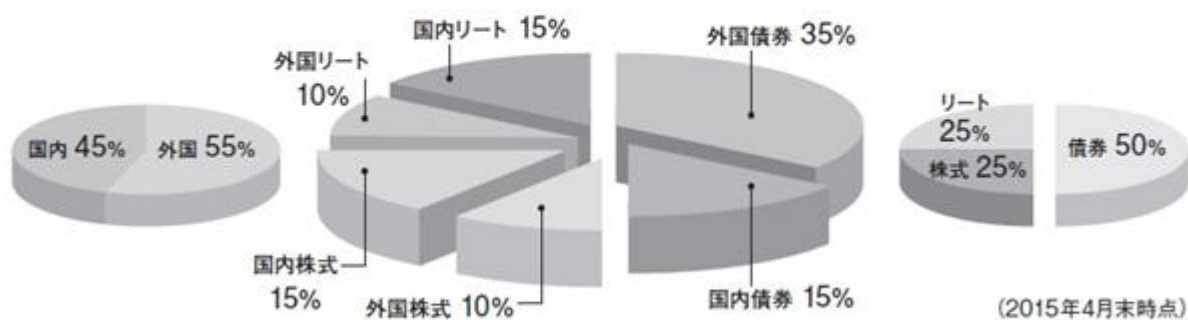
<訂正前>

(略)

#### 6つの資産にバランスよく分散投資

○ 国内外の債券、株式、リーートの6資産に分散投資を行います。

#### [基本資産配分]



※上記基本資産配分は、各マザーファンドの構成比です。

※今後の市場規模・投資環境等が大幅に変化する局面においては変更となる場合があります。

※時価変動等により各マザーファンドの純資産総額が基本資産配分比率から一定以上乖離した場合には、各マザーファンドへの投資割合を基本資産配分比率に近づけることとします。

※外国リーートの基本資産配分比率は、DIAM US・リート・オープン・マザーファンドとDIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの合計です。

(略)

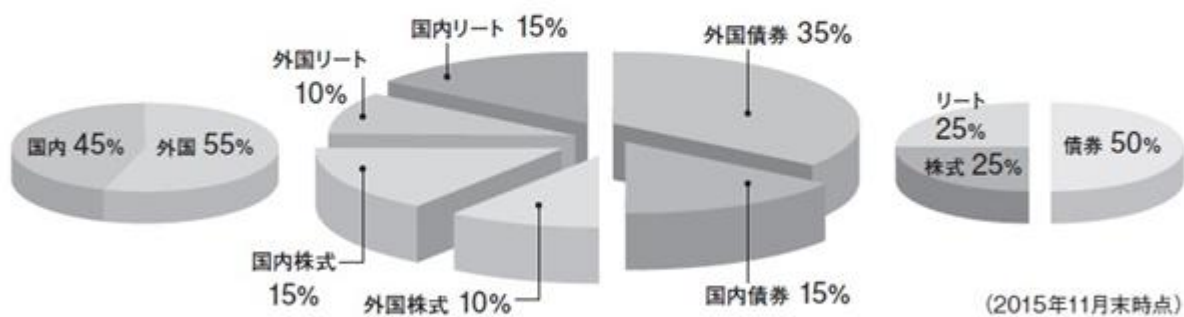
<訂正後>

(略)

#### 6つの資産にバランスよく分散投資

○ 国内外の債券、株式、リーートの6資産に分散投資を行います。

#### [基本資産配分]



※上記基本資産配分は、各マザーファンドの構成比です。

※今後の市場規模・投資環境等が大幅に変化する局面においては変更となる場合があります。

※時価変動等により各マザーファンドの純資産総額が基本資産配分比率から一定以上乖離した場合には、各マザーファンドへの投資割合を基本資産配分比率に近づけることとします。

※外国リーートの基本資産配分比率は、DIAM US・リート・オープン・マザーファンドとDIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの合計です。

(略)

## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

委託会社の概況

( 略 )

資本金の額

20億円（平成27年5月29日現在）

( 略 )

大株主の状況

(平成27年5月29日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

&lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

委託会社の概況

( 略 )

資本金の額

20億円（平成27年11月30日現在）

( 略 )

大株主の状況

(平成27年11月30日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

## 2 【投資方針】

## ( 2 ) 【投資対象】

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

( 略 )

ファンド名	D I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド
( 略 )	

投資態度	<p>(略)</p> <p>デービス・セレクトド・アドバイザーズとは・・・ Davis Selected Advisers, LP</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・1969年設立。創業者一族であるDavis家が約80%を出資する独立系運用会社。</li> <li>・運用受託資産は、約4兆2,208億円（約35,124百万米ドル、1米ドル=120.17円で換算）。そのうち、不動産関連証券投資は約919億円（2015年3月末現在）。</li> <li>・不動産関連証券投資では1994年からの実績。</li> <li>・運用スタイルは、個別銘柄選択による割安銘柄投資を特徴としています。</li> </ul> <p>(略)</p>
(略)	

ファンド名	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>(略)</p> <p>コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントとは・・・ Colonial First State Asset Management (Australia) Limited</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・オーストラリア・コモンウェルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。</li> <li>・運用受託資産は、約19兆928億円(約207,395百万豪ドル、1豪ドル=92.06円換算)と豪州を代表する資産運用会社の一つです。そのうち、不動産関連証券投資は約3,214億円（2015年3月末現在）。</li> <li>・不動産関連証券投資では1991年からの実績。</li> <li>・運用スタイルは、マクロ分析によるトップダウンと個別銘柄調査によるボトムアップ運用の融合を特徴としています。</li> </ul> <p>(略)</p>
(略)	

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

<訂正後>

(略)

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

(略)

ファンド名	D I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド
(略)	

投資態度	<p>(略)</p> <p>デAVIS・セレクトド・アドバイザーズとは・・・</p> <p>Davis Selected Advisers, LP</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・1969年設立。創業者一族であるDavis家が約80%を出資する独立系運用会社。</li> <li>・運用受託資産は、約3兆4,609億円（約28,850百万米ドル、1米ドル=119.96円で換算）。そのうち、不動産関連証券投資は約757億円（2015年9月末現在）。</li> <li>・不動産関連証券投資では1994年からの実績。</li> <li>・運用スタイルは、個別銘柄選択による割安銘柄投資を特徴としています。</li> </ul> <p>(略)</p>
(略)	

ファンド名	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>(略)</p> <p>コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントとは・・・</p> <p>Colonial First State Asset Management (Australia) Limited</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・オーストラリア・コモンウェルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。</li> <li>・運用受託資産は、約16兆4,719億円（約195,954百万豪ドル、1豪ドル=84.06円換算）と豪州を代表する資産運用会社の一つです。そのうち、不動産関連証券投資は約2,646億円（2015年9月末現在）。</li> <li>・不動産関連証券投資では1991年からの実績。</li> <li>・運用スタイルは、マクロ分析によるトップダウンと個別銘柄調査によるボトムアップ運用の融合を特徴としています。</li> </ul> <p>(略)</p>
(略)	

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (3) 【運用体制】

<訂正前>

(略)

各ファンドの運用指図の委託先の運用体制は以下の通りです。

- ・DIAM International Ltdの運用体制

高金利ソブリン・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。	
運用体制	<ul style="list-style-type: none"> <li>・DIAM International Ltdでは、資産クラス別運用体制ではなく、マルチプラットフォーム体制を採用しており、全ての運用担当者は3つまたは4つのプラットフォームに所属しております。</li> <li>・マクロ分析・市場分析・企業分析プラットフォームにおいては、株式や債券などの特定の資産クラスのみならず、幅広い資産クラスに関連する様々なレベルの分析が行われております。</li> </ul>

運用プロセス	<p>情報収集・分析</p> <p>・マルチプラットフォーム体制のもと、DIAM International Ltd内の他の運用担当者との情報交換や議論を通じ、投資対象国・地域のマクロ経済環境や対象資産に関する情報収集や分析を行います。</p> <p>運用方針・戦略の決定</p> <p>・月次の各種テーマ別運用方針会議におけるマクロ経済環境や金融市場環境などに関する議論を踏まえ、当該ファンドの運用目標・ガイドラインに沿った運用方針・戦略を策定します。</p> <p>(略)</p>
--------	--

(略)

各運用体制は、平成27年5月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

<訂正後>

(略)

各ファンドの運用指図の委託先の運用体制は以下の通りです。

・DIAM International Ltdの運用体制

高金利ソブリン・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。	
運用体制	<p>・DIAM International Ltdの運用部門は、債券（含む、エマージング、クレジット）、為替、株式、トレーディングの担当者で構成されています。</p> <p>・DIAM International Ltdの債券、為替、株式の運用担当者は、欧州およびその近接地域の市場を中心に、マクロ分析、市場分析、企業分析を行います。</p> <p>・グローバル運用体制を採用しており、アジア、オセアニア、米州等の地域に関しては、東京およびNYオフィスの運用担当者からの情報、分析を投資判断に活用しています。</p>
運用プロセス	<p>情報収集・分析</p> <p>・運用担当者は、欧州およびその近接地域の市場を中心に、マクロ分析、市場分析、企業分析を行います。アジア、オセアニア、米州等の地域に関しては、東京およびNYオフィスの運用担当者との情報交換や議論を活用し、投資対象国・地域のマクロ経済環境や対象資産に関する分析を行います。</p> <p>運用方針・戦略の決定</p> <p>・月次の運用方針会議におけるマクロ経済環境や金融市場環境などに関する議論を踏まえ、当該ファンドの運用目標・ガイドラインに沿った運用方針・戦略を策定します。さらに市場環境の変化に対応するため、週次の担当者ミーティングで運用方針・戦略の確認・見直しを行います。</p> <p>(略)</p>

(略)

各運用体制は、平成27年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

### 3【投資リスク】

<外部委託先に関する管理体制>

<訂正前>

(略)

上記体制は平成27年5月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

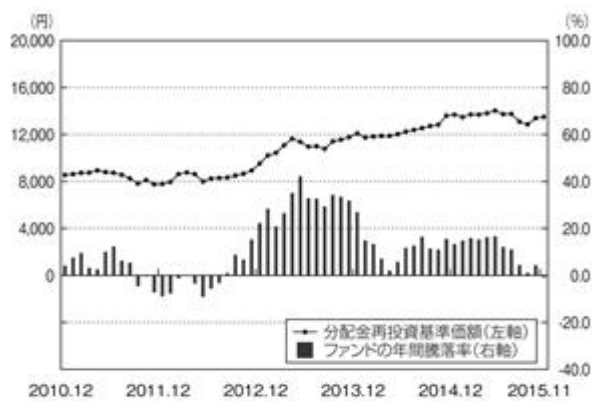
上記体制は平成27年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

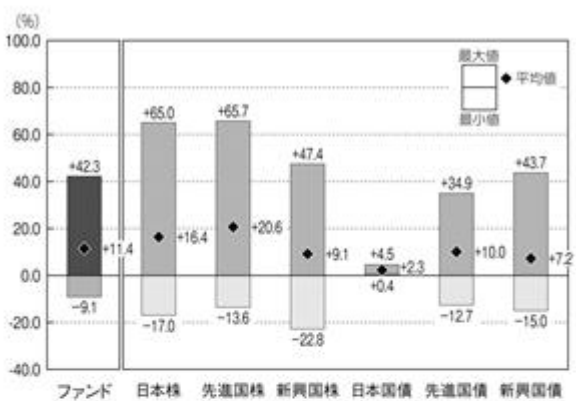
<更新・訂正後>

## (参考情報)

### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



2010年12月～2015年11月

\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

#### \*各資産クラスの指数

日本株…… 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)  
 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)  
 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)  
 日本国債… NOMURA-BPI国債  
 先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国債… JPモルガンGBI-EMグローバル・レディバースィファイド(円ベース)

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

●「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

●「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

●「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・レディバースィファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。



## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

&lt;訂正前&gt;

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.539%（税抜1.425%）

信託報酬の配分（税抜）	主な役務
（略）	

（略）

&lt;訂正後&gt;

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.539%（税抜1.425%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
（略）		

（略）

## (4)【その他の手数料等】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (4)その他の手数料」  
 につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

&lt;更新・訂正後&gt;

信託財産留保額

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に対して0.3%を乗じて得た額とします。

その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

- 1) 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- 2) 監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。
- 3) 有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- 4) マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示す事ができません。

上場不動産投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託（リート）の費用は表示しておりません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (5)【課税上の取扱い】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」  
 につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

&lt;更新・訂正後&gt;

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

#### 個人の受益者に対する課税

##### 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### 換金（解約）時および償還時

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

##### 損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成28年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

#### < 個別元本について >

受益者毎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相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「一般コース（分配金受取コース）」と「累積投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

#### < 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、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、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元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	1,042,945,529	98.46
内 日本	1,042,945,529	98.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	16,327,735	1.54
純資産総額	1,059,273,264	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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

## ジャパン・セレクション・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	9,588,748,980	96.89
内 日本	9,588,748,980	96.89
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	308,159,932	3.11
純資産総額	9,896,908,912	100.00

## その他資産の投資状況

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	174,020,000	1.76
内 日本	174,020,000	1.76

（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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## 国内債券アクティブ・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	411,119,460	49.97
内 日本	411,119,460	49.97
社債券	393,825,140	47.87
内 日本	393,825,140	47.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,818,554	2.17
純資産総額	822,763,154	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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

## J - R E I Tオープン・アクティブ・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	1,173,061,400	98.66
内 日本	1,173,061,400	98.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,886,794	1.34
純資産総額	1,188,948,194	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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

## D I A M U S・リート・オープン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	44,890,541,785	96.17
内 アメリカ	44,890,541,785	96.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,787,443,332	3.83
純資産総額	46,677,985,117	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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

## D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	30,493,669,221	44.62
内 オーストラリア	22,166,757,567	32.44
内 シンガポール	8,326,911,654	12.18
投資証券	34,620,033,320	50.66
内 カナダ	11,668,800,699	17.07
内 イギリス	7,989,774,446	11.69
内 ベルギー	4,683,251,639	6.85
内 オランダ	4,076,253,589	5.96
内 ニュージーランド	2,630,617,044	3.85
内 フランス	2,235,864,987	3.27
内 ドイツ	1,335,470,916	1.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,226,266,591	4.72
純資産総額	68,339,969,132	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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

## D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	39,922,846,190	97.53
内 アメリカ	18,384,360,899	44.91
内 イギリス	7,512,340,241	18.35
内 フランス	3,077,448,219	7.52
内 カナダ	2,600,283,815	6.35
内 ドイツ	1,354,830,414	3.31
内 スイス	1,302,353,890	3.18
内 オーストラリア	962,432,058	2.35
内 イタリア	818,697,876	2.00
内 フィンランド	653,405,912	1.60
内 シンガポール	594,829,265	1.45
内 香港	530,865,476	1.30
内 スペイン	514,504,290	1.26
内 ベルギー	439,209,163	1.07
内 アイルランド	369,601,461	0.90
内 ジャージー	367,132,750	0.90
内 オランダ	228,561,751	0.56
内 スウェーデン	211,988,710	0.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,011,820,019	2.47
純資産総額	40,934,666,209	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

## 高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	14,964,246,024	98.39
内 イギリス	1,874,080,244	12.32
内 アメリカ	1,618,582,233	10.64
内 カナダ	1,522,258,284	10.01
内 マレーシア	1,473,127,950	9.69
内 オーストラリア	1,449,292,191	9.53
内 タイ	1,448,384,189	9.52
内 メキシコ	1,444,588,479	9.50
内 ニュージーランド	1,392,488,195	9.16
内 シンガポール	1,389,760,000	9.14
内 ポーランド	1,351,684,259	8.89
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	245,268,336	1.61
純資産総額	15,209,514,360	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）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	高金利ソブリン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	263,896,815	1.3669 360,746,946	1.3718 362,013,650	- -	34.18%
2	J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	88,229,324	1.8205 160,630,307	1.8688 164,882,960	- -	15.57%
3	ジャパン・セレクション・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	69,102,769	2.3391 161,645,197	2.3539 162,661,007	- -	15.36%
4	国内債券アクティブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	121,733,565	1.3207 160,785,692	1.3245 161,236,106	- -	15.22%
5	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	41,958,454	2.4171 101,421,975	2.4163 101,384,212	- -	9.57%
6	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	23,601,096	2.2668 53,501,324	2.2496 53,093,025	- -	5.01%
7	D I A M US・リート・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	12,657,339	2.9003 36,711,346	2.9765 37,674,569	- -	3.56%

(注) 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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.46%
合計	98.46%

(注) 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。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## ジャパン・セレクション・マザーファンド

平成27年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	143,100	4,449.24 636,686,265	5,088.00 728,092,800	- -	7.36%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	468,500	768.30 359,948,550	790.00 370,115,000	- -	3.74%
3	東洋ゴム工業 日本	株式 ゴム製品	133,400	2,759.27 368,086,936	2,662.00 355,110,800	- -	3.59%
4	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	44,700	7,338.00 328,008,600	7,657.00 342,267,900	- -	3.46%
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	3,900	56,650.00 220,935,000	66,720.00 260,208,000	- -	2.63%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	53,200	4,854.00 258,232,800	4,697.00 249,880,400	- -	2.52%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	54,600	4,390.50 239,721,300	4,565.00 249,249,000	- -	2.52%
8	ソニー 日本	株式 電気機器	75,800	3,224.50 244,417,100	3,177.00 240,816,600	- -	2.43%
9	ヤマハ発動機 日本	株式 輸送用機器	75,800	2,498.42 189,380,512	3,005.00 227,779,000	- -	2.30%
10	A D E K A 日本	株式 化学	120,500	1,556.00 187,498,000	1,820.00 219,310,000	- -	2.22%
11	アルプス電気 日本	株式 電気機器	56,400	3,750.00 211,500,000	3,870.00 218,268,000	- -	2.21%
12	塩野義製薬 日本	株式 医薬品	37,300	4,645.00 173,258,500	5,426.00 202,389,800	- -	2.04%
13	日本航空 日本	株式 空運業	48,000	4,380.00 210,240,000	4,210.00 202,080,000	- -	2.04%
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	36,100	4,590.50 165,717,050	4,540.00 163,894,000	- -	1.66%
15	K D D I 日本	株式 情報・通信業	52,600	2,632.00 138,443,200	3,058.00 160,850,800	- -	1.63%
16	オリックス 日本	株式 その他金融業	81,300	1,633.50 132,803,550	1,776.50 144,429,450	- -	1.46%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	12,300	10,425.00 128,227,500	11,620.00 142,926,000	- -	1.44%
18	セイコーエプソン 日本	株式 電気機器	70,800	1,913.33 135,463,903	1,939.00 137,281,200	- -	1.39%
19	大林組 日本	株式 建設業	120,000	999.06 119,887,394	1,137.00 136,440,000	- -	1.38%
20	エン・ジャパン 日本	株式 サービス業	33,100	3,000.00 99,300,000	4,075.00 134,882,500	- -	1.36%
21	村田製作所 日本	株式 電気機器	7,000	17,385.00 121,695,000	19,100.00 133,700,000	- -	1.35%



22	味の素 日本	株式 食料品	45,000	2,491.50 112,117,500	2,822.50 127,012,500	- -	1.28%
23	電源開発 日本	株式 電気・ガス業	31,900	3,770.00 120,263,000	3,935.00 125,526,500	- -	1.27%
24	ダイフク 日本	株式 機械	60,900	1,772.14 107,923,834	2,001.00 121,860,900	- -	1.23%
25	セブテーニ・ホールディングス 日本	株式 サービス業	51,500	1,860.00 95,790,000	2,342.00 120,613,000	- -	1.22%
26	三菱ケミカルホールディングス 日本	株式 化学	142,400	692.94 98,675,162	806.70 114,874,080	- -	1.16%
27	セイノーホールディングス 日本	株式 陸運業	90,500	1,355.50 122,673,173	1,248.00 112,944,000	- -	1.14%
28	東ソー 日本	株式 化学	160,000	624.44 99,911,523	690.00 110,400,000	- -	1.12%
29	あいホールディングス 日本	株式 卸売業	32,400	2,872.00 93,052,800	3,120.00 101,088,000	- -	1.02%
30	I Tホールディングス 日本	株式 情報・通信業	33,300	2,834.68 94,395,002	2,983.00 99,333,900	- -	1.00%

(注) 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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率
株式	96.89%
合計	96.89%

(注) 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。

## 投資株式の業種別投資比率

平成27年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
輸送用機器	国内	13.99%
電気機器		12.33%
情報・通信業		9.05%
化学		7.48%
銀行業		6.94%
医薬品		6.05%
小売業		5.65%
陸運業		4.98%
サービス業		4.58%
建設業		3.89%
ゴム製品		3.59%
機械		3.18%
不動産業		2.19%
食料品		2.16%
その他金融業		2.10%
卸売業		2.09%
空運業		2.04%
保険業		1.66%
電気・ガス業		1.27%
精密機器		0.97%
非鉄金属	0.50%	
ガラス・土石製品	0.21%	
合計		96.89%

(注) 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。

## 国内債券アクティブ・マザーファンド

平成27年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	6 8回 アコム社債 日本	社債券	100,000,000	100.81 100,819,000	101.63 101,637,000	0.950000 2022/6/6	12.35%
2	4回 ヒューリック社債 日本	社債券	100,000,000	100.30 100,301,000	100.33 100,331,000	0.359000 2019/4/24	12.19%
3	5回 ブラザー工業社債 日本	社債券	100,000,000	100.00 100,000,000	100.00 100,000,000	0.150000 2018/11/26	12.15%
4	1 3 1回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	59,000,000	111.88 66,009,200	114.14 67,345,550	1.700000 2031/9/20	8.19%
5	1 4 5回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	43,000,000	113.04 48,610,550	113.06 48,618,380	1.700000 2033/6/20	5.91%
6	3 3回 利付国庫債券(3 0 年) 日本	国債証券	40,000,000	113.82 45,530,040	115.73 46,292,800	2.000000 2040/9/20	5.63%
7	1 1 8回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	42,000,000	100.65 42,276,100	100.65 42,275,520	0.200000 2019/6/20	5.14%
8	1 1 4回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	31,000,000	118.24 36,654,400	119.90 37,169,310	2.100000 2029/12/20	4.52%
9	3 4 0回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	32,000,000	100.13 32,042,520	100.95 32,304,640	0.400000 2025/9/20	3.93%
10	3 1 7回 北海道電力社債 日本	社債券	22,000,000	103.00 22,660,660	103.51 22,773,080	1.139000 2023/11/24	2.77%
11	4 4回 利付国庫債券(3 0 年) 日本	国債証券	17,000,000	106.36 18,082,160	108.15 18,386,350	1.700000 2044/9/20	2.23%
12	4 7 3回 東北電力社債 日本	社債券	17,000,000	100.74 17,125,800	101.09 17,185,810	0.597000 2021/4/23	2.09%
13	3 3 4回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	16,000,000	103.38 16,541,680	103.31 16,530,880	0.600000 2024/6/20	2.01%
14	4 9 6回 関西電力社債 日本	社債券	12,000,000	99.71 11,965,680	100.71 12,085,440	0.908000 2025/2/25	1.47%
15	3 0 8回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	10,000,000	105.81 10,581,600	105.74 10,574,400	1.300000 2020/6/20	1.29%
16	4 7 1回 東北電力社債 日本	社債券	10,000,000	104.06 10,406,500	104.13 10,413,000	1.168000 2023/12/25	1.27%
17	3 0 7回 北陸電力社債 日本	社債券	10,000,000	101.74 10,174,500	102.28 10,228,500	1.055000 2026/6/25	1.24%
18	1 3 8回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	9,000,000	108.25 9,742,680	110.63 9,956,970	1.500000 2032/6/20	1.21%

19	140回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	8,000,000	112.71 9,017,420	113.58 9,086,400	1.700000 2032/9/20	1.10%
20	76回 伊藤忠商事社債 日本	社債券	8,000,000	100.69 8,055,680	100.92 8,074,240	0.560000 2021/1/29	0.98%
21	178回 オリックス社債 日本	社債券	6,000,000	100.10 6,006,520	100.48 6,029,220	0.552000 2021/6/16	0.73%
22	148回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	5,000,000	106.59 5,329,900	109.16 5,458,400	1.500000 2034/3/20	0.66%
23	320回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000	105.46 5,273,000	105.66 5,283,250	1.000000 2021/12/20	0.64%
24	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000	104.98 5,249,100	105.00 5,250,350	0.800000 2023/6/20	0.64%
25	327回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000	103.73 5,186,500	104.97 5,248,650	0.800000 2022/12/20	0.64%
26	154回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	5,000,000	102.27 5,113,700	102.29 5,114,550	1.200000 2035/9/20	0.62%
27	495回 関西電力社債 日本	社債券	5,000,000	100.62 5,031,100	101.35 5,067,850	0.746000 2021/9/17	0.62%
28	108回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000	100.24 5,012,000	100.22 5,011,250	0.100000 2017/12/20	0.61%
29	93回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000	100.15 5,007,500	100.02 5,001,250	0.500000 2015/12/20	0.61%
30	146回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	4,000,000	110.55 4,422,120	112.87 4,515,160	1.700000 2033/9/20	0.55%

(注) 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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	49.97%
社債券	47.87%
合計	97.83%

(注) 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。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## J - R E I Tオープン・アクティブ・マザーファンド

平成27年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	179	560,755.32 100,375,203	581,000.00 103,999,000	- -	8.75%
2	野村不動産マスターファンド 投資法人 日本	投資証券	603	149,855.32 90,482,647	148,500.00 89,664,300	- -	7.54%
3	ジャパンリアルエステイト投 資法人 日本	投資証券	136	545,981.15 74,253,437	586,000.00 79,696,000	- -	6.70%
4	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	411	171,133.76 70,335,977	160,900.00 66,129,900	- -	5.56%
5	日本リテールファンド投資法 人 日本	投資証券	278	241,176.97 67,047,199	235,500.00 65,469,000	- -	5.51%
6	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	103	602,305.43 62,037,460	607,000.00 62,521,000	- -	5.26%
7	プレミア投資法人 日本	投資証券	410	129,797.64 53,217,033	121,200.00 49,692,000	- -	4.18%
8	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	268	159,162.08 42,655,438	157,900.00 42,317,200	- -	3.56%
9	日本プライムリアルティ投資 法人 日本	投資証券	85	411,178.14 34,950,142	425,000.00 36,125,000	- -	3.04%
10	ユナイテッド・アーバン投資 法人 日本	投資証券	219	186,805.34 40,910,370	164,000.00 35,916,000	- -	3.02%
11	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	391	63,567.35 24,854,835	74,100.00 28,973,100	- -	2.44%
12	ジャパン・ホテル・リート投 資法人 日本	投資証券	322	84,166.65 27,101,662	89,700.00 28,883,400	- -	2.43%
13	グローバル・ワン不動産投資 法人 日本	投資証券	61	404,194.19 24,655,846	454,500.00 27,724,500	- -	2.33%
14	日本プロロジスリート投資法 人 日本	投資証券	125	252,000.00 31,500,000	215,900.00 26,987,500	- -	2.27%
15	日本リート投資法人 日本	投資証券	85	285,712.34 24,285,549	298,300.00 25,355,500	- -	2.13%
16	アクティビア・プロパティ ーズ投資法人 日本	投資証券	49	527,717.04 25,858,135	506,000.00 24,794,000	- -	2.09%
17	福岡リート投資法人 日本	投資証券	122	202,818.22 24,743,824	201,200.00 24,546,400	- -	2.06%
18	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	48	583,266.25 27,996,780	498,500.00 23,928,000	- -	2.01%

19	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	55	442,502.40 24,337,632	420,500.00 23,127,500	- -	1.95%
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	94	244,744.46 23,005,980	235,900.00 22,174,600	- -	1.87%
21	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	79	284,651.18 22,487,444	262,400.00 20,729,600	- -	1.74%
22	いちごオフィスリート投資法人 日本	投資証券	220	85,450.85 18,799,189	88,500.00 19,470,000	- -	1.64%
23	平和不動産リート投資法人 日本	投資証券	224	93,031.49 20,839,055	86,500.00 19,376,000	- -	1.63%
24	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	141	140,913.41 19,868,791	136,400.00 19,232,400	- -	1.62%
25	G L P 投資法人 日本	投資証券	156	119,905.10 18,705,197	120,100.00 18,735,600	- -	1.58%
26	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	143	128,978.39 18,443,910	128,700.00 18,404,100	- -	1.55%
27	MCUBS MidCity 投資法人 日本	投資証券	48	365,780.68 17,557,473	378,500.00 18,168,000	- -	1.53%
28	イオンリート投資法人 日本	投資証券	116	152,996.14 17,747,553	142,200.00 16,495,200	- -	1.39%
29	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	109	150,041.76 16,354,552	149,800.00 16,328,200	- -	1.37%
30	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	29	565,979.20 16,413,397	550,000.00 15,950,000	- -	1.34%

（注）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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率
投資証券	98.66%
合計	98.66%

（注）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。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## D I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド

平成27年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	152,510	15,602.09 2,379,475,451	15,453.21 2,356,769,423	- -	5.05%
2	CYRUSONE INC アメリカ	投資証券	476,108	3,605.53 1,716,625,669	4,447.31 2,117,400,916	- -	4.54%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	84,990	23,422.17 1,990,650,476	23,335.80 1,983,309,642	- -	4.25%
4	TERRENO REALTY CORP アメリカ	投資証券	688,583	2,583.36 1,778,863,629	2,871.53 1,977,287,843	- -	4.24%
5	KITE REALTY GROUP TRUST アメリカ	投資証券	593,252	3,408.06 2,021,843,197	3,324.73 1,972,407,112	- -	4.23%
6	ACADIA REALTY TRUST アメリカ	投資証券	446,260	3,980.90 1,776,519,774	4,159.91 1,856,402,953	- -	3.98%
7	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	145,246	12,545.69 1,822,211,293	11,981.09 1,740,205,543	- -	3.73%
8	DCT INDUSTRIAL TRUST INC アメリカ	投資証券	353,367	4,282.41 1,513,265,780	4,727.34 1,670,486,589	- -	3.58%
9	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES アメリカ	投資証券	318,144	4,990.93 1,587,835,042	4,980.35 1,584,468,788	- -	3.39%
10	CATCHMARK TIMBER TRUST INC アメリカ	投資証券	1,082,160	1,340.25 1,450,370,656	1,402.60 1,517,842,377	- -	3.25%
11	POST PROPERTIES, INC アメリカ	投資証券	198,490	7,143.97 1,418,006,992	7,349.54 1,458,811,941	- -	3.13%
12	FIRST INDUSTRIAL RT アメリカ	投資証券	487,880	2,627.06 1,281,693,393	2,802.75 1,367,406,840	- -	2.93%
13	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	229,810	5,314.61 1,221,352,179	5,354.95 1,230,621,519	- -	2.64%
14	LIBERTY PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	282,690	4,458.09 1,260,259,008	4,195.53 1,186,034,714	- -	2.54%
15	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	120,740	9,794.36 1,182,571,312	9,748.22 1,177,000,493	- -	2.52%
16	EDUCATION REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	257,293	4,345.98 1,118,192,503	4,530.82 1,165,750,791	- -	2.50%
17	AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	562,600	2,128.45 1,197,470,687	2,052.32 1,154,636,469	- -	2.47%
18	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	59,830	16,704.13 999,408,524	18,165.07 1,086,816,616	- -	2.33%
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	37,091	25,451.88 944,035,842	28,719.00 1,065,216,451	- -	2.28%
20	CEDAR REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,174,400	891.19 1,046,620,633	903.95 1,061,604,986	- -	2.27%
21	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES アメリカ	投資証券	502,400	2,208.37 1,109,486,448	2,084.25 1,047,129,912	- -	2.24%

22	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	46,550	20,389.52 949,132,388	22,396.22 1,042,544,366	- -	2.23%
23	COUSINS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	869,500	1,364.57 1,186,496,726	1,190.12 1,034,814,383	- -	2.22%
24	HIGHWOODS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	188,790	5,439.03 1,026,836,325	5,426.18 1,024,409,957	- -	2.19%
25	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP アメリカ	投資証券	411,210	2,110.47 867,849,355	2,269.71 933,328,929	- -	2.00%
26	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	274,150	3,187.58 873,875,059	3,103.66 850,868,772	- -	1.82%
27	BIOMED REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	272,300	2,468.09 672,061,914	2,880.12 784,259,126	- -	1.68%
28	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	71,020	10,077.89 715,732,017	10,571.11 750,760,757	- -	1.61%
29	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	362,930	2,089.13 758,209,075	2,044.95 742,174,792	- -	1.59%
30	UDR INC アメリカ	投資証券	159,440	3,981.58 634,823,640	4,632.77 738,648,912	- -	1.58%

(注) 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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率
投資証券	96.17%
合計	96.17%

(注) 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。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。



## D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	VICINITY CENTRES オーストラリア	投資信託受益 証券	21,443,428	238.57 5,115,922,134	242.32 5,196,385,907	- -	7.60%
2	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	10,615,791	366.57 3,891,528,172	358.64 3,807,336,456	- -	5.57%
3	WAREHOUSES DE PAUW ベルギー	投資証券	330,312	7,734.35 2,554,749,938	9,829.31 3,246,741,819	- -	4.75%
4	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,032,649	2,481.84 2,562,870,670	2,951.04 3,047,397,282	- -	4.46%
5	ALLIED PROPERTIES REIT カナダ	投資証券	950,022	3,400.81 3,230,853,343	3,003.36 2,853,266,434	- -	4.18%
6	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	1,778,892	1,424.18 2,533,478,418	1,540.48 2,740,360,000	- -	4.01%
7	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV オランダ	投資証券	506,927	4,622.62 2,343,332,999	5,198.44 2,635,233,141	- -	3.86%
8	GOODMAN PROPERTY TRUST ニュージーランド	投資証券	26,401,917	88.43 2,334,804,685	99.63 2,630,617,044	- -	3.85%
9	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	2,211,954	1,140.82 2,523,459,057	1,124.21 2,486,709,654	- -	3.64%
10	CHARTER HALL GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,908,131	420.33 2,483,378,882	398.30 2,353,222,756	- -	3.44%
11	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,819,678	1,351.61 2,459,508,115	1,232.73 2,243,189,311	- -	3.28%
12	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA オーストラリア	投資信託受益 証券	10,362,271	161.70 1,675,581,292	183.28 1,899,296,506	- -	2.78%
13	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,717,963	622.12 1,690,918,710	681.16 1,851,388,333	- -	2.71%
14	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,147,091	307.53 1,582,930,189	357.76 1,841,460,335	- -	2.69%
15	MAPLETREE LOGISTICS TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	19,701,320	99.81 1,966,473,473	87.72 1,728,369,221	- -	2.53%
16	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	12,519,840	129.34 1,619,356,495	132.46 1,658,396,786	- -	2.43%
17	NATIONAL STORAGE REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	12,019,303	132.30 1,590,204,958	133.94 1,609,894,290	- -	2.36%
18	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	9,478,152	160.81 1,524,266,929	166.10 1,574,379,811	- -	2.30%
19	SEGRO PLC イギリス	投資証券	1,925,876	710.15 1,367,672,781	804.85 1,550,052,853	- -	2.27%
20	ASCOTT RESIDENCE TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	14,377,600	105.76 1,520,598,046	102.92 1,479,873,428	- -	2.17%
21	FRASERS CENTREPOINT TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	8,667,000	165.90 1,437,877,834	162.42 1,407,765,209	- -	2.06%

22	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券	827,220	1,298.80 1,074,393,336	1,614.40 1,335,470,916	- -	1.95%
23	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST カナダ	投資証券	3,200,000	404.79 1,295,340,480	412.13 1,318,838,720	- -	1.93%
24	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	532,772	2,178.27 1,160,526,592	2,276.11 1,212,651,939	- -	1.77%
25	CROMBIE REAL ESTATE INV カナダ	投資証券	992,261	1,144.62 1,135,763,075	1,197.85 1,188,589,265	- -	1.74%
26	ASCENDAS REAL ESTATE INVT シンガポール	投資信託受益 証券	5,365,100	198.85 1,066,897,810	204.98 1,099,789,702	- -	1.61%
27	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	847,500	1,127.18 955,286,067	1,200.61 1,017,519,687	- -	1.49%
28	ALE PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,579,620	277.57 716,045,760	335.73 866,074,395	- -	1.27%
29	COFINIMMO SA ベルギー	投資証券	66,685	12,249.53 816,860,067	12,949.03 863,506,465	- -	1.26%
30	ICADE フランス	投資証券	96,588	8,583.76 829,089,099	8,714.94 841,759,397	- -	1.23%

（注）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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	44.62%
投資証券	50.66%
合計	95.28%

（注）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。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	83,122	10,316.25 857,508,049	10,736.92 892,474,629	- -	2.18%
2	ALTRIA GROUP INC アメリカ	株式 タバコ	122,212	6,273.25 766,666,560	7,092.85 866,831,995	- -	2.12%
3	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	110,354	7,293.05 804,817,416	6,627.36 731,356,479	- -	1.79%
4	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	172,794	4,294.53 742,069,140	4,123.06 712,441,308	- -	1.74%
5	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	171,137	4,246.02 726,651,609	4,027.26 689,214,529	- -	1.68%
6	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 タバコ	92,673	6,748.91 625,442,386	7,196.63 666,933,383	- -	1.63%
7	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	213,386	3,667.11 782,511,517	3,089.28 659,209,315	- -	1.61%
8	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サー ビス	1,543,666	448.09 691,716,452	416.82 643,441,357	- -	1.57%
9	REYNOLDS AMERICAN INC アメリカ	株式 タバコ	108,584	4,719.72 512,486,612	5,752.88 624,671,677	- -	1.53%
10	BCE INC カナダ	株式 各種電気通信 サービス	110,909	4,961.45 550,270,390	5,243.96 581,602,659	- -	1.42%
11	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	50,374	12,132.36 611,155,676	11,099.24 559,113,287	- -	1.37%
12	ORANGE フランス	株式 各種電気通信 サービス	258,378	1,947.85 503,282,488	2,158.60 557,736,197	- -	1.36%
13	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	78,477	5,760.25 452,047,767	6,623.68 519,806,739	- -	1.27%
14	PPL CORPORATION アメリカ	株式 電力	124,020	3,948.81 489,732,106	4,132.89 512,561,389	- -	1.25%
15	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	15,348	33,117.34 508,284,980	32,831.33 503,895,329	- -	1.23%
16	TOTAL SA フランス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	80,330	6,029.05 484,314,132	6,055.00 486,398,599	- -	1.19%
17	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	36,590	12,447.80 455,465,258	12,573.08 460,049,121	- -	1.12%

18	VECTOR GROUP LTD アメリカ	株式 タバコ	147,286	2,636.40 388,305,981	3,090.15 455,136,009	- -	1.11%
19	LOCKHEED MARTIN CORP アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	16,145	24,758.18 399,720,859	27,746.26 447,963,467	- -	1.09%
20	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	59,870	8,057.16 482,382,561	7,369.20 441,194,004	- -	1.08%
21	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	102,458	3,982.96 408,086,987	4,232.37 433,640,903	- -	1.06%
22	ALLIANZ SE ドイツ	株式 保険	19,588	19,741.75 386,701,594	21,728.92 425,626,163	- -	1.04%
23	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP アメリカ	株式 運送インフラ	44,737	10,454.20 467,689,817	9,193.07 411,270,685	- -	1.00%
24	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	162,881	2,607.59 424,728,265	2,520.71 410,576,253	- -	1.00%
25	AMEREN CORP アメリカ	株式 総合公益事業	77,001	5,097.69 392,527,990	5,319.33 409,594,052	- -	1.00%
26	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	44,167	8,709.45 384,670,702	9,234.83 407,874,992	- -	1.00%
27	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	44,786	8,753.03 392,013,492	9,104.58 407,758,078	- -	1.00%
28	CONOCOPHILLIPS アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	60,634	7,749.87 469,905,774	6,568.41 398,269,190	- -	0.97%
29	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	36,941	11,690.57 431,861,604	10,576.33 390,700,483	- -	0.95%
30	AVIVA PLC イギリス	株式 保険	402,521	993.14 399,762,926	946.99 381,186,581	- -	0.93%

(注) 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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率
株式	97.53%
合計	97.53%

(注) 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。

## 投資株式の業種別投資比率

平成27年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品	外国	10.23%
商業銀行		10.11%
保険		9.74%
タバコ		9.23%
各種電気通信サービス		8.44%
石油・ガス・消耗燃料		8.16%
電力		4.75%
総合公益事業		4.24%
メディア		3.71%
食品		2.99%
無線通信サービス		2.58%
航空宇宙・防衛		1.80%
半導体・半導体製造装置		1.57%
建設・土木		1.55%
化学		1.36%
ソフトウェア		1.27%
水道		1.23%
ホテル・レストラン・レジャー		1.11%
バイオテクノロジー		1.08%
自動車		1.03%
運送インフラ		1.00%
航空貨物・物流サービス		0.94%
家庭用品		0.92%
コンピュータ・周辺機器		0.82%
コングロマリット		0.77%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.71%
金属・鉱業		0.68%
パーソナル用品		0.58%
通信機器		0.57%
建設資材		0.53%
ガス		0.51%
紙製品・林産品		0.51%
各種金融サービス		0.49%
レジャー用品	0.49%	
飲料	0.49%	
商業サービス・用品	0.48%	
情報技術サービス	0.41%	
専門小売り	0.41%	
合計	97.53%	

(注) 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。

## 高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	UK TREASURY 2.0 07/22/20 イギリス	国債証券	1,809,080,000	102.63 1,856,768,456	103.59 1,874,080,244	2.000000 2020/7/22	12.32%
2	US T N/B 1.375 02/29/20 アメリカ	国債証券	1,630,435,500	99.41 1,620,933,315	99.27 1,618,582,233	1.375000 2020/2/29	10.64%
3	MALAYSIA 4.378 11/29/19 マレーシア	国債証券	1,435,000,000	103.02 1,478,377,180	102.65 1,473,127,950	4.378000 2019/11/29	9.69%
4	NEW ZEALAND 3.0 04/15/20 ニュージーランド	国債証券	1,382,918,400	100.79 1,393,935,774	100.69 1,392,488,195	3.000000 2020/4/15	9.16%
5	CANADA 1.5 03/01/20 カナダ	国債証券	1,351,148,800	102.28 1,382,024,936	102.91 1,390,521,276	1.500000 2020/3/1	9.14%
6	SINGAPORE 1.625 10/01/19 シンガポール	国債証券	1,389,760,000	99.80 1,387,037,807	100.00 1,389,760,000	1.625000 2019/10/1	9.14%
7	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20 オーストラリア	国債証券	828,328,000	109.95 910,790,960	109.53 907,325,641	4.500000 2020/4/15	5.97%
8	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 メキシコ	国債証券	783,340,000	111.63 874,481,609	111.47 873,204,764	8.000000 2020/6/11	5.74%
9	THAILAND 3.875 06/13/19 タイ	国債証券	598,500,000	106.76 638,964,585	107.00 640,412,955	3.875000 2019/6/13	4.21%
10	POLAND 5.5 10/25/19 ポーランド	国債証券	517,310,000	113.69 588,129,739	113.40 586,629,540	5.500000 2019/10/25	3.86%
11	POLAND 3.75 04/25/18 ポーランド	国債証券	544,697,000	105.11 572,558,251	104.99 571,915,509	3.750000 2018/4/25	3.76%
12	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18 メキシコ	国債証券	517,300,000	111.20 575,263,465	110.45 571,383,715	8.500000 2018/12/13	3.76%
13	THAILAND 3.65 12/17/21 タイ	国債証券	444,600,000	106.97 475,597,512	107.23 476,780,148	3.650000 2021/12/17	3.13%
14	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19 オーストラリア	国債証券	370,104,000	111.21 411,618,565	109.95 406,936,750	5.250000 2019/3/15	2.68%
15	THAILAND 3.25 06/16/17 タイ	国債証券	322,506,000	103.38 333,426,053	102.69 331,191,086	3.250000 2017/6/16	2.18%
16	POLAND 5.25 10/25/20 ポーランド	国債証券	167,365,000	114.64 191,867,236	115.40 193,139,210	5.250000 2020/10/25	1.27%
17	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19 オーストラリア	国債証券	132,180,000	103.29 136,539,296	102.15 135,029,800	2.750000 2019/10/21	0.89%
18	CANADA 3.75 06/01/19 カナダ	国債証券	119,327,000	111.37 132,895,673	110.40 131,737,008	3.750000 2019/6/1	0.87%

(注) 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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	98.39%
合計	98.39%

（注）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。

## 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）

## ジャパン・セレクション・マザーファンド

平成27年11月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2712月	買建	11	162,910,000	174,020,000	1.76%

（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）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## 国内債券アクティブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

該当事項はありません。

## D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

該当事項はありません。

## D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

該当事項はありません。

## 高金利ソブリン・マザーファンド

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（平成27年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成18年11月8日)	3,031	3,104	1.0343	1.0593
第2特定期間末 (平成19年5月8日)	6,978	7,433	1.1054	1.1774
第3特定期間末 (平成19年11月8日)	10,701	10,829	1.0050	1.0170
第4特定期間末 (平成20年5月8日)	9,350	9,422	0.9010	0.9080
第5特定期間末 (平成20年11月10日)	5,935	6,002	0.6217	0.6287
第6特定期間末 (平成21年5月8日)	5,763	5,829	0.6119	0.6189
第7特定期間末 (平成21年11月9日)	5,647	5,710	0.6287	0.6357
第8特定期間末 (平成22年5月10日)	4,599	4,635	0.6322	0.6372
第9特定期間末 (平成22年11月8日)	3,804	3,835	0.6233	0.6283
第10特定期間末 (平成23年5月9日)	3,282	3,295	0.6444	0.6469
第11特定期間末 (平成23年11月8日)	2,525	2,536	0.5797	0.5822
第12特定期間末 (平成24年5月8日)	2,272	2,281	0.6048	0.6073
第13特定期間末 (平成24年11月8日)	1,899	1,906	0.6114	0.6139
第14特定期間末 (平成25年5月8日)	2,187	2,194	0.8241	0.8266
第15特定期間末 (平成25年11月8日)	1,912	1,918	0.7901	0.7926
第16特定期間末 (平成26年5月8日)	1,647	1,652	0.8171	0.8196
第17特定期間末 (平成26年11月10日)	1,491	1,495	0.8958	0.8983
第18特定期間末 (平成27年5月8日)	1,226	1,230	0.9257	0.9282
第19特定期間末 (平成27年11月9日)	1,065	1,068	0.9003	0.9028
平成26年11月末日	1,474	-	0.9285	-
12月末日	1,449	-	0.9342	-
平成27年1月末日	1,372	-	0.9173	-



2月末日	1,357	-	0.9326	-
3月末日	1,280	-	0.9291	-
4月末日	1,250	-	0.9373	-
5月末日	1,226	-	0.9496	-
6月末日	1,148	-	0.9296	-
7月末日	1,129	-	0.9285	-
8月末日	1,058	-	0.8838	-
9月末日	1,032	-	0.8654	-
10月末日	1,067	-	0.9007	-
11月末日	1,059	-	0.9058	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0250
第2特定期間	0.0840
第3特定期間	0.0260
第4特定期間	0.0210
第5特定期間	0.0210
第6特定期間	0.0210
第7特定期間	0.0210
第8特定期間	0.0170
第9特定期間	0.0150
第10特定期間	0.0075
第11特定期間	0.0075
第12特定期間	0.0075
第13特定期間	0.0075
第14特定期間	0.0075
第15特定期間	0.0075
第16特定期間	0.0075
第17特定期間	0.0075
第18特定期間	0.0075
第19特定期間	0.0075

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	5.9
第2特定期間	15.0
第3特定期間	6.7
第4特定期間	8.3
第5特定期間	28.7
第6特定期間	1.8
第7特定期間	6.2
第8特定期間	3.3
第9特定期間	1.0
第10特定期間	4.6
第11特定期間	8.9
第12特定期間	5.6
第13特定期間	2.3
第14特定期間	36.0
第15特定期間	3.2
第16特定期間	4.4
第17特定期間	10.5
第18特定期間	4.2
第19特定期間	1.9

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1特定期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	3,012,410,722	81,560,484
第2特定期間	3,945,715,927	562,935,400
第3特定期間	5,065,799,987	730,982,231
第4特定期間	289,060,834	559,653,233
第5特定期間	43,617,037	874,268,467
第6特定期間	57,610,908	185,438,942
第7特定期間	54,405,415	490,942,217
第8特定期間	38,274,159	1,745,390,064
第9特定期間	26,785,109	1,198,695,817
第10特定期間	15,254,576	1,025,078,928
第11特定期間	13,841,925	751,920,633
第12特定期間	10,842,593	609,617,246
第13特定期間	6,837,426	657,902,253
第14特定期間	11,438,694	462,970,501
第15特定期間	4,241,088	238,551,301
第16特定期間	4,571,190	408,819,196
第17特定期間	2,381,432	353,467,789
第18特定期間	1,374,876	340,968,128
第19特定期間	1,805,271	143,312,878

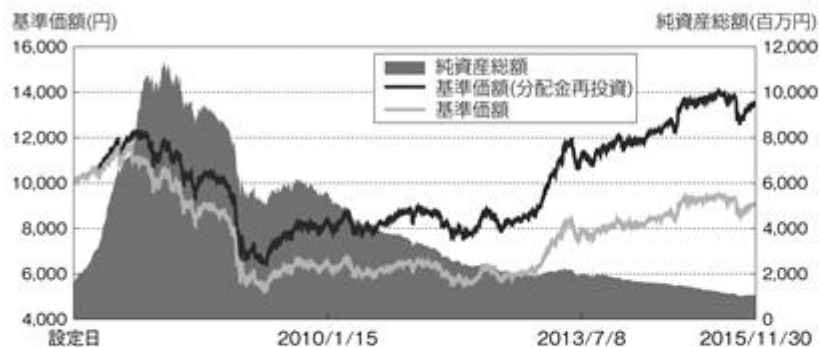
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2015年11月30日

## 基準価額・純資産の推移（設定日(2006年7月20日)～2015年11月30日）



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2006年7月20日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移（税引前）

第51期(2015.03.09)	25円
第52期(2015.05.08)	25円
第53期(2015.07.08)	25円
第54期(2015.09.08)	25円
第55期(2015.11.09)	25円
直近1年間累計	150円
設定来累計	3,260円

(注)分配金は1万円当たりです。

## 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## ■組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	高金利ソブリン・マザーファンド	34.18%
2	J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド	15.57%
3	ジャパン・セレクション・マザーファンド	15.36%
4	国内債券アクティブ・マザーファンド	15.22%
5	DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	9.57%
6	DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	5.01%
7	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	3.56%

## ■国内債券アクティブ・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	49.97
内 日本	49.97
社債券	47.87
内 日本	47.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.17
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	68回 アコム社債	社債券	日本	0.95000	2022/6/6	12.35%
2	4回 ヒューリック社債	社債券	日本	0.35900	2019/4/24	12.19%
3	5回 プラザ工業社債	社債券	日本	0.15000	2018/11/26	12.15%
4	131回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.70000	2031/9/20	8.19%
5	145回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.70000	2033/6/20	5.91%
6	33回 利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	2.00000	2040/9/20	5.63%
7	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.20000	2019/6/20	5.14%
8	114回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2.10000	2029/12/20	4.52%
9	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.40000	2025/9/20	3.93%
10	317回 北海道電力社債	社債券	日本	1.13900	2023/11/24	2.77%

## ■高金利ソブリン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	98.39
内 イギリス	12.32
内 アメリカ	10.64
内 カナダ	10.01
内 マレーシア	9.69
内 オーストラリア	9.53
内 その他	46.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.61
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	UK TREASURY 2.007/22/20	国債証券	イギリス	2.00000	2020/7/22	12.32%
2	US T N/B 1.375 02/29/20	国債証券	アメリカ	1.37500	2020/2/29	10.64%
3	MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	マレーシア	4.37800	2019/11/29	9.69%
4	NEW ZEALAND 3.004/15/20	国債証券	ニュージーランド	3.00000	2020/4/15	9.16%
5	CANADA 1.5 03/01/20	国債証券	カナダ	1.50000	2020/3/1	9.14%
6	SINGAPORE 1.625 10/01/19	国債証券	シンガポール	1.62500	2019/10/1	9.14%
7	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	オーストラリア	4.50000	2020/4/15	5.97%
8	MEXICAN BONDS 8.006/11/20	国債証券	メキシコ	8.00000	2020/6/11	5.74%
9	THAILAND 3.875 06/13/19	国債証券	タイ	3.87500	2019/6/13	4.21%
10	POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	ポーランド	5.50000	2019/10/25	3.86%

○ 掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○ 委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日: 2015年11月30日

## 主要な資産の状況

### ■ジャパン・セレクション・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	96.89
内 日本	96.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.11
純資産総額	100.00

#### その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.76

#### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	富士重工業	株式	日本	輸送用機器	7.36%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	3.74%
3	東洋ゴム工業	株式	日本	ゴム製品	3.59%
4	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.46%
5	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.63%
6	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.52%
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	2.52%
8	ソニー	株式	日本	電気機器	2.43%
9	ヤマハ発動機	株式	日本	輸送用機器	2.30%
10	ADEKA	株式	日本	化学	2.22%

#### 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	輸送用機器	13.99%
2	電気機器	12.33%
3	情報・通信業	9.05%
4	化学	7.48%
5	銀行業	6.94%

### ■DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.53
内 アメリカ	44.91
内 イギリス	18.35
内 フランス	7.52
内 カナダ	6.35
内 ドイツ	3.31
内 その他	17.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.47
純資産総額	100.00

#### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	アメリカ	タバコ	2.18%
2	ALTRIA GROUP INC	株式	アメリカ	タバコ	2.12%
3	MERCK & CO. INC.	株式	アメリカ	医薬品	1.79%
4	AT&T INC	株式	アメリカ	各種電気通信サービス	1.74%
5	PFIZER INC	株式	アメリカ	医薬品	1.68%
6	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	株式	イギリス	タバコ	1.63%
7	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	株式	イギリス	石油・ガス・消耗燃料	1.61%
8	VODAFONE GROUP PLC	株式	イギリス	無線通信サービス	1.57%
9	REYNOLDS AMERICAN INC	株式	アメリカ	タバコ	1.53%
10	BCE INC	株式	カナダ	各種電気通信サービス	1.42%

#### 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	医薬品	10.23%
2	商業銀行	10.11%
3	保険	9.74%
4	タバコ	9.23%
5	各種電気通信サービス	8.44%

### ■J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	98.66
内 日本	98.66
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.34
純資産総額	100.00

#### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	8.75%
2	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	7.54%
3	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	6.70%
4	オリックス不動産投資法人	日本	5.56%
5	日本リテールファンド投資法人	日本	5.51%
6	大和証券オフィス投資法人	日本	5.26%
7	プレミア投資法人	日本	4.18%
8	森ヒルズリート投資法人	日本	3.56%
9	日本プライムリアルティ投資法人	日本	3.04%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	3.02%

○ 掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○ 委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2015年11月30日

## 主要な資産の状況

### ■DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	96.17
内 アメリカ	96.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.83
純資産総額	100.00

#### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	5.05%
2	CYRUSONE INC	アメリカ	4.54%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	4.25%
4	TERRENO REALTY CORP	アメリカ	4.24%
5	KITE REALTY GROUP TRUST	アメリカ	4.23%
6	ACADIA REALTY TRUST	アメリカ	3.98%
7	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	3.73%
8	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	アメリカ	3.58%
9	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	アメリカ	3.39%
10	CATCHMARK TIMBER TRUST INC	アメリカ	3.25%

### ■DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

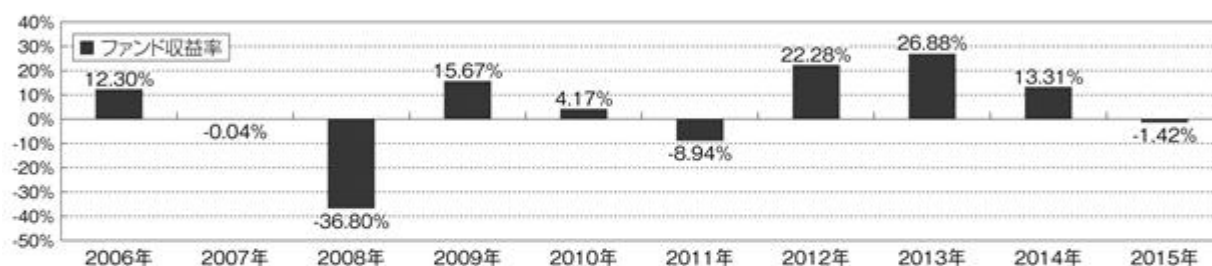
#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	44.62
内 オーストラリア	32.44
内 シンガポール	12.18
投資証券	50.66
内 カナダ	17.07
内 イギリス	11.69
内 ベルギー	6.85
内 オランダ	5.96
内 ニュージーランド	3.85
内 その他	5.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.72
純資産総額	100.00

#### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	VICINITY CENTRES	オーストラリア	7.60%
2	CHARTER HALL RETAIL REIT	オーストラリア	5.57%
3	WAREHOUSES DE PAUW	ベルギー	4.75%
4	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	カナダ	4.46%
5	ALLIED PROPERTIES REIT	カナダ	4.18%
6	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	4.01%
7	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	オランダ	3.86%
8	GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド	3.85%
9	HAMMERSON PLC	イギリス	3.64%
10	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	3.44%

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものとして算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○ 掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○ 委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年5月9日から平成27年11月9日まで）の財務諸表について、P w C あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 世界6資産アクティブ・バランス・ファンド

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成27年5月8日現在	当 期 平成27年11月9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	26,998,631	20,979,101
親投資信託受益証券	1,208,445,424	1,050,498,225
流動資産合計	1,235,444,055	1,071,477,326
資産合計	1,235,444,055	1,071,477,326
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,313,252	2,959,483
未払解約金	2,036,669	26,934
未払受託者報酬	135,084	115,406
未払委託者報酬	3,073,392	2,625,746
その他未払費用	10,661	9,101
流動負債合計	8,569,058	5,736,670
負債合計	8,569,058	5,736,670
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,325,301,068	1,183,793,461
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 98,426,071	2 118,052,805
(分配準備積立金)	35,235,773	31,408,345
元本等合計	1,226,874,997	1,065,740,656
純資産合計	1,226,874,997	1,065,740,656
負債純資産合計	1,235,444,055	1,071,477,326



## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	前 期 自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	当 期 自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
<b>営業収益</b>		
受取利息	4,410	4,332
有価証券売買等損益	69,943,777	11,947,199
<b>営業収益合計</b>	<b>69,948,187</b>	<b>11,942,867</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	434,640	365,388
委託者報酬	2 9,888,941	2 8,313,521
その他費用	34,315	28,825
<b>営業費用合計</b>	<b>10,357,896</b>	<b>8,707,734</b>
営業利益又は営業損失（ ）	59,590,291	20,650,601
経常利益又は経常損失（ ）	59,590,291	20,650,601
当期純利益又は当期純損失（ ）	59,590,291	20,650,601
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,475,101	2,028,845
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	173,507,846	98,426,071
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,744,593	12,272,436
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	29,744,593	12,272,436
剰余金減少額又は欠損金増加額	115,618	194,217
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	115,618	194,217
分配金	1 10,662,390	1 9,025,507
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	98,426,071	118,052,805

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年5月8日及び11月8日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を平成27年11月9日としております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	前 期 平成27年5月8日現在	当 期 平成27年11月9日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	1,664,894,320円 1,374,876円 340,968,128円	1,325,301,068円 1,805,271円 143,312,878円
2 . 受益権の総数	1,325,301,068口	1,183,793,461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98,426,071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118,052,805円であります。

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	前 期 自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	当 期 自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1 . 1 分配金の計算過程	( 自平成26年11月11日 至平成27年1月8日 ) 計算期間末における費用控除後の配当等収益 ( 7,165,541円 )、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益 ( 0円 )、信託約款に規定される収益調整金 ( 19,780,678円 ) 及び分配準備積立金 ( 36,720,665円 ) より分配対象収益は63,666,884円 ( 1万口当たり412.76円 ) であり、うち3,856,128円 ( 1万口当たり25円 ) を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。(以下、各期間において同じ。)	( 自平成27年5月9日 至平成27年7月8日 ) 計算期間末における費用控除後の配当等収益 ( 2,741,894円 )、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益 ( 0円 )、信託約款に規定される収益調整金 ( 15,791,319円 ) 及び分配準備積立金 ( 32,661,475円 ) より分配対象収益は51,194,688円 ( 1万口当たり416.60円 ) であり、うち3,072,196円 ( 1万口当たり25円 ) を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。(以下、各期間において同じ。)

<p>2 . 2 当ファンドの主要投資対象であるD I A M U S・リート・オープン・マザーファンド、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド及び高金利ソブリン・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用</p>	<p>(自平成27年1月9日 至平成27年3月9日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,240,984円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(17,930,711円)及び分配準備積立金(36,248,396円)より分配対象収益は56,420,091円(1万口当たり403.81円)であり、うち3,493,010円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成27年3月10日 至平成27年5月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,363,279円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(17,018,128円)及び分配準備積立金(33,185,746円)より分配対象収益は55,567,153円(1万口当たり419.28円)であり、うち3,313,252円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成27年7月9日 至平成27年9月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,368,337円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(15,399,328円)及び分配準備積立金(31,495,897円)より分配対象収益は48,263,562円(1万口当たり403.03円)であり、うち2,993,828円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成27年9月9日 至平成27年11月9日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,864,002円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(15,247,854円)及び分配準備積立金(29,503,826円)より分配対象収益は49,615,682円(1万口当たり419.12円)であり、うち2,959,483円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>
	956,136円	803,477円

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前 期 自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	当 期 自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成27年5月8日現在	当 期 平成27年11月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 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)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前 期 平成27年5月8日現在	当 期 平成27年11月9日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	13,437,221	69,905,344
合計	13,437,221	69,905,344

（デリバティブ取引等に関する注記）

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）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前 期 平成27年5月8日現在	当 期 平成27年11月9日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9257円 (9,257円)

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## ( 1 ) 株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

平成27年11月9日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ジャパン・セレクション・マザーファンド	69,102,769	161,645,197	
	国内債券アクティブ・マザーファンド	121,733,565	160,785,692	
	J - R E I Tオープン・アクティブ・マ ザーファンド	88,229,324	160,630,307	
	D I A M U S・リート・オープン・マ ザーファンド	12,657,339	36,711,346	
	D I A M インターナショナル・リート・ インカム・オープン・マザーファンド	28,045,541	63,576,436	
	D I A M世界好配当株オープン・マザー ファンド	41,958,454	101,421,975	
	高金利ソブリン・マザーファンド	267,540,068	365,727,272	
親投資信託受益証券 合計		629,267,060	1,050,498,225	
合計		629,267,060	1,050,498,225	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ジャパン・セレクション・マザーファンド」受益証券、「国内債券アクティブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド」受益証券、「DIAM US・リート・オープン・マザーファンド」受益証券、「DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド」受益証券、「DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド」受益証券及び「高金利ソブリン・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、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「ジャパン・セレクション・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		287,939,319	263,048,467
株式		9,574,394,520	9,624,989,370
派生商品評価勘定		12,888,520	18,104,788
未収入金		372,304,593	73,946,538
未収配当金		73,194,157	60,017,114
差入委託証拠金		10,493,520	8,380,788
流動資産合計		10,331,214,629	10,048,487,065
資産合計		10,331,214,629	10,048,487,065
負債の部			
流動負債			
前受金		9,588,520	14,984,788
未払金		328,962,399	62,606,270
未払解約金		26,500,000	17,000,000
流動負債合計		365,050,919	94,591,058
負債合計		365,050,919	94,591,058
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,500,360,301	4,255,243,932
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		5,465,803,409	5,698,652,075
元本等合計		9,966,163,710	9,953,896,007
純資産合計		9,966,163,710	9,953,896,007
負債純資産合計		10,331,214,629	10,048,487,065



## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等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、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	5,275,231,563円 38,513,331円 813,384,593円	4,500,360,301円 186,027,409円 431,143,778円
元本の内訳 ファンド名 I B J I T Mジャパン・セレクション D I A Mジャパン・セレクション< D C 年金 > 世界6資産アクティブ・バランス・ファンド D I A M世界6資産バランスファンド ジャパン・セレクション私募ファンド（適格機関投資家向け）	3,123,723,626円 944,170,794円 79,784,175円 238,856,466円 113,825,240円	2,826,682,906円 1,042,971,250円 69,102,769円 203,225,492円 113,261,515円
計	4,500,360,301円	4,255,243,932円
2. 受益権の総数	4,500,360,301口	4,255,243,932口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、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。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	171,669,198	687,008,036
合計	171,669,198	687,008,036

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年3月18日から平成27年5月8日まで及び平成27年9月18日から平成27年11月9日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	304,805,000	-	317,700,000	12,895,000	188,526,000	-	206,635,000	18,109,000
合計	304,805,000	-	317,700,000	12,895,000	188,526,000	-	206,635,000	18,109,000

## （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で評価しております。

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	2.2145円	2.3392円
（1万口当たり純資産額）	（22,145円）	（23,392円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成27年11月9日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
安藤・間	42,400	712.00	30,188,800	
大林組	120,000	1,048.00	125,760,000	
清水建設	92,000	1,043.00	95,956,000	
長谷工コーポレーション	54,400	1,229.00	66,857,600	
鹿島建設	20,000	682.00	13,640,000	
五洋建設	56,500	524.00	29,606,000	
クックパッド	12,700	2,246.00	28,524,200	
総合警備保障	16,700	5,740.00	95,858,000	
サンエー	8,300	5,190.00	43,077,000	
JALUX	12,700	2,543.00	32,296,100	
味の素	45,000	2,774.50	124,852,500	
キューピー	29,500	2,760.00	81,420,000	
ビックカメラ	21,300	1,019.00	21,704,700	
あいホールディングス	43,400	3,015.00	130,851,000	
マツモトキヨシホールディングス	12,900	5,450.00	70,305,000	
ウエルシアホールディングス	6,700	5,900.00	39,530,000	
ユニゾホールディングス	16,800	4,865.00	81,732,000	
セブン&アイ・ホールディングス	17,600	5,735.00	100,936,000	
クスリのアオキ	13,600	5,810.00	79,016,000	
ITホールディングス	33,300	2,999.00	99,866,700	
GMOペイメントゲートウェイ	11,700	4,590.00	53,703,000	
東ソー	137,000	664.00	90,968,000	
東京応化工業	14,000	3,715.00	52,010,000	
三菱ケミカルホールディングス	142,400	796.30	113,393,120	
セブテーニ・ホールディングス	51,500	1,991.00	102,536,500	
ADEKA	120,500	1,777.00	214,128,500	
日油	85,000	945.00	80,325,000	
塩野義製薬	37,300	5,186.00	193,437,800	
田辺三菱製薬	25,400	2,108.00	53,543,200	
日本新薬	15,000	5,090.00	76,350,000	
中外製薬	12,000	4,070.00	48,840,000	
小野薬品工業	3,300	16,895.00	55,753,500	
参天製薬	28,500	1,773.00	50,530,500	
JCRファーマ	11,900	2,740.00	32,606,000	
ダイト	21,700	2,826.00	61,324,200	
ペプチドリーム	8,700	2,859.00	24,873,300	
大塚商会	11,800	5,750.00	67,850,000	
エン・ジャパン	33,100	3,190.00	105,589,000	
東洋ゴム工業	126,200	2,671.00	337,080,200	
DOWAホールディングス	30,000	913.00	27,390,000	
UACJ	166,000	275.00	45,650,000	
アイダエンジニアリング	29,000	1,238.00	35,902,000	
DMG森精機	19,500	1,863.00	36,328,500	

日本郵政	4,600	1,702.00	7,829,200
豊田自動織機	11,100	6,760.00	75,036,000
クボタ	36,000	1,994.50	71,802,000
ダイフク	50,800	1,849.00	93,929,200
日本精工	35,800	1,457.00	52,160,600
ミネベア	21,000	1,537.00	32,277,000
マブチモーター	8,100	6,590.00	53,379,000
セイコーエプソン	68,800	1,930.00	132,784,000
ソニー	87,200	3,478.00	303,281,600
アルプス電気	56,400	3,980.00	224,472,000
フォスター電機	13,000	3,055.00	39,715,000
キーエンス	4,000	66,900.00	267,600,000
イリソ電子工業	2,500	6,540.00	16,350,000
村田製作所	7,000	19,565.00	136,955,000
日東電工	10,700	8,822.00	94,395,400
全国保証	15,700	4,250.00	66,725,000
トヨタ自動車	44,700	7,625.00	340,837,500
富士重工業	143,100	5,014.00	717,503,400
ヤマハ発動機	75,800	2,935.00	222,473,000
小糸製作所	7,200	4,810.00	34,632,000
島津製作所	55,000	1,909.00	104,995,000
ニチハ	12,200	1,714.00	20,910,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,400	2,510.00	93,874,000
イズミ	14,900	4,620.00	68,838,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	468,500	822.20	385,200,700
三井住友トラスト・ホールディングス	143,000	501.90	71,771,700
三井住友フィナンシャルグループ	53,200	5,118.00	272,277,600
琉球銀行	15,900	1,746.00	27,761,400
オリックス	81,300	1,841.50	149,713,950
東京海上ホールディングス	36,100	4,964.00	179,200,400
三井不動産	22,000	3,127.00	68,794,000
東京建物	27,900	1,460.00	40,734,000
住友不動産	9,000	3,747.00	33,723,000
東日本旅客鉄道	12,300	11,720.00	144,156,000
西日本旅客鉄道	17,000	8,215.00	139,655,000
東海旅客鉄道	1,900	22,205.00	42,189,500
サカイ引越センター	11,100	6,150.00	68,265,000
セイノーホールディングス	74,800	1,380.00	103,224,000
日本航空	54,200	4,639.00	251,433,800
日本テレビホールディングス	18,600	2,188.00	40,696,800
日本電信電話	54,600	4,813.00	262,789,800
KDDI	52,600	3,007.00	158,168,200
NTTドコモ	35,700	2,494.00	89,035,800
電源開発	31,900	4,175.00	133,182,500
エイチ・アイ・エス	11,700	4,085.00	47,794,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,300	3,125.00	100,937,500
藤田観光	145,000	475.00	68,875,000
ミスミグループ本社	42,200	1,677.00	70,769,400
ソフトバンクグループ	7,200	6,916.00	49,795,200

合計	4,100,300		9,624,989,370	
----	-----------	--	---------------	--

( 2 ) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「( デリバティブ取引等に関する注記 ) 」にて記載しております。

## 「国内債券アクティブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		12,691,333	15,568,318
国債証券		483,414,700	384,841,680
社債券		414,821,850	417,224,460
未収入金		10,022,100	337,840
未収利息		1,797,944	1,630,898
前払費用		386,397	295,302
差入委託証拠金		-	550,000
流動資産合計		923,134,324	820,448,498
資産合計		923,134,324	820,448,498
負債の部			
流動負債			
未払金		11,110,640	-
流動負債合計		11,110,640	-
負債合計		11,110,640	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	701,438,654	621,190,694
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		210,585,030	199,257,804
元本等合計		912,023,684	820,448,498
純資産合計		912,023,684	820,448,498
負債純資産合計		923,134,324	820,448,498



## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び社債券 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、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)

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	913,079,623円  387,389円 212,028,358円	701,438,654円  - 円 80,247,960円
元本の内訳 ファンド名 世界6資産アクティブ・バランス・ファンド D I A M世界6資産バランスファンド D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	140,831,941円 417,748,191円 142,858,522円	121,733,565円 356,598,607円 142,858,522円
計	701,438,654円	621,190,694円
2. 受益権の総数	701,438,654口	621,190,694口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、債券先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、市場金利の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 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)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	8,419,450	2,646,370
社債券	1,237,290	1,139,670
合計	9,656,740	3,786,040

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月9日から平成27年5月8日まで及び平成27年5月9日から平成27年11月9日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

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）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	1.3002円	1.3208円
（1万口当たり純資産額）	（13,002円）	（13,208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

平成27年11月9日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	9 3 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000	5,002,650	
	1 0 8 回 利付国庫債券(5年)	35,000,000	35,070,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(5年)	17,000,000	17,110,160	
	6 回 利付国庫債券(40年)	3,000,000	3,347,370	
	7 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000	1,056,400	
	8 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000	965,690	
	3 2 0 回 利付国庫債券(10年)	5,000,000	5,279,500	
	3 2 7 回 利付国庫債券(10年)	5,000,000	5,239,550	
	3 2 9 回 利付国庫債券(10年)	5,000,000	5,240,400	
	3 4 0 回 利付国庫債券(10年)	32,000,000	32,213,760	
	3 3 回 利付国庫債券(30年)	39,000,000	44,844,540	
	3 9 回 利付国庫債券(30年)	3,000,000	3,382,830	
	4 0 回 利付国庫債券(30年)	2,000,000	2,206,760	
	4 1 回 利付国庫債券(30年)	1,000,000	1,080,110	
	4 4 回 利付国庫債券(30年)	17,000,000	18,311,550	
	4 5 回 利付国庫債券(30年)	2,000,000	2,056,240	
	3 2 回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,132,900	
	1 1 4 回 利付国庫債券(20年)	31,000,000	37,023,610	
	1 1 7 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000	1,194,280	
	1 3 1 回 利付国庫債券(20年)	59,000,000	67,038,160	
	1 3 7 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000	1,131,920	
	1 3 8 回 利付国庫債券(20年)	9,000,000	9,908,910	
	1 4 0 回 利付国庫債券(20年)	8,000,000	9,042,640	
	1 4 1 回 利付国庫債券(20年)	3,000,000	3,385,890	
	1 4 5 回 利付国庫債券(20年)	43,000,000	48,374,570	
	1 4 6 回 利付国庫債券(20年)	4,000,000	4,492,280	
1 4 7 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000	2,209,360		
1 4 8 回 利付国庫債券(20年)	5,000,000	5,429,750		
1 5 2 回 利付国庫債券(20年)	3,000,000	3,069,900		
国債証券 合計		352,000,000	384,841,680	
社債券	4 回 ヒューリック社債	100,000,000	100,343,000	
	7 6 回 伊藤忠商事社債	8,000,000	8,075,280	
	6 8 回 アコム社債	100,000,000	101,510,000	
	6 0 回 日立キャピタル社債	100,000,000	100,005,000	
	1 7 8 回 オリックス社債	6,000,000	6,027,780	
	4 9 5 回 関西電力社債	5,000,000	5,062,550	
	4 9 6 回 関西電力社債	12,000,000	12,054,240	
	3 0 7 回 北陸電力社債	10,000,000	10,198,200	
	4 7 1 回 東北電力社債	10,000,000	10,395,700	
	4 7 3 回 東北電力社債	17,000,000	17,173,740	

	4 2 6 回 九州電力社債	13,000,000	13,297,570	
	3 1 6 回 北海道電力社債	10,000,000	10,346,600	
	3 1 7 回 北海道電力社債	22,000,000	22,734,800	
社債券	合計	413,000,000	417,224,460	
	合計	765,000,000	802,066,140	

## 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。

## 「J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		26,667,126	63,356,090
投資証券		1,222,718,700	1,089,815,220
未収入金		25,722,578	871,380
未収配当金		10,173,138	7,290,173
流動資産合計		1,285,281,542	1,161,332,863
資産合計		1,285,281,542	1,161,332,863
負債の部			
流動負債			
未払金		697,409	3,059,288
流動負債合計		697,409	3,059,288
負債合計		697,409	3,059,288
純資産の部			
元本等			
元本	1	670,204,497	636,200,387
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		614,379,636	522,073,188
元本等合計		1,284,584,133	1,158,273,575
純資産合計		1,284,584,133	1,158,273,575
負債純資産合計		1,285,281,542	1,161,332,863

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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、金融商品取引所等における最終相場（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、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9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	862,479,254円	670,204,497円
同期中追加設定元本額	163,776円	- 円
同期中一部解約元本額	192,438,533円	34,004,110円
元本の内訳		
ファンド名		
世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	98,729,392円	88,229,324円
D I A M世界6資産バランスファンド	286,092,874円	273,236,759円
D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	285,382,231円	274,734,304円
計	670,204,497円	636,200,387円
2 . 受益権の総数	670,204,497口	636,200,387口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 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)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	129,096,073	53,798,205
合計	129,096,073	53,798,205

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月9日から平成27年5月8日まで及び平成27年5月9日から平成27年11月9日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

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）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	1.9167円	1.8206円
（1万口当たり純資産額）	（19,167円）	（18,206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

平成27年11月9日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	172	20,554,000	
	MCUBS MidCity投資法人	38	13,110,000	
	SIA不動産投資法人	8	3,716,000	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	49	24,549,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	86	22,446,000	
	イオンリート投資法人	116	16,495,200	
	インヴィンシブル投資法人	365	25,404,000	
	オリックス不動産投資法人	402	64,440,600	
	グローバル・ワン不動産投資法人	51	20,349,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	29	15,573,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	20	4,634,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	39	8,802,300	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	262	22,872,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	67	8,790,400	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	138	75,210,000	
	スターツプロシード投資法人	12	2,006,400	
	トーセイ・リート投資法人	65	7,442,500	
	トップリート投資法人	18	8,226,000	
	ヒューリックリート投資法人	81	12,798,000	
	フロンティア不動産投資法人	52	25,194,000	
	プレミア投資法人	410	47,437,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	232	38,280,000	
	阪急リート投資法人	63	8,145,900	
	産業ファンド投資法人	22	11,990,000	
	森トラスト総合リート投資法人	65	13,715,000	
	森ヒルズリート投資法人	208	30,888,000	
	星野リゾート・リート投資法人	5	6,000,000	
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	105	11,613,000	
	積水ハウス・リート投資法人	143	17,875,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	31	7,601,200	
	大和ハウスリート投資法人	13	6,279,000	
	大和証券オフィス投資法人	103	62,830,000	
	東急リアル・エステート投資法人	109	15,903,100	
	日本アコモデーションファンド投資法人	57	23,740,500	
日本ビルファンド投資法人	170	95,200,000		
日本プライムリアルティ投資法人	61	23,942,500		
日本プロロジスリート投資法人	159	35,266,200		
日本リート投資法人	60	17,202,000		
日本リテールファンド投資法人	289	66,181,000		
日本ロジスティクスファンド投資法人	54	12,285,000		

	日本賃貸住宅投資法人	69	5,533,800	
	福岡リート投資法人	97	18,759,800	
	平和不動産リート投資法人	224	20,048,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	591	90,486,220	
投資証券	合計	5,410	1,089,815,220	
合計		5,410	1,089,815,220	

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。

## 「D I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
資産の部			
流動資産			
預金		905,331,256	936,596,058
コール・ローン		2,381,123,737	1,400,278,200
投資証券		49,530,647,495	43,866,860,189
未収入金		1,460,548,234	-
未収配当金		27,860,059	40,307,342
流動資産合計		54,305,510,781	46,244,041,789
資産合計		54,305,510,781	46,244,041,789
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		8,000	-
未払金		2,532,353,421	-
未払解約金		300,000,000	-
流動負債合計		2,832,361,421	-
負債合計		2,832,361,421	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	18,633,661,546	15,944,004,642
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		32,839,487,814	30,300,037,147
元本等合計		51,473,149,360	46,244,041,789
純資産合計		51,473,149,360	46,244,041,789
負債純資産合計		54,305,510,781	46,244,041,789

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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、金融商品取引所等における最終相場（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、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。
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  外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,990,256,600円	18,633,661,546円
	同期中追加設定元本額	27,267,510円	6,355,018円
	同期中一部解約元本額	3,383,862,564円	2,696,011,922円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	17,167,854円	12,657,339円
	D I A M世界6資産バランスファンド	74,652,429円	58,972,031円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	90,035,418円	76,026,227円
	D I A M ワールド・リート・インカム・オープン（毎月決算コース）	17,213,706,749円	14,739,764,520円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	283,878,037円	236,857,455円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	608,162,938円	532,360,155円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	205,162,761円	169,726,144円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	33,091,034円	30,542,038円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	107,046,285円	85,798,287円
	D I A M米国リート・オープン（毎月決算型）	758,041円	1,300,446円
	計	18,633,661,546円	15,944,004,642円
2 .	受益権の総数	18,633,661,546口	15,944,004,642口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、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。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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。	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よった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	1,400,930,138	558,874,156
合計	1,400,930,138	558,874,156

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年12月10日から平成27年5月8日まで及び平成26年12月10日から平成27年11月9日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	1,198,208,000	-	1,198,200,000	8,000	-	-	-	-
アメリカ・ドル	1,198,208,000	-	1,198,200,000	8,000	-	-	-	-
合計	1,198,208,000	-	1,198,200,000	8,000	-	-	-	-

## （注）時価の算定方法

1. 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。  
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。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。  
・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	2.7624円	2.9004円
（1万口当たり純資産額）	(27,624円)	(29,004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

平成27年11月9日現在

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	ACADIA REALTY TRUST	409,270.000	13,374,943.600	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,384.000	4,682,605.760	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	291,774.000	11,586,345.540	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	362,930.000	5,923,017.600	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	562,600.000	8,607,780.000	
		AMERICAN TOWER CORP	44,490.000	4,361,354.700	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	124,080.000	4,602,127.200	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,690.000	7,383,235.500	
		BIOMED REALTY TRUST INC	272,300.000	6,339,144.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	139,870.000	17,370,455.300	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	190,750.000	2,508,362.500	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	251,430.000	6,273,178.500	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	992,460.000	11,194,948.800	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,077,060.000	7,571,731.800	
		COUSINS PROPERTIES INC	797,430.000	7,966,325.700	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	65,130.000	5,517,813.600	
		CYRUSONE INC	436,648.000	15,156,052.080	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	353,367.000	13,078,112.670	
		DDR CORP	296,950.000	4,884,827.500	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	316,560.000	3,675,261.600	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	135,200.000	4,412,928.000	
		EAST GROUP	71,140.000	3,925,505.200	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	257,293.000	9,097,880.480	
		EQUITY RESIDENTIAL	51,350.000	3,948,815.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	34,021.000	7,441,753.540			
FEDERAL REALTY INVS TRUST	54,870.000	7,908,413.100			
FIRST INDUSTRIAL RT	447,440.000	9,745,243.200			
HIGHWOODS PROPERTIES INC	173,140.000	7,396,540.800			
KITE REALTY GROUP TRUST	544,082.000	14,369,205.620			

	LIBERTY PROPERTY TRUST	393,990.000	13,108,047.300	
	NATIONAL HEALTH INVS INC	41,600.000	2,458,560.000	
	POST PROPERTIES, INC	198,490.000	11,222,624.600	
	PROLOGIS INC	229,810.000	9,622,144.700	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	460,760.000	7,713,122.400	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	377,130.000	6,743,084.400	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	36,470.000	547,414.700	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	77,950.000	15,192,455.000	
	TERRENO REALTY CORP	631,513.000	13,899,601.130	
	THE MACERICH COMPANY	120,740.000	10,153,026.600	
	UDR INC	159,440.000	5,433,715.200	
	VENTAS INC	186,510.000	9,478,438.200	
	VORNADO REALTY TRUST	133,206.000	12,851,714.880	
	WELLTOWER INC	114,990.000	7,016,689.800	
	アメリカ・ドル 小計	12,011,308.000	355,744,547.800 (43,866,860,189)	
投資証券 合計		12,011,308	43,866,860,189 (43,866,860,189)	
合計			43,866,860,189 (43,866,860,189)	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 43銘柄	94.86%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 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。

## 「D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
資産の部			
流動資産			
預金		834,658,905	1,626,753,362
コール・ローン		1,711,027,397	1,417,221,842
投資信託受益証券		38,355,357,852	30,651,044,853
投資証券		36,822,419,002	35,046,635,607
未収入金		100,315,720	6,401,834
未収配当金		446,483,604	306,756,609
流動資産合計		78,270,262,480	69,054,814,107
資産合計		78,270,262,480	69,054,814,107
負債の部			
流動負債			
未払解約金		715,000,000	-
流動負債合計		715,000,000	-
負債合計		715,000,000	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	32,989,642,436	30,462,537,929
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		44,565,620,044	38,592,276,178
元本等合計		77,555,262,480	69,054,814,107
純資産合計		77,555,262,480	69,054,814,107
負債純資産合計		78,270,262,480	69,054,814,107

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</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、金融商品取引所等における最終相場（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>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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 . 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>



## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年5月8日現在	平成27年11月9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	37,269,858,482円	32,989,642,436円
	同期中追加設定元本額	53,269,158円	9,881,163円
	同期中一部解約元本額	4,333,485,204円	2,536,985,670円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	30,126,361円	28,045,541円
	D I A M世界6資産バランスファンド	129,033,599円	113,950,983円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	173,167,220円	153,681,198円
	D I A M ワールド・リート・インカム・オープン（毎月決算コース）	30,440,710,500円	28,115,334,092円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	535,938,201円	483,680,912円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	1,064,565,230円	1,020,290,107円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	369,792,213円	330,713,990円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	59,702,070円	55,379,423円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	186,607,042円	161,461,683円
	計	32,989,642,436円	30,462,537,929円
2 .	受益権の総数	32,989,642,436口	30,462,537,929口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、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。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 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)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	2,320,314,585	945,221,273
投資証券	2,248,110,248	2,330,400,457
合計	4,568,424,833	3,275,621,730

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年12月10日から平成27年5月8日まで及び平成26年12月10日から平成27年11月9日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

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)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	2.3509円	2.2669円
(1万口当たり純資産額)	(23,509円)	(22,669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

平成27年11月9日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ALE PROPERTY GROUP	2,579,620.000	9,983,129.400	
		CHARTER HALL GROUP	5,908,131.000	26,763,833.430	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	10,615,791.000	43,949,374.740	
		DEXUS PROPERTY GROUP	2,717,963.000	21,009,853.990	
		GOODMAN GROUP	679,426.000	4,178,469.900	
		GPT GROUP	1,940,607.000	9,120,852.900	
		MIRVAC GROUP	9,478,152.000	17,108,064.360	
		NATIONAL STORAGE REIT	12,019,303.000	19,110,691.770	
		SCENTRE GROUP	5,147,091.000	21,051,602.190	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	10,362,271.000	21,242,655.550	
		VICINITY CENTRES	21,443,428.000	62,829,244.040	
	オーストラリア・ドル 小計		82,891,783.000	256,347,772.270 (22,248,423,156)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	5,365,100.000	12,339,730.000	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	14,377,600.000	17,396,896.000	
		CACHE LOGISTICS TRUST	5,662,000.000	5,520,450.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	8,667,000.000	16,727,310.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	12,519,840.000	19,092,756.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	19,701,320.000	19,996,839.800	
		PARKWAY LIFE REIT	2,548,400.000	5,886,804.000	
シンガポール・ドル 小計		68,841,260.000	96,960,785.800 (8,402,621,697)		
投資信託受益証券 合計			151,733,043	30,651,044,853 (30,651,044,853)	
投資証券	イギリス・ボンド	BRITISH LAND CO PLC	1,778,892.000	14,916,009.420	
		HAMMERSON PLC	2,211,954.000	13,614,576.870	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	532,772.000	6,968,657.760	
		SEGRO PLC	1,925,876.000	8,404,522.860	
	イギリス・ボンド 小計		6,449,494.000	43,903,766.910 (8,154,246,629)	
	カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	950,022.000	31,160,721.600	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		1,819,678.000	24,256,307.740		

	CROMBIE REAL ESTATE INV	992,261.000	12,909,315.610	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	847,500.000	10,856,475.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	3,200,000.000	14,240,000.000	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,032,649.000	32,383,872.640	
カナダ・ドル 小計		8,842,110.000	125,806,692.590 (11,654,732,002)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	26,401,917.000	32,210,338.740	
ニュージーランド・ドル 小計		26,401,917.000	32,210,338.740 (2,592,288,062)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	827,220.000	10,096,220.100	
	BEFIMMO	76,567.000	4,612,396.080	
	COFINIMMO SA	66,685.000	6,583,810.050	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	506,927.000	20,794,145.540	
	GECINA SA	45,322.000	5,234,691.000	
	ICADE	96,588.000	6,338,104.560	
	KLEPIERRE	130,772.000	5,514,001.380	
	VASTNED RETAIL	124,533.000	5,323,785.750	
	WAREHOUSES DE PAUW	330,312.000	25,182,986.880	
	WERELDHAVE NV	108,266.000	5,864,769.220	
ユーロ 小計		2,313,192.000	95,544,910.560 (12,645,368,914)	
投資証券 合計		44,006,713	35,046,635,607 (35,046,635,607)	
合計			65,697,680,460 (65,697,680,460)	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
イギリス・ポンド	投資証券 4銘柄	-%	11.81%	12.41%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 11銘柄	32.22%	-%	33.86%
カナダ・ドル	投資証券 6銘柄	-%	16.88%	17.74%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 7銘柄	12.17%	-%	12.79%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	3.75%	3.95%
ユーロ	投資証券 10銘柄	-%	18.31%	19.25%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 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。

## 「D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
資産の部			
流動資産			
預金		240,694,693	363,592,192
コール・ローン		647,417,986	614,781,598
株式		43,660,657,073	40,203,951,747
投資証券		158,624,213	-
未収配当金		154,638,147	88,403,947
流動資産合計		44,862,032,112	41,270,729,484
資産合計		44,862,032,112	41,270,729,484
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	18,245,361,322	17,073,939,730
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		26,616,670,790	24,196,789,754
元本等合計		44,862,032,112	41,270,729,484
純資産合計		44,862,032,112	41,270,729,484
負債純資産合計		44,862,032,112	41,270,729,484



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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、金融商品取引所等における最終相場（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>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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 . 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,187,174,114円	18,245,361,322円
	同期中追加設定元本額	438,030,329円	579,503,491円
	同期中一部解約元本額	3,379,843,121円	1,750,925,083円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M世界好配当株オープン（毎月決算コース）	9,889,754,757円	8,756,581,513円
	D I A M世界好配当株式ファンド（毎月決算型）	5,170,809,145円	5,421,019,455円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	46,703,153円	41,958,454円
	D I A M世界6資産バランスファンド	216,405,385円	187,041,952円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	301,014,034円	263,149,771円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	843,311,068円	750,810,218円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	600,271,731円	510,905,913円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	95,501,909円	88,433,777円
	D I A M世界好配当株私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,081,590,140円	1,054,038,677円
	計	18,245,361,322円	17,073,939,730円
2 .	受益権の総数	18,245,361,322口	17,073,939,730口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、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。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 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)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	1,920,321,383	989,825,000
投資証券	13,671,850	-
合計	1,906,649,533	989,825,000

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月27日から平成27年5月8日まで及び平成27年5月27日から平成27年11月9日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

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）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	2.4588円	2.4172円
（1万口当たり純資産額）	(24,588円)	(24,172円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成27年11月9日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMERICAN ELECTRIC POWER	29,901	53.960	1,613,457.960	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	26,635	61.540	1,639,117.900	
	AMEREN CORP	90,799	42.550	3,863,497.450	
	VERIZON COMM INC	45,855	45.780	2,099,241.900	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	27,919	65.450	1,827,298.550	
	ONEOK INC	51,730	31.600	1,634,668.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY	35,433	38.810	1,375,154.730	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	32,042	60.860	1,950,076.120	
	CISCO SYSTEMS INC	70,135	28.450	1,995,340.750	
	COCA-COLA ENTERPRISES INC	31,769	50.550	1,605,922.950	
	RR DONNELLEY & SONS CO	97,346	17.220	1,676,298.120	
	DOW CHEMICAL	35,284	51.840	1,829,122.560	
	DUKE ENERGY CORP	53,842	67.760	3,648,333.920	
	GENERAL MILLS INC	48,116	56.580	2,722,403.280	
	GOLAR LNG LTD	35,514	29.080	1,032,747.120	
	GENERAL ELECTRIC CO	84,475	29.920	2,527,492.000	
	REYNOLDS AMERICAN INC	108,584	44.630	4,846,103.920	
	INTEL CORP	102,458	33.840	3,467,178.720	
	JOHNSON & JOHNSON	36,590	101.920	3,729,252.800	
	KIMBERLY-CLARK CORP	25,247	118.580	2,993,789.260	
	VECTOR GROUP LTD	147,286	23.740	3,496,569.640	
	ELI LILLY & CO	19,950	80.460	1,605,177.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	16,145	216.630	3,497,491.350	
	SCANA CORP	34,898	57.200	1,996,165.600	
	MATTEL INC	67,009	24.620	1,649,761.580	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	43,838	40.560	1,778,069.280	
	MERCK & CO. INC.	110,354	54.610	6,026,431.940	
	MICROSOFT CORP	78,477	54.920	4,309,956.840	
	PACWEST BANCORP	53,918	47.140	2,541,694.520	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	37,293	75.100	2,800,704.300	
	OLD REPUBLIC INTL CORP	107,202	18.410	1,973,588.820	
	PPL CORPORATION	124,020	33.080	4,102,581.600	
PFIZER INC	171,137	33.930	5,806,678.410		
CONOCOPHILLIPS	60,634	55.770	3,381,558.180		
ALTRIA GROUP INC	147,470	57.090	8,419,062.300		
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	332,188	16.160	5,368,158.080		

	SOUTHERN CO	62,615	43.590	2,729,387.850	
	AT&T INC	172,794	33.160	5,729,849.040	
	CHEVRON CORP	38,031	94.030	3,576,054.930	
	REGAL ENTERTAINMENT GROUP-A	83,747	19.900	1,666,565.300	
	AVISTA CORP	57,726	32.990	1,904,380.740	
	ALLETE INC	56,379	50.100	2,824,587.900	
	B&G FOODS INC	48,242	36.000	1,736,712.000	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	44,737	78.240	3,500,222.880	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	37,630	46.820	1,761,836.600	
	SPECTRA ENERGY CORP	77,910	27.960	2,178,363.600	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	83,122	86.370	7,179,247.140	
	KINDER MORGAN INC/DELAWARE	72,989	26.060	1,902,093.340	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	19,556	96.180	1,880,896.080	
	SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP	38,431	51.870	1,993,415.970	
	ABBVIE INC	59,870	64.130	3,839,463.100	
	KRAFT HEINZ CO	26,945	72.010	1,940,309.450	
	アメリカ・ドル 小計	3,602,217		153,173,533.370 (18,887,828,399)	
イギリス・ポンド	SEVERN TRENT PLC	47,469	21.850	1,037,197.650	
	BT GROUP PLC	290,955	4.655	1,354,395.520	
	AVIVA PLC	402,521	4.871	1,960,679.790	
	NATIONAL GRID PLC	141,638	8.942	1,266,526.990	
	BAE SYSTEMS PLC	415,057	4.450	1,847,003.650	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	92,673	38.100	3,530,841.300	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	40,548	35.050	1,421,207.400	
	HSBC HOLDINGS PLC	533,122	5.278	2,813,817.910	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	434,422	2.682	1,165,119.800	
	UNILEVER PLC	44,744	28.580	1,278,783.520	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	169,201	9.575	1,620,099.570	
	PEARSON PLC	80,978	8.275	670,092.950	
	PRUDENTIAL PLC	71,174	15.450	1,099,638.300	
	RIO TINTO PLC	90,251	22.820	2,059,527.820	
	VODAFONE GROUP PLC	1,200,646	2.162	2,595,796.650	
	RELX PLC	124,608	11.610	1,446,698.880	
	BP PLC	323,382	3.865	1,249,871.430	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	162,881	13.845	2,255,087.440	
	ASTRAZENECA PLC	38,831	42.260	1,640,998.060	
	UNITED BUSINESS MEDIA LTD	221,726	5.155	1,142,997.530	

	ITV PLC	417,748	2.560	1,069,434.880	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	213,386	17.220	3,674,506.920	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	403,570	2.743	1,106,992.510	
	INFORMA PLC	208,532	5.920	1,234,509.440	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	285,983	3.969	1,135,066.520	
	ROYAL MAIL PLC	213,905	4.420	945,460.100	
イギリス・ポンド	小計	6,669,951		42,622,352.530 (7,916,249,536)	
オーストラリア・ドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	74,005	25.970	1,921,909.850	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	71,245	31.650	2,254,904.250	
	TELSTRA CORP LTD	420,206	5.310	2,231,293.860	
	AMP LTD	381,353	5.890	2,246,169.170	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	71,714	28.650	2,054,606.100	
オーストラリア・ドル	小計	1,018,523		10,708,883.230 (929,423,975)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	49,966	76.880	3,841,386.080	
	BANK OF NOVA SCOTIA	36,609	61.660	2,257,310.940	
	NATIONAL BANK OF CANADA	53,261	44.000	2,343,484.000	
	BCE INC	110,909	56.790	6,298,522.110	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26,487	100.630	2,665,386.810	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	50,982	45.040	2,296,229.280	
	ROYAL BANK OF CANADA	31,994	76.650	2,452,340.100	
	WHITECAP RESOURCES INC	199,448	12.420	2,477,144.160	
	PEMBINA PIPELINE CORP	73,460	32.490	2,386,715.400	
	DH CORP	55,171	34.950	1,928,226.450	
カナダ・ドル	小計	688,287		28,946,745.330 (2,681,626,488)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE EXCHANGE LTD	309,400	7.620	2,357,628.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	599,600	3.920	2,350,432.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	116,800	20.460	2,389,728.000	
シンガポール・ドル	小計	1,025,800		7,097,788.000 (615,094,309)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	56,096	75.450	4,232,443.200	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15,348	270.000	4,143,960.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	36,941	89.900	3,320,995.900	
スイス・フラン	小計	108,385		11,697,399.100 (1,433,984,156)	
スウェーデン・クローナ	TELE2 AB-B SHS	171,994	87.050	14,972,077.700	
スウェーデン・クローナ	小計	171,994		14,972,077.700 (211,705,178)	



デンマーク・ク ローネ	DANSKE BANK A/S	55,327	190.500	10,539,793.500	
デンマーク・クローネ 小計		55,327		10,539,793.500 (186,975,936)	
ユーロ	CRH PLC	60,528	26.160	1,583,412.480	
	AXA	103,171	24.740	2,552,450.540	
	INTESA SANPAOLO	462,202	3.176	1,467,953.550	
	BNP PARIBAS	27,375	57.610	1,577,073.750	
	ENI SPA	97,396	14.900	1,451,200.400	
	SOCIETE GENERALE-A	35,989	45.405	1,634,080.540	
	VINCI S.A.	50,907	62.220	3,167,433.540	
	TOTAL SA	66,320	46.235	3,066,305.200	
	UPM-KYMMENE OYJ	90,420	17.680	1,598,625.600	
	DAIMLER AG	23,938	79.790	1,910,013.020	
	ORANGE	213,246	16.430	3,503,631.780	
	SAMPO OYJ-A SHS	39,428	45.510	1,794,368.280	
	ALLIANZ SE	22,152	157.300	3,484,509.600	
	MUENCHENER RUECKVER AG- REG	17,352	179.450	3,113,816.400	
	AGEAS	45,981	39.640	1,822,686.840	
	SANOFI	27,388	86.900	2,380,017.200	
	ELISA OYJ	44,481	34.570	1,537,708.170	
	ENEL SPA	438,446	4.190	1,837,088.740	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	114,072	16.780	1,914,128.160	
	HERA SPA	714,670	2.422	1,730,930.740	
FERROVIAL SA	104,383	22.375	2,335,569.620		
ENGIE	148,222	16.195	2,400,455.290		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	62,768	30.650	1,923,839.200		
BPOST SA	63,946	23.890	1,527,669.940		
FERROVIAL SA-RTS	104,383	0.391	40,813.750		
ユーロ 小計		3,179,164		51,355,782.330 (6,796,937,792)	
香港・ドル	HANG SENG BANK LTD	146,800	142.000	20,845,600.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	531,000	25.150	13,354,650.000	
香港・ドル 小計		677,800		34,200,250.000 (544,125,978)	
合計		17,197,448		40,203,951,747 (40,203,951,747)	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式 52銘柄	45.77%	46.98%
イギリス・ポンド	株式 26銘柄	19.18%	19.69%
オーストラリア・ドル	株式 5銘柄	2.25%	2.31%
カナダ・ドル	株式 10銘柄	6.50%	6.67%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	1.49%	1.53%
スイス・フラン	株式 3銘柄	3.47%	3.57%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	0.51%	0.53%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	0.45%	0.47%
ユーロ	株式 25銘柄	16.47%	16.91%
香港・ドル	株式 2銘柄	1.32%	1.35%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 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。

## 「高金利ソブリン・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
資産の部			
流動資産			
預金		333,728,222	39,729,699
コール・ローン		188,942,956	45,413,789
国債証券		16,301,050,753	14,991,083,989
派生商品評価勘定		-	287,051
未収利息		197,485,146	134,535,657
前払費用		13,729,572	1,270,175
流動資産合計		17,034,936,649	15,212,320,360
資産合計		17,034,936,649	15,212,320,360
負債の部			
流動負債			
未払金		324,647,441	-
未払解約金		5,000,000	6,000,000
流動負債合計		329,647,441	6,000,000
負債合計		329,647,441	6,000,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,744,003,260	11,123,749,313
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,961,285,948	4,082,571,047
元本等合計		16,705,289,208	15,206,320,360
純資産合計		16,705,289,208	15,206,320,360
負債純資産合計		17,034,936,649	15,212,320,360

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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、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。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
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 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,706,669,196円	11,744,003,260円
	同期中追加設定元本額	72,045,872円	- 円
	同期中一部解約元本額	1,034,711,808円	620,253,947円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M高金利ソブリン債券ファンド（毎月決算型）	1,185,721,100円	995,762,383円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	299,709,527円	267,540,068円
	D I A Mバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	261,423,626円	228,699,964円
	D I A M世界6資産バランスファンド	379,098,907円	329,147,777円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	1,277,546,434円	1,118,366,108円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	167,459,189円	156,867,900円
	D I A M高金利ソブリン私募ファンド（適格機関投資家向け）	8,173,044,477円	8,027,365,113円
	計	11,744,003,260円	11,123,749,313円
2 .	受益権の総数	11,744,003,260口	11,123,749,313口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、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。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、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よった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	32,488,274	32,404,997
合計	32,488,274	32,404,997

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月9日から平成27年5月8日まで及び平成27年5月9日から平成27年11月9日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	40,003,892	-	39,716,841	287,051
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	1,796,827	-	1,792,829	3,998
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	38,207,065	-	37,924,012	283,053
合計	-	-	-	-	40,003,892	-	39,716,841	287,051

## （注）時価の算定方法

1. 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。  
 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。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。  
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。



(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	1.4225円	1.3670円
(1万口当たり純資産額)	(14,225円)	(13,670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

平成27年11月9日現在

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	US T N/B 1.375 02/29/20	17,775,000.000	17,576,275.500	
	アメリカ・ドル 小計		17,775,000.000 (2,191,835,250)	17,576,275.500 (2,167,330,532)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 2.0 07/22/20	9,800,000.000	10,063,032.000	
	イギリス・ポンド 小計		9,800,000.000 (1,820,154,000)	10,063,032.000 (1,869,006,933)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	9,400,000.000	10,346,580.000	
		AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,200,000.000	4,642,428.000	
		AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,538,910.000	
	オーストラリア・ドル 小計		15,100,000.000 (1,310,529,000)	16,527,918.000 (1,434,458,003)	
	カナダ・ドル	CANADA 1.5 03/01/20	14,720,000.000	15,083,731.200	
		CANADA 3.75 06/01/19	1,300,000.000	1,434,394.000	
	カナダ・ドル 小計		16,020,000.000 (1,484,092,800)	16,518,125.200 (1,530,239,119)	
	シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.625 10/01/19	16,000,000.000	15,952,000.000	
	シンガポール・ドル 小計		16,000,000.000 (1,386,560,000)	15,952,000.000 (1,382,400,320)	
	タイ・パーツ	THAILAND 3.25 06/16/17	94,300,000.000	96,920,597.000	
		THAILAND 3.65 12/17/21	130,000,000.000	138,795,800.000	
		THAILAND 3.875 06/13/19	175,000,000.000	187,101,250.000	
	タイ・パーツ 小計		399,300,000.000 (1,373,592,000)	422,817,647.000 (1,454,492,706)	
	ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 3.0 04/15/20	4,100,000.000	4,138,089.000	
		NEW ZEALAND 5.0 03/15/19	8,580,000.000	9,222,127.200	
	ニュージーランド・ドル 小計		12,680,000.000 (1,020,486,400)	13,360,216.200 (1,075,230,200)	
	ポーランド・ズロチ	POLAND 3.75 04/25/18	17,900,000.000	18,739,510.000	
POLAND 5.25 10/25/20		5,500,000.000	6,255,700.000		
POLAND 5.5 10/25/19		17,000,000.000	19,191,300.000		
ポーランド・ズロチ 小計		40,400,000.000 (1,252,400,000)	44,186,510.000 (1,369,781,810)		
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 4.378 11/29/19	44,000,000.000	45,003,640.000		
マレーシア・リングギット 小計		44,000,000.000 (1,243,880,000)	45,003,640.000 (1,272,252,903)		

	メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	106,000,000.000	118,241,940.000	
		MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	70,000,000.000	77,383,600.000	
	メキシコ・ペソ 小計		176,000,000.000 (1,291,840,000)	195,625,540.000 (1,435,891,464)	
国債証券 合計			14,375,369,450 (14,375,369,450)	14,991,083,989 (14,991,083,989)	
合計			14,375,369,450 (14,375,369,450)	14,991,083,989 (14,991,083,989)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 1銘柄	14.25%	14.46%
イギリス・ポンド	国債証券 1銘柄	12.29%	12.47%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	9.43%	9.57%
カナダ・ドル	国債証券 2銘柄	10.06%	10.21%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	9.09%	9.22%
タイ・バーツ	国債証券 3銘柄	9.57%	9.70%
ニュージーランド・ドル	国債証券 2銘柄	7.07%	7.17%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	9.01%	9.14%
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	8.37%	8.49%
メキシコ・ペソ	国債証券 2銘柄	9.44%	9.58%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 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

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成27年11月30日現在

資産総額	1,062,637,419円
負債総額	3,364,155円
純資産総額（ - ）	1,059,273,264円
発行済数量	1,169,420,664口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9058円

（参考）

## ジャパン・セレクション・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産総額	10,046,697,392円
負債総額	149,788,480円
純資産総額（ - ）	9,896,908,912円
発行済数量	4,204,491,382口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3539円

## 国内債券アクティブ・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産総額	832,060,544円
負債総額	9,297,390円
純資産総額（ - ）	822,763,154円
発行済数量	621,190,694口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3245円

## J - R E I Tオープン・アクティブ・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産総額	1,206,813,332円
負債総額	17,865,138円
純資産総額（ - ）	1,188,948,194円
発行済数量	636,200,387口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8688円

## D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産総額	46,702,985,117円
負債総額	25,000,000円
純資産総額（ - ）	46,677,985,117円
発行済数量	15,682,183,767口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9765円

## D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産総額	68,369,969,132円
負債総額	30,000,000円
純資産総額（ - ）	68,339,969,132円
発行済数量	30,378,961,220口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2496円

## D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産総額	40,934,666,209円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	40,934,666,209円
発行済数量	16,941,067,463口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4163円

## 高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産総額	15,209,514,360円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	15,209,514,360円
発行済数量	11,087,286,645口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3718円

## 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】

原届出書の「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」につきまして、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

#### (2) 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、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

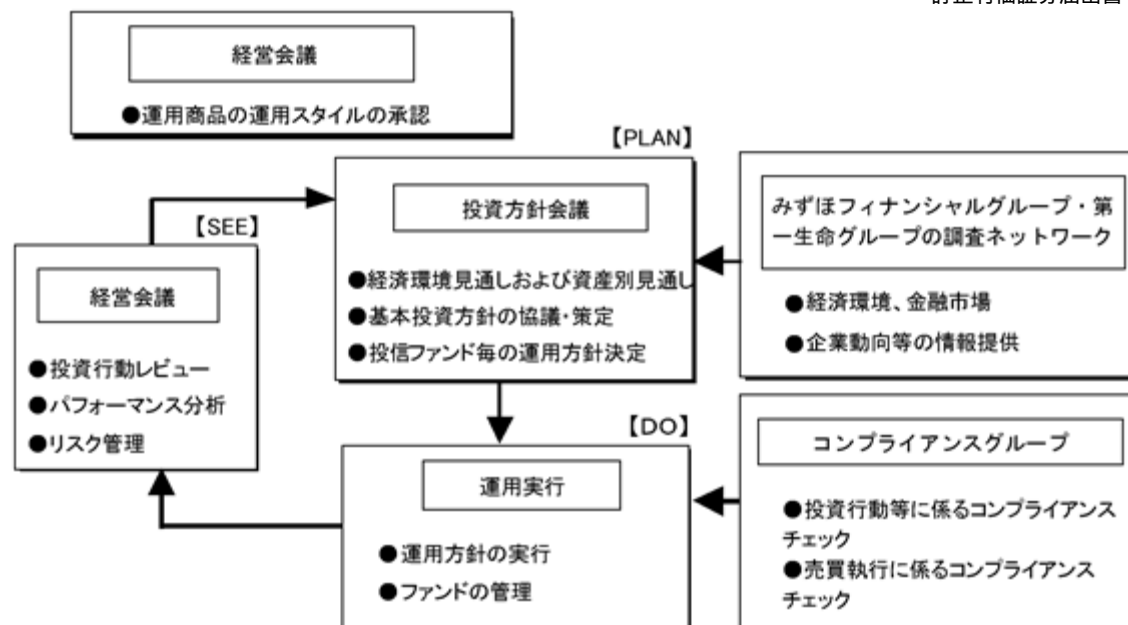
##### 投資運用の意思決定機構

委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見通しおよび資産別市場見通しならびにファンド毎の運用方針は、投資方針会議において協議し、策定します。投資方針会議は原則として月1回開催され、議長は運用部門担当取締役とします。

各ファンドにおける有価証券の売買等の意思決定は、原則として運用担当者が行います。すなわち、運用担当者は、投資方針会議において決定された運用方針を受けて、各ファンドの投資方針に基づき運用計画を策定し、有価証券への運用指図を行います。

運用担当者による運用計画の策定および有価証券等の運用指図に関する意思決定は、運用担当者自身の調査活動、アナリスト等の調査活動、その他の活動によって得られた当該有価証券等に関する情報に基づいて行われ、それらの活動の成果である各ファンドの投資運用の実績は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月1回検討・評価されます。



上記体制は平成27年11月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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であり、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」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成27年11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は397本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	5	23,428,974,381
追加型株式投資信託	355	5,983,246,488,045
単位型公社債投資信託	37	298,941,044,307
追加型公社債投資信託	0	0
合計	397	6,305,616,506,733

### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「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」につきまして、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）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）ならびに同規則第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）により作成しております。

また、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）、ならびに同規則第38条及び第57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）により作成しております。

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、第30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。



## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	617,159	613,137
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

	第29期 ( 自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日 )		第30期 ( 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日 )	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	15,024		17,346	
受取利息	2,318		2,404	
時効成立分配金・償還金	33,872		974	
為替差益	-		652	
雑収入	4,746		1,822	
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損	7,364		-	
金銭の信託運用損	213,744		163,033	
時効成立後支払分配金・償還金	-		65	
外国税支払損失	-		47,515	
雑損失	10,952		-	
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
会計方針の変 更による累積 的影響額									
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金の 積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
会計方針の変 更による累積 的影響額		
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の配当		3,096,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	139,391	139,391
当期変動額合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変 更による累積 的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の 積立				2,350,000			2,350,000	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変 更による累積 的影響額		131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	243,159	27,291,419
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

## 重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(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) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 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）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ9,168千円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

## 注記事項

（貸借対照表関係）

### 1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

### 2. 関係会社項目

関係会社に関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含まれております。

（千円）

		第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035



## （損益計算書関係）

## 1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

## 2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成27年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30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

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブ取引は、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等でありませ

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替及び市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

### (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

### (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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

#### 第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,487,360	11,487,360	-
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	536,913	536,913	-
資産計	22,976,732	22,976,732	-
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	-
負債計	1,721,861	1,721,861	-

#### 第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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。

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 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、投資信託は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積も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ため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積も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ため、記載しておりません。

当事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金等であり、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ため、記載しておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第29期（平成26年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	11,486,870	-	-	-
合計	11,486,870	-	-	-

## 第30期（平成27年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額  
該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）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。

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	522,887	146,101	376,785
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,551	3,000	1,551
小計	527,439	149,101	378,337
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	9,474	10,000	526
小計	9,474	10,000	526
合計	536,913	159,101	377,811

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）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。

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	532,891	159,101	373,789

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）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。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券  
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券  
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券  
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,952,459	1,628,835

第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	14,169,657	2,544,066

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

## (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

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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、確定給付型の制度として退職一時金制度(非積立型制度であります)を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
会計方針の変更による累積的影響額	-	203,600
会計方針の変更を反映した期首残高	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
過去勤務費用の発生額	24,260	-
退職給付債務の期末残高	1,079,828	973,035

## (2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840	174,402

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.89%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり  
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の内訳

	第29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

## 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差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27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が行われることになりました。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35.64%から、平成27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33.10%に、平成28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32.34%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額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。

## 有形固定資産

当社は、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

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額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。

## 有形固定資産

当社は、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

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

## (関連当事者との取引)

## (1) 親会社及び法人主要株主等

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102 億円	生命保険業	(被所有) 直接 50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431 億円	生命保険業	(被所有) 直接 50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## (2)子会社等

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	627,855	未払 費用	224,758
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	251,110	未払 費用	97,587

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	658,756	未払 費用	235,583
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	383,980	未払 費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	増資の引受	400,000	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その 他 の 関 係 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行 (旧株式 会社みず ほコーポ レート銀 行)	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	1,629,874	未払 手数料	224,525
								預金の預入 (純額)	775,579	現金・ 預金	10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	432,201	-	-
							預金の引出 (純額)	203,876			
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	287,136	未払 費用	155,413
							業務委託料 の支払	11,810	未払金	2,646	
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)	1,000,000	金銭の 信託	10,952,459
							信託報酬の 支払	7,933			

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	71
その他の 関係 会社 の子 会社	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	407,531	未払 費用	240,725
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## （1株当たり情報）

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46銭

（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、潜在株式が存在してい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、以下のとおりであります。

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（注3）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,613,571
金銭の信託		14,000,363
前払費用		141,040
未収委託者報酬		4,528,913
未収運用受託報酬		2,131,544
未収投資助言報酬		268,863
未収収益		240,459
繰延税金資産		392,452
その他		37,555
	流動資産計	32,354,763
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,557
車両運搬具	1	745
器具備品	1	246,491
無形固定資産		
商標権	1	54
ソフトウェア	1	1,688,242
ソフトウェア仮勘定		142,901
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	167
投資その他の資産		
投資有価証券		574,051
関係会社株式		2,316,596
繰延税金資産		600,727
差入保証金		771,427
その他		90,932
	固定資産計	6,640,044
資産合計		38,994,807



（単位：千円）

	第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	956,031
未払金	2,105,195
未払収益分配金	44
未払償還金	49,873
未払手数料	1,770,062
その他未払金	285,213
未払費用	1,927,420
未払法人税等	1,486,583
未払消費税等	289,515
賞与引当金	724,368
その他	20,000
流動負債計	7,509,114
固定負債	
退職給付引当金	920,913
役員退職慰労引当金	137,750
固定負債計	1,058,663
負債合計	8,567,778
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	25,771,823
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	22,030,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	3,118,530
株主資本計	30,200,301
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	226,727
評価・換算差額等計	226,727
純資産合計	30,427,029
負債・純資産合計	38,994,807

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	15,465,477	
運用受託報酬	3,695,539	
投資助言報酬	510,549	
その他営業収益	383,893	
	営業収益計	20,055,459
営業費用		
支払手数料	6,672,717	
広告宣伝費	217,738	
公告費	129	
調査費	3,678,769	
調査費	2,272,268	
委託調査費	1,406,500	
委託計算費	207,057	
営業雑経費	280,193	
通信費	17,208	
印刷費	226,482	
協会費	11,849	
諸会費	17	
支払販売手数料	24,635	
	営業費用計	11,056,605
一般管理費		
給料	2,351,238	
役員報酬	121,094	
給料・手当	2,230,144	
交際費	19,774	
寄付金	2,156	
旅費交通費	119,653	
租税公課	94,838	
不動産賃借料	363,395	
退職給付費用	114,178	
固定資産減価償却費	1 362,235	
福利厚生費	10,385	
修繕費	30,844	
賞与引当金繰入額	724,368	
役員退職慰労引当金繰入額	27,285	
機器リース料	76	
事務委託費	137,814	
事務用消耗品費	33,473	
器具備品費	14,115	
諸経費	84,703	
	一般管理費計	4,490,538
営業利益		4,508,315

（単位：千円）

	第31期中間会計期間 （自平成27年4月1日至平成27年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	8,323	
受取利息	1,015	
雑収入	5,491	
営業外収益計		14,830
営業外費用		
為替差損	3,664	
金銭の信託運用損	166,406	
営業外費用計		170,070
経常利益		4,353,076
特別損失		
固定資産除却損	182	
固定資産売却損	2,654	
ゴルフ会員権評価損	3,806	
特別損失計		6,642
税引前中間純利益		4,346,433
法人税、住民税及び事業税		1,434,006
法人税等調整額		14,388
法人税等合計		1,448,394
中間純利益		2,898,038

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							2,898,038	2,898,038	2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	2,195,961	354,038	354,038
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	3,118,530	25,771,823	30,200,301

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	252,905	30,099,168
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	26,178	26,178
当中間期変動額 合計	26,178	327,860
当中間期末残高	226,727	30,427,029

## 重要な会計方針

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 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）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来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、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 追加情報

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
<p>当社は、平成27年9月30日開催の取締役会の決議に基づき、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」)の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」)、及び新光投信株式会社(以下「新光投信」)の機能統合に向けた具体的な準備を開始すべく、同日付で当社、TB、MHAM及び新光投信の間で「統合基本合意書」を締結いたしました。今後、統合に必要な各社の取締役会決議及び株主総会決議、国内外の関係当局への届出、許認可の取得等を前提として、平成28年度上期中の統合を予定しております。</p>

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: right;">...</td> <td style="width: 40%; text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 30%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%; text-align: right;">...</td> <td style="width: 60%; text-align: right;">68,441千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">293,794千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	68,441千円	無形固定資産	...	293,794千円
有形固定資産	...	68,441千円					
無形固定資産	...	293,794千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

## (金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、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含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,613,571	10,613,571	-
(2) 金銭の信託	14,000,363	14,000,363	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	493,805	493,805	-
資産計	25,107,739	25,107,739	-
(1) 未払法人税等	1,486,583	1,486,583	-
負債計	1,486,583	1,486,583	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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。

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 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、投資信託は基準価額によっております。

## 負債

### (1) 未払法人税等

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

### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,316,596
差入保証金	771,427

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積も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ため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積も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ため、時価開示の対象としておりません。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金等であり、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ため、時価開示の対象としておりません。



## （有価証券関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）			
1. 満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2. 子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,316,596千円）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。			
3. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	493,805	159,101	334,703
（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）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。			

## （金銭の信託関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
1. 満期保有目的の金銭の信託 該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外） 該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

## 1. セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	15,465,477	4,206,088	383,893	20,055,459

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間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。

## 有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間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

特定の顧客に対する営業収益で中間損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

## (1株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,267,792円	89銭
1株当たり中間純利益金額	120,751円	62銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。		

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
中間純利益	2,898,038千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,898,038千円
期中平均株式数	24,000株

## （重要な後発事象）

第31期中間会計期間  
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、平成27年9月25日開催の取締役会において、子会社であるDIAM International Ltdの増資引受を決議いたしました。

## 1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

## 2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

## 3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

## 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】

&lt;訂正前&gt;

(略)

## (4)投資顧問会社

## a. 名称

DIAM International Ltd

## b. 資本金の額

平成26年12月末日現在 400万ポンド

## c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

## (5)投資顧問会社

## a. 名称

DIAM U.S.A., Inc.

## b. 資本金の額

平成26年12月末日現在 400万米ドル

## c. 事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

## (4)投資顧問会社

## a. 名称

DIAM International Ltd

## b. 資本金の額

平成27年12月末日現在 900万ポンド

## c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

## (5)投資顧問会社

## a. 名称

DIAM U.S.A., Inc.

## b. 資本金の額

平成27年12月末日現在 400万米ドル

## c. 事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

(略)

## 独立監査人の監査報告書

平成27年12月24日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界6資産アクティブ・バランス・ファンドの平成27年5月9日から平成27年11月9日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界6資産アクティブ・バランス・ファンドの平成27年11月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

D I A Mアセットマネジメント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

---

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。

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 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D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30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、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 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D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

（注1）上記は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）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。