

【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26年5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 中島 敬雄
【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投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型） ただし、愛称として「インカム・パスポート」という名称を用いる場合があります。
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【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25年11月8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。

第一部【証券情報】

（５）【申込手数料】

<訂正前>

お申込日の翌営業日の基準価額に、 $3.15\%^{*}$ （税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

*消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

（略）

<訂正後>

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

（略）

（７）【申込期間】

<訂正前>

継続申込期間：平成25年11月9日から平成26年11月7日まで

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

継続申込期間において、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」といいます。）には、お申込みの受付を行いません。

<訂正後>

継続申込期間：平成25年11月9日から平成26年11月7日まで

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

継続申込期間において、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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】****(3)【ファンドの仕組み】**

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

(1)資本金の額

20億円（平成25年8月30日現在）

(略)

(3)大株主の状況

(平成25年8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	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

(1)資本金の額

20億円（平成26年2月28日現在）

(略)

(3)大株主の状況

(平成26年2月28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】**

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (2)投資対象」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。)

八.金銭債権

二.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された、高金利ソブリン・マザーファンド、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド、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・マザーファンドの各受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
18. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.ならびに18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲(約款第17条第2項)

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

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

金融商品の指図範囲(約款第17条第3項)

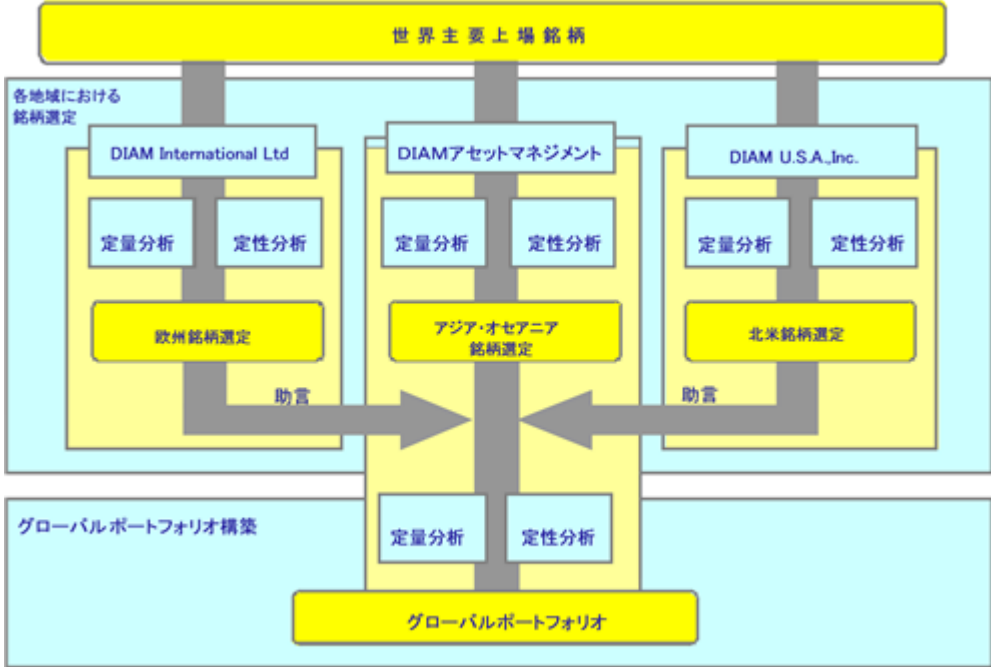
上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と定めるときは、委託会社は、信託金を、上記 1.から4.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	高金利ソブリン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。
主な投資対象	高金利国のソブリン債券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>景気・金利・為替動向、財政・金融政策を中心としたファンダメンタルズ分析に基づき、投資対象銘柄の発行規模やポートフォリオの地域分散を考慮した上で、主として高金利国のソブリン債に投資し、収益を追求します。なお、組入対象国および国別配分は特に限定しません。</p> <p>当初債券組入れ時において、A-/A3格以上の債券に投資対象とします。</p> <p>格付機関はMoody's社またはS&P社とし、両社が格付けを付与している場合には、どちらか高い方の格付けとします。</p> <p>運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。</p> <p>外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p>

<p>運用 プロセス</p>	<p>地域配分（通貨アロケーション）の決定</p> <p>各国の金利はその国の名目経済成長率と密接な関係があるため、経済分析を中心に、名目経済成長率のサイクルとリスク・プレミアムがピークに近いと判断される国に注目します。これらの国の実体経済、財政政策、金融政策等のファンダメンタルズ分析をもとに、為替リスク、金利リスク、信用リスクを判断し、リスクの相対的に小さな国に重点投資します。</p> <p>投資銘柄の決定</p> <p>当該国のイールドカーブの形状や銘柄毎の流動性を勘案した上で銘柄選定を行い、ポートフォリオを構築します。</p> <p>リスク管理とモニタリング</p> <ul style="list-style-type: none"> ・日次で、保有債券のスプレッドや信用格付けをモニターすると同時に、保有国に関するニュースのフォロー、およびマクロ経済分析を実施いたします。（ファンドマネジャー） ・週次で、ポートフォリオのリスク量や寄与度分析等を中心に、パフォーマンス評価を実施します。（ミドル・オフィサー） ・月次で、コンプライアンス・オフィサーが運用ガイドライン等の契約項目をチェックします。 <p>上記は、平成26年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。</p>
<p>主な投資 制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式（株式投資信託証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

ファンド名	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界各国の好配当株式に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>組入銘柄の選定に当たっては、配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄を選定し、安定的な配当収入およびキャピタルゲインを享受することをめざします。</p> <p>北米地域の銘柄選定に当たってはDIAM U.S.A., Inc.、欧州地域の銘柄選定に当たってはDIAM International Ltdの投資助言を受けます。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向の急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、株式組入比率を引き下げる場合があります。</p> <p>外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資対象銘柄イメージ</p> <p>世界の株式の中でも配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄に着目します。</p> <p>上記企業の特徴はあくまでも一般論であり、すべての企業にあてはまるわけではありません。</p>

運用 プロセス	<p>組入れ銘柄選定にあたっては、世界を三極（北米、欧州、アジア・オセアニア）に区分し、DIAM International Ltdは欧州における銘柄を、DIAM U.S.A., Inc.は北米における銘柄をそれぞれ選定し、委託会社に助言します。委託会社はアジア・オセアニアにおける銘柄を選定します。</p> <p>委託会社は、選定された各地域の組入れ銘柄について、平均配当利回り、地域配分、業種配分等を考慮し、最終的にグローバルポートフォリオとして集約・構築します。</p>  <p>上記は、平成26年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。</p>
主な投資 制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

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
基本方針	この投資信託は、信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主な投資 対象	米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託および不動産投資法人をいいます。以下同じ。）の投資信託証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>運用指図に関する権限はデAVIS・セレクトド・アドバイザーズ（米国）に委託します。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <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"> ・1969年設立。創業者一族であるDavis家が出資する独立系運用会社。 ・運用受託資産は、約5兆770億円（約48,174百万米ドル、1米ドル=105.39円で換算）。そのうち、不動産関連証券投資は約815億円（2013年12月末現在）。 ・不動産関連証券投資では1994年からの実績。 ・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。 </div> <p>不動産投信等への投資は、原則として高位を維持することをめざします。</p> <p>外貨建資産については、対円で為替ヘッジは行いません。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>

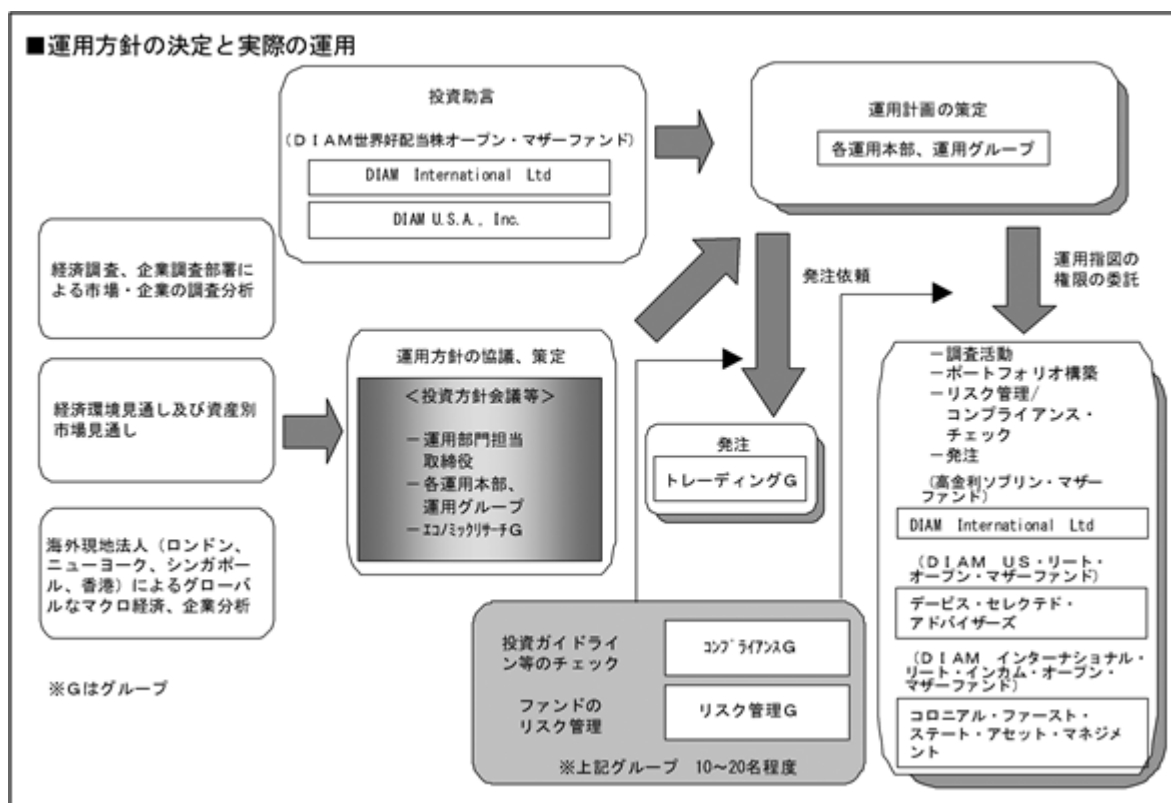
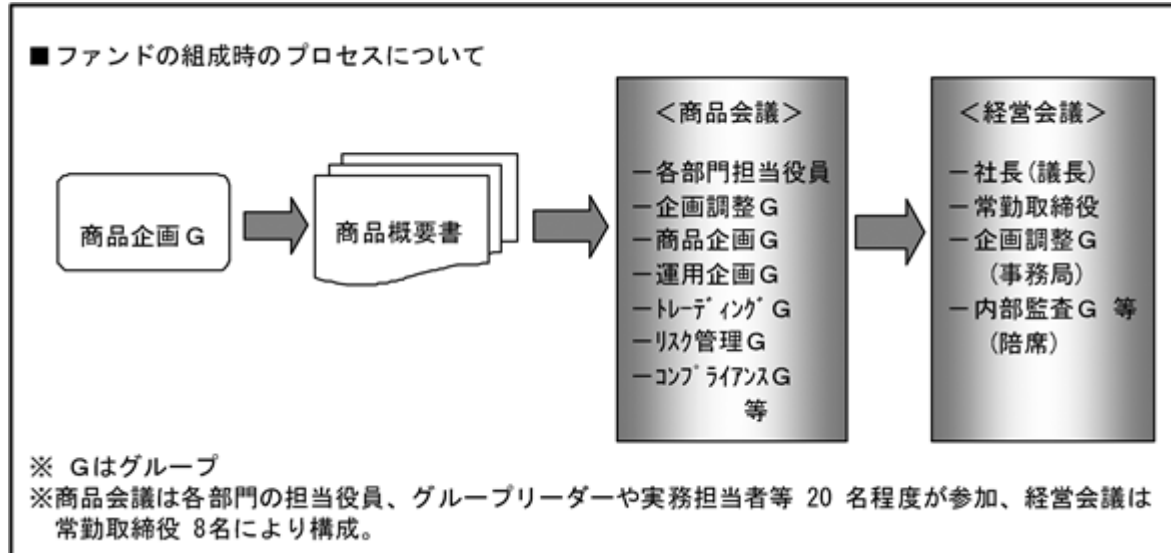
ファンド名	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主な投資対象	米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>運用指図に関する権限はコロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント（豪州）に委託します。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>コロニアル・ファースト・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"> ・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。 ・運用受託資産は、約17兆37億円（約182,365百万豪ドル、1豪ドル=93.24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2,908億円（2013年12月末現在）。 ・不動産関連証券投資では1991年からの実績。 ・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。 </div> <p>不動産投信等への投資は、原則として高位を維持することをめざします。</p> <p>外貨建資産について、対円で為替ヘッジは行いません。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>

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】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (3)運用体制」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

<ファンドの組成時のプロセスについて>

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席の

うえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

<運用方針の決定と実際の運用>

経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部、運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

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"> ・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。 ・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。

運用プロセス	<p>情報収集・分析</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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>運用方針・戦略の決定</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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>ポートフォリオの構築</p> <ul style="list-style-type: none"> ・策定した運用方針・戦略に基づき、運用担当者がポートフォリオを構築します。運用対象となる銘柄の執行については基本的にはそれぞれの運用担当者が自ら行います。 ・運用担当者は使用するポートフォリオ・マネジメント・システムでポートフォリオのリスク量やその変化をリアルタイムで把握することができる体制となっています。 <p>運用モニタリング</p> <ul style="list-style-type: none"> ・運用ガイドラインチェックは運用部門からは独立したコンプライアンスチームによってシステムを用いて日次で行われています。 ・同じく運用部門から独立したリスク管理チームが各ファンドのパフォーマンス評価や各種リスクのモニタリングを行っており、週次で開催されるモニタリング会議で報告されています。
--------	---

・デベイス・セレクトド・アドバイザーズの運用体制

D I A M US・リート・オープン・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デベイス・セレクトド・アドバイザーズに委託します。	
調査活動	不動産担当ポートフォリオマネジャー（運用担当者、以下同じ）およびアナリストにより、綿密な個別銘柄調査が行われます。経済・政治・不動産市場などのマクロ分析結果は、上記個別銘柄調査を効率的に行うことを目的として、活用されます。
ポートフォリオ構築	の分析結果に基づき、個別銘柄の選択の結果としてポートフォリオが構築されます。付加価値の源泉を個別銘柄選択に求めているため、良い経営の成長している銘柄を、内在価値より割安な価格で購入することを主眼とします。組入銘柄は、地理的、不動産タイプ別に分散させながら、30～40銘柄でポートフォリオを組成します。ポートフォリオ構築の最終決定は、不動産担当ポートフォリオマネジャーが行います。
リスク管理/コンプライアンス・チェック	不動産投信等への投資にかかるリスク管理は、個別銘柄のリスク管理に帰結するとの認識のもと、組入銘柄の継続的な調査を運用部門にて行います。また、業種分散、銘柄集中度を月次でモニタリングします。それら一連のリスク管理は、運用部門とは独立した組織により並行して行われます。また、ガイドラインの遵守状況などコンプライアンス・チェックも、運用部門とは完全に独立した部門により、定期的に行われます。

運用評価	委託会社において、マザーファンドの運用実績を、原則として月1回開催される経営会議において、評価いたします。
------	---

・コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントの運用体制

D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をコロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントに委託します。	
調査活動	<p>a) トップダウン・マクロ・スクリーニング</p> <p>中長期的に良好な運用を行うため、経済・政治・税金・証券市場・通貨見通しに加え、不動産需給の基礎的要因や貸借レート成長率、土地価格の見積もりなどに基づき、専属ファンドマネジャー（運用担当者、以下同じ）およびアナリストが地域別に不動産物件セクターの見通しを策定します。</p> <p>b) ボトムアップ調査</p> <p>専属ファンドマネジャーおよびアナリストが、不動産関連証券発行会社のマネジメントとの面談、主要な不動産賃貸契約の個別契約条項や不動産入居テナント企業に対する分析に基づき、綿密な調査活動を行います。また、オーストラリア・コモンウェルス銀行の調査情報ネットワークも活用します。</p>
ポートフォリオ構築	a) およびb)の分析結果に基づき、個別銘柄の選択の結果としてポートフォリオが構築されます。付加価値の源泉を個別銘柄選択に求めているため、グローバルな視点により銘柄の横比較を行い、優良な銘柄を選択することに主眼を置いています。ポートフォリオ構築に関する権限は、不動産関連証券チームの責任者に一任されています。
リスク管理/コンプライアンス・チェック	運用部門でのモニタリングに加え、運用部門とは完全に独立した部門により、個別銘柄ベースのリスク評価、また主に社内管理システムを活用してポートフォリオのリスク管理が行われます。また、ガイドラインの遵守状況などコンプライアンス・チェックも、運用部門とは完全に独立した部門により、システマティックに行われます。
運用評価	委託会社において、マザーファンドの運用実績を、原則として月1回開催される経営会議において、評価いたします。

各運用体制は、平成26年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

なお、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドについては、DIAM U.S.A., Inc.およびDIAM International Ltdの運用助言を受けます。

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<運用評価・運用リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成25年8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。

< 訂正後 >

(略)

< 運用評価・運用リスク管理体制 >

(略)

上記体制は平成26年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

< 訂正前 >

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に $3.15\%^{*}$ （税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

*消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

(略)

< 訂正後 >

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に 3.24% （税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

(略)

(3)【信託報酬等】

< 訂正前 >

ファンドの日々の純資産総額に対して年率 $1.26\%^{*}$ （税抜1.20%）

*消費税率が8%になった場合は、年率1.296%となります。

信託報酬の配分（税抜）	
委託会社	年率0.58%
販売会社	年率0.56%
受託会社	年率0.06%

(略)

< 訂正後 >

ファンドの日々の純資産総額に対して年率 1.296% （税抜1.20%）

信託報酬の配分（税抜）	
委託会社	年率0.58%
販売会社	年率0.56%
受託会社	年率0.06%

(略)

（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・訂正されます。

<更新・訂正後>

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「NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。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26年2月末現在のものです。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、「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・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成26年2月28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	816,761,609	98.49
内 日本	816,761,609	98.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,481,168	1.51
純資産総額	829,242,777	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)

D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	50,202,670,390	92.15
内 アメリカ	50,202,670,390	92.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,278,780,931	7.85
純資産総額	54,481,451,321	100.00

その他資産の投資状況

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	509,650,000	0.94
-	509,650,000	0.94

(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) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

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26年2月28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	44,085,439,870	53.56
内 オーストラリア	36,004,300,568	43.74
内 シンガポール	8,081,139,302	9.82
投資証券	34,576,695,903	42.00
内 カナダ	13,302,447,917	16.16
内 イギリス	6,426,257,566	7.81
内 オランダ	5,686,663,352	6.91
内 フランス	2,907,164,633	3.53
内 ベルギー	2,906,174,612	3.53
内 ニュージーランド	2,191,947,873	2.66
内 ドイツ	1,156,039,950	1.40
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,655,483,575	4.44
純資産総額	82,317,619,348	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26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	44,874,518,672	96.49
内 アメリカ	16,252,360,306	34.95
内 イギリス	8,760,898,035	18.84
内 フランス	4,780,141,842	10.28
内 ドイツ	3,840,048,829	8.26
内 カナダ	3,475,637,508	7.47
内 スイス	2,862,574,505	6.16
内 オーストラリア	2,075,771,797	4.46
内 イタリア	835,054,799	1.80
内 スペイン	391,656,914	0.84
内 スウェーデン	350,055,281	0.75
内 オランダ	278,729,525	0.60
内 フィンランド	262,313,754	0.56
内 パミュダ	249,035,025	0.54
内 ジョージア	246,260,908	0.53
内 香港	213,979,644	0.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,632,401,773	3.51
純資産総額	46,506,920,445	100.00

その他資産の投資状況

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	1,140,315,016	2.45
-	1,140,315,016	2.45
為替予約取引（売建）	1,141,279,965	2.45
-	1,141,279,965	2.45

（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）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

高金利ソブリン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	17,733,013,667	97.37
内 メキシコ	2,467,245,357	13.55
内 ニュージーランド	2,034,482,602	11.17
内 マレーシア	1,938,985,192	10.65
内 タイ	1,822,330,626	10.01
内 ポーランド	1,797,591,862	9.87
内 ノルウェー	1,651,666,038	9.07
内 フランス	1,635,177,715	8.98
内 スウェーデン	1,616,625,594	8.88
内 オーストラリア	1,536,523,160	8.44
内 カナダ	1,232,385,521	6.77
特殊債券	156,533,833	0.86
内 オーストラリア	156,533,833	0.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	322,957,846	1.77
純資産総額	18,212,505,346	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26年2月28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	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	136,488,578	1.9555 266,917,063	2.0315 277,276,546	- -	33.44%
2	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	206,087,741	1.2914 266,162,317	1.2985 267,604,931	- -	32.27%
3	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	88,308,367	1.8083 159,696,850	1.8573 164,015,130	- -	19.78%
4	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	54,334,577	1.9347 105,126,539	1.9852 107,865,002	- -	13.01%

(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26年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.49%
合計	98.49%

(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)

D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

平成26年2月28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	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES アメリカ	投資証券	772,464	3,367.22 2,601,061,158	3,721.82 2,874,979,225	- -	5.28%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	173,443	15,589.09 2,703,818,801	16,349.13 2,835,643,403	- -	5.20%
3	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	161,536	15,692.07 2,534,835,196	16,829.27 2,718,533,701	- -	4.99%
4	CORPORATE OFFICE PROPERTIES アメリカ	投資証券	923,380	2,275.94 2,101,562,762	2,713.64 2,505,723,488	- -	4.60%
5	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	331,164	6,498.14 2,151,952,245	7,393.70 2,448,529,982	- -	4.49%
6	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券	293,088	8,023.64 2,351,634,852	8,304.03 2,433,812,248	- -	4.47%
7	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	203,310	10,301.99 2,094,497,947	11,308.20 2,299,070,995	- -	4.22%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	170,560	12,409.10 2,116,497,282	12,976.96 2,213,350,638	- -	4.06%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	346,073	5,775.32 1,998,682,463	6,365.13 2,202,800,880	- -	4.04%
10	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	880,680	2,143.64 1,887,861,992	2,263.06 1,993,038,726	- -	3.66%
11	EDUCATION REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	2,055,530	920.47 1,892,065,016	961.29 1,975,969,066	- -	3.63%
12	LIBERTY PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	518,040	3,428.05 1,775,870,546	3,771.77 1,953,932,911	- -	3.59%
13	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC アメリカ	投資証券	633,030	2,356.34 1,491,634,202	2,656.55 1,681,679,897	- -	3.09%
14	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	136,400	10,633.06 1,450,349,892	11,309.22 1,542,578,099	- -	2.83%
15	TANGER FACTORY OUTLET アメリカ	投資証券	382,190	3,351.31 1,280,837,543	3,478.19 1,329,330,506	- -	2.44%
16	ACADIA REALTY TRUST アメリカ	投資証券	488,520	2,642.32 1,290,830,144	2,676.94 1,307,740,878	- -	2.40%
17	DIGITAL REALTY 7.0% アメリカ	投資証券	517,500	2,387.43 1,235,497,509	2,460.83 1,273,480,353	- -	2.34%
18	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	624,440	1,885.98 1,177,682,646	1,995.98 1,246,372,998	- -	2.29%
19	CUBESMART アメリカ	投資証券	700,040	1,658.85 1,161,263,883	1,779.87 1,245,981,874	- -	2.29%
20	DCT INDUSTRIAL TRUST INC アメリカ	投資証券	1,532,050	741.25 1,135,638,160	796.15 1,219,743,752	- -	2.24%
21	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	289,840	3,770.02 1,092,704,354	4,169.34 1,208,443,244	- -	2.22%
22	POST PROPERTIES, INC アメリカ	投資証券	237,580	4,705.76 1,117,994,604	4,941.03 1,173,890,335	- -	2.15%

23	BIOMED REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	558,880	1,915.87 1,070,743,866	2,097.92 1,172,488,435	- -	2.15%
24	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	115,836	9,255.99 1,072,177,766	9,662.89 1,119,310,827	- -	2.05%
25	EAST GROUP アメリカ	投資証券	164,200	6,092.36 1,000,367,132	6,284.60 1,031,931,484	- -	1.89%
26	LASALLE HOTEL PROPERTIES アメリカ	投資証券	288,480	3,079.04 888,242,169	3,167.27 913,695,722	- -	1.68%
27	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	149,497	4,950.38 740,067,571	5,132.67 767,320,112	- -	1.41%
28	EPR PROPERTIES アメリカ	投資証券	143,540	5,074.56 728,402,624	5,313.11 762,644,211	- -	1.40%
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	186,180	3,692.22 687,419,171	4,077.60 759,167,568	- -	1.39%
30	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	89,420	5,482.44 490,240,333	5,949.21 531,979,109	- -	0.98%

(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26年2月28日現在

種類	投資比率
投資証券	92.15%
合計	92.15%

(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26年2月28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	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	42,722,515	148.06 6,325,837,351	161.32 6,892,038,841	- -	8.37%
2	INVESTA OFFICE FUND オーストラリア	投資信託 受益証券	15,480,205	279.68 4,329,565,655	288.82 4,471,054,728	- -	5.43%
3	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	23,503,224	177.31 4,167,497,666	180.97 4,253,425,453	- -	5.17%
4	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資信託 受益証券	11,547,169	335.43 3,873,359,275	328.12 3,788,926,375	- -	4.60%
5	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資信託 受益証券	12,282,105	265.05 3,255,494,751	285.16 3,502,463,318	- -	4.25%
6	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR カナダ	投資証券	1,321,578	2,254.76 2,979,852,048	2,357.38 3,115,464,981	- -	3.78%
7	ALLIED PROPERTIES REIT カナダ	投資証券	950,022	2,981.31 2,832,314,648	3,039.95 2,888,020,898	- -	3.51%
8	WERELDHAVE NV オランダ	投資証券	281,550	7,740.75 2,179,408,866	8,633.75 2,430,833,720	- -	2.95%

9	GOODMAN PROPERTY TRUST ニュージーランド	投資証券	26,401,917	85.16 2,248,441,376	83.02 2,191,947,873	- -	2.66%
10	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	2,211,954	855.80 1,892,999,523	983.40 2,175,255,913	- -	2.64%
11	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV オランダ	投資証券	476,927	4,122.62 1,966,191,173	4,557.24 2,173,474,378	- -	2.64%
12	CHARTER HALL GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	5,908,131	324.46 1,917,011,265	367.42 2,170,812,757	- -	2.64%
13	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	1,778,892	1,022.54 1,818,990,716	1,179.92 2,098,951,849	- -	2.55%
14	FEDERATION CENTRES オーストラリア	投資信託 受益証券	9,031,136	208.16 1,879,978,524	221.18 1,997,578,909	- -	2.43%
15	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,361,067	1,307.41 1,779,482,678	1,427.43 1,942,840,934	- -	2.36%
16	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	19,415,105	93.61 1,817,595,711	97.34 1,889,885,735	- -	2.30%
17	MAPLETREE LOGISTICS TRUST シンガポール	投資信託 受益証券	19,701,320	83.60 1,647,080,705	84.20 1,658,971,322	- -	2.02%
18	WAREHOUSES DE PAUW ベルギー	投資証券	216,085	7,355.04 1,589,314,358	7,665.28 1,656,353,649	- -	2.01%
19	CROMWELL PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	17,368,956	87.74 1,524,021,675	90.02 1,563,709,739	- -	1.90%
20	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA オーストラリア	投資信託 受益証券	10,362,271	139.84 1,449,080,701	149.43 1,548,527,415	- -	1.88%
21	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST シンガポール	投資信託 受益証券	12,519,840	105.44 1,320,179,418	108.78 1,361,945,754	- -	1.65%
22	ASCOTT RESIDENCE TRUST シンガポール	投資信託 受益証券	14,377,600	92.72 1,333,192,082	93.47 1,343,914,529	- -	1.63%
23	KLEPIERRE フランス	投資証券	285,420	4,695.60 1,340,218,152	4,636.20 1,323,265,987	- -	1.61%
24	CHOICE PROPERTIES REIT カナダ	投資証券	1,309,280	952.84 1,247,544,829	962.00 1,259,540,452	- -	1.53%
25	CROMBIE REAL ESTATE INV カナダ	投資証券	992,261	1,219.46 1,210,024,782	1,213.96 1,204,570,124	- -	1.46%
26	ASCENDAS REAL ESTATE INVT シンガポール	投資信託 受益証券	6,872,000	174.85 1,201,628,299	174.05 1,196,090,841	- -	1.45%
27	AUSTRALAND PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	3,338,857	339.09 1,132,186,375	356.45 1,190,168,966	- -	1.45%
28	SEGRO PLC イギリス	投資証券	1,925,876	559.76 1,078,029,505	607.22 1,169,449,028	- -	1.42%
29	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券	827,220	1,238.32 1,024,367,001	1,397.50 1,156,039,950	- -	1.40%
30	NORTHERN PROPERTY RE INV TR カナダ	投資証券	414,973	2,472.82 1,026,155,110	2,637.73 1,094,590,798	- -	1.33%

(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26年2月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	53.56%
投資証券	42.00%
合計	95.56%

（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26年2月28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	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	226,670	3,874.95 878,335,653	3,975.32 901,086,033	- -	1.94%
2	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	116,375	7,539.73 877,436,311	7,631.53 888,120,467	- -	1.91%
3	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	27,864	29,113.81 811,227,231	31,295.05 872,005,328	- -	1.88%
4	SANOFI フランス	株式 医薬品	79,896	11,810.27 943,593,531	10,527.36 841,094,553	- -	1.81%
5	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	254,726	2,960.33 754,074,955	3,285.52 836,908,946	- -	1.80%
6	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	137,191	5,153.42 707,003,011	5,775.92 792,404,295	- -	1.70%
7	TOTAL SA フランス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	119,329	5,567.07 664,312,996	6,476.01 772,776,393	- -	1.66%
8	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	261,689	2,909.50 761,384,530	2,866.00 750,002,845	- -	1.61%
9	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	324,086	1,941.27 629,140,848	2,301.99 746,044,092	- -	1.60%
10	ALLIANZ SE ドイツ	株式 保険	40,427	16,364.72 661,576,737	17,888.00 723,158,176	- -	1.55%
11	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	80,985	8,183.08 662,707,420	8,423.38 682,167,753	- -	1.47%
12	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	609,738	1,204.13 734,205,104	1,081.92 659,687,895	- -	1.42%
13	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	70,471	8,850.43 623,698,708	9,313.23 656,313,223	- -	1.41%
14	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 タバコ	118,162	6,305.38 745,057,304	5,477.65 647,250,941	- -	1.39%
15	SIEMENS AG-REG ドイツ	株式 コングロマ リット	48,203	11,636.13 560,896,455	13,417.39 646,758,811	- -	1.39%
16	VINCI S.A. フランス	株式 建設・土木	78,821	5,261.85 414,745,013	7,573.05 596,915,571	- -	1.28%

17	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG ドイツ	株式 各種電気通信 サービス	341,692	1,266.00 432,583,238	1,721.02 588,059,192	- -	1.26%
18	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サー ビス	1,399,255	394.77 552,391,281	419.90 587,554,898	- -	1.26%
19	BNP PARIBAS フランス	株式 商業銀行	68,226	6,323.39 431,420,254	8,266.21 563,970,614	- -	1.21%
20	BHP BILLITON PLC イギリス	株式 金属・鉱業	159,289	3,255.27 518,529,794	3,276.89 521,973,550	- -	1.12%
21	BASF SE ドイツ	株式 化学	43,361	10,264.63 445,084,946	11,459.49 496,895,379	- -	1.07%
22	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品	69,307	5,832.39 404,226,091	6,980.84 483,821,368	- -	1.04%
23	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO アメリカ	株式 医薬品	85,407	4,831.05 412,605,592	5,499.66 469,709,717	- -	1.01%
24	AUST AND NZ BANKING GROUP LT オーストラリア	株式 商業銀行	159,508	2,911.94 464,477,935	2,938.50 468,715,853	- -	1.01%
25	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス ・消耗燃料	546,461	816.16 446,004,201	856.31 467,942,543	- -	1.01%
26	WESTPAC BANKING CORPORATION オーストラリア	株式 商業銀行	152,403	2,901.63 442,217,452	3,065.55 467,199,931	- -	1.00%
27	AXA フランス	株式 保険	176,668	2,401.42 424,255,392	2,642.67 466,875,665	- -	1.00%
28	LOCKHEED MARTIN CORP アメリカ	株式 航空宇宙 ・防衛	28,079	12,521.39 351,588,112	16,457.19 462,101,539	- -	0.99%
29	REED ELSEVIER PLC イギリス	株式 メディア	292,869	1,277.75 374,213,774	1,571.24 460,168,336	- -	0.99%
30	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN フランス	株式 建設関連製品	76,270	5,267.54 401,755,966	6,032.30 460,084,188	- -	0.99%

（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26年2月28日現在

種類	投資比率
株式	96.49%
合計	96.49%

（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26年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品	外国	15.08%
商業銀行		9.69%
石油・ガス・消耗燃料		9.58%
保険		8.82%
各種電気通信サービス		7.45%
総合公益事業		5.37%
電力		3.72%
タバコ		3.58%
メディア		2.96%
化学		2.29%
建設・土木		2.13%
金属・鉱業		2.10%
ホテル・レストラン・レジャー		2.04%
食品		1.91%
コングロマリット		1.91%
自動車		1.72%
半導体・半導体製造装置		1.56%
商社・流通業		1.51%
航空宇宙・防衛		1.43%
水道		1.36%
無線通信サービス		1.26%
建設関連製品		0.99%
商業サービス・用品		0.99%
建設資材		0.93%
航空貨物・物流サービス		0.70%
ガス		0.70%
バイオテクノロジー		0.63%
容器・包装		0.59%
情報技術サービス		0.53%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.53%
機械		0.51%
家庭用品		0.49%
各種金融サービス		0.49%
資本市場	0.48%	
ヘルスケア機器・用品	0.48%	
合計	96.49%	

(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26年2月28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	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17 ニュージーランド	国債証券	1,891,539,000	114.15 2,159,305,260	107.55 2,034,482,602	6.000000 2017/12/15	11.17%
2	MALAYSIA 4.24 02/07/18 マレーシア	国債証券	1,897,710,000	102.10 1,937,561,910	102.17 1,938,985,192	4.240000 2018/2/7	10.65%
3	THAILAND 3.25 06/16/17 タイ	国債証券	1,791,816,000	101.35 1,816,148,861	101.70 1,822,330,626	3.250000 2017/6/16	10.01%
4	SWEDEN 4.25 03/12/19 スウェーデン	国債証券	1,422,585,000	116.33 1,654,964,259	113.64 1,616,625,594	4.250000 2019/3/12	8.88%
5	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18 オーストラリア	国債証券	1,325,300,000	111.08 1,472,221,935	108.80 1,441,966,159	5.500000 2018/1/21	7.92%
6	FRANCE OAT 4.25 10/25/17 フランス	国債証券	1,131,975,000	116.26 1,316,034,135	113.53 1,285,210,455	4.250000 2017/10/25	7.06%
7	CANADA 4.25 06/01/18 カナダ	国債証券	1,104,021,000	114.42 1,263,242,908	111.62 1,232,385,521	4.250000 2018/6/1	6.77%
8	POLAND 5.5 10/25/19 ポーランド	国債証券	1,075,520,000	115.03 1,237,224,432	108.13 1,162,959,776	5.500000 2019/10/25	6.39%
9	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17 メキシコ	国債証券	935,424,000	115.21 1,077,758,115	110.35 1,032,305,863	7.750000 2017/12/14	5.67%
10	NORWAY 5.0 05/15/15 ノルウェー	国債証券	983,521,000	107.51 1,057,481,779	104.20 1,024,878,058	5.000000 2015/5/15	5.63%
11	POLAND 5.25 10/25/17 ポーランド	国債証券	598,258,000	110.40 660,536,657	106.07 634,632,086	5.250000 2017/10/25	3.48%
12	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 メキシコ	国債証券	522,240,000	111.94 584,641,595	112.63 588,230,246	8.000000 2020/6/11	3.23%
13	MEXICAN BONDS 7.25 12/15/16 メキシコ	国債証券	460,800,000	110.80 510,575,616	107.81 496,820,736	7.250000 2016/12/15	2.73%
14	NORWAY 4.25 05/19/17 ノルウェー	国債証券	337,400,000	111.75 377,044,500	107.72 363,447,280	4.250000 2017/5/19	2.00%
15	FRANCE OAT 4.0 04/25/18 フランス	国債証券	307,450,000	113.18 347,971,910	113.82 349,967,260	4.000000 2018/4/25	1.92%
16	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18 メキシコ	国債証券	307,200,000	113.50 348,690,416	113.89 349,888,512	8.500000 2018/12/13	1.92%
17	NORWAY 4.5 05/22/19 ノルウェー	国債証券	236,180,000	112.80 266,411,040	111.50 263,340,700	4.500000 2019/5/22	1.45%
18	NEW S WALES 5.5 03/01/17 オーストラリア	特殊債券	146,240,000	109.24 159,758,425	107.03 156,533,833	5.500000 2017/3/1	0.86%
19	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17 オーストラリア	国債証券	86,830,000	110.52 95,967,120	108.89 94,557,001	6.000000 2017/2/15	0.52%

(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26年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	97.37%
特殊債券	0.86%
合計	98.23%

（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）

D I A M U S・リート・オープン・マザーファンド

平成26年2月28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
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売 / 円買 2014年03月	売建	5,000,000	511,600,000	509,650,000	0.94%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

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

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26年2月28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
為替予約取引	-	オーストラリア・ドル買 / 円売 2014年03月	買建	7,800,000	713,630,970	712,686,000	1.53%
		ユーロ買 / 円売 2014年03月	買建	3,060,176	428,778,000	427,629,016	0.92%
		アメリカ・ドル売 / 円買 2014年03月	売建	7,000,500	713,630,970	713,560,965	1.53%
		イギリス・ポンド売 / 円買 2014年03月	売建	1,300,000	221,832,000	221,169,000	0.48%
		スイス・フラン売 / 円買 2014年03月	売建	1,800,000	206,946,000	206,550,000	0.44%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

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26年2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20年2月8日)	1,578	1,583	0.9077	0.9107
第2特定期間末 (平成20年8月8日)	1,568	1,573	0.8930	0.8960
第3特定期間末 (平成21年2月9日)	811	816	0.4861	0.4891
第4特定期間末 (平成21年8月10日)	1,015	1,020	0.6107	0.6137
第5特定期間末 (平成22年2月8日)	941	946	0.5723	0.5753
第6特定期間末 (平成22年8月9日)	921	926	0.5760	0.5790
第7特定期間末 (平成23年2月8日)	915	920	0.5958	0.5988
第8特定期間末 (平成23年8月8日)	808	812	0.5483	0.5513
第9特定期間末 (平成24年2月8日)	755	759	0.5519	0.5549
第10特定期間末 (平成24年8月8日)	745	749	0.5648	0.5678
第11特定期間末 (平成25年2月8日)	876	879	0.6899	0.6929
第12特定期間末 (平成25年8月8日)	816	820	0.6912	0.6942
第13特定期間末 (平成26年2月10日)	813	817	0.7307	0.7337
平成25年2月末日	867	-	0.6821	-
3月末日	881	-	0.6983	-
4月末日	927	-	0.7491	-
5月末日	908	-	0.7476	-
6月末日	832	-	0.6960	-
7月末日	838	-	0.7073	-
8月末日	800	-	0.6821	-
9月末日	824	-	0.7045	-
10月末日	850	-	0.7292	-
11月末日	852	-	0.7396	-
12月末日	859	-	0.7574	-
平成26年1月末日	819	-	0.7299	-
2月末日	829	-	0.7472	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0240
第2特定期間	0.0180
第3特定期間	0.0180
第4特定期間	0.0180
第5特定期間	0.0180
第6特定期間	0.0180
第7特定期間	0.0180
第8特定期間	0.0180
第9特定期間	0.0180
第10特定期間	0.0180
第11特定期間	0.0180
第12特定期間	0.0180
第13特定期間	0.0180

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	6.8
第2特定期間	0.4
第3特定期間	43.5
第4特定期間	29.3
第5特定期間	3.3
第6特定期間	3.8
第7特定期間	6.6
第8特定期間	5.0
第9特定期間	3.9
第10特定期間	5.6
第11特定期間	25.3
第12特定期間	2.8
第13特定期間	8.3

(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	1,764,046,378	24,791,049
第2特定期間	40,714,816	23,863,656
第3特定期間	2,131,244	89,278,252
第4特定期間	10,856,290	16,484,516
第5特定期間	8,101,863	26,743,189
第6特定期間	3,257,201	47,437,282
第7特定期間	5,059,112	68,827,822
第8特定期間	2,582,669	65,396,213
第9特定期間	5,514,726	110,355,631
第10特定期間	13,441,504	62,458,346
第11特定期間	17,391,808	67,620,316
第12特定期間	27,505,788	116,107,063
第13特定期間	20,079,763	87,547,408

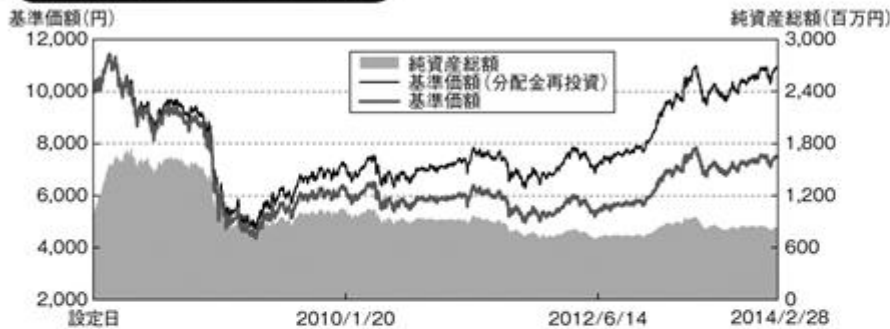
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(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。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2014年2月28日

基準価額・純資産の推移 (設定日(2007年8月20日)~2014年2月28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:2007年8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73期(2013.10.08)	30円
第74期(2013.11.08)	30円
第75期(2013.12.09)	30円
第76期(2014.01.08)	30円
第77期(2014.02.10)	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	2,400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	DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	33.44%
2	高金利ソブリン・マザーファンド	32.27%
3	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	19.78%
4	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	13.01%

■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

組入上位10銘柄

資産の種類	投資比率(%)	順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
国債証券	97.37	1	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17	国債証券	ニュージーランド	6.000000	2017/12/15	11.17%
内 メキシコ	13.55	2	MALAYSIA 4.24 02/07/18	国債証券	マレーシア	4.240000	2018/2/7	10.65%
内 ニュージーランド	11.17	3	THAILAND 3.25 06/16/17	国債証券	タイ	3.250000	2017/6/16	10.01%
内 マレーシア	10.65	4	SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	スウェーデン	4.250000	2019/3/12	8.88%
内 タイ	10.01	5	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	国債証券	オーストラリア	5.500000	2018/1/21	7.92%
内 ポーランド	9.87	6	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	国債証券	フランス	4.250000	2017/10/25	7.06%
内 その他	42.12	7	CANADA 4.25 06/01/18	国債証券	カナダ	4.250000	2018/6/1	6.77%
特殊債券	0.86	8	POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	ポーランド	5.500000	2019/10/25	6.39%
内 オーストラリア	0.86	9	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	国債証券	メキシコ	7.750000	2017/12/14	5.67%
コール・ローンその他の資産(負債控除後)	1.77	10	NORWAY 5.0 05/15/15	国債証券	ノルウェー	5.000000	2015/5/15	5.63%
純資産総額	100.00							

■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

組入上位10銘柄

組入上位5業種(外国株式)

資産の種類	投資比率(%)	順位	銘柄名	発行体の国/地域	業種	投資比率	順位	業種	投資比率
株式	96.49	1	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	イギリス	石油・ガス・消耗燃料	1.94%	1	医薬品	15.08%
内 アメリカ	34.95	2	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品	1.91%	2	商業銀行	9.69%
内 イギリス	18.84	3	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	医薬品	1.88%	3	石油・ガス・消耗燃料	9.58%
内 フランス	10.28	4	SANOFI	フランス	医薬品	1.81%	4	保険	8.82%
内 ドイツ	8.26	5	PFIZER INC	アメリカ	医薬品	1.80%	5	各種電気通信サービス	7.45%
内 カナダ	7.47	6	MERCK & CO.INC.	アメリカ	医薬品	1.70%			
内 その他	16.69	7	TOTAL SA	フランス	石油・ガス・消耗燃料	1.66%			
コール・ローンその他の資産(負債控除後)	3.51	8	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	医薬品	1.61%			
		9	PRUDENTIAL PLC	イギリス	保険	1.60%			
純資産総額	100.00	10	ALLIANZ SE	ドイツ	保険	1.55%			

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2.45
為替予約取引(売建)	△2.45

○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:2014年2月28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	92.15
内 アメリカ	92.15
コール・ローンその他の資産(負債控除後)	7.85
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(%)
為替予約取引(売建)	△0.94

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	アメリカ	5.28%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	5.20%
3	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	4.99%
4	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	アメリカ	4.60%
5	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	4.49%
6	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	4.47%
7	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	4.22%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	4.06%
9	VENTAS INC	アメリカ	4.04%
10	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	アメリカ	3.66%

■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。

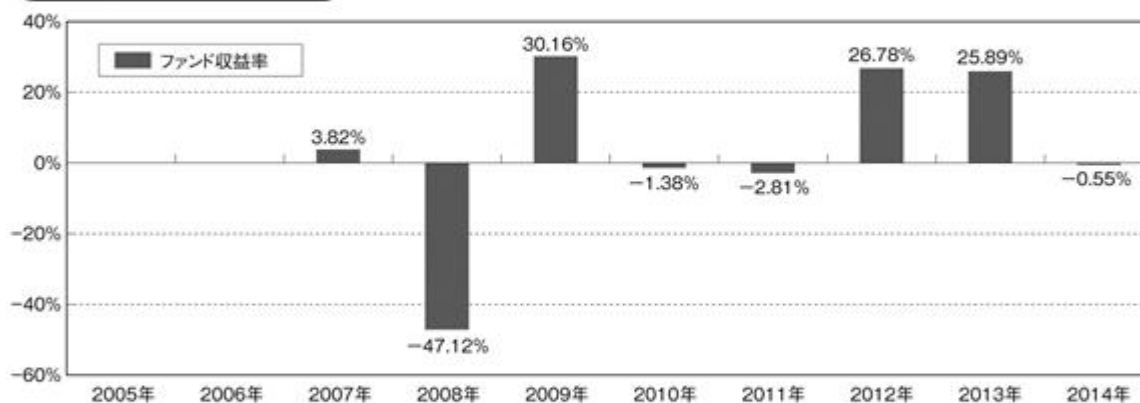
ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	53.56
内 オーストラリア	43.74
内 シンガポール	9.82
投資証券	42.00
内 カナダ	16.16
内 イギリス	7.81
内 オランダ	6.91
内 フランス	3.53
内 ヘルギー	3.53
内 その他	4.06
コール・ローンその他の資産(負債控除後)	4.44
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	MIRVAC GROUP	オーストラリア	8.37%
2	INVESTA OFFICE FUND	オーストラリア	5.43%
3	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	オーストラリア	5.17%
4	CHARTER HALL RETAIL REIT	オーストラリア	4.60%
5	WESTFIELD RETAIL TRUST	オーストラリア	4.25%
6	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	カナダ	3.78%
7	ALLIED PROPERTIES REIT	カナダ	3.51%
8	WERELDHAVE NV	オランダ	2.95%
9	GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド	2.66%
10	HAMMERSON PLC	イギリス	2.64%

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、2007年は設定日から年末までの収益率、および2014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2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（略）

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続が完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、海外休業日には、お申込みの受付を行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

（略）

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、 $3.15\%^{*}$ （税抜3.0%）を上限として、各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

*消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「累積投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（略）

<訂正後>

（略）

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続が完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

（略）

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、 3.24% （税抜3.0%）を上限として、各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「累積投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（略）

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・訂正されます。

<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カ月未満であるため、財務諸表は6カ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25年8月9日から平成26年2月10日まで）の財務諸表について、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】

D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成25年8月8日現在	当 期 平成26年2月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,164,105	20,257,076
親投資信託受益証券	808,458,425	797,902,769
未収入金	5,000,000	-
流動資産合計	823,622,530	818,159,845
資産合計	823,622,530	818,159,845
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,543,720	3,341,317
未払解約金	2,658,158	-
未払受託者報酬	45,514	47,197
未払委託者報酬	864,972	896,865
その他未払費用	5,391	5,587
流動負債合計	7,117,755	4,290,966
負債合計	7,117,755	4,290,966
純資産の部		
元本等		
元本	1,181,240,064	1,113,772,419
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 364,735,289	2 299,903,540
（分配準備積立金）	42,725,540	33,897,793
元本等合計	816,504,775	813,868,879
純資産合計	816,504,775	813,868,879
負債純資産合計	823,622,530	818,159,845

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	前 期 自 平成25年2月9日 至 平成25年8月8日	当 期 自 平成25年8月9日 至 平成26年2月10日
営業収益		
受取利息	3,161	3,022
有価証券売買等損益	32,478,137	72,444,344
営業収益合計	32,481,298	72,447,366
営業費用		
受託者報酬	276,542	267,517
委託者報酬	2 5,255,270	2 5,083,651
その他費用	32,754	31,682
営業費用合計	5,564,566	5,382,850
営業利益又は営業損失（ ）	26,916,732	67,064,516
経常利益又は経常損失（ ）	26,916,732	67,064,516
当期純利益又は当期純損失（ ）	26,916,732	67,064,516
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（ ）	122,289	118,972
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	393,747,332	364,735,289
剰余金増加額又は欠損金減少額	32,175,319	24,073,932
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	32,175,319	24,073,932
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,898,156	5,474,489
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,898,156	5,474,489
分配金	1 22,059,563	1 20,713,238
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	364,735,289	299,903,540

(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2月8日及び8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26年2月10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25年8月8日現在	当 期 平成26年2月10日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	1,269,841,339円 27,505,788円 116,107,063円	1,181,240,064円 20,079,763円 87,547,408円
2 . 受益権の総数	1,181,240,064口	1,113,772,419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364,735,289円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は299,903,540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25年2月9日 至 平成25年8月8日	当 期 自 平成25年8月9日 至 平成26年2月10日
1 . 1 分配金の計算過程	(自平成25年2月9日 至平成25年3月8日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (3,069,266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 (41,289,296円) 及び分配準備積立金 (50,276,614円) より分配対象収益は94,635,176円 (1万口当たり745.94円) であり、うち3,806,032円 (1万口当たり30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25年8月9日 至平成25年9月9日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (2,235,666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 (38,879,077円) 及び分配準備積立金 (42,343,452円) より分配対象収益は83,458,195円 (1万口当たり712.01円) であり、うち3,516,447円 (1万口当たり30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25年3月9日 至平成25年4月8日）

計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,235,328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（41,217,253円）及び分配準備積立金（49,019,066円）より分配対象収益は93,471,647円（1万口当たり741.65円）であり、うち3,780,946円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

（自平成25年4月9日 至平成25年5月8日）

計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,063,984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（40,696,071円）及び分配準備積立金（47,438,441円）より分配対象収益は92,198,496円（1万口当たり744.54円）であり、うち3,714,989円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

（自平成25年5月9日 至平成25年6月10日）

計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,950,646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（39,934,206円）及び分配準備積立金（46,732,993円）より分配対象収益は89,617,845円（1万口当たり738.89円）であり、うち3,638,629円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

（自平成25年9月10日 至平成25年10月8日）

計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,060,298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（38,918,758円）及び分配準備積立金（40,785,728円）より分配対象収益は81,764,784円（1万口当たり699.66円）であり、うち3,505,906円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

（自平成25年10月9日 至平成25年11月8日）

計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,122,766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（38,880,776円）及び分配準備積立金（39,193,911円）より分配対象収益は80,197,453円（1万口当たり687.88円）であり、うち3,497,594円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

（自平成25年11月9日 至平成25年12月9日）

計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,393,673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（38,484,164円）及び分配準備積立金（37,281,279円）より分配対象収益は78,159,116円（1万口当たり678.68円）であり、うち3,454,896円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

<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25年6月11日 至平成25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（3,819,599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（39,282,892円）及び分配準備積立金（45,200,642円）より分配対象収益は88,303,133円（1万口当たり740.95円）であり、うち3,575,247円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成25年7月9日 至平成25年8月8日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,410,647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（39,125,547円）及び分配準備積立金（44,858,613円）より分配対象収益は85,394,807円（1万口当たり722.93円）であり、うち3,543,720円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成25年12月10日 至平成26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（4,459,193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（37,955,778円）及び分配準備積立金（35,503,283円）より分配対象収益は77,918,254円（1万口当たり688.11円）であり、うち3,397,078円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成26年1月9日 至平成26年2月10日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,489,546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（37,554,076円）及び分配準備積立金（35,749,564円）より分配対象収益は74,793,186円（1万口当たり671.53円）であり、うち3,341,317円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>
	1,137,903円	1,097,586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25年2月9日 至 平成25年8月8日	当 期 自 平成25年8月9日 至 平成26年2月10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25年8月8日現在	当 期 平成26年2月10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25年8月8日現在	当 期 平成26年2月10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	16,740,564	19,294,834
合計	16,740,564	19,294,834

(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25年8月8日現在	当 期 平成26年2月10日現在
1口当たり純資産額	0.6912円	0.7307円
(1万口当たり純資産額)	(6,912円)	(7,307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26年2月10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	D I A M U S・リート・オープン・マ ザーファンド	54,334,577	105,126,539	
	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	88,308,367	159,696,850	
	D I A M世界好配当株オープン・マザー ファンド	136,488,578	266,917,063	
	高金利ソブリン・マザーファンド	206,087,741	266,162,317	
親投資信託受益証券 合計		485,219,263	797,902,769	
合計		485,219,263	797,902,769	

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、「D I A M US・リート・オープン・マザーファンド」受益証券、「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」受益証券、「D I A M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。

「D I A M US・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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,282,043,659	1,107,800,584
コール・ローン		2,439,912,198	1,298,033,573
投資証券		54,032,958,229	50,673,876,289
未収入金		595,498,157	227,130,093
未収配当金		23,243,157	87,540,177
流動資産合計		59,373,655,400	53,394,380,716
資産合計		59,373,655,400	53,394,380,716
負債の部			
流動負債			
未払金		224,969,886	14,854,554
未払解約金		500,000,000	-
流動負債合計		724,969,886	14,854,554
負債合計		724,969,886	14,854,554
純資産の部			
元本等			
元本	1	32,325,974,964	27,589,763,927
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		26,322,710,550	25,789,762,235
元本等合計		58,648,685,514	53,379,526,162
純資産合計		58,648,685,514	53,379,526,162
負債純資産合計		59,373,655,400	53,394,380,716

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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	41,834,017,268円	32,325,974,964円
	同期中追加設定元本額	37,908,512円	9,993,017円
	同期中一部解約元本額	9,545,950,816円	4,746,204,054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	42,084,519円	36,109,125円
	D I A M世界6資産バランスファンド	165,933,804円	150,476,871円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	214,025,648円	214,025,648円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	4,242,597円	3,994,120円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	1,445,426円	1,341,672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）	29,866,204,332円	25,294,972,209円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	564,837,784円	517,248,851円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	898,241,523円	834,527,908円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	427,957,484円	403,348,407円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	58,032,412円	54,334,577円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	82,969,435円	79,384,539円
	計	32,325,974,964円	27,589,763,927円
2 .	受益権の総数	32,325,974,964口	27,589,763,927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25年2月9日 至 平成25年8月8日	自 平成25年8月9日 至 平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10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	923,611,720	2,005,434,204
合計	923,611,720	2,005,434,204

(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24年12月11日から平成25年8月8日まで及び平成25年12月10日から平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
1口当たり純資産額	1.8143円	1.9348円
(1万口当たり純資産額)	(18,143円)	(19,348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26年2月10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	488,520.000	12,608,701.200	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	331,164.000	23,423,229.720	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,280,764.000	42,572,595.360	
		AMERICAN TOWER CORP	293,088.000	23,558,413.440	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	170,560.000	21,799,273.600	
		BIOMED REALTY TRUST INC	558,880.000	11,199,955.200	
		BOSTON PROPERTIES INC	203,310.000	22,197,385.800	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	923,380.000	23,426,150.600	
		COUSINS PROPERTIES INC	211,790.000	2,280,978.300	
		CUBESMART	700,040.000	11,431,653.200	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	1,532,050.000	11,674,221.000	
		DIGITAL REALTY 7.0%	517,500.000	12,016,350.000	
		DUPONT FABROS 7.625	85,000.000	2,025,975.000	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	633,030.000	16,072,631.700	
		EAST GROUP	164,200.000	10,021,126.000	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	2,055,530.000	18,314,772.300	
		EPR PROPERTIES	143,540.000	7,212,885.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	186,180.000	7,313,150.400	
		EQUITY RESIDENTIAL	89,420.000	5,085,315.400	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	161,536.000	26,716,439.040	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	136,400.000	15,361,368.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	880,680.000	18,150,814.800	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	624,440.000	11,502,184.800	
		LASALLE HOTEL PROPERTIES	288,480.000	8,351,496.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	518,040.000	18,499,208.400	
		POST PROPERTIES, INC	237,580.000	11,159,132.600	
		PROLOGIS INC	289,840.000	11,573,311.200	
		REGENCY CENTERS CORP	149,497.000	7,252,099.470	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	173,443.000	27,225,347.710	
		SL GREEN REALTY PFD 6.5	200,000.000	4,674,000.000	
TANGER FACTORY OUTLET	382,190.000	12,757,502.200			
TAUBMAN CENTERS INC	53,290.000	3,617,325.200			
TERRENO REALTY CORP	73,280.000	1,264,080.000			
VENTAS INC	346,073.000	21,435,761.620			
VORNADO REALTY TRUST	115,836.000	10,700,929.680			

	アメリカ・ドル 小計	15,198,551.000	494,475,763.940 (50,673,876,289)	
投資証券	合計	15,198,551	50,673,876,289 (50,673,876,289)	
合計			50,673,876,289 (50,673,876,289)	

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 35銘柄	94.93%	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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
資産の部			
流動資産			
預金		717,585,869	569,712,608
コール・ローン		1,880,503,887	2,268,034,210
投資信託受益証券		47,261,160,169	43,148,228,045
投資証券		39,649,338,144	33,716,971,971
未収入金		20,958,707	38,920,645
未収配当金		1,067,110,235	1,222,150,326
流動資産合計		90,596,657,011	80,964,017,805
資産合計		90,596,657,011	80,964,017,805
負債の部			
流動負債			
未払解約金		500,000,000	-
流動負債合計		500,000,000	-
負債合計		500,000,000	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	54,397,733,331	44,772,217,199
剰余金			
剰余金又は欠損金()		35,698,923,680	36,191,800,606
元本等合計		90,096,657,011	80,964,017,805
純資産合計		90,096,657,011	80,964,017,805
負債純資産合計		90,596,657,011	80,964,017,805

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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	66,537,508,932円	54,397,733,331円
	同期中追加設定元本額	50,422,784円	17,455,533円
	同期中一部解約元本額	12,190,198,385円	9,642,971,665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	70,327,818円	56,221,232円
	D I A M世界6資産バランスファンド	264,970,548円	237,000,103円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	364,279,507円	347,707,668円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	6,840,541円	6,242,561円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	2,469,236円	2,132,252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）	50,308,817,026円	41,137,369,613円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	941,911,880円	812,673,811円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	1,508,706,134円	1,335,527,925円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	695,906,968円	620,482,925円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	94,914,048円	88,308,367円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	138,589,625円	128,550,742円
	計	54,397,733,331円	44,772,217,199円
2 .	受益権の総数	54,397,733,331口	44,772,217,199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25年2月9日 至 平成25年8月8日	自 平成25年8月9日 至 平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10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	1,867,744,613	368,909,916
投資証券	41,448,648	1,129,155,500
合計	1,909,193,261	1,498,065,416

(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24年12月11日から平成25年8月8日まで及び平成25年12月10日から平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
1口当たり純資産額	1.6563円	1.8084円
(1万口当たり純資産額)	(16,563円)	(18,084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26年2月10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	7,403,509.400		
		AUSTRALAND PROPERTY GROUP	3,338,857.000	12,687,656.600		
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	23,503,224.000	45,361,222.320		
		CHARTER HALL GROUP	5,908,131.000	22,509,979.110		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	11,547,169.000	41,223,393.330		
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	4,676,206.000	5,775,114.410		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	17,368,956.000	16,847,887.320		
		DEXUS PROPERTY GROUP	17,637,680.000	17,990,433.600		
		FEDERATION CENTRES	9,031,136.000	21,042,546.880		
		GOODMAN GROUP	679,426.000	3,247,656.280		
		GPT GROUP	2,822,156.000	10,159,761.600		
		INVESTA OFFICE FUND	15,480,205.000	47,214,625.250		
		MIRVAC GROUP	42,722,515.000	71,987,437.770		
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	10,362,271.000	15,595,217.850		
	STOCKLAND	2,240,956.000	8,201,898.960			
	WESTFIELD RETAIL TRUST	12,282,105.000	36,355,030.800			
	オーストラリア・ドル 小計			182,180,613.000	383,603,371.480 (35,191,773,300)	
	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	6,872,000.000	14,706,080.000	
			ASCOTT RESIDENCE TRUST	14,377,600.000	16,749,904.000	
			CACHE LOGISTICS TRUST	5,662,000.000	6,228,200.000	
FRASERS CENTREPOINT TRUST			7,330,000.000	12,314,400.000		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST			4,528,000.000	5,388,320.000		
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST			12,519,840.000	16,713,986.400		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST			19,701,320.000	19,898,333.200		
PARKWAY LIFE REIT			2,853,000.000	6,362,190.000		
シンガポール・ドル 小計			73,843,760.000	98,361,413.600 (7,956,454,745)		
投資信託受益証券	合計		256,024,373	43,148,228,045 (43,148,228,045)		

投資証券	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,778,892.000	11,882,998.560		
		HAMMERSON PLC	2,211,954.000	11,800,774.590		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	532,772.000	5,508,862.480		
		SEGRO PLC	1,925,876.000	6,763,676.510		
	イギリス・ポンド 小計			6,449,494.000	35,956,312.140 (6,047,132,576)	
	カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	950,022.000	31,189,222.260		
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,361,067.000	20,851,546.440		
		CALLOWAY REAL ESTATE INV TR	1,321,578.000	33,488,786.520		
		CHOICE PROPERTIES REIT	1,309,280.000	13,655,790.400		
		CROMBIE REAL ESTATE INV	992,261.000	13,137,535.640		
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	847,500.000	9,720,825.000		
		NORTHERN PROPERTY RE INV TR	414,973.000	12,150,409.440		
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	384,645.000	9,781,522.350		
	カナダ・ドル 小計			7,581,326.000	143,975,638.050 (13,359,499,454)	
	ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	26,401,917.000	25,477,849.900		
	ニュージーランド・ドル 小計			26,401,917.000	25,477,849.900 (2,162,050,343)	
	ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	827,220.000	8,065,395.000		
		BEFIMMO	76,567.000	3,897,260.300		
		COFINIMMO SA	57,159.000	4,857,371.820		
		CORIO NV	95,009.000	3,011,785.300		
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	476,927.000	14,994,584.880		
		GECINA SA	45,322.000	4,210,413.800		
		ICADE	96,588.000	6,486,850.080		
KLEPIERRE		285,420.000	9,249,035.100			
VASTNED RETAIL		124,533.000	4,477,584.010			
WAREHOUSES DE PAUW		216,085.000	11,236,420.000			
WERELDHAVE NV		281,550.000	16,535,431.500			
ユーロ 小計			2,582,380.000	87,022,131.790 (12,148,289,598)		
投資証券 合計			43,015,117	33,716,971,971 (33,716,971,971)		
合計				76,865,200,016 (76,865,200,016)		

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	-%	7.47%	7.87%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 16銘柄	43.47%	-%	45.78%
カナダ・ドル	投資証券 8銘柄	-%	16.50%	17.38%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 8銘柄	9.83%	-%	10.35%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	2.67%	2.81%
ユーロ	投資証券 11銘柄	-%	15.00%	15.80%

(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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
資産の部			
流動資産			
預金		81,798,260	150,356,157
コール・ローン		724,181,910	1,638,995,450
株式		42,286,173,636	42,824,655,737
派生商品評価勘定		-	68,250
未収入金		-	891,685,676
未収配当金		118,444,612	65,213,239
流動資産合計		43,210,598,418	45,570,974,509
資産合計		43,210,598,418	45,570,974,509
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	718,900
未払金		-	890,590,723
未払解約金		25,000,000	-
流動負債合計		25,000,000	891,309,623
負債合計		25,000,000	891,309,623
純資産の部			
元本等			
元本	1	24,952,682,029	22,846,747,219
剰余金			
剰余金又は欠損金()		18,232,916,389	21,832,917,667
元本等合計		43,185,598,418	44,679,664,886
純資産合計		43,185,598,418	44,679,664,886
負債純資産合計		43,210,598,418	45,570,974,509

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	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 . 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。
4 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	28,018,403,315円	24,952,682,029円
	同期中追加設定元本額	546,540,090円	1,672,054,986円
	同期中一部解約元本額	3,612,261,376円	3,777,989,796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）	18,033,559,397円	15,022,168,602円
	D I A M世界好配当株式ファンド（毎月決算型）	1,684,947,177円	3,342,084,877円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	109,725,917円	86,233,046円
	D I A M世界6資産バランスファンド	437,778,814円	354,365,700円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	647,018,259円	538,378,055円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	22,339,420円	28,221,353円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	8,247,020円	9,936,397円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	1,550,708,242円	1,229,880,910円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	1,117,404,437円	953,251,153円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	158,674,629円	136,488,578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）	1,182,278,717円	1,145,738,548円
	計	24,952,682,029円	22,846,747,219円
2 .	受益権の総数	24,952,682,029口	22,846,747,219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25年2月9日 至 平成25年8月8日	自 平成25年8月9日 至 平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10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。	(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 「(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。 (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。
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25年8月8日現在	平成26年2月10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	202,378,808	1,605,523,835
合計	202,378,808	1,605,523,835

(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25年5月28日から平成25年8月8日まで及び平成25年5月28日から平成26年2月10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25年8月8日 現在				平成26年2月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	666,123,250	-	666,055,000	68,250
アメリカ・ドル	-	-	-	-	666,123,250	-	666,055,000	68,250
買 建	-	-	-	-	650,178,900	-	649,460,000	718,900
カナダ・ドル	-	-	-	-	650,178,900	-	649,460,000	718,900
合計	-	-	-	-	1,316,302,150	-	1,315,515,000	650,650

（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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
1口当たり純資産額	1.7307円	1.9556円
（1万口当たり純資産額）	（17,307円）	（19,556円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年2月10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	ABBOTT LABORATORIES	55,486	37.180	2,062,969.480	
	AMEREN CORP	60,284	37.440	2,257,032.960	
	VERIZON COMM INC	79,545	46.810	3,723,501.450	
	BOEING CO	15,637	127.020	1,986,211.740	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	85,407	50.330	4,298,534.310	
	JPMORGAN CHASE & CO	39,148	56.620	2,216,559.760	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	41,861	45.730	1,914,303.530	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	636,282	4.540	2,888,720.280	
	CMS ENERGY CORP	82,266	27.230	2,240,103.180	
	RR DONNELLEY & SONS CO	107,229	17.430	1,869,001.470	
	DOW CHEMICAL	58,607	45.600	2,672,479.200	
	DTE ENERGY CO	32,934	67.890	2,235,889.260	
	DUKE ENERGY CORP	45,137	69.990	3,159,138.630	
	ATMOS ENERGY CORP	46,457	47.190	2,192,305.830	
	FORD MOTOR CO	131,671	14.970	1,971,114.870	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	48,926	45.320	2,217,326.320	
	GENERAL ELECTRIC CO	92,573	25.190	2,331,913.870	
	REYNOLDS AMERICAN INC	44,144	48.760	2,152,461.440	
	HOLLYFRONTIER CORP	44,756	44.970	2,012,677.320	
	CENTERPOINT ENERGY INC	93,159	23.330	2,173,399.470	
	INTEL CORP	82,449	24.210	1,996,090.290	
	JOHNSON & JOHNSON	70,471	90.040	6,345,208.840	
	KLA-TENCOR CORP	37,553	62.240	2,337,298.720	
	WESTAR ENERGY INC	93,480	33.080	3,092,318.400	
	KIMBERLY-CLARK CORP	20,574	106.900	2,199,360.600	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	37,231	65.010	2,420,387.310	
	ELI LILLY & CO	50,451	53.210	2,684,497.710	
	LOCKHEED MARTIN CORP	28,079	155.130	4,355,895.270	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	41,536	66.930	2,780,004.480	
	METLIFE INC	46,901	49.110	2,303,308.110	
	MERCK & CO. INC.	81,555	54.770	4,466,767.350	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	52,440	44.440	2,330,433.600	
NISOURCE INC	64,359	34.010	2,188,849.590		
WELLS FARGO & CO	48,001	45.370	2,177,805.370		
OLD REPUBLIC INTL CORP	129,520	15.050	1,949,276.000		

PPL CORPORATION	83,989	30.340	2,548,226.260		
PFIZER INC	254,726	31.220	7,952,545.720		
CONOCOPHILLIPS	43,507	64.970	2,826,649.790		
PITNEY BOWES INC	93,525	25.470	2,382,081.750		
ALTRIA GROUP INC	60,489	35.300	2,135,261.700		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,630	79.890	2,207,360.700		
PDL BIOPHARMA INC	328,099	8.390	2,752,750.610		
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	150,319	15.350	2,307,396.650		
AT&T INC	88,933	32.300	2,872,535.900		
REGAL ENTERTAINMENT GROUP-A	122,789	19.290	2,368,599.810		
WYNN RESORTS LTD	11,553	221.950	2,564,188.350		
WILLIAMS COS INC	60,977	41.420	2,525,667.340		
SEADRILL LTD	43,547	36.800	1,602,529.600		
AIRCATTLE LTD	122,947	18.810	2,312,633.070		
SPECTRA ENERGY CORP	59,008	36.790	2,170,904.320		
TIME WARNER CABLE INC	16,421	135.350	2,222,582.350		
MAIN STREET CAPITAL CORP	63,442	33.320	2,113,887.440		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	26,120	80.250	2,096,130.000		
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	73,538	33.990	2,499,556.620		
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	31,117	80.830	2,515,187.110		
SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP	63,048	35.460	2,235,682.080		
KAR AUCTION SERVICES INC	79,733	28.390	2,263,619.870		
TARGA RESOURCES CORP	34,243	92.940	3,182,544.420		
HOME LOAN SERVICING SOLUTIONS LTD	98,363	21.560	2,120,706.280		
ABBVIE INC	61,847	48.890	3,023,699.830		
NRG YIELD INC	66,095	36.560	2,416,433.200		
アメリカ・ドル 小計	4,892,114		160,422,506.780 (16,440,098,494)		
イギリス・ポンド	SEVERN TRENT PLC	96,027	17.630	1,692,956.010	
	BHP BILLITON PLC	159,289	18.050	2,875,166.450	
	BT GROUP PLC	523,634	3.920	2,052,645.280	
	AVIVA PLC	351,761	4.563	1,605,085.440	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	118,162	29.250	3,456,238.500	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	86,090	22.140	1,906,032.600	
	HSBC HOLDINGS PLC	794,076	6.278	4,985,209.120	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,100,802	2.212	2,434,974.020	
	UNILEVER PLC	84,816	23.630	2,004,202.080	

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	246,808	7.330	1,809,102.640	
	PRUDENTIAL PLC	324,086	12.760	4,135,337.360	
	RIO TINTO PLC	76,937	34.070	2,621,243.590	
	VODAFONE GROUP PLC	2,565,302	2.220	5,694,970.440	
	REED ELSEVIER PLC	292,869	8.870	2,597,748.030	
	BP PLC	429,758	4.817	2,070,144.280	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	231,062	16.125	3,725,874.750	
	WOLSELEY PLC	41,592	33.420	1,390,004.640	
	ASTRAZENECA PLC	69,307	38.600	2,675,250.200	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	226,670	22.230	5,038,874.100	
イギリス・ポンド	小計	7,819,048		54,771,059.530 (9,211,396,792)	
オーストラリア・ドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	77,030	29.450	2,268,533.500	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	75,871	31.250	2,370,968.750	
	TELSTRA CORP LTD	490,026	5.010	2,455,030.260	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	31,794	73.520	2,337,494.880	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	71,385	32.780	2,340,000.300	
オーストラリア・ドル	小計	746,106		11,772,027.690 (1,079,965,820)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	32,921	69.300	2,281,425.300	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,759	84.820	2,184,878.380	
	BCE INC	61,468	46.580	2,863,179.440	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	25,495	87.450	2,229,537.750	
	GREAT WEST LIFE CO INC	75,370	31.350	2,362,849.500	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	132,629	20.220	2,681,758.380	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	71,066	37.130	2,638,680.580	
	POWER FINANCIAL CORP	72,293	34.250	2,476,035.250	
	ROYAL BANK OF CANADA	33,390	70.100	2,340,639.000	
	WHITECAP RESOURCES INC	203,845	11.730	2,391,101.850	
	PEMBINA PIPELINE CORP	60,697	39.000	2,367,183.000	
	VERMILION ENERGY INC	40,230	60.800	2,445,984.000	
	DAVIS & HENDERSON CORP	86,041	29.230	2,514,978.430	
	PENGROWTH ENERGY CORP	327,015	7.350	2,403,560.250	
	INTER PIPELINE LTD	84,533	28.410	2,401,582.530	
カナダ・ドル	小計	1,332,752		36,583,373.640 (3,394,571,240)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	116,375	67.600	7,866,950.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	24,340	254.000	6,182,360.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	104,726	72.200	7,561,217.200	
	SWISSCOM AG-REG	7,070	501.000	3,542,070.000	

スイス・フラン 小計		252,511		25,152,597.200 (2,867,647,607)	
スウェーデン・ クローナ	SVENSKA HANDELSBANKEN- A SHS	67,699	317.600	21,501,202.400	
スウェーデン・クローナ 小計		67,699		21,501,202.400 (339,288,974)	
ユーロ	AXA	176,668	19.405	3,428,242.540	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	33,022	81.800	2,701,199.600	
	BNP PARIBAS	68,226	59.510	4,060,129.260	
	IMERYS SA	20,509	61.820	1,267,866.380	
	DEUTSCHE POST AG-REG	87,100	25.550	2,225,405.000	
	COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	55,958	40.360	2,258,464.880	
	VINCI S.A.	78,821	51.060	4,024,600.260	
	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	101,042	13.700	1,384,275.400	
	TOTAL SA	119,329	43.175	5,152,029.570	
	SIEMENS AG-REG	38,930	93.400	3,636,062.000	
	DAIMLER AG	31,732	63.540	2,016,251.280	
	BASF SE	43,361	78.820	3,417,714.020	
	ORANGE	208,665	9.155	1,910,328.070	
	SAMPO OYJ-A SHS	51,145	35.570	1,819,227.650	
	ALLIANZ SE	40,427	126.100	5,097,844.700	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	54,010	34.070	1,840,120.700	
	SANOFI	79,896	70.730	5,651,044.080	
	ENEL SPA	623,423	3.564	2,221,879.570	
	DEUTSCHE TELEKOM AG- REG	341,692	11.755	4,016,589.460	
	SNAM SPA	434,897	4.084	1,776,119.340	
FERROVIAL SA	154,977	14.390	2,230,119.030		
GDF SUEZ	86,022	16.985	1,461,083.670		
GTECH SPA	56,692	22.920	1,299,380.640		
REXEL SA	80,609	19.330	1,558,171.970		
ユーロ 小計		3,067,153		66,454,149.070 (9,276,999,210)	
香港・ドル	SJM HOLDINGS LTD	654,000	24.850	16,251,900.000	
香港・ドル 小計		654,000		16,251,900.000 (214,687,600)	
合計		18,831,383		42,824,655,737 (42,824,655,737)	

(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 61銘柄	36.80%	38.39%
イギリス・ポンド	株式 19銘柄	20.62%	21.51%
オーストラリア・ドル	株式 5銘柄	2.42%	2.52%
カナダ・ドル	株式 15銘柄	7.60%	7.93%
スイス・フラン	株式 4銘柄	6.42%	6.70%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	0.76%	0.79%
ユーロ	株式 24銘柄	20.76%	21.66%
香港・ドル	株式 1銘柄	0.48%	0.50%

(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。

「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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
資産の部			
流動資産			
預金		39,646,400	12,118,698
コール・ローン		61,550,254	123,648,029
国債証券		17,393,353,526	17,195,794,310
特殊債券		772,204,029	602,953,443
未収利息		247,880,139	245,938,781
前払費用		9,728,809	17,039,964
流動資産合計		18,524,363,157	18,197,493,225
資産合計		18,524,363,157	18,197,493,225
負債の部			
流動負債			
未払解約金		14,000,000	10,000,000
流動負債合計		14,000,000	10,000,000
負債合計		14,000,000	10,000,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	15,233,341,274	14,082,497,792
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,277,021,883	4,104,995,433
元本等合計		18,510,363,157	18,187,493,225
純資産合計		18,510,363,157	18,187,493,225
負債純資産合計		18,524,363,157	18,197,493,225

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	国債証券及び特殊債券 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。
2 . 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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,352,819,391円	15,233,341,274円
	同期中追加設定元本額	926,570円	77,285,726円
	同期中一部解約元本額	1,120,404,687円	1,228,129,208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）	2,499,198,982円	1,990,491,475円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	552,120,616円	470,693,898円
	D I A Mバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	500,629,050円	421,346,307円
	D I A M世界6資産バランスファンド	625,275,848円	551,946,791円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	2,241,022,063円	1,990,736,811円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	30,950,793円	14,423,598円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	11,637,421円	4,952,529円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	223,311,582円	206,087,741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）	8,549,194,919円	8,431,818,642円
	計	15,233,341,274円	14,082,497,792円
2 .	受益権の総数	15,233,341,274口	14,082,497,792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25年2月9日 至 平成25年8月8日	自 平成25年8月9日 至 平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10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	410,492,985	526,352,669
特殊債券	3,874,126	13,057,905
合計	414,367,111	539,410,574

(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25年5月9日から平成25年8月8日まで及び平成25年5月9日から平成26年2月10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25年8月8日現在	平成26年2月10日現在
1口当たり純資産額	1.2151円	1.2915円
(1万口当たり純資産額)	(12,151円)	(12,915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26年2月10日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	9,900,000.000	10,726,155.000	
		AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	950,000.000	1,031,918.500	
	オーストラリア・ドル	小計	10,850,000.000 (995,379,000)	11,758,073.500 (1,078,685,663)	
	カナダ・ドル	CANADA 4.25 06/01/18	12,050,000.000	13,440,570.000	
	カナダ・ドル	小計	12,050,000.000 (1,118,119,500)	13,440,570.000 (1,247,150,490)	
	スウェーデン・クローナ	SWEDEN 4.25 03/12/19	90,900,000.000	102,896,982.000	
	スウェーデン・クローナ	小計	90,900,000.000 (1,434,402,000)	102,896,982.000 (1,623,714,376)	
	タイ・バーツ	THAILAND 3.25 06/16/17	574,300,000.000	581,317,946.000	
	タイ・バーツ	小計	574,300,000.000 (1,791,816,000)	581,317,946.000 (1,813,711,992)	
	ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17	22,100,000.000	23,755,732.000	
	ニュージーランド・ドル	小計	22,100,000.000 (1,875,406,000)	23,755,732.000 (2,015,911,418)	
	ノルウェー・クローネ	NORWAY 4.25 05/19/17	20,000,000.000	21,640,000.000	
		NORWAY 4.5 05/22/19	14,000,000.000	15,674,400.000	
		NORWAY 5.0 05/15/15	58,300,000.000	60,923,500.000	
	ノルウェー・クローネ	小計	92,300,000.000 (1,531,257,000)	98,237,900.000 (1,629,766,761)	
	ポーランド・ズロチ	POLAND 5.25 10/25/17	17,800,000.000	18,811,040.000	
		POLAND 5.5 10/25/19	32,000,000.000	34,433,600.000	
	ポーランド・ズロチ	小計	49,800,000.000 (1,664,814,000)	53,244,640.000 (1,779,968,315)	
	マレーシア・リンギット	MALAYSIA 4.262 09/15/16	60,000,000.000	61,429,800.000	
	マレーシア・リンギット	小計	60,000,000.000 (1,848,600,000)	61,429,800.000 (1,892,652,138)	
	メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 6.0 06/18/15	11,000,000.000	11,345,290.000	
		MEXICAN BONDS 7.25 12/15/16	60,000,000.000	64,802,400.000	
		MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	121,800,000.000	134,374,632.000	
		MEXICAN BONDS 8.0 12/17/15	61,000,000.000	65,471,300.000	
		MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	40,000,000.000	45,621,600.000	
	メキシコ・ペソ	小計	293,800,000.000	321,615,222.000	

			(2,268,136,000)	(2,482,869,514)	
	ユーロ	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	2,200,000.000	2,498,804.000	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,100,000.000	9,187,182.000	
	ユーロ 小計		10,300,000.000 (1,437,880,000)	11,685,986.000 (1,631,363,646)	
国債証券 合計			15,965,809,500 (15,965,809,500)	17,195,794,310 (17,195,794,310)	
特殊債券	オーストラリア・ドル	NEW S WALES 5.5 03/01/17	1,600,000.000	1,706,704.000	
		NEW S WALES 5.5 08/01/14	4,800,000.000	4,865,712.000	
	オーストラリア・ドル 小計		6,400,000.000 (587,136,000)	6,572,416.000 (602,953,444)	
特殊債券 合計			587,136,000 (587,136,000)	602,953,443 (602,953,443)	
合計			16,552,945,500 (16,552,945,500)	17,798,747,753 (17,798,747,753)	

- (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
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄	5.93%	9.45%
	特殊債券 2銘柄	3.32%	
カナダ・ドル	国債証券 1銘柄	6.86%	7.01%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	8.93%	9.12%
タイ・バーツ	国債証券 1銘柄	9.97%	10.19%
ニュージーランド・ドル	国債証券 1銘柄	11.08%	11.33%
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	8.96%	9.16%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	9.79%	10.00%
マレーシア・リングギット	国債証券 1銘柄	10.41%	10.63%
メキシコ・ペソ	国債証券 5銘柄	13.65%	13.95%
ユーロ	国債証券 2銘柄	8.97%	9.17%

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年2月28日現在

資産総額	829,805,140円
負債総額	562,363円
純資産総額（ - ）	829,242,777円
発行済数量	1,109,805,954口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7472円

（参考）

D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	54,481,451,321円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	54,481,451,321円
発行済数量	27,443,396,405口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9852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26年2月28日現在

資産総額	82,317,619,348円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	82,317,619,348円
発行済数量	44,320,699,511口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8573円

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	47,847,211,480円
負債総額	1,340,291,035円
純資産総額（ - ）	46,506,920,445円
発行済数量	22,892,838,451口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0315円

高金利ソブリン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産総額	18,219,505,346円
負債総額	7,000,000円
純資産総額（ - ）	18,212,505,346円
発行済数量	14,026,254,477口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2985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」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<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。

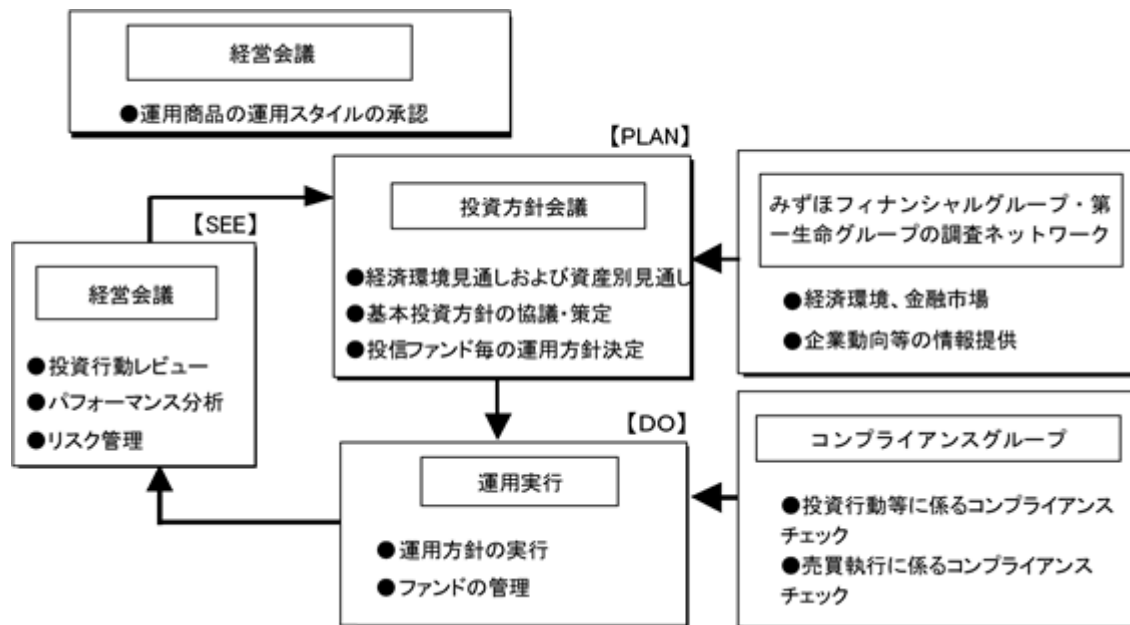
投資運用の意思決定機構

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26年2月28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・訂正されます。

<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26年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は315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	8	21,903,771,605
追加型株式投資信託	297	4,966,954,572,956
単位型公社債投資信託	9	89,877,531,429
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	102,533,373
合計	315	5,078,838,409,363

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」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<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28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25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29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,520,748	10,806,745
金銭の信託	6,548,577	10,214,440
前払費用	25,744	69,143
未収委託者報酬	2,780,527	3,073,481
未収運用受託報酬	1,167,998	1,173,744
未収投資助言報酬	2 241,851	2 245,819
未収収益	212,226	244,974
繰延税金資産	344,793	426,229
その他	22,264	25,354
流動資産計	23,864,733	26,279,933
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 167,433	1 142,820
車両運搬具	1 4,752	1 2,770
器具備品	1 188,367	1 231,732
建設仮勘定	109,529	1,207
無形固定資産		
商標権	1 383	1 289
ソフトウェア	1 1,101,685	1 1,261,335
ソフトウェア仮勘定	152,513	68,920
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 371	1 292
投資その他の資産		
投資有価証券	3,982,258	4,002,042
関係会社株式	450,882	400,579
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	590,822	661,777
長期差入保証金	731,197	731,564
その他	90,282	89,047
固定資産計	5,714,444	5,718,557
資産合計	29,579,177	31,998,491

（単位：千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	132,805	571,153
未払金	1,460,128	1,547,527
未払収益分配金	670	48
未払償還金	86,391	84,932
未払手数料	1,088,348	1,195,452
その他未払金	284,718	267,093
未払費用	2 1,105,512	2 1,306,837
未払法人税等	1,195,056	1,299,068
未払消費税等	92,354	116,872
賞与引当金	574,646	724,974
その他	-	100,000
流動負債計	4,560,503	5,666,434
固定負債		
退職給付引当金	680,768	802,603
役員退職慰労引当金	56,690	98,510
固定負債計	737,458	901,113
負債合計	5,297,962	6,567,548
（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	19,716,594	20,898,697
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	15,630,000	16,330,000
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	3,463,300	3,945,403
株主資本計	24,145,072	25,327,175
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	136,143	103,768
評価・換算差額等計	136,143	103,768
純資産合計	24,281,215	25,430,943
負債・純資産合計	29,579,177	31,998,491

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)		第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	23,208,602		23,374,427	
運用受託報酬	4,966,992		5,374,163	
投資助言報酬	943,057		885,923	
その他営業収益	697,063		715,164	
営業収益計		29,815,715		30,349,678
営業費用				
支払手数料	10,154,958		10,846,568	
広告宣伝費	164,286		177,553	
公告費	-		3,769	
調査費	4,590,302		4,546,312	
調査費	2,888,013		3,001,788	
委託調査費	1,702,289		1,544,523	
委託計算費	335,754		341,978	
営業雑経費	496,565		456,677	
通信費	26,941		25,513	
印刷費	399,066		374,775	
協会費	25,014		25,492	
諸会費	41		42	
支払販売手数料	45,500		30,854	
営業費用計		15,741,867		16,372,860
一般管理費				
給料	4,630,102		4,870,759	
役員報酬	245,224		242,014	
給料・手当	3,824,122		4,035,751	
賞与	560,755		592,994	
交際費	35,987		36,212	
寄付金	3,156		2,693	
旅費交通費	213,642		187,653	
租税公課	84,346		95,064	
不動産賃借料	656,463		675,811	
退職給付費用	164,627		173,065	
固定資産減価償却費	475,556		524,750	
福利厚生費	24,887		26,642	
修繕費	6,721		6,018	
賞与引当金繰入	574,646		724,974	
役員退職慰労引当金繰入	30,048		47,820	
役員退職金	27,503		7,200	
機器リース料	1,510		35	
事務委託費	323,740		224,066	
消耗品費	58,739		60,044	
器具備品費	2,889		2,065	
諸経費	114,695		159,247	

一般管理費計		7,429,267		7,824,126
営業利益		6,644,580		6,152,691

（単位：千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）		第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	
	営業外収益			
受取配当金	61,720		10,223	
受取利息	3,921		3,554	
時効成立分配金	11,383		2,080	
為替差益	1,660		-	
金銭の信託運用益	-		168,444	
雑収入	5,992		4,957	
営業外収益計		84,678		189,260
営業外費用				
為替差損	-		6,549	
時効成立後支払分配金	36		-	
金銭の信託運用損	417,812		-	
雑損失	1,152		-	
営業外費用計		419,001		6,549
経常利益		6,310,257		6,335,402
特別利益				
ゴルフ会員権売却益	1,959		-	
特別利益計		1,959		-
特別損失				
固定資産除却損	1 36,415		1 1,752	
固定資産売却損	381		115	
関係会社株式評価損	338,244		-	
特別損失計		375,042		1,868
税引前当期純利益		5,937,173		6,333,533
法人税、住民税及び事業税		2,582,251		2,573,893
法人税等調整額		56,997		134,463
法人税等合計		2,525,253		2,439,430
当期純利益		3,411,920		3,894,102

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第27期	第28期
	(自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	13,430,000	15,630,000
当期変動額	2,200,000	700,000
当期末残高	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
当期首残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	4,459,380	3,463,300
当期変動額		
剰余金の配当	2,208,000	2,712,000
別途積立金の積立	2,200,000	700,000
当期純利益	3,411,920	3,894,102
当期末残高	3,463,300	3,945,403
利益剰余金合計		
当期首残高	18,512,674	19,716,594
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	19,716,594	20,898,697
株主資本合計		
当期首残高	22,941,152	24,145,072
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	24,145,072	25,327,175

評価・換算差額等	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高	216,534	136,143
	当期変動額(純額)	80,390	32,375
	当期末残高	136,143	103,768
純資産合計			
	当期首残高	23,157,686	24,281,215
	当期変動額	1,123,529	1,149,727
	当期末残高	24,281,215	25,430,943

重要な会計方針

項目	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社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：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 定率法によっております。 (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。 (会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。
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	(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。 (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。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期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。 (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。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25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）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 平成24年5月17日）

（1）概要

財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。

（2）適用予定日

平成25年4月1日以後に開始する事業年度の期末から適用予定であります。ただし、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

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27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
建物	513,080	539,393
車両運搬具	171	2,152
器具備品	462,449	565,794
商標権	2,555	649
ソフトウェア	961,584	1,071,133
電話施設利用権	1,225	1,304

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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	238,121	241,190
流動負債	未払費用	292,536	334,888

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
建物	1,892	-
器具備品	18,917	-
ソフトウェア	15,606	1,752

(株主資本等変動計算書関係)

第27期(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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23年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2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25年6月28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25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

(リース取引関係)

1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額
該当事項はありません。

未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
支払リース料	588	-
減価償却費相当額	543	-
支払利息相当額	1	-

減価償却費相当額の算定方法

該当事項はありません。

利息相当額の算定方法

該当事項はありません。

2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

（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であります。

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、株価指数先物取引およ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およ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27期（平成24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	12,520,748	12,520,748	-
(2) 金銭の信託	6,548,577	6,548,577	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	370,636	370,636	-
資産計	19,439,962	19,439,962	-
(1) 未払法人税等	1,195,056	1,195,056	-
負債計	1,195,056	1,195,056	-

第28期（平成25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	10,806,745	10,806,745	-
(2) 金銭の信託	10,214,440	10,214,440	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	320,332	320,332	-
資産計	21,341,518	21,341,518	-
(1) 未払法人税等	1,299,068	1,299,068	-
負債計	1,299,068	1,299,068	-

(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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25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	2,119,074
長期差入保証金	731,197	731,564

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、記載しておりません。

長期差入保証金は、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、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27期(平成24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	12,520,524	-	-	-
合計	12,520,524	-	-	-

第28期(平成25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	10,806,412	-	-	-
合計	10,806,412	-	-	-

(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27期及び第28期の貸借対照表計上額2,119,074千円)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27期（平成24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	359,540	146,101	213,438
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,482	3,000	482
小計	363,022	149,101	213,920
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）	7,614	10,000	2,386
小計	7,614	10,000	2,386
合計	370,636	159,101	211,534

（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28期（平成25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	307,639	146,101	161,537
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
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）	8,688	10,000	1,312
小計	8,688	10,000	1,312
合計	320,332	159,101	161,231

（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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第27期（平成24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	6,548,577	495,939

第28期（平成25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	10,214,440	946,377

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. 退職給付債務に関する事項

(千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(1) 退職給付債務	740,560	936,125
(2) 未認識数理計算上の差異	59,792	133,522
退職給付引当金	680,768	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
(1) 勤務費用	102,728	102,125
(2) 利息費用	9,549	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	13,388	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	38,960	41,923
(5) その他	-	314
退職給付費用	164,627	173,065

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1.5%	1.5%

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

5年（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する方法）

（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27期	第28期
	(平成24年3月31日現在)	(平成25年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	87,682	107,022
未払事業所税	5,792	5,986
賞与引当金	218,423	275,562
未払法定福利費	24,791	34,566
未払確定拠出年金掛金	2,607	3,091
減価償却超過額（一括償却資産）	5,496	5,192
減価償却超過額	150,369	159,737
繰延資産償却超過額（税法上）	47,261	27,873
退職給付引当金	243,845	286,796
役員退職慰労引当金	20,204	35,109
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	4,410	22,907
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	678	109
繰延税金資産合計	935,615	1,088,007
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
差引繰延税金資産の純額	935,615	1,088,007

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。

（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せん。

2．関連情報

第27期（自平成23年4月1日 至平成24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	23,208,602	5,910,049	697,063	29,815,715

（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28期（自平成24年4月1日 至平成25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	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（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27期（自平成23年4月1日 至平成24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	687,972	未収投資 助言報酬	177,282

第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	710,289	未収投資 助言報酬	203,114

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27期（自平成23年4月1日 至平成24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	523,845	未払 費用	158,645
	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	203,092	未払 費用	75,484

第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	520,967	未払 費用	175,664
	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	214,290	未払 費用	89,815

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。

(3)兄弟会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24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	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 預金の引出 (純額) 受取利息	1,548,354 91,135 104	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	122,786 433,779 -
	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 預金の預入 (純額) 受取利息	450,766 392,267 3,654	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	83,446 11,440,025 -
	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 業務委託料 の支払	237,031 15,140	未払 費用 未払 費用	127,757 6,373
	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) 信託報酬の 支払	1,000,000 5,087	金銭の 信託	6,548,577

第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	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 預金の預入 (純額) 受取利息	1,661,638 191,782 106	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	142,323 625,561 -
	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 預金の引出 (純額) 受取利息	460,605 1,912,442 3,210	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	100,875 9,527,582 61
	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 業務委託料 の支払	259,435 11,140	未払 費用 未払 費用	132,250 5,848
	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) 信託報酬の 支払	3,500,000 5,908	金銭の 信託	10,214,440

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) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

(注4) 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5) 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6) 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27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,011,717円32銭	1,059,622円64銭
1株当たり当期純利益金額	142,163円33銭	162,254円29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、新株引受権付社債及び転換社債を発行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27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(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29期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,422,331
金銭の信託		9,988,674
前払費用		81,570
未収委託者報酬		3,539,476
未収運用受託報酬		1,927,231
未収投資助言報酬		233,557
未収収益		265,944
繰延税金資産		365,930
その他		77,287
	流動資産計	25,902,003
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	131,728
車両運搬具	1	2,193
器具備品	1	192,157
建設仮勘定		6,839
無形固定資産		
商標権	1	242
ソフトウェア	1	1,141,508
ソフトウェア仮勘定		292,572
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	258
投資その他の資産		
投資有価証券		409,446
関係会社株式		2,119,074
繰延税金資産		675,426
差入保証金		731,197
その他		87,266
	固定資産計	5,797,060
資産合計		31,699,064

（単位：千円）

	第29期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	915,630
未払金	1,777,659
未払収益分配金	48
未払償還金	51,109
未払手数料	1,403,573
その他未払金	322,928
未払費用	1,320,067
未払法人税等	1,362,916
未払消費税等	149,912
賞与引当金	592,328
	流動負債計
	6,118,515
固定負債	
退職給付引当金	870,468
役員退職慰労引当金	121,100
	固定負債計
	991,568
負債合計	7,110,084
（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	20,051,026
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	19,927,733
別途積立金	17,130,000
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	2,297,733
	株主資本計
	24,479,504
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	109,475
	評価・換算差額等計
	109,475
純資産合計	24,588,979
負債・純資産合計	31,699,064

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,617,519	
運用受託報酬	3,032,543	
投資助言報酬	455,315	
その他営業収益	409,599	
	営業収益計	16,514,977
営業費用		
支払手数料	5,584,176	
広告宣伝費	113,543	
調査費	2,650,938	
調査費	1,833,878	
委託調査費	817,060	
委託計算費	178,138	
営業雑経費	239,279	
通信費	16,255	
印刷費	206,531	
協会費	12,524	
諸会費	15	
支払販売手数料	3,952	
	営業費用計	8,766,076
一般管理費		
給料	2,201,917	
役員報酬	125,877	
給料・手当	2,076,040	
交際費	17,522	
寄付金	2,515	
旅費交通費	97,277	
租税公課	53,858	
不動産賃借料	341,829	
退職給付費用	110,074	
固定資産減価償却費	1 279,285	
福利厚生費	11,941	
修繕費	5,939	
賞与引当金繰入額	592,328	
役員退職慰労引当金繰入額	26,388	
役員退職慰労金	528	
機器リース料	23	
事務委託費	105,422	
事務用消耗品費	32,711	
器具備品費	2,550	
諸経費	56,566	
	一般管理費計	3,938,680
営業利益		3,810,221

（単位：千円）

	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日至平成25年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,371	
受取利息	1,297	
時効成立分配金・償還金	33,823	
雑収入	3,864	
		営業外収益計 45,357
営業外費用		
為替差損	5,352	
金銭の信託運用損	205,313	
		営業外費用計 210,666
経常利益		3,644,913
特別損失		
固定資産除却損	22	
固定資産売却損	1,448	
		特別損失計 1,470
税引前中間純利益		3,643,442
法人税、住民税及び事業税		1,351,622
法人税等調整額		43,490
法人税等合計		1,395,112
中間純利益		2,248,329

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	当期首残高	16,330,000
	当中間期変動額	800,000
	当中間期末残高	17,130,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	3,945,403
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	3,096,000
	別途積立金の積立	800,000
	中間純利益	2,248,329
	当中間期末残高	2,297,733
	利益剰余金合計	
	当期首残高	20,898,697
	当中間期変動額	847,670
	当中間期末残高	20,051,026
	株主資本合計	
	当期首残高	25,327,175
	当中間期変動額	847,670
	当中間期末残高	24,479,504
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	103,768
	当中間期変動額（純額）	5,706
	当中間期末残高	109,475
純資産合計		
	当期首残高	25,430,943
	当中間期変動額	841,963
	当中間期末残高	24,588,979

重要な会計方針

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25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、数理計算上の差異及び過去勤務債務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 過去勤務債務：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。

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
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。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第29期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)
1. 固定資産の減価償却累計額	建物 ... 550,694千円
	車両運搬具 ... 2,730千円
	器具備品 ... 610,752千円
	商標権 ... 696千円
	ソフトウェア ... 1,285,419千円
	電信電話専用施設利用権 ... 1,338千円

(中間損益計算書関係)

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
1. 減価償却実施額	有形固定資産 ... 64,676千円
	無形固定資産 ... 214,609千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25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

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成25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	9,422,331	9,422,331	-
(2) 金銭の信託	9,988,674	9,988,674	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	329,200	329,200	-
資産計	19,740,206	19,740,206	-
(1) 未払法人税等	1,362,916	1,362,916	-
負債計	1,362,916	1,362,916	-

(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	2,119,074
差入保証金	731,197

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、記載しておりません。

差入保証金は、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、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。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成25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2,119,074千円）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	315,920	146,101	169,818
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,263	3,000	1,263
小計	320,184	149,101	171,082
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）	9,016	10,000	984
小計	9,016	10,000	984
合計	329,200	159,101	170,098

（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29期中間会計期間末（平成25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29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25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	12,617,519	3,487,859	409,599	16,514,977

（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29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

1株当たり純資産額	1,024,540円	82銭
1株当たり中間純利益金額	93,680円	39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29期中間会計期間 （自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
中間純利益	2,248,329千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,248,329千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1 名称、資本金の額及び事業の内容」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成25年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでおります。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 [*] (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社七十七銀行(1)	24,658	日本において銀行業務を営んでおります。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

* 平成25年3月末日現在

(注1)平成22年2月26日以前における既契約者による定時定額購入（積立）によるお申込みを除き、平成22年3月1日以降は募集の取扱い及び販売業務を行いません。

(3)投資顧問会社

a. 名称

デービス・セレクトド・アドバイザーズ

b. 資本金の額

平成25年12月末日現在 658,664,756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。

(4)投資顧問会社

a. 名称

コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント

b. 資本金の額

平成25年12月末日現在 6,000千豪ドル

c. 事業の内容

豪州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 International Ltd

b. 資本金の額

平成25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。

(6) 投資顧問会社

a. 名称

DIAM U.S.A., Inc.

b. 資本金の額

平成25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。

独立監査人の監査報告書

平成26年3月19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

あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 渉 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）の平成25年8月9日から平成26年2月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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インカム3資産ファンド（毎月決算型）の平成26年2月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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25年6月6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	浅野 功 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘 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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28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25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、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体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25年12月6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	浅野 功 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘 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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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25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25年4月1日から平成25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、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。