

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年11月7日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託 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）
【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。

## 第一部【証券情報】

### （１）【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）

また、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。（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。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」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

#### <基準価額の照会方法等>

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されま

す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：インカムパス）

**( 5 ) 【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。

「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。

**( 6 ) 【申込単位】**

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「累積投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「累積投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

**( 7 ) 【申込期間】**

継続申込期間：平成26年11月8日から平成27年11月10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。

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

**( 9 ) 【払込期日】**

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

**（ 1 1 ） 【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

**（ 1 2 ） 【その他】**

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドでは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資コース」があり、「累積投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「累積投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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、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。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

## 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

### （参考）

#### 投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

## 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】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、各マザーファンド<sup>\*</sup>への投資を通じ、実質的に外国債券、外国株式、外国不動産投資信託証券の3資産へ分散投資を行い、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

\* 高金利ソブリン・マザーファンド、DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド、DIAM US・リート・オープン・マザーファンド、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）「不動産投資信託証券」（以下「リート（REIT）」という場合があります。）とは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資者から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入などが投資者に分配される商品をいいます。

当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

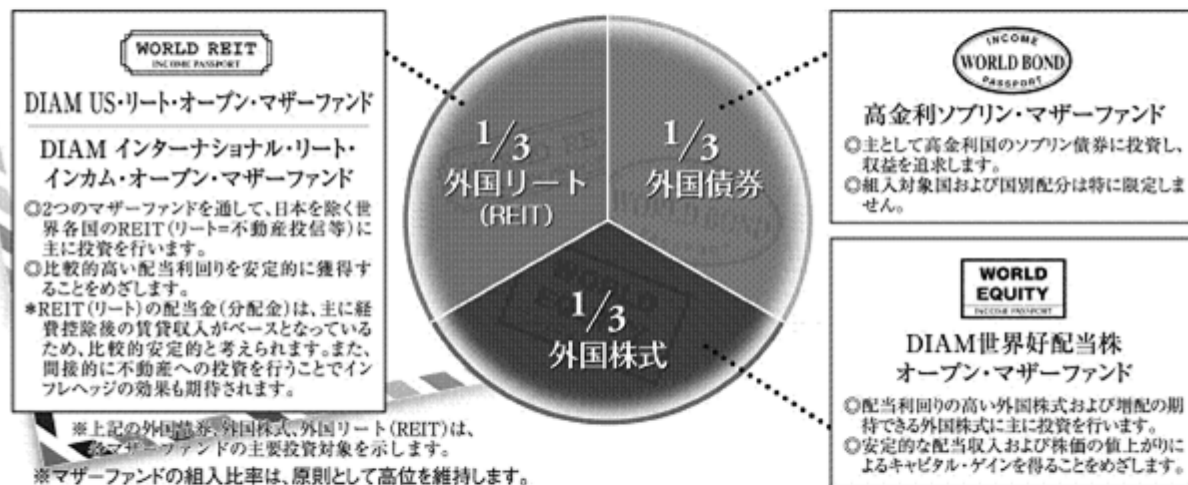
## &lt; ファンドの特色 &gt;

# 1 相対的に金利の高い外国債券(ソブリン債券<sup>\*1</sup>)、好配当の外国株式、外国リート(REIT)<sup>\*2</sup>に分散投資します。

- ◎3つの資産への投資は、各マザーファンドを通じて行います。
- ◎各マザーファンドの配分比率は、3分の1ずつを基本とします。  
ただし、「DIAM US・リート・オープン・マザーファンド」、「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」については、合算して3分の1とします。
- ◎各マザーファンドの時価の変動などにより、時価構成比が変化した場合には、定期的に基本配分比率に修正します。
- ◎実質組入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。

\*1 ソブリン債券とは、各国政府や政府機関が発行する債券の総称で、自国通貨建て、外貨建てがあります。また、世界銀行やアジア開発銀行など国際機関が発行する債券もこれに含まれます。

\*2 外国リート(REIT)とは、外国不動産投資信託証券を指します。



# 2 毎月決算を行い、原則として利子配当等収益を中心に分配を行うことをめざします。

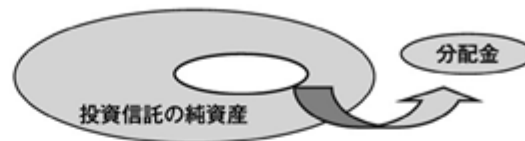
- ◎毎月8日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として利子配当等収益を中心に分配を行います。
- ◎毎年3月、6月、9月、12月の決算時には、原則として利子配当等収益に売買益(評価益を含みます。)等を加えた額から分配を行います。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 投資信託の収益分配金に関するご説明

投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が支払われるイメージ



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

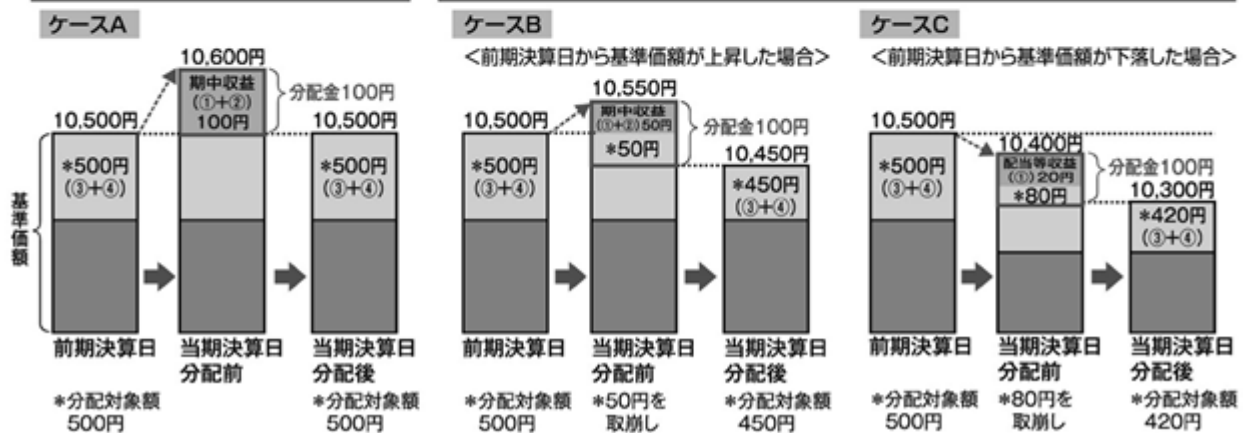
### 分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上記のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA: 分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円 = 100円

ケースB: 分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円 = 50円

ケースC: 分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円 = ▲100円

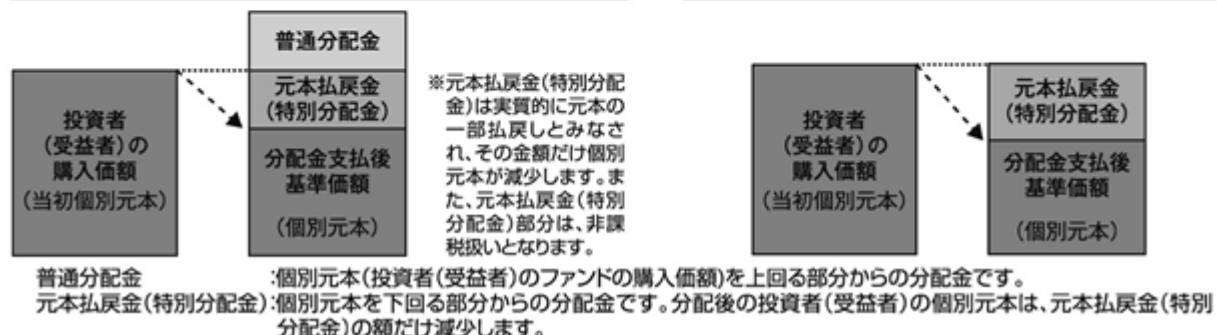
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりの方が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合





## 商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ( ) 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

## 単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

## 投資対象地域

「海外」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 投資対象資産

「資産複合」とは目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回	グローバル (日本を除く)  日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年4回  年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	あり ( )
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券、不動産投信) 資産配分固定型))	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)  エマージング	ファンド・ オブ・ファンズ	なし
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

## 投資対象資産

「その他資産（投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分固定型)）」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

(注) 商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分固定型)）に分類されます。

## 決算頻度

「年12回(毎月)」とは目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。

#### 投資対象地域

「グローバル(日本を除く)」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

#### 投資形態

「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。

#### 為替ヘッジ

「なし」とは目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

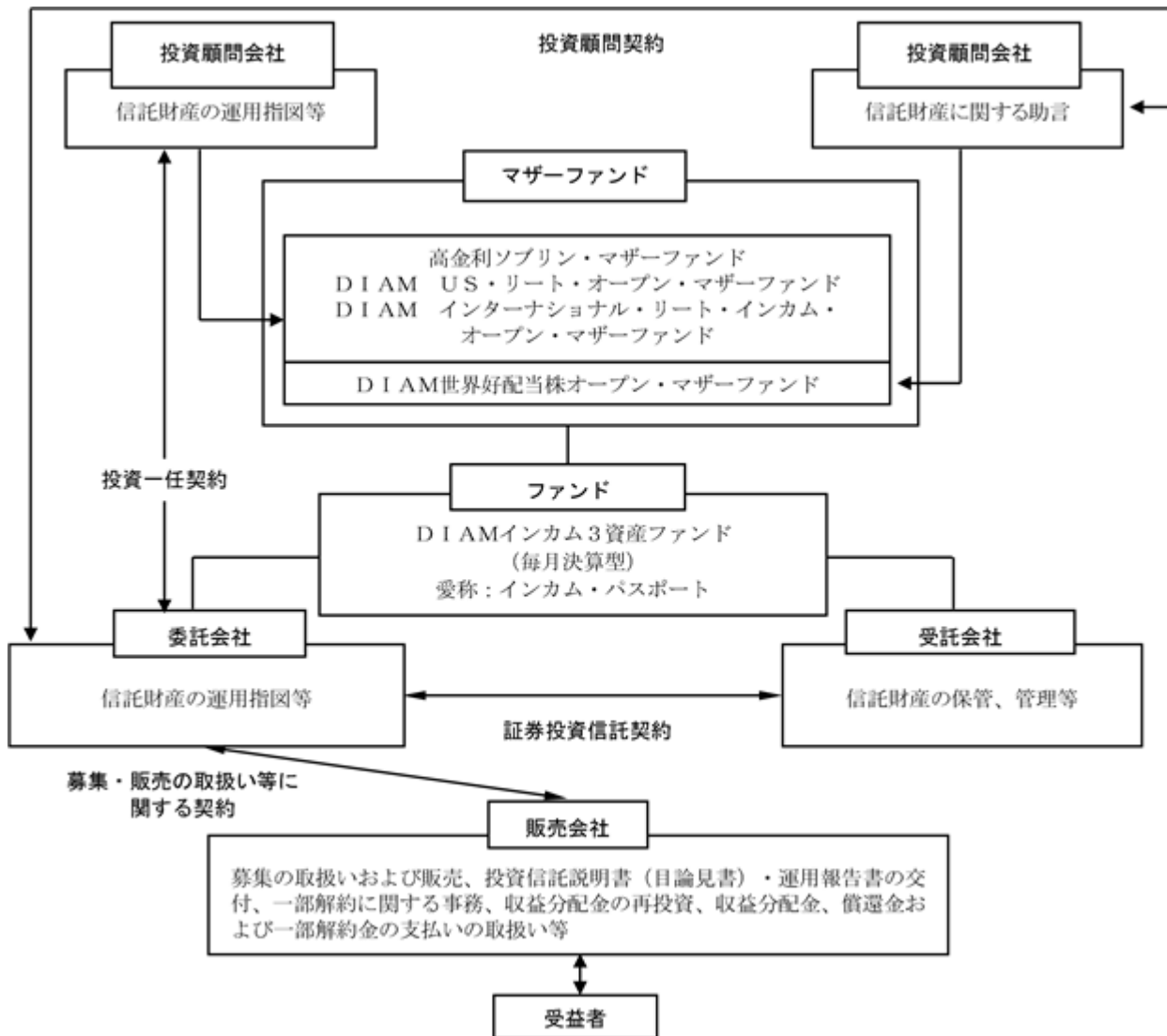
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

## (2)【ファンドの沿革】

平成19年8月20日 信託契約締結、当初設定日、ファンドの運用開始

## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

当ファンドの信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

販売会社

当ファンドの募集の取扱いおよび販売を行い、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

## 投資顧問会社

### デービス・セレクトド・アドバイザーズ

委託会社との投資一任契約に基づき、D I A M U S・リート・オープン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

### コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント

委託会社との投資一任契約に基づき、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

### DIAM International Ltd

委託会社との投資一任契約に基づき、高金利ソブリン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

委託会社との投資顧問契約に基づき、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの信託財産の運用助言を行います。

### DIAM U.S.A., Inc.

委託会社との投資顧問契約に基づき、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの信託財産の運用助言を行います。

## ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

## ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

## ・「投資一任契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（デービス・セレクトド・アドバイザーズ）との間においては、D I A M U S・リート・オープン・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。

委託会社と投資顧問会社（コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント）との間においては、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。

委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）との間においては、高金利ソブリン・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものであります。

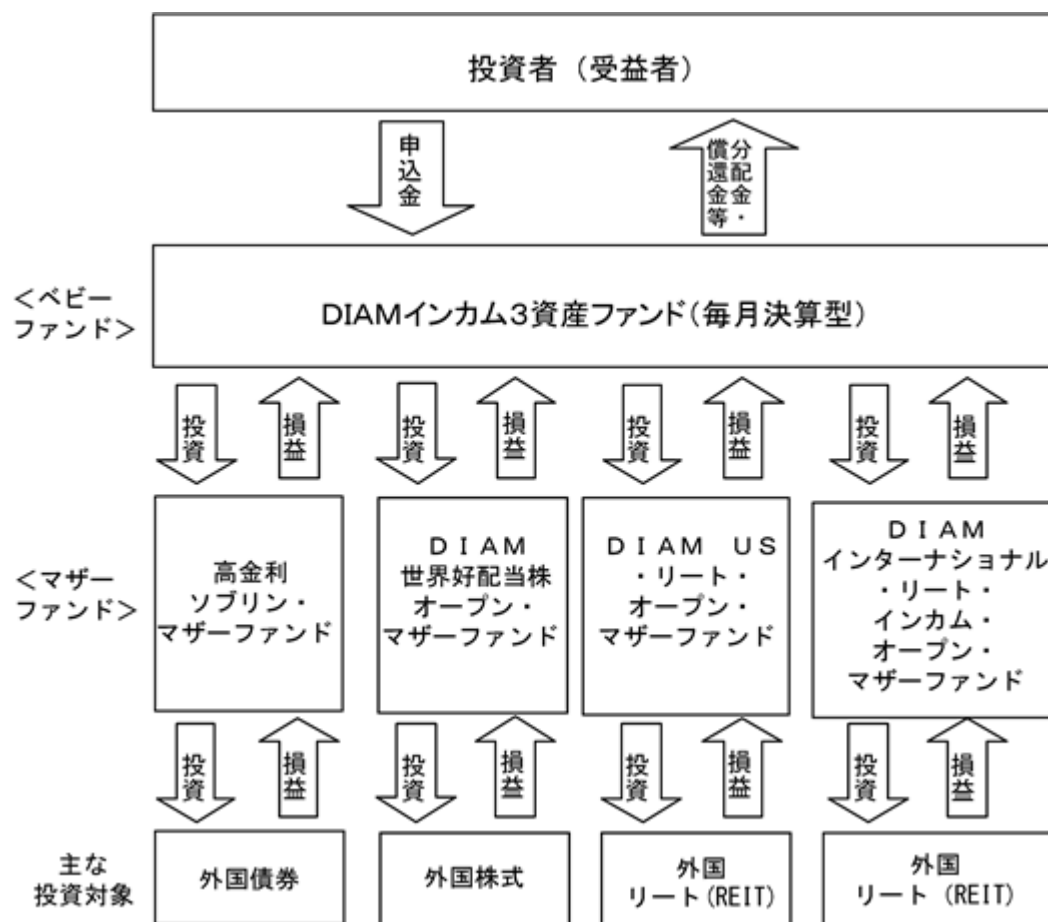
## ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（DIAM U.S.A., Inc.およびDIAM International Ltd）との間においては、DIAM世界好配当株オープン・マザーファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものであります。

### ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



### 委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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

#### (1) 資本金の額

20億円（平成26年8月29日現在）

#### (2) 委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日	会社設立
平成10年 3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブルユ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年 1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

### (3)大株主の状況

（平成26年8月29日現在）

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

#### <投資対象>

高金利ソブリン・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、D I A M US・リート・オープン・マザーファンド受益証券および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を主要投資対象とします。

#### <投資態度>

各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に外国債券、外国株式、外国不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。以下同じ。）および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の3資産へ分散投資を行います。

マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。

各資産への投資は、原則として3分の1を基本資産配分比率とし、各マザーファンド受益証券を通じて行います。ただし、外国不動産投資信託証券への投資については、D I A M US・リート・オープン・マザーファンド受益証券および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の純資産総額を合算して資産配分を算出します。なお、時価変動等により各マザーファンド受益証券の時価構成比率が基本資産配分比率から乖離した場合は、原則として定期的に基本資産配分比率に近づけるものとします。

実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

### 不動産投資信託証券( R E I T )とは

- ・不動産投資信託証券( R E I T )とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。(以下同じ。)
- ・R E I T (リート)とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場する不動産投資信託証券については、LPT ( Listed Property Trust ) と呼ばれる場合があります。
- ・不動産投資信託証券( R E I T )は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くの不動産投資信託証券( R E I T )は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、不動産投資信託証券( R E I T )は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどを不動産投資信託証券( R E I T )に投資する投資家が、配当金(もしくは分配金)として享受する仕組みになっています。
- ・R E I T (リート)の配当金(分配金)は、主に経費控除後の賃貸収入がベースとなっているため、比較的安定的と考えられます。また、間接的に不動産への投資を行うことでインフレヘッジの効果も期待されます。

## ( 2 ) 【投資対象】

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。)

ハ.金銭債権

ニ.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 US・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書
- 2.国債証券
- 3.地方債証券
- 4.特別の法律により法人の発行する債券



5. 社債券(新株引受権証券と社債券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. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
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）

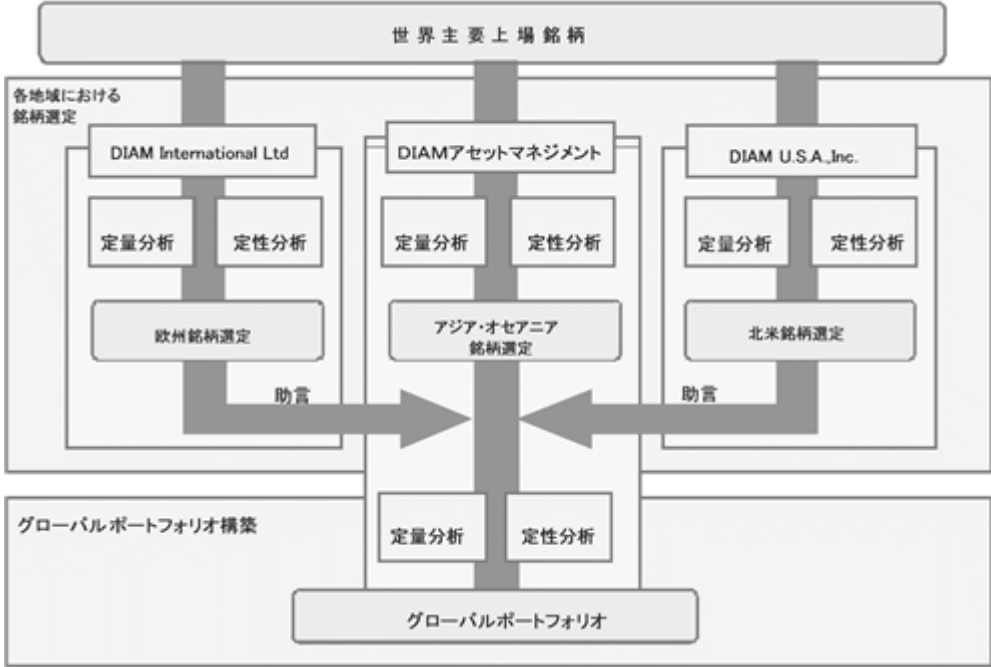
上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と定めるときは、委託会社は、信託金を、上記 1.から4.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(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&amp;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>

運用 プロセス	<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"> <li>・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）</li> <li>・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）</li> <li>・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。</li> </ul> <p>上記は、平成26年8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8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>

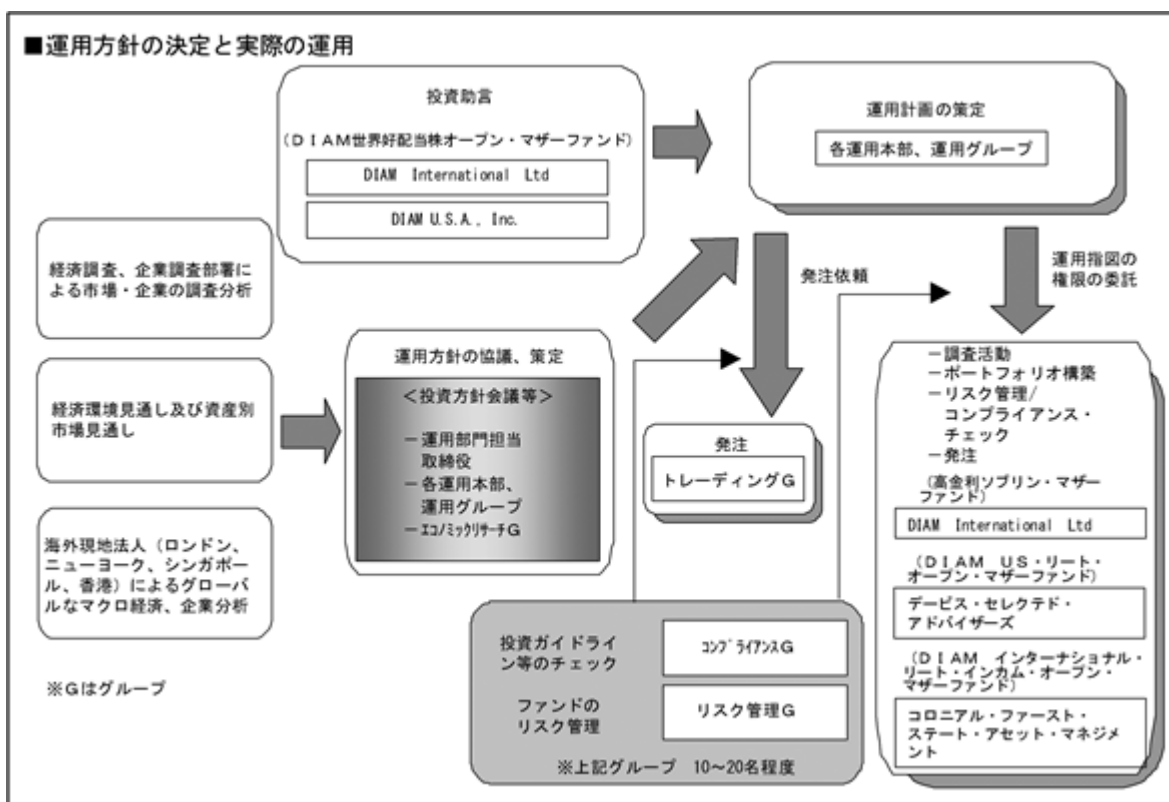
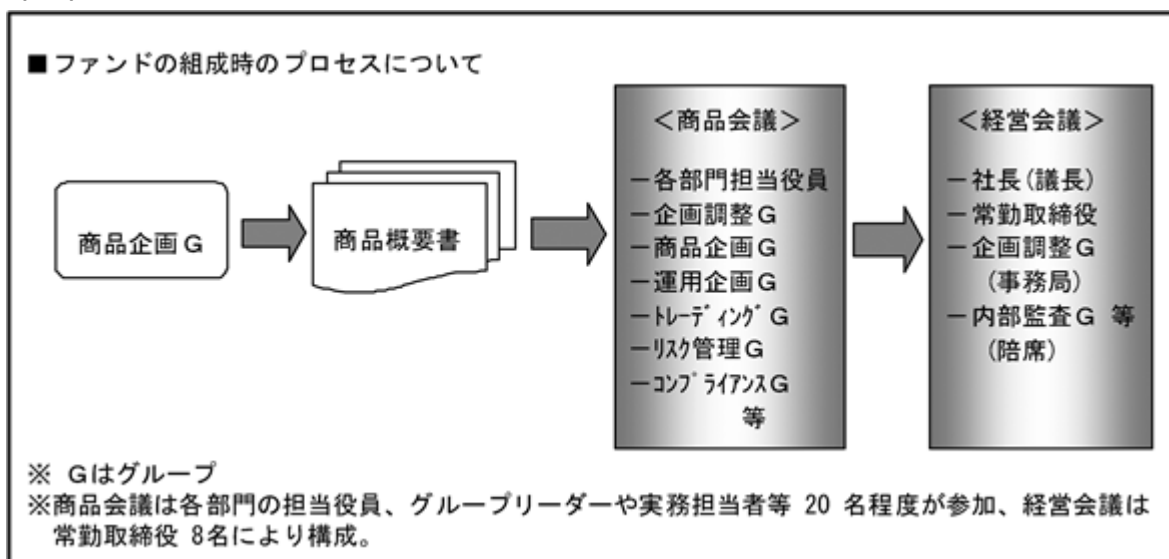
ファンド名	D I A M U S・リート・オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主な投資 対象	米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託および不動産投資法人をいいます。以下同じ。）の投資信託証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>運用指図に関する権限はデビス・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>デビス・セレクトド・アドバイザーズとは・・・</p> <p>Davis Selected Advisers, LP</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・1969年設立。創業者一族であるDavis家が出資する独立系運用会社。</li> <li>・運用受託資産は、約4兆1,481億円（約40,925百万米ドル、1米ドル=101.36円で換算）。そのうち、不動産関連証券投資は約817億円（2014年6月末現在）。</li> <li>・不動産関連証券投資では1994年からの実績。</li> <li>・運用スタイルは、個別銘柄選択による割安銘柄投資を特徴としています。</li> </ul> </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。 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"> <li>・オーストラリア・コモンウェルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。</li> <li>・運用受託資産は、約16兆3,948億円（約171,673百万豪ドル、1豪ドル=95.5円換算）と豪州を代表する資産運用会社の一つです。そのうち、不動産関連証券投資は約3,016億円（2014年6月末現在）。</li> <li>・不動産関連証券投資では1991年からの実績。</li> <li>・運用スタイルは、マクロ分析によるトップダウンと個別銘柄調査によるボトムアップ運用の融合を特徴としています。</li> </ul> </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。 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】



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"> <li>・DIAM International Ltdでは、資産クラス別運用体制ではなく、マルチプラットフォーム体制を採用しており、全ての運用担当者は3つまたは4つのプラットフォームに所属しております。</li> <li>・マクロ分析・市場分析・企業分析プラットフォームにおいては、株式や債券などの特定の資産クラスのみならず、幅広い資産クラスに関連する様々なレベルの分析が行われております。</li> </ul>
------	---



運用プロセス	<p>情報収集・分析</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> </ul> <p>運用方針・戦略の決定</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> </ul> <p>ポートフォリオの構築</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul> <p>運用モニタリング</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
--------	---

・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、システム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8月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎月8日。休業日の場合は翌営業日。）に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

分配対象額の範囲内で、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。原則として、利子配当等収益を中心に安定的に分配を行うことをめざし、売買益（評価益を含みます。）等については、決算時の基準価額水準を勘案して分配することとします。なお、原則として四半期毎（3月、6月、9月、12月）の決算時には、利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行うこととします。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

### 3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

## 収益の分配方式

1) 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
3. 上記1.および2.におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

## 収益分配金の支払い

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

「累積投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

## (5) 【投資制限】

マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。(約款「運用の基本方針」)

### (3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)

### 投資する株式等の範囲(約款第20条)

1)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずるものとして市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

### 信用取引の指図および範囲(約款第23条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

### 先物取引等の運用指図(約款第24条)

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

- 2) 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図（約款第25条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第26条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

#### 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.～2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1)1.～2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 特別の場合の外貨建資産への投資制限（約款第28条）

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

#### 外貨為替予約の指図および範囲（約款第29条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第36条）

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

2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合において、当該株式を投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図してはなりません。

デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令 第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き、為替変動等により影響を受けませんが、運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

#### 資産配分リスク

当ファンドで行われる各資産（外国債券、外国株式、外国リート（REIT））への資産配分は、委託会社が定める基本資産配分比率に基づくことを基本とし、一定量以上乖離した場合には、基本資産配分比率に近づけることとします。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となる場合があります。

#### 株価変動リスク

株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により、当ファンドの基準価額が下がる要因となる場合があります。

#### 金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券およびリート（REIT）の価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券およびリート（REIT）の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となる場合があります。

#### リート（REIT）の価格変動リスク

リート（REIT）の価格は、リート（REIT）が投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。当ファンドは、実質的にリート（REIT）に投資をします。これらの影響を受け、基準価額が上下します。

#### 為替リスク

当ファンドでは外貨建資産の為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、為替相場が円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。

#### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対する規制が変更となる場合または新たな規制が設けられた場合等には、運用上の制約を受ける可能性があり、当ファンドの基準価額が下がる要因となる場合があります。

#### 信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリート（REIT）が収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

#### 流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

< 分配金に関する留意点 >

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

#### <その他の留意点>

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

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

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、お申込みの受付または解約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または解約の受付を取り消すことができるものとします。

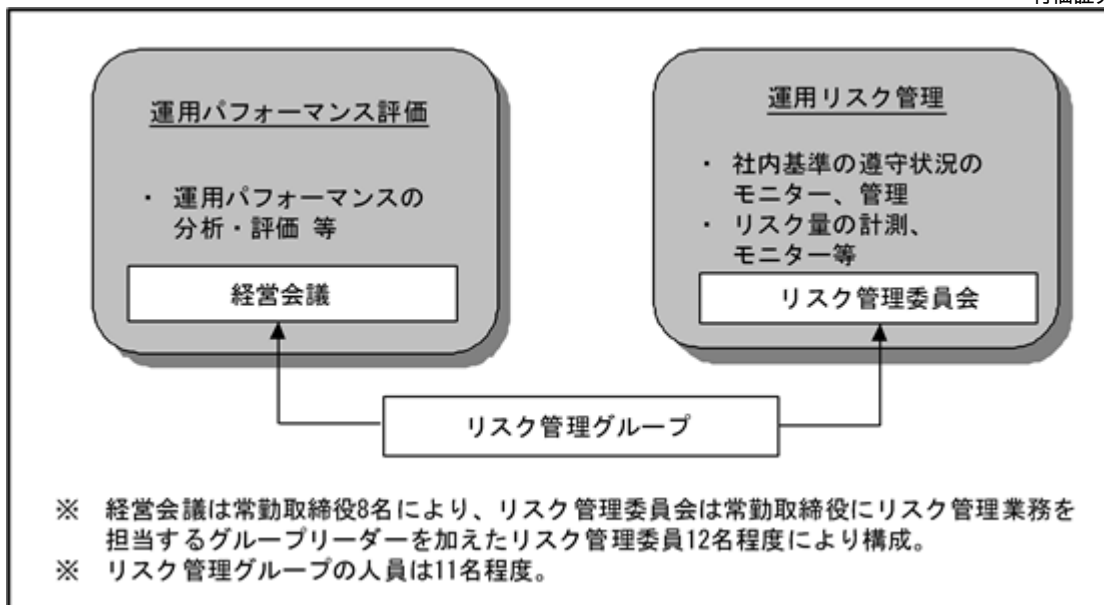
委託会社は、当ファンドの純資産総額が10億円を下回ることとなった場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

#### 注意事項

- ・当ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

#### <運用評価・運用リスク管理体制>

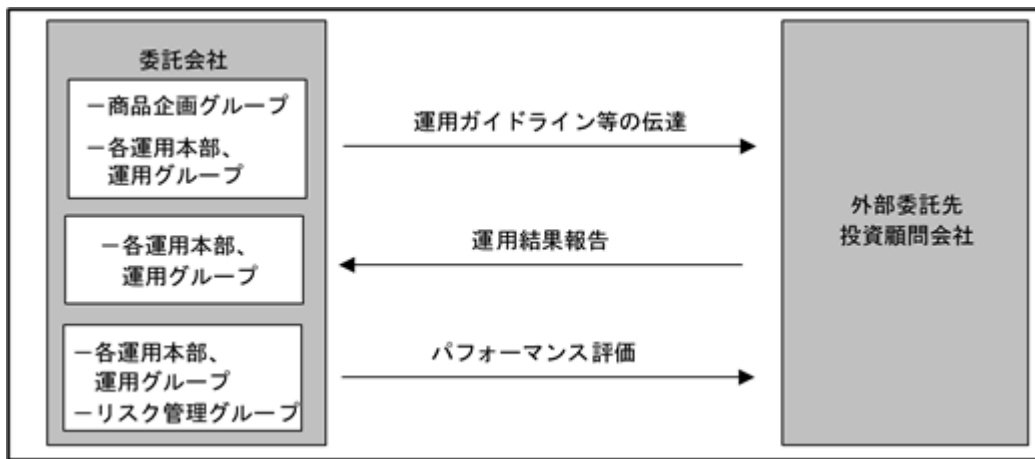




運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理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、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

## &lt; 外部委託先に関する管理体制 &gt;



マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用本部、運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

上記体制は平成26年8月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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。

「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。

## (2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

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%

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

委託会社の信託報酬には、各マザーファンドの投資顧問会社への報酬が含まれます。

・高金利ソブリン・マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、当ファンドの信託財産に属する当該マザーファンドの時価総額に対して年率0.29%とします。

- ・ D I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンドおよび D I A M インターナショナル ・ リート ・ インカム ・ オープン ・ マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、当ファンドの信託財産に属する上記それぞれのマザーファンドの時価総額に対して年率0.325%～0.50%とします。

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。

#### (4) 【その他の手数料等】

##### イ. 信託財産留保額

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

##### ロ. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

- ・ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・ 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、受益者の負担とし、毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用に係る消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。
- ・ 有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・ マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

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8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ついて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】

## (1)【投資状況】

平成26年8月29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	806,424,838	99.01
内 日本	806,424,838	99.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,067,054	0.99
純資産総額	814,491,892	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 U S・リート・オープン・マザーファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	49,388,522,617	91.64
内 アメリカ	49,388,522,617	91.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,504,224,748	8.36
純資産総額	53,892,747,365	100.00

その他資産の投資状況

平成26年8月29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）	518,650,000	0.96
-	518,650,000	0.96

(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8月29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	41,126,932,260	50.17
内 オーストラリア	31,969,994,709	39.00
内 シンガポール	9,156,937,551	11.17
投資証券	36,345,684,156	44.34
内 カナダ	13,424,516,844	16.38
内 イギリス	6,770,432,169	8.26
内 オランダ	6,319,619,984	7.71
内 ベルギー	3,061,007,508	3.73
内 フランス	3,029,180,884	3.70
内 ニュージーランド	2,593,782,410	3.16
内 ドイツ	1,147,144,357	1.40
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,495,313,341	5.48
純資産総額	81,967,929,757	100.00

## その他資産の投資状況

平成26年8月29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）	509,311,000	0.62
-	509,311,000	0.62

（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世界好配当株オープン・マザーファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	45,354,093,378	96.90
内 アメリカ	15,261,864,108	32.61
内 イギリス	6,890,049,792	14.72
内 カナダ	5,286,642,955	11.29
内 フランス	3,380,472,423	7.22
内 オーストラリア	3,165,017,279	6.76
内 スイス	2,745,427,213	5.87
内 ドイツ	2,217,985,330	4.74
内 香港	1,159,898,820	2.48
内 シンガポール	1,156,818,862	2.47
内 スペイン	1,012,886,904	2.16
内 イタリア	856,535,305	1.83
内 パミューダ	718,126,456	1.53
内 スウェーデン	473,277,985	1.01
内 オランダ	325,354,238	0.70
内 ジャージー	290,254,040	0.62
内 フィンランド	235,912,497	0.50
内 ノルウェー	177,569,171	0.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,451,442,922	3.10
純資産総額	46,805,536,300	100.00

## その他資産の投資状況

平成26年8月29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）	219,673,000	0.47
-	219,673,000	0.47

（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8月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	17,456,220,711	97.93
内 メキシコ	2,144,261,373	12.03
内 ニュージーランド	2,047,108,714	11.48
内 マレーシア	2,044,867,327	11.47
内 オーストラリア	1,873,945,726	10.51
内 アメリカ	1,709,922,974	9.59
内 ノルウェー	1,629,087,695	9.14
内 ポーランド	1,616,353,857	9.07
内 スウェーデン	1,574,744,273	8.83
内 タイ	1,540,941,496	8.64
内 カナダ	1,274,987,276	7.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	368,770,906	2.07
純資産総額	17,824,991,617	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8月29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	124,612,325	2.0551 256,103,250	2.1682 270,184,443	- -	33.17%
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	194,888,672	1.3288 258,968,068	1.3589 264,834,216	- -	32.52%
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	76,798,172	2.0323 156,084,604	2.1315 163,695,303	- -	20.10%
4	D I A M U S・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	48,205,727	2.1452 103,410,926	2.2344 107,710,876	- -	13.22%

(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8月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.01%
合計	99.01%

(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 U S・リート・オープン・マザーファンド

平成26年8月29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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	188,103	15,110.86 2,842,398,401	17,529.98 3,297,442,806	- -	6.12%
2	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	185,030	12,852.56 2,378,110,583	15,835.91 2,930,118,612	- -	5.44%
3	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	282,054	6,724.13 1,896,568,015	8,176.78 2,306,295,424	- -	4.28%
4	CORPORATE OFFICE PROPERTIES アメリカ	投資証券	785,670	2,359.87 1,854,082,342	2,913.01 2,288,671,794	- -	4.25%
5	ACADIA REALTY TRUST アメリカ	投資証券	740,920	2,758.47 2,043,812,860	2,985.63 2,212,118,314	- -	4.10%
6	POST PROPERTIES, INC アメリカ	投資証券	371,640	4,978.76 1,850,306,411	5,678.72 2,110,442,325	- -	3.92%
7	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	93,986	16,242.30 1,526,548,957	19,946.08 1,874,653,195	- -	3.48%

8	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	147,720	10,632.74 1,570,668,574	12,559.80 1,855,333,921	- -	3.44%
9	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	712,290	2,199.86 1,566,940,478	2,517.76 1,793,382,250	- -	3.33%
10	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES アメリカ	投資証券	390,854	3,468.16 1,355,548,095	4,099.80 1,602,425,105	- -	2.97%
11	CUBESMART アメリカ	投資証券	759,310	1,707.30 1,296,376,174	1,924.37 1,461,198,699	- -	2.71%
12	BIOMED REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	606,180	1,972.33 1,195,591,859	2,312.36 1,401,709,173	- -	2.60%
13	DCT INDUSTRIAL TRUST INC アメリカ	投資証券	1,661,750	758.78 1,260,910,558	822.65 1,367,052,263	- -	2.54%
14	LIBERTY PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	369,240	3,488.59 1,288,128,858	3,639.19 1,343,737,912	- -	2.49%
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	190,613	5,928.80 1,130,108,208	6,829.20 1,301,735,100	- -	2.42%
16	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	115,836	9,419.43 1,091,109,686	10,936.27 1,266,813,864	- -	2.35%
17	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC アメリカ	投資証券	432,430	2,397.99 1,036,964,672	2,909.90 1,258,331,084	- -	2.33%
18	EAST GROUP アメリカ	投資証券	178,050	6,221.13 1,107,672,578	6,696.41 1,192,297,046	- -	2.21%
19	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	504,040	1,919.30 967,407,037	2,346.59 1,182,779,659	- -	2.19%
20	EDUCATION REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,023,030	936.78 958,363,866	1,125.57 1,151,501,084	- -	2.14%
21	BRANDYWINE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	659,050	1,612.08 1,062,441,650	1,649.46 1,087,080,567	- -	2.02%
22	LASALLE HOTEL PROPERTIES アメリカ	投資証券	288,480	3,133.41 903,926,256	3,757.46 1,083,952,868	- -	2.01%
23	DIGITAL REALTY 7.0% アメリカ	投資証券	400,000	2,429.59 971,836,320	2,689.97 1,075,991,280	- -	2.00%
24	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証券	282,300	3,091.09 872,616,053	3,521.97 994,252,977	- -	1.84%
25	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	75,860	10,961.19 831,516,297	12,889.69 977,812,262	- -	1.81%
26	TERRENO REALTY CORP アメリカ	投資証券	442,553	1,858.14 822,327,322	2,082.06 921,422,695	- -	1.71%
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	186,180	3,757.42 699,557,238	4,711.87 877,256,105	- -	1.63%
28	KITE REALTY GROUP TRUST アメリカ	投資証券	327,082	2,664.22 871,419,615	2,680.64 876,789,615	- -	1.63%
29	CORESITE REALTY CORP アメリカ	投資証券	239,700	3,263.02 782,147,105	3,600.81 863,115,451	- -	1.60%
30	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券	84,088	8,165.45 686,616,939	10,247.43 861,686,499	- -	1.60%

(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8月29日現在

種類	投資比率
投資証券	91.64%
合計	91.64%

（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8月29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	29,603,085	157.18 4,653,267,486	178.05 5,270,830,763	- -	6.43%
2	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	23,503,224	188.23 4,424,204,579	210.55 4,948,723,679	- -	6.04%
3	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資信託 受益証券	10,615,791	356.10 3,780,284,236	386.17 4,099,599,798	- -	5.00%
4	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	11,274,972	276.36 3,116,023,355	330.87 3,730,575,918	- -	4.55%
5	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR カナダ	投資証券	1,321,578	2,350.99 3,107,021,023	2,555.42 3,377,196,764	- -	4.12%
6	ALLIED PROPERTIES REIT カナダ	投資証券	950,022	3,108.54 2,953,187,278	3,400.86 3,230,899,419	- -	3.94%
7	FEDERATION CENTRES オーストラリア	投資信託 受益証券	11,467,852	222.22 2,548,390,230	261.01 2,993,232,078	- -	3.65%
8	WERELDHAVE NV オランダ	投資証券	281,550	7,575.13 2,132,779,653	9,588.24 2,699,569,985	- -	3.29%
9	CHARTER HALL GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	5,908,131	344.45 2,035,094,125	439.54 2,596,894,757	- -	3.17%
10	GOODMAN PROPERTY TRUST ニュージーランド	投資証券	26,401,917	86.50 2,283,905,751	98.24 2,593,782,410	- -	3.16%
11	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV オランダ	投資証券	476,927	4,034.41 1,924,123,827	5,157.90 2,459,943,394	- -	3.00%
12	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	2,211,954	865.56 1,914,584,212	1,054.85 2,333,280,561	- -	2.85%
13	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	1,778,892	1,034.20 1,839,731,529	1,254.46 2,231,554,550	- -	2.72%
14	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,361,067	1,363.21 1,855,424,364	1,522.74 2,072,562,324	- -	2.53%
15	MAPLETREE LOGISTICS TRUST シンガポール	投資信託 受益証券	19,701,320	85.74 1,689,267,905	97.63 1,923,454,647	- -	2.35%
16	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	16,307,783	99.38 1,620,815,298	116.43 1,898,813,021	- -	2.32%
17	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA オーストラリア	投資信託 受益証券	10,362,271	148.45 1,538,340,267	179.02 1,855,057,380	- -	2.26%
18	CROMWELL PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	17,368,956	93.14 1,617,897,408	100.91 1,752,722,192	- -	2.14%

19	WAREHOUSES DE PAUW ベルギー	投資証券	216,085	7,197.67 1,555,310,423	7,793.95 1,684,156,204	- -	2.05%
20	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST シンガポール	投資信託 受益証券	12,519,840	108.65 1,360,365,663	119.23 1,492,792,480	- -	1.82%
21	ASCOTT RESIDENCE TRUST シンガポール	投資信託 受益証券	14,377,600	93.25 1,340,804,225	102.20 1,469,400,784	- -	1.79%
22	FRASERS CENTREPOINT TRUST シンガポール	投資信託 受益証券	8,667,000	148.72 1,288,980,319	165.34 1,433,080,649	- -	1.75%
23	KLEPIERRE フランス	投資証券	285,420	4,595.13 1,311,543,717	4,958.23 1,415,179,091	- -	1.73%
24	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST カナダ	投資証券	3,200,000	439.43 1,406,201,600	429.88 1,375,632,000	- -	1.68%
25	CROMBIE REAL ESTATE INV カナダ	投資証券	992,261	1,271.50 1,261,664,128	1,271.50 1,261,664,128	- -	1.54%
26	SEGRO PLC イギリス	投資証券	1,925,876	566.14 1,090,321,601	628.26 1,209,958,712	- -	1.48%
27	ASCENDAS REAL ESTATE INVT シンガポール	投資信託 受益証券	6,043,000	180.28 1,089,482,511	195.26 1,179,965,244	- -	1.44%
28	NORTHERN PROPERTY RE INV TR カナダ	投資証券	414,973	2,578.35 1,069,947,584	2,774.19 1,151,214,444	- -	1.40%
29	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券	827,220	1,143.45 945,885,008	1,386.74 1,147,144,357	- -	1.40%
30	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	532,772	1,618.41 862,244,814	1,868.78 995,638,346	- -	1.21%

(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8月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	50.17%
投資証券	44.34%
合計	94.52%

(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8月29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	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	29,946	30,431.19 911,292,475	30,283.79 906,878,614	- -	1.94%
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	198,007	4,209.97 833,604,148	4,375.99 866,477,523	- -	1.85%
3	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	104,921	7,936.59 832,716,008	7,998.95 839,258,777	- -	1.79%
4	SANOFI フランス	株式 医薬品	71,752	10,613.94 761,571,681	11,278.59 809,261,906	- -	1.73%
5	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	124,533	5,893.46 733,931,424	6,224.39 775,143,205	- -	1.66%
6	WESTPAC BANKING CORPORATION オーストラリア	株式 商業銀行	221,179	3,317.45 733,751,534	3,397.02 751,349,552	- -	1.61%
7	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CO LLC アメリカ	株式 運送インフラ	99,674	6,936.07 691,346,348	7,430.89 740,667,147	- -	1.58%
8	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	73,125	9,149.76 669,076,638	9,297.16 679,854,825	- -	1.45%
9	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 タバコ	106,245	6,049.47 642,726,195	6,074.42 645,377,177	- -	1.38%
10	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	252,265	2,800.60 706,493,862	2,517.53 635,084,806	- -	1.36%
11	TARGA RESOURCES CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	39,926	11,983.00 478,433,553	14,445.79 576,762,811	- -	1.23%
12	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	693,116	872.44 604,706,004	829.94 575,245,966	- -	1.23%
13	NATIONAL BANK OF CANADA カナダ	株式 商業銀行	115,578	4,741.37 547,998,639	4,966.60 574,030,238	- -	1.23%
14	ALLIANZ SE ドイツ	株式 保険	31,675	16,657.36 527,622,131	17,710.41 560,977,553	- -	1.20%
15	TOTAL SA フランス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	78,667	7,151.18 562,561,908	6,780.56 533,406,376	- -	1.14%
16	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	203,698	2,382.44 485,299,811	2,479.67 505,104,390	- -	1.08%
17	SIEMENS AG-REG ドイツ	株式 コングロマ リット	37,970	13,171.35 500,116,372	13,023.65 494,508,172	- -	1.06%
18	BANK OF MONTREAL カナダ	株式 商業銀行	59,975	7,404.49 444,084,476	7,929.94 475,598,469	- -	1.02%

19	CONOCOPHILLIPS アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	56,034	8,345.59 467,637,184	8,367.66 468,873,931	- -	1.00%
20	BHP BILLITON PLC イギリス	株式 金属・鉱業	144,009	3,351.25 482,611,312	3,254.03 468,610,009	- -	1.00%
21	LOCKHEED MARTIN CORP アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	25,716	17,253.24 443,684,522	18,061.13 464,460,121	- -	0.99%
22	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	337,000	1,063.78 358,497,198	1,276.45 430,164,324	- -	0.92%
23	AXA フランス	株式 保険	159,710	2,407.65 384,527,346	2,554.67 408,007,431	- -	0.87%
24	VINCI S.A. フランス	株式 建設・土木	60,107	7,365.89 442,741,766	6,732.69 404,682,086	- -	0.86%
25	REED ELSEVIER PLC イギリス	株式 メディア	230,218	1,604.64 369,418,392	1,709.61 393,584,100	- -	0.84%
26	RIO TINTO PLC イギリス	株式 金属・鉱業	69,976	5,605.50 392,250,887	5,522.04 386,410,774	- -	0.83%
27	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	35,422	10,475.66 371,069,012	10,680.03 378,308,128	- -	0.81%
28	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	538,690	604.10 325,427,897	700.24 377,214,979	- -	0.81%
29	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	73,555	5,160.02 379,545,830	5,125.79 377,027,733	- -	0.81%
30	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN フランス	株式 建設関連製品	69,392	5,752.80 399,198,949	5,274.83 366,031,225	- -	0.78%

(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8月29日現在

種類	投資比率
株式	96.90%
合計	96.90%

(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8月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
石油・ガス・消耗燃料	外国	17.25%
医薬品		11.61%
商業銀行		10.15%
各種電気通信サービス		7.61%
保険		6.03%
タバコ		5.13%
電力		4.48%
総合公益事業		3.96%
食品		3.14%
メディア		1.86%
金属・鉱業		1.83%
コングロマリット		1.74%
無線通信サービス		1.68%
化学		1.67%
建設・土木		1.62%
運送インフラ		1.58%
航空貨物・物流サービス		1.42%
ガス		1.30%
水道		1.15%
商社・流通業		1.11%
航空宇宙・防衛		0.99%
自動車		0.91%
家庭用品		0.86%
建設関連製品		0.78%
ソフトウェア		0.69%
半導体・半導体製造装置		0.69%
コンピュータ・周辺機器		0.58%
情報技術サービス		0.57%
バイオテクノロジー		0.56%
陸運・鉄道		0.54%
容器・包装		0.52%
商業サービス・用品		0.51%
不動産管理・開発		0.51%
通信機器		0.50%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.49%
エネルギー設備・サービス		0.49%
ホテル・レストラン・レジャー		0.41%
合計		96.90%

(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8月29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	1,921,374,000	106.96 2,055,159,271	106.54 2,047,108,714	6.000000 2017/12/15	11.48%
2	MALAYSIA 4.24 02/07/18 マレーシア	国債証券	2,003,240,000	102.39 2,051,157,500	102.07 2,044,867,327	4.240000 2018/2/7	11.47%
3	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,597,596,000	107.14 1,711,792,162	107.03 1,709,922,974	3.125000 2019/5/15	9.59%
4	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18 オーストラリア	国債証券	1,523,371,000	108.65 1,655,218,760	108.97 1,660,093,547	5.500000 2018/1/21	9.31%
5	SWEDEN 4.25 03/12/19 スウェーデン	国債証券	1,353,501,000	114.01 1,543,167,095	116.34 1,574,744,273	4.250000 2019/3/12	8.83%
6	THAILAND 3.25 06/16/17 タイ	国債証券	1,346,475,000	102.52 1,380,527,352	101.91 1,372,259,996	3.250000 2017/6/16	7.70%
7	CANADA 4.25 06/01/18 カナダ	国債証券	1,151,136,500	111.08 1,278,716,958	110.75 1,274,987,276	4.250000 2018/6/1	7.15%
8	NORWAY 5.0 05/15/15 ノルウェー	国債証券	978,857,000	103.51 1,013,312,766	102.51 1,003,524,196	5.000000 2015/5/15	5.63%
9	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18 メキシコ	国債証券	713,700,000	114.20 815,109,633	114.90 820,076,985	8.500000 2018/12/13	4.60%
10	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17 メキシコ	国債証券	634,400,000	110.25 699,426,000	111.03 704,425,072	7.750000 2017/12/14	3.95%
11	POLAND 5.5 10/25/19 ポーランド	国債証券	551,140,000	109.83 605,344,619	113.95 628,051,587	5.500000 2019/10/25	3.52%
12	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 メキシコ	国債証券	539,240,000	113.76 613,477,170	114.93 619,759,316	8.000000 2020/6/11	3.48%
13	POLAND 3.75 04/25/18 ポーランド	国債証券	580,318,000	102.44 594,483,594	104.64 607,273,771	3.750000 2018/4/25	3.41%
14	POLAND 5.25 10/25/17 ポーランド	国債証券	350,136,000	106.81 374,004,771	108.82 381,028,499	5.250000 2017/10/25	2.14%
15	NORWAY 4.25 05/19/17 ノルウェー	国債証券	335,800,000	107.44 360,783,520	107.39 360,615,620	4.250000 2017/5/19	2.02%
16	NORWAY 4.5 05/22/19 ノルウェー	国債証券	235,060,000	111.53 262,162,418	112.71 264,947,879	4.500000 2019/5/22	1.49%
17	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19 オーストラリア	国債証券	194,060,000	109.10 211,734,984	110.19 213,852,179	5.250000 2019/3/15	1.20%
18	THAILAND 3.875 06/13/19 タイ	国債証券	162,500,000	103.60 168,352,899	103.80 168,681,500	3.875000 2019/6/13	0.95%

(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8月29日現在

種類	投資比率
国債証券	97.93%
合計	97.93%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資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8月29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09月	売建	5,000,000	518,500,000	518,650,000	0.96%

（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

平成26年8月29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	-	カナダ・ドル売/円買 2014年09月	売建	3,200,000	305,600,000	305,632,000	0.37%
		オーストラリア・ドル 売/円買2014年0 9月	売建	2,100,000	203,700,000	203,679,000	0.25%

（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世界好配当株オープン・マザーファンド

平成26年8月29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	-	カナダ・ドル買/円売 2014年09月	買建	2,300,000	219,759,480	219,673,000	0.47%

(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8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
第14特定期間末 (平成26年8月8日)	787	790	0.7552	0.7582
平成25年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	-
3月末日	836	-	0.7558	-
4月末日	836	-	0.7663	-
5月末日	833	-	0.7680	-
6月末日	823	-	0.7734	-
7月末日	818	-	0.7779	-

8月末日	814	-	0.7853	-
------	-----	---	--------	---

## 【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
第14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
第14特定期間	5.8

(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
第14特定期間	23,023,495	93,647,183

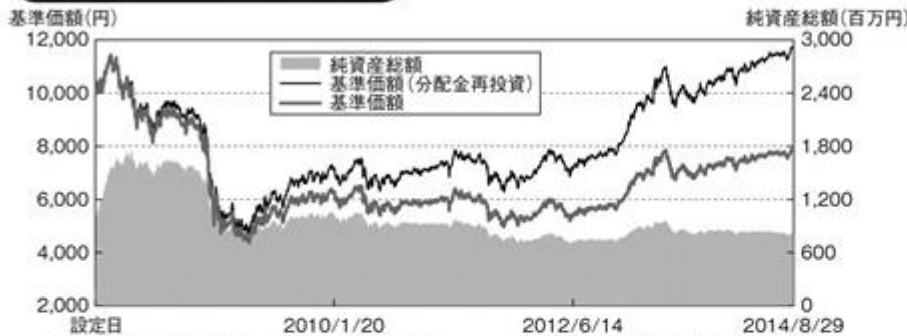
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2014年8月29日

## 基準価額・純資産の推移 《設定日(2007年8月20日)~2014年8月29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  
として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79期(2014.04.08)	30円
第80期(2014.05.08)	30円
第81期(2014.06.09)	30円
第82期(2014.07.08)	30円
第83期(2014.08.08)	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	2,580円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 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	33.17%
2	高金利ソブリン・マザーファンド	32.52%
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	20.10%
4	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	13.22%

## ■高金利ソブリン・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.93
内 メキシコ	12.03
内 ニュージーランド	11.48
内 マレーシア	11.47
内 オーストラリア	10.51
内 アメリカ	9.59
内 その他	42.85
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.07
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17	国債証券	ニュージーランド	6.000000	2017/12/15	11.48%
2	MALAYSIA 4.24 02/07/18	国債証券	マレーシア	4.240000	2018/2/7	11.47%
3	US T N/B 3.125 05/15/19	国債証券	アメリカ	3.125000	2019/5/15	9.59%
4	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	国債証券	オーストラリア	5.500000	2018/1/21	9.31%
5	SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	スウェーデン	4.250000	2019/3/12	8.83%
6	THAILAND 3.25 06/16/17	国債証券	タイ	3.250000	2017/6/16	7.70%
7	CANADA 4.25 06/01/18	国債証券	カナダ	4.250000	2018/6/1	7.15%
8	NORWAY 5.0 05/15/15	国債証券	ノルウェー	5.000000	2015/5/15	5.63%
9	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	国債証券	メキシコ	8.500000	2018/12/13	4.60%
10	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	国債証券	メキシコ	7.750000	2017/12/14	3.95%

## ■DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	96.90
内 アメリカ	32.61
内 イギリス	14.72
内 カナダ	11.29
内 フランス	7.22
内 オーストラリア	6.76
内 その他	24.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.10
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	業種	投資比率
1	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	医薬品	1.94%
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	イギリス	石油・ガス・消耗燃料	1.85%
3	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品	1.79%
4	SANOFI	フランス	医薬品	1.73%
5	MERCK & CO.INC.	アメリカ	医薬品	1.66%
6	WESTPAC BANKING CORPORATION	オーストラリア	商業銀行	1.61%
7	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CO LLC	アメリカ	運送インフラ	1.58%
8	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス	医薬品	1.45%
9	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	タバコ	1.38%
10	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	医薬品	1.36%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	石油・ガス・消耗燃料	17.25%
2	医薬品	11.61%
3	商業銀行	10.15%
4	各種電気通信サービス	7.61%
5	保険	6.03%

## 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)	0.47

○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8月29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	91.64
内 アメリカ	91.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8.36
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	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	6.12%
2	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	5.44%
3	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	4.28%
4	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	アメリカ	4.25%
5	ACADIA REALTY TRUST	アメリカ	4.10%
6	POST PROPERTIES, INC	アメリカ	3.92%
7	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	3.48%
8	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	3.44%
9	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	アメリカ	3.33%
10	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	アメリカ	2.97%

#### 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)	△0.96

### ■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	50.17
内 オーストラリア	39.00
内 シンガポール	11.17
投資証券	44.34
内 カナダ	16.38
内 イギリス	8.26
内 オランダ	7.71
内 ベルギー	3.73
内 フランス	3.70
内 その他	4.56
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5.48
純資産総額	100.00

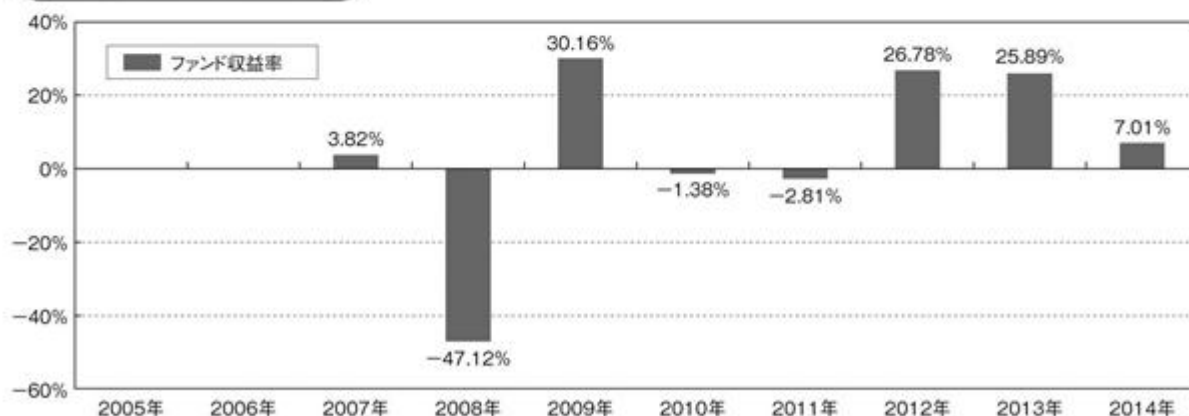
#### 組入上位10銘柄

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	6.43%
2	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	オーストラリア	6.04%
3	CHARTER HALL RETAIL REIT	オーストラリア	5.00%
4	SCENTRE GROUP	オーストラリア	4.55%
5	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	カナダ	4.12%
6	ALLIED PROPERTIES REIT	カナダ	3.94%
7	FEDERATION CENTRES	オーストラリア	3.65%
8	WERELDHAVE NV	オランダ	3.29%
9	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	3.17%
10	GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド	3.16%

#### 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)	△0.62

## 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。

○掲載データ等はい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】

#### ・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に、収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資コース」があり、「累積投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「累積投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）を行うことができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、「累積投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されま  
す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

### ・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「累積投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売  
会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「累積投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

### ・ 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  
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。

### ・ 払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うも  
のとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委  
託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部  
について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

### ・ 解約のお申込み方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、各販売会社の定める単位をもって解約  
の請求をすることができます。受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権を  
もって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解  
約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受  
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。なお、信託財  
産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

#### ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

解約価額 = 基準価額 - 信託財産留保額

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

#### ・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（「外貨建有価証券」といいます。））、預金、その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（２）【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は平成19年8月20日から無期限です。

ただし、下記(5)イ.の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎月9日から翌月8日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 上記d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は、上記d.の規定により、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a.からe.の規定に従い信託約款を変更します。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。
- h. 上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

#### ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

投資一任契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、各マザーファンド（高金利ソブリン・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)の信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの投資顧問契約について、委託会社とDIAMU.S.A., Inc.（投資顧問会社）との間の当該契約は、原則として期間満了の30日前までに当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。また、委託会社とDIAM International Ltd（投資顧問会社）との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、マザーファンドの信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

## 二. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <http://www.diam.co.jp/>)

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

## ホ. 運用報告書

委託会社は、毎年2月8日、8月8日（休業日の場合は翌営業日）および償還時に運用報告書（交付運用報告書を作成している場合は、交付運用報告書）を作成し、当該信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。

運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

(URL <http://www.diam.co.jp/>)

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金受領権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

なお、「累積投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金を販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### (2) 償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

### (3)一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

### (4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成26年2月11日から平成26年8月8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26年2月10日現在	当 期 平成26年8月8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	20,257,076	16,060,627
親投資信託受益証券	797,902,769	779,528,045
流動資産合計	818,159,845	795,588,672
資産合計	818,159,845	795,588,672
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,341,317	3,129,446
未払解約金	-	3,811,006
未払受託者報酬	47,197	44,773
未払委託者報酬	896,865	850,844
その他未払費用	5,587	5,299
流動負債合計	4,290,966	7,841,368
負債合計	4,290,966	7,841,368
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,113,772,419	1,104,314,731
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 299,903,540	2 255,401,427
（分配準備積立金）	33,897,793	27,775,668
元本等合計	813,868,879	787,747,304
純資産合計	813,868,879	787,747,304
負債純資産合計	818,159,845	795,588,672

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	前 期 自 平成25年8月9日 至 平成26年2月10日	当 期 自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8日
営業収益		
受取利息	3,022	3,418
有価証券売買等損益	72,444,344	52,625,276
営業収益合計	72,447,366	52,628,694
営業費用		
受託者報酬	267,517	261,299
委託者報酬	2 5,083,651	2 4,965,653
その他費用	31,682	30,939
営業費用合計	5,382,850	5,257,891
営業利益又は営業損失（ ）	67,064,516	47,370,803
経常利益又は経常損失（ ）	67,064,516	47,370,803
当期純利益又は当期純損失（ ）	67,064,516	47,370,803
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（ ）	118,972	121,808
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	364,735,289	299,903,540
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,073,932	21,988,837
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,073,932	21,988,837
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,474,489	5,492,301
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,474,489	5,492,301
分配金	1 20,713,238	1 19,487,034
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	299,903,540	255,401,427

## ( 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、前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26年2月10日現在	当 期 平成26年8月8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	1,181,240,064円 20,079,763円 87,547,408円	1,113,772,419円 23,023,495円 93,647,183円
2 . 受益権の総数	1,113,772,419口	1,043,148,731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299,903,540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255,401,427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8月9日 至 平成26年2月10日	当 期 自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8日
1 . 1 分配金の計算過程	( 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26年2月11日 至平成26年3月10日 ) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,928,209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(37,437,479円)及び分配準備積立金(33,637,879円)より分配対象収益は74,003,567円(1万口当たり667.98円)であり、うち3,323,592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。

（自平成26年3月11日 至平成26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（2,208,761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（37,564,286円）及び分配準備積立金（33,066,686円）より分配対象収益は72,839,733円（1万口当たり658円）であり、うち3,320,984円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

（自平成26年4月9日 至平成26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（3,033,532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（37,060,745円）及び分配準備積立金（31,462,802円）より分配対象収益は71,557,079円（1万口当たり655.81円）であり、うち3,273,380円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

（自平成26年5月9日 至平成26年6月9日）

計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,199,949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（36,943,134円）及び分配準備積立金（30,779,251円）より分配対象収益は70,922,334円（1万口当たり655.46円）であり、うち3,246,077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>	<p>（自平成26年6月10日 至平成26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（3,544,093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（36,526,807円）及び分配準備積立金（30,061,576円）より分配対象収益は70,132,476円（1万口当たり658.82円）であり、うち3,193,555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7月9日 至平成26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（1,147,849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（35,838,990円）及び分配準備積立金（29,757,265円）より分配対象収益は66,744,104円（1万口当たり639.83円）であり、うち3,129,446円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>
	1,097,586円	1,054,607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8月9日 至 平成26年2月10日	当 期 自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8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26年2月10日現在	当 期 平成26年8月8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26年2月10日現在	当 期 平成26年8月8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	19,294,834	14,089,394
合計	19,294,834	14,089,394

## (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26年2月10日現在	当 期 平成26年8月8日現在
1口当たり純資産額	0.7307円	0.7552円
(1万口当たり純資産額)	(7,307円)	(7,552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8月8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 US・リート・オープン・マ ザーファンド	49,128,322	105,390,076	
	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	76,798,172	156,084,604	
	D I A M世界好配当株オープン・マザー ファンド	124,612,325	256,103,250	
	高金利ソブリン・マザーファンド	197,132,838	261,950,115	
親投資信託受益証券 合計		447,671,657	779,528,045	
合計		447,671,657	779,528,045	

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26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,107,800,584	3,027,505,800
コール・ローン		1,298,033,573	1,340,822,320
投資証券		50,673,876,289	47,013,412,326
派生商品評価勘定		-	400,000
未収入金		227,130,093	2,660,340,753
未収配当金		87,540,177	34,652,031
流動資産合計		53,394,380,716	54,077,133,230
資産合計		53,394,380,716	54,077,133,230
負債の部			
流動負債			
未払金		14,854,554	1,287,943,445
未払解約金		-	500,500,000
流動負債合計		14,854,554	1,788,443,445
負債合計		14,854,554	1,788,443,445
純資産の部			
元本等			
元本	1	27,589,763,927	24,374,446,753
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		25,789,762,235	27,914,243,032
元本等合計		53,379,526,162	52,288,689,785
純資産合計		53,379,526,162	52,288,689,785
負債純資産合計		53,394,380,716	54,077,133,230

## 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 . 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26年2月10日現在	平成26年8月8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	32,325,974,964円	27,589,763,927円
	同期中追加設定元本額	9,993,017円	35,030,088円
	同期中一部解約元本額	4,746,204,054円	3,250,347,262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	36,109,125円	28,864,897円
	D I A M世界6資産バランスファンド	150,476,871円	123,374,111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	175,656,129円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	3,994,120円	3,366,182円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	1,341,672円	1,101,189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）	25,294,972,209円	22,373,463,206円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	517,248,851円	425,475,507円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	834,527,908円	762,347,134円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	403,348,407円	322,625,589円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	54,334,577円	49,128,322円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	79,384,539円	109,044,487円
	計	27,589,763,927円	24,374,446,753円
2 .	受益権の総数	27,589,763,927口	24,374,446,753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8月9日 至 平成26年2月10日	自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8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26年2月10日現在	平成26年8月8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26年2月10日現在	平成26年8月8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	2,005,434,204	5,119,123,488
合計	2,005,434,204	5,119,123,488

(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12月10日から平成26年2月10日まで及び平成25年12月10日から平成26年8月8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26年2月10日 現在				平成26年8月8日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	1,021,600,000	-	1,021,200,000	400,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,021,600,000	-	1,021,200,000	400,000
合計	-	-	-	-	1,021,600,000	-	1,021,200,000	400,000

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
1口当たり純資産額	1.9348円	2.1452円
（1万口当たり純資産額）	（19,348円）	（21,452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8月8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	706,220.000	19,971,901.600	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	268,854.000	20,777,037.120	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	372,554.000	14,160,777.540	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	291,490.000	5,118,564.400	
		AMERICAN TOWER CORP	136,788.000	13,301,265.120	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	176,330.000	26,285,513.100	
		BIOMED REALTY TRUST INC	577,780.000	12,422,270.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	140,820.000	16,711,109.400	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	628,150.000	9,629,539.500	
		CEDAR REALTY TRUST INC	437,300.000	2,702,514.000	
		CORESITE REALTY CORP	239,700.000	8,003,583.000	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	748,870.000	20,548,992.800	
		COUSINS PROPERTIES INC	211,790.000	2,621,960.200	
		CUBESMART	723,710.000	13,330,738.200	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	1,583,850.000	12,227,322.000	
		DIGITAL REALTY 7.0%	400,000.000	10,176,000.000	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	432,430.000	11,813,987.600	
		EAST GROUP	169,750.000	10,522,802.500	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	1,023,030.000	10,762,275.600	
		EPR PROPERTIES	143,540.000	7,749,724.600	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	186,180.000	8,201,229.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	89,586.000	16,821,563.220	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	72,260.000	8,773,809.200	
		FIRST INDUSTRIAL RT	142,000.000	2,520,500.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	678,890.000	15,736,670.200	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	136,570.000	5,690,871.900	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	504,040.000	10,786,456.000	
		KITE REALTY GROUP TRUST	853,930.000	5,208,973.000	
		LASALLE HOTEL PROPERTIES	288,480.000	10,108,339.200	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	410,590.000	14,194,096.300	
POST PROPERTIES, INC	354,240.000	19,408,809.600			
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	328,240.000	5,383,136.000			
SIMON PROPERTY GROUP INC	179,303.000	29,633,406.810			
SL GREEN REALTY PFD 6.5	200,000.000	5,000,000.000			



	TANGER FACTORY OUTLET	238,450.000	8,123,991.500	
	TAUBMAN CENTERS INC	53,290.000	3,890,702.900	
	TERRENO REALTY CORP	421,853.000	8,015,207.000	
	VENTAS INC	181,713.000	11,418,844.920	
	VORNADO REALTY TRUST	115,836.000	12,055,052.520	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	86,721.000	1,613,010.600	
	WEYERHAEUSER CO	282,300.000	8,906,565.000	
	アメリカ・ドル 小計	15,217,428.000	460,329,113.150 (47,013,412,326)	
投資証券 合計		15,217,428	47,013,412,326 (47,013,412,326)	
合計			47,013,412,326 (47,013,412,326)	

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 41銘柄	89.91%	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

「(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。

## 「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26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		569,712,608	1,067,911,502
コール・ローン		2,268,034,210	1,201,301,192
投資信託受益証券		43,148,228,045	40,137,016,941
投資証券		33,716,971,971	35,356,023,888
未収入金		38,920,645	612,348,484
未収配当金		1,222,150,326	1,114,485,417
流動資産合計		80,964,017,805	79,489,087,424
資産合計		80,964,017,805	79,489,087,424
負債の部			
流動負債			
未払解約金		-	500,000
流動負債合計		-	500,000
負債合計		-	500,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	44,772,217,199	39,111,464,157
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		36,191,800,606	40,377,123,267
元本等合計		80,964,017,805	79,488,587,424
純資産合計		80,964,017,805	79,488,587,424
負債純資産合計		80,964,017,805	79,489,087,424

## 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26年2月10日現在	平成26年8月8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	54,397,733,331円	44,772,217,199円
	同期中追加設定元本額	17,455,533円	50,601,614円
	同期中一部解約元本額	9,642,971,665円	5,711,354,656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	56,221,232円	45,497,060円
	D I A M世界6資産バランスファンド	237,000,103円	197,732,196円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	347,707,668円	281,739,867円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	6,242,561円	5,426,319円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	2,132,252円	1,777,753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）	41,137,369,613円	35,940,733,719円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	812,673,811円	667,938,446円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	1,335,527,925円	1,214,214,197円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	620,482,925円	506,304,218円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	88,308,367円	76,798,172円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	128,550,742円	173,302,210円
	計	44,772,217,199円	39,111,464,157円
2 .	受益権の総数	44,772,217,199口	39,111,464,157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8月9日 至 平成26年2月10日	自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8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26年2月10日現在	平成26年8月8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26年2月10日現在	平成26年8月8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	368,909,916	3,827,716,299
投資証券	1,129,155,500	3,334,042,443
合計	1,498,065,416	7,161,758,742

(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12月10日から平成26年2月10日まで及び平成25年12月10日から平成26年8月8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26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
1口当たり純資産額	1.8084円	2.0324円
(1万口当たり純資産額)	(18,084円)	(20,324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8月8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	7,738,860.000		
		AUSTRALAND PROPERTY GROUP	1,874,046.000	8,395,726.080		
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	23,503,224.000	49,591,802.640		
		CHARTER HALL GROUP	5,908,131.000	24,814,150.200		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	10,615,791.000	41,295,426.990		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	17,368,956.000	17,021,576.880		
		DEXUS PROPERTY GROUP	16,307,783.000	18,590,872.620		
		FEDERATION CENTRES	11,467,852.000	29,013,665.560		
		GOODMAN GROUP	679,426.000	3,512,632.420		
		GPT GROUP	1,940,607.000	7,743,021.930		
		MIRVAC GROUP	32,555,560.000	57,786,119.000		
		SCENTRE GROUP	11,274,972.000	37,996,655.640		
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	10,362,271.000	17,667,672.050		
	STOCKLAND	2,240,956.000	9,053,462.240			
	オーストラリア・ドル 小計			148,679,195.000	330,221,644.250 (31,245,571,978)	
	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	6,043,000.000	13,959,330.000	
			ASCOTT RESIDENCE TRUST	14,377,600.000	17,684,448.000	
			CACHE LOGISTICS TRUST	5,662,000.000	6,766,090.000	
			FRASERS CENTREPOINT TRUST	8,667,000.000	16,423,965.000	
			MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	4,528,000.000	6,339,200.000	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST			12,519,840.000	17,715,573.600		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST			19,701,320.000	23,247,557.600		
PARKWAY LIFE REIT			2,853,000.000	6,961,320.000		
シンガポール・ドル 小計			74,351,760.000	109,097,484.200 (8,891,444,963)		
投資信託受益証券 合計			223,030,955	40,137,016,941 (40,137,016,941)		
投資証券	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,778,892.000	12,203,199.120		
		HAMMERSON PLC	2,211,954.000	13,028,409.060		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	532,772.000	5,514,190.200		



	SEGR0 PLC	1,925,876.000	6,867,673.810	
イギリス・ポンド	小計	6,449,494.000	37,613,472.190 (6,458,985,444)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	950,022.000	34,048,788.480	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,361,067.000	21,450,415.920	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	1,321,578.000	34,374,243.780	
	CHOICE PROPERTIES REIT	311,817.000	3,389,450.790	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	992,261.000	13,147,458.250	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	847,500.000	9,508,950.000	
	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	414,973.000	12,345,446.750	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	3,200,000.000	14,816,000.000	
カナダ・ドル	小計	9,399,218.000	143,080,753.970 (13,366,604,036)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	26,401,917.000	28,382,060.770	
ニュージーランド・ドル	小計	26,401,917.000	28,382,060.770 (2,451,358,589)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	827,220.000	8,284,608.300	
	BEFIMMO	76,567.000	4,549,611.140	
	COFINIMMO SA	57,159.000	5,266,630.260	
	CORIO NV	95,009.000	3,708,676.310	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	476,927.000	17,121,679.300	
	GECINA SA	45,322.000	4,872,115.000	
	ICADE	96,588.000	6,793,034.040	
	KLEPIERRE	285,420.000	9,916,917.900	
	VASTNED RETAIL	124,533.000	4,702,988.740	
	WAREHOUSES DE PAUW	216,085.000	12,051,060.450	
	WERELDHAVE NV	281,550.000	18,641,425.500	
ユーロ	小計	2,582,380.000	95,908,746.940 (13,079,075,819)	
投資証券	合計	44,833,009	35,356,023,888 (35,356,023,888)	
合計			75,493,040,829 (75,493,040,829)	

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	-%	8.13%	8.56%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 14銘柄	39.31%	-%	41.39%
カナダ・ドル	投資証券 8銘柄	-%	16.82%	17.71%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 8銘柄	11.19%	-%	11.78%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	3.08%	3.25%
ユーロ	投資証券 11銘柄	-%	16.45%	17.32%

(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26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		150,356,157	136,677,020
コール・ローン		1,638,995,450	954,558,893
株式		42,824,655,737	43,257,886,854
派生商品評価勘定		68,250	67,500
未収入金		891,685,676	2,063,102,039
未収配当金		65,213,239	74,557,873
流動資産合計		45,570,974,509	46,486,850,179
資産合計		45,570,974,509	46,486,850,179
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		718,900	548,548
未払金		890,590,723	2,056,515,626
未払解約金		-	500,000
流動負債合計		891,309,623	2,057,564,174
負債合計		891,309,623	2,057,564,174
純資産の部			
元本等			
元本	1	22,846,747,219	21,617,827,271
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		21,832,917,667	22,811,458,734
元本等合計		44,679,664,886	44,429,286,005
純資産合計		44,679,664,886	44,429,286,005
負債純資産合計		45,570,974,509	46,486,850,179

## 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26年2月10日現在	平成26年8月8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	24,952,682,029円	22,846,747,219円
	同期中追加設定元本額	1,672,054,986円	1,296,266,734円
	同期中一部解約元本額	3,777,989,796円	2,525,186,682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）	15,022,168,602円	13,222,137,850円
	D I A M世界好配当株式ファンド（毎月決算型）	3,342,084,877円	4,343,500,893円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	86,233,046円	73,663,494円
	D I A M世界6資産バランスファンド	354,365,700円	320,943,973円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	538,378,055円	471,005,705円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	28,221,353円	27,160,508円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	9,936,397円	8,584,935円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	1,229,880,910円	1,076,803,879円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	953,251,153円	832,521,315円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	136,488,578円	124,612,325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）	1,145,738,548円	1,116,892,394円
	計	22,846,747,219円	21,617,827,271円
2 .	受益権の総数	22,846,747,219口	21,617,827,271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8月9日 至 平成26年2月10日	自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8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26年2月10日現在	平成26年8月8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 「(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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,605,523,835	879,680,545
合計	1,605,523,835	879,680,545

(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26年2月10日まで及び平成26年5月27日から平成26年8月8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26年2月10日 現在				平成26年8月8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	1,131,795,000	-	1,131,907,500	112,500
アメリカ・ドル	666,123,250	-	666,055,000	68,250	918,900,000	-	919,080,000	180,000
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	212,895,000	-	212,827,500	67,500
買 建	650,178,900	-	649,460,000	718,900	1,334,907,000	-	1,334,538,452	368,548
カナダ・ドル	650,178,900	-	649,460,000	718,900	681,966,000	-	681,820,000	146,000
シンガポール・ドル	-	-	-	-	440,046,000	-	440,046,000	-
香港・ドル	-	-	-	-	212,895,000	-	212,672,452	222,548
合計	1,316,302,150	-	1,315,515,000	650,650	2,466,702,000	-	2,466,445,952	481,048

## （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26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
1口当たり純資産額	1.9556円	2.0552円
（1万口当たり純資産額）	(19,556円)	(20,552円)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成26年8月8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	VERIZON COMM INC	96,507	48.650	4,695,065.550	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	54,785	48.650	2,665,290.250	
	ONEOK INC	34,813	62.030	2,159,450.390	
	SEMPRA ENERGY	23,495	99.520	2,338,222.400	
	CLECO CORPORATION	38,896	54.000	2,100,384.000	
	CENTURYLINK INC	56,198	38.950	2,188,912.100	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	538,690	6.420	3,458,389.800	
	CISCO SYSTEMS INC	90,603	24.860	2,252,390.580	
	CLOROX COMPANY	24,859	87.240	2,168,699.160	
	CONSOLIDATED EDISON INC	41,028	55.340	2,270,489.520	
	CMS ENERGY CORP	82,266	28.500	2,344,581.000	
	COVANTA HOLDING CORP	111,138	20.500	2,278,329.000	
	DOW CHEMICAL	46,055	51.320	2,363,542.600	
	DTE ENERGY CO	29,823	73.070	2,179,166.610	
	DUKE ENERGY CORP	43,802	70.600	3,092,421.200	
	ENTERGY CORP	29,820	71.570	2,134,217.400	
	GENERAL ELECTRIC CO	92,573	25.500	2,360,611.500	
	HEWLETT-PACKARD CO	68,393	34.820	2,381,444.260	
	REYNOLDS AMERICAN INC	62,348	56.260	3,507,698.480	
	INTEL CORP	65,310	32.680	2,134,330.800	
	JOHNSON & JOHNSON	35,422	99.930	3,539,720.460	
	KELLOGG CO	32,718	62.380	2,040,948.840	
	ELI LILLY & CO	38,000	60.350	2,293,300.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	21,601	162.950	3,519,882.950	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	71,146	30.010	2,135,091.460	
	MERCK & CO. INC.	124,533	55.640	6,929,016.120	
	MICROSOFT CORP	55,203	43.230	2,386,425.690	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	52,440	45.570	2,389,690.800	
	NISOURCE INC	59,644	36.590	2,182,373.960	
	WELLS FARGO & CO	44,225	49.700	2,197,982.500	
	PPL CORPORATION	79,612	32.390	2,578,632.680	
	PFIZER INC	76,093	28.040	2,133,647.720	
	CONOCOPHILLIPS	91,437	79.590	7,277,470.830	
ALTRIA GROUP INC	90,129	41.150	3,708,808.350		
PDL BIOPHARMA INC	251,162	9.320	2,340,829.840		
AT&T INC	64,333	34.210	2,200,831.930		
CHEVRON CORP	18,215	125.650	2,288,714.750		

	REGAL ENTERTAINMENT GROUP-A	122,789	20.250	2,486,477.250	
	AVISTA CORP	68,344	30.970	2,116,613.680	
	WILLIAMS COS INC	39,485	54.370	2,146,799.450	
	SHIP FINANCE INTERNATIONAL LTD	119,041	18.120	2,157,022.920	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CO LLC	99,674	68.950	6,872,522.300	
	WINDSTREAM HOLDINGS INC	305,673	11.160	3,411,310.680	
	SEADRILL LTD	59,449	35.720	2,123,518.280	
	SPECTRA ENERGY CORP	54,476	39.760	2,165,965.760	
	CVR ENERGY INC	44,745	45.930	2,055,137.850	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	26,120	82.710	2,160,385.200	
	LORILLARD INC	41,339	60.300	2,492,741.700	
	KINDER MORGAN INC/DELAWARE	60,195	35.370	2,129,097.150	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	27,637	107.930	2,982,861.410	
	TARGA RESOURCES CORP	39,926	129.940	5,187,984.440	
	KRAFT FOODS GROUP INC	38,594	54.680	2,110,319.920	
	ABBVIE INC	43,082	52.430	2,258,789.260	
	CBS OUTDOOR AMERICAS INC	68,025	32.170	2,188,364.250	
アメリカ・ドル	小計	4,095,909		150,262,916.980 (15,346,351,712)	
イギリス・ポンド	SEVERN TRENT PLC	96,027	18.670	1,792,824.090	
	BHP BILLITON PLC	159,289	19.930	3,174,629.770	
	BT GROUP PLC	523,634	3.791	1,985,096.490	
	AVIVA PLC	351,761	5.025	1,767,599.020	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	118,162	34.165	4,037,004.730	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	69,423	25.070	1,740,434.610	
	COMPASS GROUP PLC	125,117	9.585	1,199,246.440	
	HSBC HOLDINGS PLC	212,222	6.287	1,334,239.710	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	176,171	8.430	1,485,121.530	
	PRUDENTIAL PLC	223,852	13.310	2,979,470.120	
	RIO TINTO PLC	76,937	33.730	2,595,085.010	
	VODAFONE GROUP PLC	1,116,437	1.959	2,187,100.080	
	REED ELSEVIER PLC	252,299	9.380	2,366,564.620	
	BP PLC	768,722	4.691	3,606,074.900	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	279,513	13.770	3,848,894.010	
	WOLSELEY PLC	57,362	30.200	1,732,332.400	
	ASTRAZENECA PLC	33,642	41.890	1,409,263.380	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	219,117	25.295	5,542,564.510	

イギリス・ポンド 小計		4,859,687		44,783,545.420 (7,690,230,420)	
オーストラリア・ドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	101,560	32.850	3,336,246.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	221,179	33.650	7,442,673.350	
	TELSTRA CORP LTD	490,026	5.430	2,660,841.180	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	197,800	12.400	2,452,720.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	41,511	81.350	3,376,919.850	
	SONIC HEALTHCARE	134,152	17.870	2,397,296.240	
オーストラリア・ドル 小計		1,186,228		21,666,696.620 (2,050,102,834)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	59,975	79.460	4,765,613.500	
	BANK OF NOVA SCOTIA	49,329	72.190	3,561,060.510	
	NATIONAL BANK OF CANADA	68,809	48.230	3,318,658.070	
	BCE INC	49,722	48.570	2,414,997.540	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,277	100.050	3,429,413.850	
	FORTIS INC	70,601	33.530	2,367,251.530	
	POWER FINANCIAL CORP	68,016	34.430	2,341,790.880	
	TRANSCANADA CORP	44,512	53.890	2,398,751.680	
	VERESEN INC	153,209	18.190	2,786,871.710	
	KEYERA CORP	28,721	88.200	2,533,192.200	
	WHITECAP RESOURCES INC	150,878	16.140	2,435,170.920	
	ALTAGAS LTD	48,927	49.270	2,410,633.290	
	GIBSON ENERGY INC	72,888	33.630	2,451,223.440	
	PEMBINA PIPELINE CORP	60,697	45.560	2,765,355.320	
	DH CORP	86,041	33.260	2,861,723.660	
INTER PIPELINE LTD	84,533	34.190	2,890,183.270		
カナダ・ドル 小計		1,131,135		45,731,891.370 (4,272,273,292)	
シンガポール・ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	148,000	18.140	2,684,720.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	1,207,000	2.570	3,101,990.000	
	SINGAPORE POST LTD	1,624,000	1.760	2,858,240.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	269,000	10.170	2,735,730.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	713,000	3.930	2,802,090.000	
シンガポール・ドル 小計		3,961,000		14,182,770.000 (1,155,895,755)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	116,375	69.400	8,076,425.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	33,309	258.700	8,617,038.300	
	NOVARTIS AG-REG SHS	80,985	77.750	6,296,583.750	
	SWISSCOM AG-REG	5,828	502.500	2,928,570.000	
スイス・フラン 小計		236,497		25,918,617.050	

				(2,910,660,695)	
スウェーデン・ クローナ	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	75,930	166.300	12,627,159.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN- A SHS	67,699	322.000	21,799,078.000	
スウェーデン・クローナ 小計		143,629		34,426,237.000 (508,819,783)	
ノルウェー・ク ローネ	ORKLA ASA	208,372	55.000	11,460,460.000	
ノルウェー・クローネ 小計		208,372		11,460,460.000 (187,263,916)	
ユーロ	AXA	176,668	17.465	3,085,506.620	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,042	86.200	2,158,620.400	
	BNP PARIBAS	34,068	48.170	1,641,055.560	
	DEUTSCHE POST AG-REG	63,149	23.385	1,476,739.360	
	REPSOL SA	153,942	17.935	2,760,949.770	
	COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	76,270	35.685	2,721,694.950	
	VINCI S.A.	66,384	46.365	3,077,894.160	
	TOTAL SA	87,076	48.290	4,204,900.040	
	SIEMENS AG-REG	41,675	89.220	3,718,243.500	
	DAIMLER AG	19,960	58.950	1,176,642.000	
	BASF SE	20,908	74.500	1,557,646.000	
	ORANGE	195,893	10.990	2,152,864.070	
	SAMPO OYJ-A SHS	51,145	36.810	1,882,647.450	
	ALLIANZ SE	35,042	121.300	4,250,594.600	
	SANOFI	79,896	77.230	6,170,368.080	
	ENEL SPA	623,423	3.804	2,371,501.090	
	DEUTSCHE TELEKOM AG- REG	242,049	11.360	2,749,676.640	
	SNAM SPA	566,346	4.178	2,366,193.580	
	ENAGAS	95,362	23.490	2,240,053.380	
	HERA SPA	939,248	1.900	1,784,571.200	
FERROVIAL SA	182,815	14.505	2,651,731.570		
GDF SUEZ	86,022	18.475	1,589,256.450		
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	95,596	12.965	1,239,402.140		
ユーロ 小計		3,957,979		59,028,752.610 (8,049,750,994)	
香港・ドル	CHINA MOBILE LIMITED	337,000	86.000	28,982,000.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	326,000	55.400	18,060,400.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	243,000	70.800	17,204,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	741,000	24.550	18,191,550.000	
香港・ドル 小計		1,647,000		82,438,350.000 (1,086,537,453)	
合計		21,427,436		43,257,886,854 (43,257,886,854)	

## ( 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、内数で表示してあります。

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 54銘柄	34.54%	35.48%
イギリス・ポンド	株式 18銘柄	17.31%	17.78%
オーストラリア・ドル	株式 6銘柄	4.61%	4.74%
カナダ・ドル	株式 16銘柄	9.62%	9.88%
シンガポール・ドル	株式 5銘柄	2.60%	2.67%
スイス・フラン	株式 4銘柄	6.55%	6.73%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	1.15%	1.18%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	0.42%	0.43%
ユーロ	株式 23銘柄	18.12%	18.61%
香港・ドル	株式 4銘柄	2.45%	2.51%

(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26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		12,118,698	41,134,545
コール・ローン		123,648,029	22,774,485
国債証券		17,195,794,310	17,108,477,249
特殊債券		602,953,443	-
派生商品評価勘定		-	558,292
未収入金		-	181,148,399
未収利息		245,938,781	161,287,343
前払費用		17,039,964	2,916,329
流動資産合計		18,197,493,225	17,518,296,642
資産合計		18,197,493,225	17,518,296,642
負債の部			
流動負債			
未払解約金		10,000,000	10,000,000
流動負債合計		10,000,000	10,000,000
負債合計		10,000,000	10,000,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,082,497,792	13,176,152,506
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,104,995,433	4,332,144,136
元本等合計		18,187,493,225	17,508,296,642
純資産合計		18,187,493,225	17,508,296,642
負債純資産合計		18,197,493,225	17,518,296,642

## 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>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p>
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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。</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26年2月10日現在	平成26年8月8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	15,233,341,274円	14,082,497,792円
	同期中追加設定元本額	77,285,726円	373,609円
	同期中一部解約元本額	1,228,129,208円	906,718,895円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M高金利ソブリン債券ファンド（毎月決算型）	1,990,491,475円	1,651,165,425円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	470,693,898円	407,798,078円
	D I A Mバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	421,346,307円	361,318,832円
	D I A M世界6資産バランスファンド	551,946,791円	509,574,618円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	1,990,736,811円	1,749,236,013円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	14,423,598円	14,119,547円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	4,952,529円	4,274,951円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	206,087,741円	197,132,838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）	8,431,818,642円	8,281,532,204円
	計	14,082,497,792円	13,176,152,506円
2 .	受益権の総数	14,082,497,792口	13,176,152,506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8月9日 至 平成26年2月10日	自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8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26年2月10日現在	平成26年8月8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26年2月10日現在	平成26年8月8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	526,352,669	57,494,247
特殊債券	13,057,905	-
合計	539,410,574	57,494,247

(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26年2月10日まで及び平成26年5月9日から平成26年8月8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26年2月10日 現在				平成26年8月8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	-	-	-	-	188,727,997	-	188,169,705	558,292
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	188,727,997	-	188,169,705	558,292
合計	-	-	-	-	188,727,997	-	188,169,705	558,292

## (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26年2月10日現在	平成26年8月8日現在
1口当たり純資産額	1.2915円	1.3288円
(1万口当たり純資産額)	(12,915円)	(13,288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8月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 3.125 05/15/19	15,400,000.000	16,498,944.000	
	アメリカ・ドル 小計		15,400,000.000 (1,572,802,000)	16,498,944.000 (1,685,037,151)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,000,000.000	2,204,600.000	
		AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	15,700,000.000	17,135,765.000	
	オーストラリア・ドル 小計		17,700,000.000 (1,674,774,000)	19,340,365.000 (1,829,985,336)	
	カナダ・ドル	CANADA 4.25 06/01/18	12,050,000.000	13,365,257.500	
	カナダ・ドル 小計		12,050,000.000 (1,125,711,000)	13,365,257.500 (1,248,582,356)	
	スウェーデン・クローナ	SWEDEN 4.25 03/12/19	90,900,000.000	105,348,555.000	
		スウェーデン・クローナ 小計		90,900,000.000 (1,343,502,000)	105,348,555.000 (1,557,051,643)
	タイ・バーツ	THAILAND 3.25 06/16/17	414,300,000.000	422,271,132.000	
		THAILAND 3.875 06/13/19	50,000,000.000	51,848,000.000	
	タイ・バーツ 小計		464,300,000.000 (1,467,188,000)	474,119,132.000 (1,498,216,457)	
	ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17	22,100,000.000	23,548,434.000	
	ニュージーランド・ドル 小計		22,100,000.000 (1,908,777,000)	23,548,434.000 (2,033,878,245)	
	ノルウェー・クローネ	NORWAY 4.25 05/19/17	20,000,000.000	21,552,000.000	
		NORWAY 4.5 05/22/19	14,000,000.000	15,848,000.000	
		NORWAY 5.0 05/15/15	58,300,000.000	59,920,740.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		92,300,000.000 (1,508,182,000)	97,320,740.000 (1,590,220,892)	
	ポーランド・ズロチ	POLAND 3.75 04/25/18	17,900,000.000	18,531,870.000	
		POLAND 5.25 10/25/17	10,800,000.000	11,682,792.000	
		POLAND 5.5 10/25/19	17,000,000.000	19,079,100.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		45,700,000.000 (1,480,680,000)	49,293,762.000 (1,597,117,889)	
	マレーシア・リングgit	MALAYSIA 4.24 02/07/18	61,000,000.000	62,478,640.000	
マレーシア・リングgit 小計		61,000,000.000 (1,937,360,000)	62,478,640.000 (1,984,321,606)		
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	80,000,000.000	88,948,000.000		

	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	68,000,000.000	78,166,680.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	90,000,000.000	103,543,200.000	
	メキシコ・ペソ 小計	238,000,000.000 (1,832,600,000)	270,657,880.000 (2,084,065,676)	
国債証券 合計		15,851,576,000 (15,851,576,000)	17,108,477,249 (17,108,477,249)	
合計		15,851,576,000 (15,851,576,000)	17,108,477,249 (17,108,477,249)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 1銘柄	9.62%	9.85%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄	10.45%	10.70%
カナダ・ドル	国債証券 1銘柄	7.13%	7.30%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	8.89%	9.10%
タイ・バーツ	国債証券 2銘柄	8.56%	8.76%
ニュージーランド・ドル	国債証券 1銘柄	11.62%	11.89%
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	9.08%	9.29%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	9.12%	9.34%
マレーシア・リングギット	国債証券 1銘柄	11.33%	11.60%
メキシコ・ペソ	国債証券 3銘柄	11.90%	12.18%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成26年8月29日現在

資産総額	815,308,384円
負債総額	816,492円
純資産総額（ - ）	814,491,892円
発行済数量	1,037,237,724口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7853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8月29日現在

資産総額	53,892,897,365円
負債総額	150,000円
純資産総額（ - ）	53,892,747,365円
発行済数量	24,120,008,578口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2344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8月29日現在

資産総額	82,502,961,757円
負債総額	535,032,000円
純資産総額（ - ）	81,967,929,757円
発行済数量	38,455,672,470口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1315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8月29日現在

資産総額	47,244,105,505円
負債総額	438,569,205円
純資産総額（ - ）	46,805,536,300円
発行済数量	21,587,157,806口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1682円

高金利ソブリン・マザーファンド

平成26年8月29日現在

資産総額	17,845,991,617円
負債総額	21,000,000円
純資産総額（ - ）	17,824,991,617円
発行済数量	13,116,976,794口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3589円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

### (2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (4)受益権の譲渡の対抗要件

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

### (5)受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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



## 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】

##### (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ヵ年の資本金の変動

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。

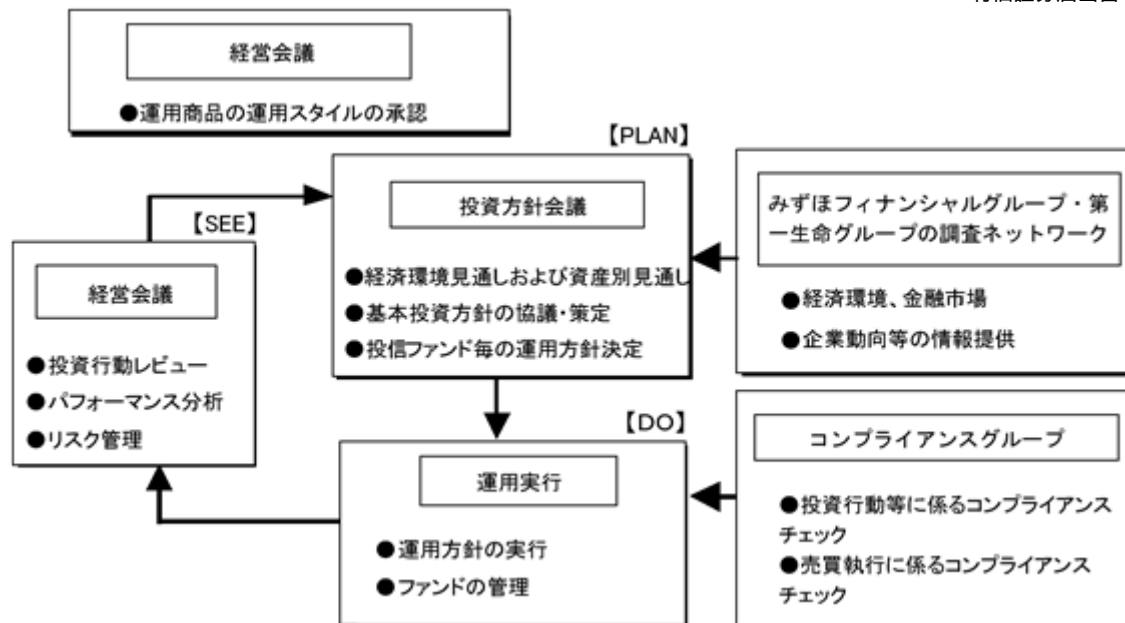
###### 投資運用の意思決定機構

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8月29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】

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8月29日現在、委託会社の運用する投資信託は336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	7	20,451,452,315
追加型株式投資信託	314	5,177,824,775,272
単位型公社債投資信託	15	150,909,870,559
追加型公社債投資信託	0	0
合計	336	5,349,186,098,146

### 3【委託会社等の経理状況】

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。以下「財務諸表等規則」という。）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。  
なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26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ております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	10,806,745	11,487,360
金銭の信託	10,214,440	10,952,459
前払費用	69,143	64,554
未収委託者報酬	3,073,481	3,854,410
未収運用受託報酬	1,173,744	1,415,502
未収投資助言報酬	2 245,819	2 255,218
未収収益	244,974	275,082
繰延税金資産	426,229	401,327
その他	25,354	23,246
流動資産計	26,279,933	28,729,163
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 142,820	1 122,181
車両運搬具	1 2,770	1 1,615
器具備品	1 231,732	1 140,023
建設仮勘定	1,207	29,509
無形固定資産		
商標権	1 289	1 195
ソフトウェア	1 1,261,335	1 1,188,444
ソフトウェア仮勘定	68,920	642,834
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 292	1 231
投資その他の資産		
投資有価証券	4,002,042	4,178,284
関係会社株式	400,579	617,159
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	661,777	622,698
差入保証金	731,564	731,197
その他	89,047	88,154
固定資産計	5,718,557	6,310,469
資産合計	31,998,491	35,039,633

（単位：千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	571,153	760,493
未払金	1,547,527	1,972,562
未払収益分配金	48	-
未払償還金	84,932	51,109
未払手数料	1,195,452	1,554,065
その他未払金	267,093	367,387
未払費用	2 1,306,837	2 1,466,924
未払法人税等	1,299,068	1,721,861
未払消費税等	116,872	195,272
賞与引当金	724,974	668,366
その他	100,000	10,000
流動負債計	5,666,434	6,795,481
固定負債		
退職給付引当金	802,603	947,759
役員退職慰労引当金	98,510	136,010
固定負債計	901,113	1,083,769
負債合計	6,567,548	7,879,251
（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	20,898,697	22,488,744
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	16,330,000	17,130,000
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	3,945,403	4,735,451
株主資本計	25,327,175	26,917,222
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	103,768	243,159
評価・換算差額等計	103,768	243,159
純資産合計	25,430,943	27,160,381
負債・純資産合計	31,998,491	35,039,633

## （ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第28期 （ 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日 ）		第29期 （ 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日 ）	
	営業収益			
委託者報酬	23,374,427		25,437,511	
運用受託報酬	5,374,163		6,328,414	
投資助言報酬	885,923		926,837	
その他営業収益	715,164		835,020	
営業収益計		30,349,678		33,527,783
営業費用				
支払手数料	10,846,568		11,284,530	
広告宣伝費	177,553		316,226	
公告費	3,769		319	
調査費	4,546,312		5,226,606	
調査費	3,001,788		3,635,440	
委託調査費	1,544,523		1,591,166	
委託計算費	341,978		356,496	
営業雑経費	456,677		540,260	
通信費	25,513		32,834	
印刷費	374,775		466,075	
協会費	25,492		25,048	
諸会費	42		38	
支払販売手数料	30,854		16,264	
営業費用計		16,372,860		17,724,440
一般管理費				
給料	4,870,759		5,009,676	
役員報酬	242,014		255,603	
給料・手当	4,035,751		4,171,884	
賞与	592,994		582,188	
交際費	36,212		34,917	
寄付金	2,693		2,515	
旅費交通費	187,653		232,436	
租税公課	95,064		103,775	
不動産賃借料	675,811		683,633	
退職給付費用	173,065		221,376	
固定資産減価償却費	524,750		561,503	
福利厚生費	26,642		32,812	
修繕費	6,018		9,184	
賞与引当金繰入額	724,974		668,366	
役員退職慰労引当金繰入額	47,820		47,298	
役員退職慰労金	7,200		6,528	
機器リース料	35		35	
事務委託費	224,066		215,100	
事務用消耗品費	60,044		67,394	
器具備品費	2,065		3,191	
諸経費	159,247		118,672	

一般管理費計		7,824,126		8,018,417
営業利益		6,152,691		7,784,925

（単位：千円）

	第28期		第29期	
	（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）		（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	10,223		15,024	
受取利息	3,554		2,318	
時効成立分配金・償還金	2,080		33,872	
金銭の信託運用益	168,444		-	
雑収入	4,957		4,746	
営業外収益計		189,260		55,962
営業外費用				
為替差損	6,549		7,364	
金銭の信託運用損	-		213,744	
雑損失	-		10,952	
営業外費用計		6,549		232,061
経常利益		6,335,402		7,608,826
特別損失				
固定資産除却損	1	1,752	1	22
固定資産売却損	2	115	2	1,448
特別損失計		1,868		1,470
税引前当期純利益		6,333,533		7,607,355
法人税、住民税及び事業税		2,573,893		2,934,516
法人税等調整額		134,463		13,207
法人税等合計		2,439,430		2,921,308
当期純利益		3,894,102		4,686,047



## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	15,630,000	300,000	200,000	3,463,300	19,716,594	24,145,072
当期変動額									
剰余金の 配当							2,712,000	2,712,000	2,712,000
別途積立金 の積立				700,000			700,000	-	-
当期純利益							3,894,102	3,894,102	3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	700,000	-	-	482,102	1,182,102	1,182,102
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	136,143	24,281,215
当期変動額		
剰余金の 配当		2,712,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	32,375	32,375
当期変動額 合計	32,375	1,149,727
当期末残高	103,768	25,430,943

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の 配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金 の積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の 配当		3,096,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	139,391	139,391
当期変動額 合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

## 重要な会計方針

項目	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26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。
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。また、数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理  (4) 役員退職慰労引当金は、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29期（自平成25年4月1日 至平成26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第25号 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**

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27年3月期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**

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正により財務諸表に与える影響額については、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28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
建物	539,393	562,127
車両運搬具	2,152	3,308
器具備品	565,794	664,016
商標権	649	742
ソフトウェア	1,071,133	1,502,289
電信電話専用施設利用権	1,304	1,365

## 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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	241,190	255,084
流動負債	未払費用	334,888	392,646

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	-	22
ソフトウェア	1,752	0

## 2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	115	1,448

(株主資本等変動計算書関係)

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

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

平成26年6月30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26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

## （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	-

## 第29期（平成26年3月31日現在）

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

## (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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26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
差入保証金	731,564	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。

## (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	-	-	-

## 第29期(平成26年3月31日現在)

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

## (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28期及び第29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。

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

## 7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

## 1. 運用目的の金銭の信託

第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

## 第29期（平成26年3月31日現在）

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

## 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）

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

（千円）

（1）退職給付債務	936,125
（2）未認識数理計算上の差異	133,522
退職給付引当金	802,603

## 3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

(1) 勤務費用	102,125
(2) 利息費用	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	41,923
(5) その他	314
退職給付費用	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

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）

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

退職給付債務の期首残高	936,125
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の発生額	14,996
退職給付の支払額	34,684
過去勤務費用の発生額	24,260
退職給付債務の期末残高	1,079,828

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828
未積立退職給付債務	1,079,828
未認識数理計算上の差異	112,660
未認識過去勤務費用	19,408
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759
退職給付引当金	947,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の費用処理額	35,858
過去勤務費用の費用処理額	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第28期	第29期
	(平成25年3月31日現在)	(平成26年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	107,022	123,518
未払事業所税	5,986	5,841
賞与引当金	275,562	238,205
未払法定福利費	34,566	31,036
未払確定拠出年金掛金	3,091	2,724
減価償却超過額（一括償却資産）	5,192	3,183
減価償却超過額	159,737	152,470
繰延資産償却超過額（税法上）	27,873	10,908
退職給付引当金	286,796	337,781
役員退職慰労引当金	35,109	48,474
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	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	109	-
繰延税金資産合計	1,088,007	1,078,198
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	54,172
繰延税金負債合計	-	54,172
差引繰延税金資産の純額	1,088,007	1,024,025

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

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

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## 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。

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。



## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者との取引)

## (1) 親会社及び法人主要株主等

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

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

## 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

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

## 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

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

## 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せん。

（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。

（注7）株式会社みずほ銀行は平成25年7月1日付で株式会社みずほコーポレート銀行（株式会社みずほ銀行に商号変更）に吸収合併されており、合併後の取引については吸収合併後の株式会社みずほ銀行（旧株式会社みずほコーポレート銀行）に引き継いでおります。

（1株当たり情報）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
1株当たり純資産額	1,059,622円64銭	1,131,682円58銭
1株当たり当期純利益金額	162,254円29銭	195,251円97銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
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。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

・公告の方法の変更(電子公告(ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。 )に変更)

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

## a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

## b. 資本金の額

平成26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 <sup>*</sup> (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26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。

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱いおよび販売
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

- (1) デービス・セレクトド・アドバイザーズは、委託会社との投資一任契約に基づき、D I A M U S・リート・オープン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。
- (2) コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントは、委託会社との投資一任契約に基づき、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。
- (3) DIAM International Ltdは、委託会社との投資一任契約に基づき、高金利ソブリン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。また、委託会社との投資顧問契約に基づき、D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンドの信託財産について運用助言を行います。
- (4) DIAM U.S.A., Inc.は、委託会社との投資顧問契約に基づき、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの信託財産について運用助言を行います。

### 3【資本関係】

委託会社は、DIAM U.S.A., Inc.およびDIAM International Ltdの株式を、それぞれについて100%保有しています。

その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2) 目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3) 請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。  
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4) ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。  
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。  
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。  
（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：インカムパス）

# 独立監査人の監査報告書

平成26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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成26年9月24日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 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26年2月11日から平成26年8月8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8月8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。