

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成27年5月8日
<b>【発行者名】</b>	D I A Mアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 西 惠正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	上野 圭子
<b>【電話番号】</b>	03-3287-3110
<b>【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】</b>	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>	5,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

有価証券報告書の提出に伴い、平成26年11月7日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

**2【訂正の内容】**

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

#### (3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(略)

委託会社の概況

(略)

(1)資本金の額

20億円（平成26年8月29日現在）

(略)

(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%

< 訂正後 >

(略)

委託会社の概況

(略)

(1)資本金の額

20億円（平成27年2月27日現在）

(略)

(3)大株主の状況

（平成27年2月27日現在）

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

### 2【投資方針】

#### (2)【投資対象】

< 訂正前 >

(略)

(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		
(略)			
運用プロセス	(略)	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。	
(略)			

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
(略)	
運用 プロセス	(略) 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。
(略)	

ファンド名	D I A M U S・リート・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	運用指図に関する権限はデービス・セレクトド・アドバイザーズ（米国）に委託します。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>デービス・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>
(略)	

ファンド名	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	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。 <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>
(略)	

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

## (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
(略)	
運用 プロセス	(略) 上記は、平成27年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
(略)	

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
(略)	
運用 プロセス	(略) 上記は、平成27年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
(略)	

ファンド名	D I A M US・リート・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 5px 0;"> <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4兆4,328億円（約36,772百万米ドル、1米ドル=120.55円で換算）。そのうち、不動産関連証券投資は約933億円（2014年12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>
(略)	
(略)	

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

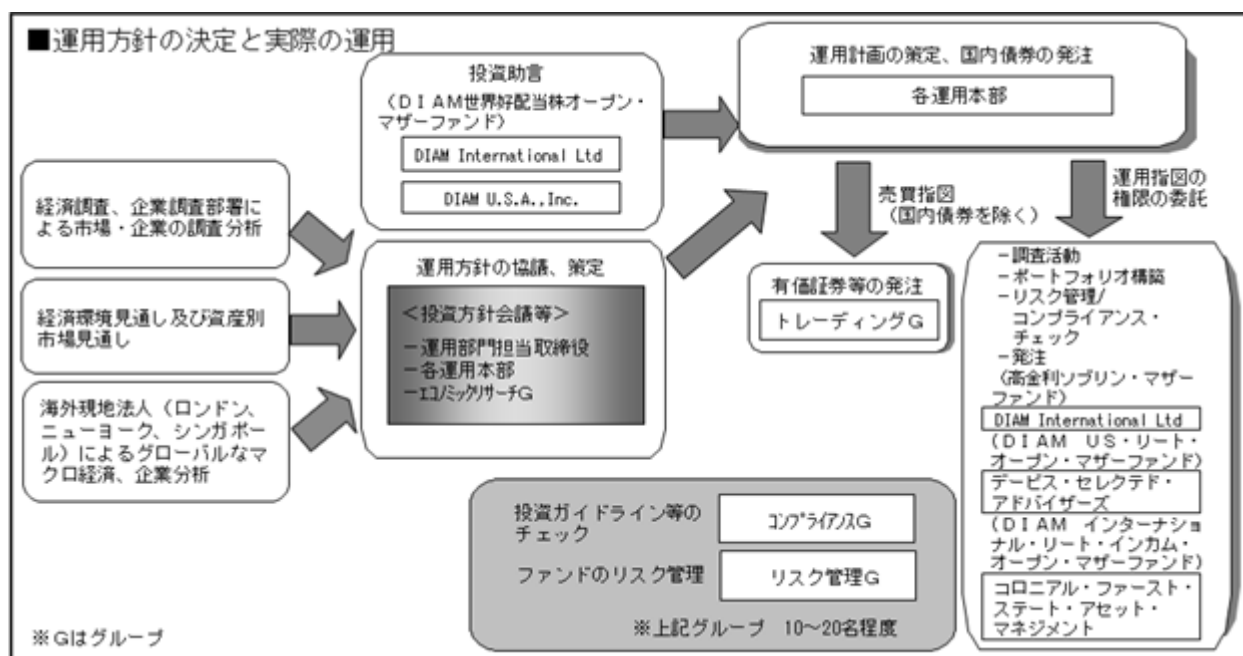
投資態度	<p>運用指図に関する権限はコロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント（豪州）に委託します。</p> <p>コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントとは・・・ Colonial First State Asset Management (Australia) Limited</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・オーストラリア・コモンウェルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。</li> <li>・運用受託資産は、約18兆7,908億円（約191,606百万豪ドル、1豪ドル=98.07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3,204億円（2014年12月末現在）。</li> <li>・不動産関連証券投資では1991年からの実績。</li> <li>・運用スタイルは、マクロ分析によるトップダウンと個別銘柄調査によるボトムアップ運用の融合を特徴としています。</li> </ul> <p>(略)</p>
(略)	(略)

(略)

### （３）【運用体制】

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

<更新・訂正後>



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、各運用本部の運用担当者、エコ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。

国内債券の発注は、債券運用本部で執行されます。それ以外の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。

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記運用体制は、平成27年4月13日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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>

・デビス・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ビス・セレクトド・アドバイザーズに委託します。	
調査活動	不動産担当ポートフォリオマネジャー（運用担当者、以下同じ）およびアナリストにより、綿密な個別銘柄調査が行われます。経済・政治・不動産市場などのマクロ分析結果は、上記個別銘柄調査を効率的に行うことを目的として、活用されます。
ポートフォリオ構築	の分析結果に基づき、個別銘柄の選択の結果としてポートフォリオが構築されます。付加価値の源泉を個別銘柄選択に求めているため、良い経営の成長している銘柄を、内在価値より割安な価格で購入することを主眼とします。組入銘柄は、地理的、不動産タイプ別に分散させながら、30～40銘柄でポートフォリオを組成します。ポートフォリオ構築の最終決定は、不動産担当ポートフォリオマネジャーが行います。
リスク管理/コンプライアンス・チェック	不動産投信等への投資にかかるリスク管理は、個別銘柄のリスク管理に帰結するとの認識のもと、組入銘柄の継続的な調査を運用部門にて行います。また、業種分散、銘柄集中度を月次でモニタリングします。それら一連のリスク管理は、運用部門とは独立した組織により並行して行われます。また、ガイドラインの遵守状況などコンプライアンス・チェックも、運用部門とは完全に独立した部門により、定期的に行われます。
運用評価	委託会社において、マザーファンドの運用実績を、原則として月1回開催される経営会議において、評価いたします。

・コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントの運用体制

D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をコロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントに委託します。	
調査活動	<p>a) トップダウン・マクロ・スクリーニング</p> <p>中長期的に良好な運用を行うため、経済・政治・税金・証券市場・通貨見通しに加え、不動産需給の基礎的要因や貸借レート成長率、土地価格の見積もりなどに基づき、専属ファンドマネジャー（運用担当者、以下同じ）およびアナリストが地域別に不動産物件セクターの見通しを策定します。</p> <p>b) ボトムアップ調査</p> <p>専属ファンドマネジャーおよびアナリストが、不動産関連証券発行会社のマネジメントとの面談、主要な不動産賃貸契約の個別契約条項や不動産入居テナント企業に対する分析に基づき、綿密な調査活動を行います。また、オーストラリア・コモンウェルス銀行の調査情報ネットワークも活用します。</p>
ポートフォリオ構築	a) およびb)の分析結果に基づき、個別銘柄の選択の結果としてポートフォリオが構築されます。付加価値の源泉を個別銘柄選択に求めているため、グローバルな視点により銘柄の横比較を行い、優良な銘柄を選択することに主眼を置いています。ポートフォリオ構築に関する権限は、不動産関連証券チームの責任者に一任されています。



リスク管理/コンプライアンス・チェック	運用部門でのモニタリングに加え、運用部門とは完全に独立した部門により、個別銘柄ベースのリスク評価、また主に社内管理システムを活用してポートフォリオのリスク管理が行われます。また、ガイドラインの遵守状況などコンプライアンス・チェックも、運用部門とは完全に独立した部門により、システマティックに行われます。
運用評価	委託会社において、マザーファンドの運用実績を、原則として月1回開催される経営会議において、評価いたします。

各運用体制は、平成27年2月27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。

#### ( 5 ) 【投資制限】

< 訂正前 >

(略)

\_\_有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

(略)

\_\_特別の場合の外貨建資産への投資制限（約款第28条）

(略)

\_\_外貨為替予約の指図および範囲（約款第29条）

(略)

\_\_資金の借入れ（約款第36条）

(略)

\_\_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）

(略)

\_\_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。

< 訂正後 >

(略)

\_\_デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条の2）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出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。

\_\_有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

(略)

\_\_特別の場合の外貨建資産への投資制限（約款第28条）

(略)

\_\_外貨為替予約の指図および範囲（約款第29条）

(略)

\_\_資金の借入れ（約款第36条）

(略)

\_\_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）

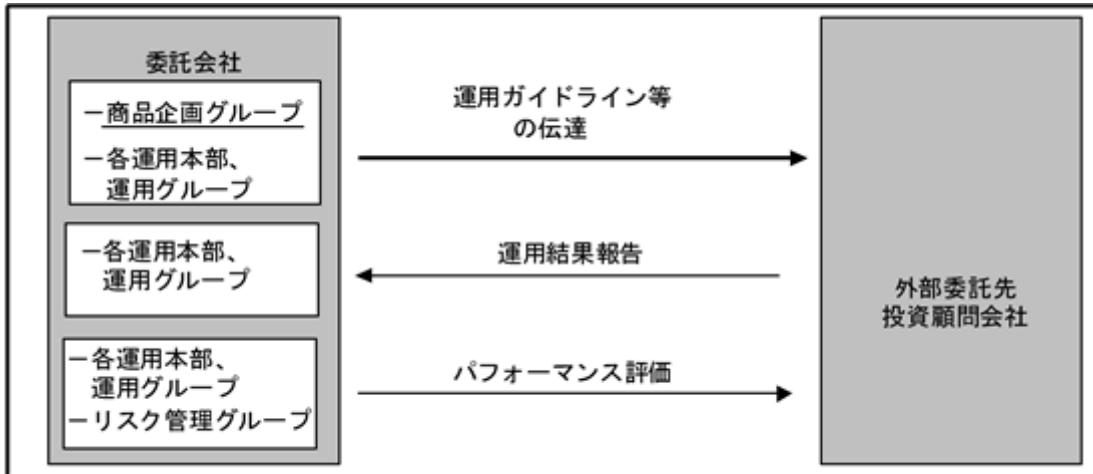
(略)

## 3【投資リスク】

&lt;訂正前&gt;

(略)

&lt;外部委託先に関する管理体制&gt;



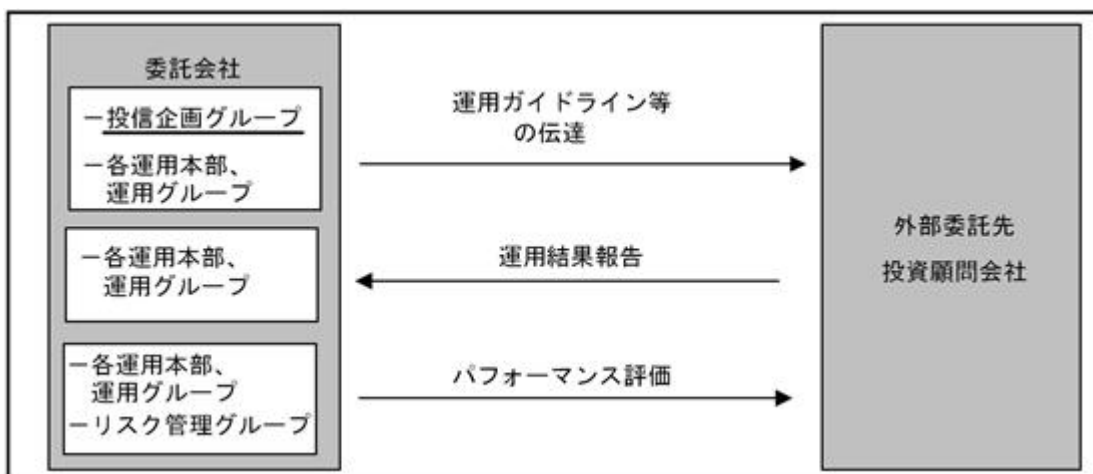
マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用本部、運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

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。

&lt;訂正後&gt;

(略)

&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、運用外部委託先から運用結果の報告を受けるなど、担当の運用本部/運用グループは運用外部委託先と連携します。

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27年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

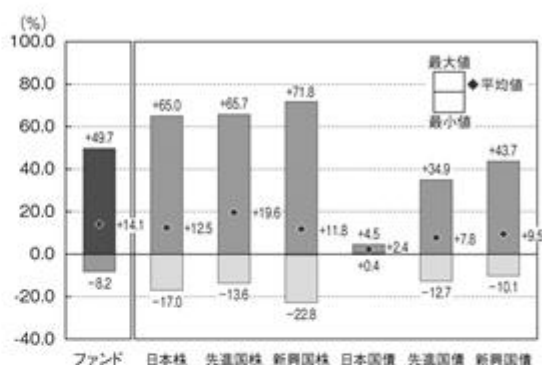
投資リスクの末尾に以下の内容が追加されます。

## (参考情報)

### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



2010年3月～2015年2月

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

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

#### \* 各資産クラスの指数

- 日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
  - 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
  - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
  - 日本国債…NOMURA-BPI国債
  - 先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
  - 新興国債…JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(旧東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

&lt;訂正前&gt;

(略)

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

&lt;訂正後&gt;

(略)

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

## (3)【信託報酬等】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (3) 信託報酬等」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

&lt;更新・訂正後&gt;

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）		主な役務
委託会社	年率0.58%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.56%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.06%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、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】

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

## □. 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。

( 略 )

- ・ 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。

( 略 )

&lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

## □. その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等がファンドから支払われます。

( 略 )

- ・ 監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

( 略 )

## ( 5 ) 【課税上の取扱い】

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

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。

( 略 )

&lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

上記は、平成27年2月末現在のものです。 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

( 略 )

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成27年2月27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	759,730,756	98.67
内 日本	759,730,756	98.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,201,633	1.33
純資産総額	769,932,389	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

## D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	49,838,986,253	91.46
内 アメリカ	49,838,986,253	91.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,654,603,073	8.54
純資産総額	54,493,589,326	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

平成27年2月27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	40,811,483,361	48.96
内 オーストラリア	30,644,316,174	36.76
内 シンガポール	10,167,167,187	12.20
投資証券	37,966,133,286	45.55
内 カナダ	12,896,206,594	15.47
内 イギリス	8,179,109,913	9.81
内 ベルギー	4,695,586,379	5.63
内 フランス	4,103,331,536	4.92
内 オランダ	3,901,273,336	4.68
内 ニュージーランド	2,816,390,173	3.38
内 ドイツ	1,374,235,355	1.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,574,707,561	5.49
純資産総額	83,352,324,208	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	45,851,676,676	97.94
内 アメリカ	19,660,805,359	42.00
内 イギリス	6,852,962,043	14.64
内 カナダ	3,905,756,542	8.34
内 オーストラリア	3,873,599,836	8.27
内 フランス	3,053,438,861	6.52
内 スイス	2,274,692,135	4.86
内 ドイツ	1,472,731,001	3.15
内 スペイン	881,949,328	1.88
内 イタリア	752,850,909	1.61
内 アイルランド	623,418,624	1.33
内 シンガポール	513,908,444	1.10
内 フィンランド	440,516,260	0.94
内 スウェーデン	368,381,804	0.79
内 ジョージア	336,768,338	0.72
内 デンマーク	301,197,312	0.64
内 バミューダ	285,352,830	0.61
内 香港	253,347,050	0.54
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	962,104,667	2.06
純資産総額	46,813,781,343	100.00

## その他資産の投資状況

平成27年2月27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）	663,191,000	1.42
-	663,191,000	1.42
為替予約取引（売建）	954,080,000	2.04
-	954,080,000	2.04

（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27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	16,810,530,802	98.27
内 タイ	2,272,765,703	13.29
内 アメリカ	2,246,239,580	13.13
内 メキシコ	2,100,476,203	12.28
内 マレーシア	1,889,926,746	11.05
内 ニュージーランド	1,541,419,355	9.01
内 スウェーデン	1,518,541,752	8.88
内 カナダ	1,503,685,373	8.79
内 ポーランド	1,459,165,827	8.53
内 オーストラリア	1,367,729,543	8.00
内 ノルウェー	910,580,720	5.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	295,327,324	1.73
純資産総額	17,105,858,126	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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



## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年2月27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	104,479,030	2.4029 251,063,109	2.4574 256,746,768	- -	33.35%
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	178,086,462	1.4146 251,938,917	1.4214 253,132,097	- -	32.88%
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	63,932,824	2.3527 150,421,148	2.3686 151,431,286	- -	19.67%
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	34,768,999	2.9001 100,837,050	2.8307 98,420,605	- -	12.78%

(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27年2月27日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.67%
合計	98.67%

(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27年2月27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	CORPORATE OFFICE PROPERTIES アメリカ	投資証券	932,380	3,413.11 3,182,322,420	3,545.89 3,306,123,538	- -	6.07%
2	ACADIA REALTY TRUST アメリカ	投資証券	644,530	3,869.99 2,494,329,263	4,087.38 2,634,440,900	- -	4.83%
3	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	145,900	15,851.52 2,312,738,094	16,248.15 2,370,605,391	- -	4.35%
4	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	116,000	19,669.64 2,281,678,561	19,826.25 2,299,845,243	- -	4.22%
5	DCT INDUSTRIAL TRUST INC アメリカ	投資証券	493,107	4,164.71 2,053,647,705	4,268.67 2,104,912,684	- -	3.86%

6	LIBERTY PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	438,250	4,371.33 1,915,739,004	4,421.33 1,937,651,772	- -	3.56%
7	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	67,006	24,542.87 1,644,519,904	26,279.95 1,760,914,450	- -	3.23%
8	KITE REALTY GROUP TRUST アメリカ	投資証券	507,622	3,350.82 1,700,951,562	3,355.06 1,703,104,856	- -	3.13%
9	POST PROPERTIES, INC アメリカ	投資証券	246,750	6,951.14 1,715,194,206	6,710.13 1,655,724,626	- -	3.04%
10	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	124,246	12,336.78 1,532,795,733	13,045.75 1,620,882,577	- -	2.97%
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	140,694	10,740.67 1,511,148,992	11,335.42 1,594,825,694	- -	2.93%
12	BRANDYWINE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	782,240	1,878.51 1,469,453,426	1,880.88 1,471,305,750	- -	2.70%
13	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	87,420	16,102.47 1,407,678,456	16,765.78 1,465,664,828	- -	2.69%
14	TERRENO REALTY CORP アメリカ	投資証券	558,043	2,494.28 1,391,918,050	2,612.01 1,457,615,570	- -	2.67%
15	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	267,520	5,245.36 1,403,239,813	5,060.62 1,353,818,694	- -	2.48%
16	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	508,050	2,813.00 1,429,149,157	2,518.98 1,279,769,008	- -	2.35%
17	DDR CORP アメリカ	投資証券	555,940	2,303.54 1,280,631,341	2,239.89 1,245,244,780	- -	2.29%
18	CYRUSONE INC アメリカ	投資証券	346,658	3,368.59 1,167,750,658	3,554.24 1,232,107,809	- -	2.26%
19	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	333,680	3,273.33 1,092,246,328	3,427.81 1,143,794,910	- -	2.10%
20	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES アメリカ	投資証券	231,554	4,899.42 1,134,482,548	4,891.26 1,132,591,443	- -	2.08%
21	FIRST INDUSTRIAL RT アメリカ	投資証券	413,290	2,559.80 1,057,940,067	2,539.25 1,049,450,062	- -	1.93%
22	LASALLE HOTEL PROPERTIES アメリカ	投資証券	218,720	4,875.75 1,066,425,702	4,593.08 1,004,600,141	- -	1.84%
23	COUSINS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	760,140	1,353.38 1,028,758,688	1,252.33 951,949,926	- -	1.75%
24	HIGHWOODS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	175,370	5,303.32 930,044,613	5,394.58 946,047,862	- -	1.74%
25	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES アメリカ	投資証券	425,600	2,173.55 925,065,601	2,214.84 942,637,563	- -	1.73%
26	CEDAR REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	994,860	875.48 870,980,446	888.56 883,994,293	- -	1.62%
27	EDUCATION REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	203,643	4,247.38 864,951,228	4,107.65 836,495,961	- -	1.54%
28	SL GREEN アメリカ	投資証券	50,530	14,479.46 731,647,364	14,999.39 757,919,439	- -	1.39%

29	CATCHMARK TIMBER TRUST INC アメリカ	投資証券	525,430	1,343.01 705,662,562	1,410.96 741,362,867	- -	1.36%
30	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	367,600	2,031.97 746,952,381	1,965.56 722,543,384	- -	1.33%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
投資証券	91.46%
合計	91.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

平成27年2月27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	NOVION PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	23,503,224	204.04 4,795,651,882	229.19 5,386,896,634	- -	6.46%
2	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	23,965,870	170.03 4,075,042,697	191.93 4,599,774,222	- -	5.52%
3	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	10,615,791	387.58 4,114,544,709	411.81 4,371,703,753	- -	5.24%
4	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	11,274,972	325.16 3,666,207,102	358.70 4,044,383,193	- -	4.85%
5	ALLIED PROPERTIES REIT カナダ	投資証券	950,022	3,535.31 3,358,623,226	3,816.79 3,626,043,969	- -	4.35%
6	WAREHOUSES DE PAUW ベルギー	投資証券	330,312	7,958.85 2,628,906,138	9,642.84 3,185,148,243	- -	3.82%
7	FEDERATION CENTRES オーストラリア	投資信託受益 証券	11,467,852	259.94 2,981,002,760	273.91 3,141,271,726	- -	3.77%
8	GOODMAN PROPERTY TRUST ニュージーランド	投資証券	26,401,917	99.47 2,626,254,127	106.67 2,816,390,173	- -	3.38%
9	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	2,211,954	1,136.81 2,514,573,638	1,237.06 2,736,328,110	- -	3.28%
10	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	1,778,892	1,419.17 2,524,557,719	1,518.50 2,701,260,398	- -	3.24%
11	CHARTER HALL GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,908,131	444.42 2,625,696,896	454.66 2,686,247,558	- -	3.22%
12	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV オランダ	投資証券	476,927	4,736.55 2,258,991,443	5,533.10 2,638,889,552	- -	3.17%
13	CALLOWAY REAL ESTATE INV TR カナダ	投資証券	917,649	2,560.11 2,349,290,273	2,859.73 2,624,235,165	- -	3.15%
14	KLEPIERRE フランス	投資証券	393,730	4,744.59 1,868,088,526	5,980.83 2,354,835,148	- -	2.83%

15	MAPLETREE LOGISTICS TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	19,701,320	101.67 2,003,148,122	108.49 2,137,489,788	- -	2.56%
16	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,361,067	1,400.76 1,906,535,832	1,456.10 1,981,862,180	- -	2.38%
17	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,717,963	657.78 1,787,822,245	710.88 1,932,164,834	- -	2.32%
18	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA オーストラリア	投資信託受益 証券	10,362,271	170.96 1,771,605,867	184.94 1,916,423,785	- -	2.30%
19	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	12,519,840	130.87 1,638,473,276	136.60 1,710,294,652	- -	2.05%
20	ASCOTT RESIDENCE TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	14,377,600	109.27 1,571,110,198	113.76 1,635,678,447	- -	1.96%
21	FRASERS CENTREPOINT TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	8,667,000	167.79 1,454,266,264	180.09 1,560,861,697	- -	1.87%
22	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST カナダ	投資証券	3,200,000	420.80 1,346,567,040	480.91 1,538,933,760	- -	1.85%
23	SEGR0 PLC イギリス	投資証券	1,925,876	707.65 1,362,857,032	790.98 1,523,339,027	- -	1.83%
24	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券	827,220	1,403.32 1,160,858,506	1,661.26 1,374,235,355	- -	1.65%
25	ASCENDAS REAL ESTATE INV シンガポール	投資信託受益 証券	6,043,000	201.17 1,215,709,589	216.98 1,311,267,548	- -	1.57%
26	CROMBIE REAL ESTATE INV カナダ	投資証券	992,261	1,189.88 1,180,678,861	1,273.85 1,263,998,620	- -	1.52%
27	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	532,772	2,170.60 1,156,440,230	2,286.49 1,218,182,378	- -	1.46%
28	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	847,500	1,171.75 993,064,566	1,260.49 1,068,272,224	- -	1.28%
29	ICADE フランス	投資証券	96,588	8,832.92 853,154,897	10,730.75 1,036,462,501	- -	1.24%
30	COFINIMMO SA ベルギー	投資証券	57,159	12,589.82 719,622,092	14,815.10 846,816,443	- -	1.02%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	48.96%
投資証券	45.55%
合計	94.51%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成27年2月27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	ALTRIA GROUP INC アメリカ	株式 タバコ	134,850	5,100.95 687,863,149	6,689.85 902,126,852	- -	1.93%
2	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	121,349	6,814.82 826,971,878	7,032.15 853,345,486	- -	1.82%
3	REYNOLDS AMERICAN INC アメリカ	株式 タバコ	91,710	7,324.04 671,688,392	9,020.39 827,259,976	- -	1.77%
4	WESTPAC BANKING CORPORATION オーストラリア	株式 商業銀行	221,179	3,185.48 704,561,789	3,510.64 776,481,083	- -	1.66%
5	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	21,960	33,576.83 737,347,406	32,400.90 711,523,764	- -	1.52%
6	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CO LLC アメリカ	株式 運送インフラ	74,122	8,261.28 612,342,721	9,419.94 698,225,133	- -	1.49%
7	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	56,754	10,095.56 572,963,979	12,278.56 696,857,678	- -	1.49%
8	CONOCOPHILLIPS アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	88,619	8,704.07 771,346,796	7,853.92 696,007,378	- -	1.49%
9	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	164,260	4,507.87 740,462,751	4,031.26 662,175,465	- -	1.41%
10	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	221,352	2,993.78 662,680,574	2,858.58 632,753,064	- -	1.35%
11	BCE INC カナダ	株式 各種電気通信 サービス	116,609	4,997.97 582,808,938	5,252.87 612,532,034	- -	1.31%
12	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	143,203	3,503.14 501,661,281	4,125.54 590,791,036	- -	1.26%
13	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 タバコ	83,927	6,466.76 542,735,958	6,980.90 585,886,204	- -	1.25%
14	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC アメリカ	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	294,553	1,936.05 570,271,312	1,971.53 580,720,989	- -	1.24%
15	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品	76,817	6,745.96 518,204,831	7,218.22 554,482,036	- -	1.18%
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	59,276	8,757.00 519,079,932	9,332.45 553,190,898	- -	1.18%
17	LOCKHEED MARTIN CORP アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	21,934	19,836.08 435,084,744	24,012.62 526,693,006	- -	1.13%
18	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	41,291	12,132.58 500,966,416	12,260.95 506,267,134	- -	1.08%

19	SANOFI フランス	株式 医薬品	41,679	10,372.57 432,318,615	11,699.72 487,632,671	- -	1.04%
20	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO アメリカ	株式 医薬品	65,940	6,233.09 411,010,134	7,330.33 483,362,237	- -	1.03%
21	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA オーストラリア	株式 商業銀行	56,319	7,757.69 436,905,548	8,424.43 474,455,552	- -	1.01%
22	ALLIANZ SE ドイツ	株式 保険	23,110	16,278.56 376,197,752	19,920.53 460,363,506	- -	0.98%
23	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	54,201	7,431.12 402,774,414	8,352.47 452,712,665	- -	0.97%
24	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品	53,936	8,354.44 450,605,485	8,213.36 442,996,189	- -	0.95%
25	ORANGE フランス	株式 各種電気通信 サービス	199,656	1,577.37 314,931,933	2,198.54 438,952,201	- -	0.94%
26	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	144,194	2,546.78 367,231,514	2,994.70 431,818,636	- -	0.92%
27	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	397,124	1,168.39 463,998,134	1,069.85 424,864,381	- -	0.91%
28	BT GROUP PLC イギリス	株式 各種電気通信 サービス	497,307	721.54 358,831,483	830.71 413,121,975	- -	0.88%
29	VALERO ENERGY CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	55,781	6,641.94 370,494,217	7,391.16 412,286,401	- -	0.88%
30	CRH PLC アイルランド	株式 建設資材	120,437	2,378.31 286,436,593	3,354.61 404,019,766	- -	0.86%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
株式	97.94%
合計	97.94%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

平成27年2月27日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品	外国	13.70%
商業銀行		12.40%
各種電気通信サービス		7.62%
タバコ		7.45%
石油・ガス・消耗燃料		7.38%
保険		5.32%
電力		4.25%
総合公益事業		4.17%
メディア		3.01%
航空宇宙・防衛		2.73%
ホテル・レストラン・レジャー		2.48%

食品	2.15%
自動車	2.04%
建設・土木	1.61%
運送インフラ	1.49%
無線通信サービス	1.25%
貯蓄・抵当・不動産金融	1.24%
各種金融サービス	1.22%
金属・鉱業	1.08%
家庭用耐久財	1.04%
飲料	1.00%
化学	0.99%
家庭用品	0.97%
建設資材	0.86%
商社・流通業	0.72%
通信機器	0.71%
ガス	0.59%
情報技術サービス	0.59%
商業サービス・用品	0.58%
資本市場	0.54%
コングロマリット	0.54%
水道	0.53%
各種消費者サービス	0.53%
ソフトウェア	0.52%
専門小売り	0.51%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.50%
容器・包装	0.50%
食品・生活必需品小売り	0.50%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.49%
コンピュータ・周辺機器	0.47%
航空貨物・物流サービス	0.43%
半導体・半導体製造装置	0.42%
機械	0.42%
紙製品・林産品	0.41%
合計	97.94%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年2月27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	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	2,099,152,000	107.20 2,250,418,876	107.00 2,246,239,580	3.125000 2019/5/15	13.13%
2	MALAYSIA 4.24 02/07/18 マレーシア	国債証券	1,854,160,000	102.39 1,898,511,507	101.92 1,889,926,746	4.240000 2018/2/7	11.05%
3	THAILAND 3.25 06/16/17 タイ	国債証券	1,524,624,000	102.52 1,563,181,740	102.63 1,564,752,103	3.250000 2017/6/16	9.15%
4	SWEDEN 4.25 03/12/19 スウェーデン	国債証券	1,292,200,000	114.60 1,480,915,586	117.51 1,518,541,752	4.250000 2019/3/12	8.88%
5	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 メキシコ	国債証券	1,138,280,000	114.52 1,303,568,138	113.54 1,292,448,643	8.000000 2020/6/11	7.56%
6	CANADA 4.25 06/01/18 カナダ	国債証券	1,149,811,000	111.08 1,277,244,553	111.99 1,287,730,829	4.250000 2018/6/1	7.53%
7	NEW ZEALAND 5.0 03/15/19 ニュージーランド	国債証券	898,399,600	105.97 952,121,931	106.91 960,541,900	5.000000 2019/3/15	5.62%
8	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18 メキシコ	国債証券	716,400,000	114.20 818,193,276	112.79 808,027,560	8.500000 2018/12/13	4.72%
9	POLAND 5.5 10/25/19 ポーランド	国債証券	547,740,000	109.83 601,610,229	116.41 637,624,134	5.500000 2019/10/25	3.73%
10	POLAND 3.75 04/25/18 ポーランド	国債証券	576,738,000	102.44 590,816,206	106.21 612,611,103	3.750000 2018/4/25	3.58%
11	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17 ニュージーランド	国債証券	540,120,000	106.96 577,728,555	107.54 580,877,455	6.000000 2017/12/15	3.40%
12	NORWAY 4.5 05/22/19 ノルウェー	国債証券	498,880,000	112.44 560,946,908	115.25 574,959,200	4.500000 2019/5/22	3.36%
13	THAILAND 3.65 12/17/21 タイ	国債証券	478,400,000	107.93 516,380,974	107.09 512,318,560	3.650000 2021/12/17	2.99%
14	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19 オーストラリア	国債証券	437,899,000	109.78 480,763,815	113.25 495,924,996	5.250000 2019/3/15	2.90%
15	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20 オーストラリア	国債証券	391,314,000	109.45 428,324,478	112.36 439,703,889	4.500000 2020/4/15	2.57%
16	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18 オーストラリア	国債証券	391,314,000	108.65 425,182,226	110.42 432,100,658	5.500000 2018/1/21	2.53%
17	NORWAY 4.25 05/19/17 ノルウェー	国債証券	311,800,000	107.44 334,997,920	107.64 335,621,520	4.250000 2017/5/19	1.96%
18	CANADA 3.75 06/01/19 カナダ	国債証券	190,840,000	110.18 210,267,512	113.16 215,954,544	3.750000 2019/6/1	1.26%
19	POLAND 5.25 10/25/20 ポーランド	国債証券	177,210,000	114.68 203,236,671	117.90 208,930,590	5.250000 2020/10/25	1.22%
20	THAILAND 3.875 06/13/19 タイ	国債証券	184,000,000	103.60 190,627,282	106.35 195,695,040	3.875000 2019/6/13	1.14%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。



## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
国債証券	98.27%
合計	98.27%

（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

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成27年2月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	オーストラリア・ドル 買/円売2015年0 3月	買建	4,150,000	386,780,000	386,531,000	0.83%
		カナダ・ドル買/円売 2015年03月	買建	2,900,000	276,718,000	276,660,000	0.59%
		アメリカ・ドル売/円 買2015年03月	売建	8,000,000	953,920,000	954,080,000	2.04%

（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27年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成20年2月8日)	1,578	1,583	0.9077	0.9107
第2特定期間末 (平成20年8月8日)	1,568	1,573	0.8930	0.8960
第3特定期間末 (平成21年2月9日)	811	816	0.4861	0.4891
第4特定期間末 (平成21年8月10日)	1,015	1,020	0.6107	0.6137
第5特定期間末 (平成22年2月8日)	941	946	0.5723	0.5753
第6特定期間末 (平成22年8月9日)	921	926	0.5760	0.5790
第7特定期間末 (平成23年2月8日)	915	920	0.5958	0.5988
第8特定期間末 (平成23年8月8日)	808	812	0.5483	0.5513
第9特定期間末 (平成24年2月8日)	755	759	0.5519	0.5549
第10特定期間末 (平成24年8月8日)	745	749	0.5648	0.5678
第11特定期間末 (平成25年2月8日)	876	879	0.6899	0.6929
第12特定期間末 (平成25年8月8日)	816	820	0.6912	0.6942
第13特定期間末 (平成26年2月10日)	813	817	0.7307	0.7337
第14特定期間末 (平成26年8月8日)	787	790	0.7552	0.7582
第15特定期間末 (平成27年2月9日)	770	773	0.8462	0.8492
平成26年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	-
9月末日	798	-	0.7843	-
10月末日	801	-	0.7931	-
11月末日	807	-	0.8593	-
12月末日	801	-	0.8628	-

平成27年1月末日	775	-	0.8445	-
2月末日	769	-	0.8518	-

## 【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
第15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
第15特定期間	14.4

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配額の額）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（分配額の額。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
第15特定期間	25,135,896	157,461,542

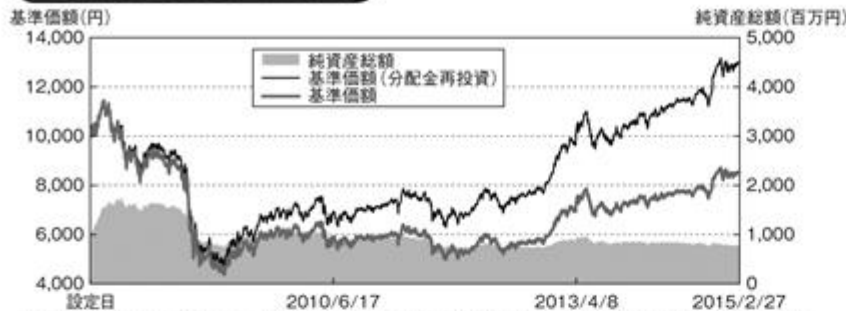
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2015年2月27日

## 基準価額・純資産の推移 《設定日(2007年8月20日)～2015年2月27日》



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2007年8月20日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第85期(2014.10.08)	30円
第86期(2014.11.10)	30円
第87期(2014.12.08)	30円
第88期(2015.01.08)	30円
第89期(2015.02.09)	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	2,760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	33.35%
2	高金利ソブリン・マザーファンド	32.88%
3	DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	19.67%
4	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	12.78%

## ■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(%)	組入上位10銘柄						
国債証券		98.27	順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
内 タイ		13.29	1	US T N/B 3.125 05/15/19	国債証券	アメリカ	3.125000	2019/5/15	13.13%
内 アメリカ		13.13	2	MALAYSIA 4.24 02/07/18	国債証券	マレーシア	4.240000	2018/2/7	11.05%
内 メキシコ		12.28	3	THAILAND 3.25 06/16/17	国債証券	タイ	3.250000	2017/6/16	9.15%
内 マレーシア		11.05	4	SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	スウェーデン	4.250000	2019/3/12	8.88%
内 ニューゼaland		9.01	5	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	メキシコ	8.000000	2020/6/11	7.56%
内 その他		39.51	6	CANADA 4.25 06/01/18	国債証券	カナダ	4.250000	2018/6/1	7.53%
コール・ローンその他の資産(負債控除後)		1.73	7	NEW ZEALAND 5.0 03/15/19	国債証券	ニュージーランド	5.000000	2019/3/15	5.62%
純資産総額		100.00	8	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	国債証券	メキシコ	8.500000	2018/12/13	4.72%
			9	POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	ポーランド	5.500000	2019/10/25	3.73%
			10	POLAND 3.75 04/25/18	国債証券	ポーランド	3.750000	2018/4/25	3.58%

## ■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(%)	組入上位10銘柄					組入上位5業種(外国株式)		
株式		97.94	順位	銘柄名	発行体の国/地域	業種	投資比率	順位	業種	投資比率
内 アメリカ		42.00	1	ALTRIA GROUP INC	アメリカ	タバコ	1.93%	1	医薬品	13.70%
内 イギリス		14.64	2	MERCK & CO.INC.	アメリカ	医薬品	1.82%	2	商業銀行	12.40%
内 カナダ		8.34	3	REYNOLDS AMERICAN INC	アメリカ	タバコ	1.77%	3	各種電気通信サービス	7.62%
内 オーストラリア		8.27	4	WESTPAC BANKING CORPORATION	オーストラリア	商業銀行	1.66%	4	タバコ	7.45%
内 フランス		6.52	5	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	医薬品	1.52%	5	石油・ガス・消耗燃料	7.38%
内 その他		18.17	6	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CO LLC	アメリカ	運送インフラ	1.49%			
コール・ローンその他の資産(負債控除後)		2.06	7	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス	医薬品	1.49%			
純資産総額		100.00	8	CONOCOPHILLIPS	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.49%			
			9	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	イギリス	石油・ガス・消耗燃料	1.41%			
			10	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	医薬品	1.35%			

## 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)	1.42
為替予約取引(売建)	△2.04

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2015年2月27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	91.46
内 アメリカ	91.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8.54
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	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	アメリカ	6.07%
2	ACADIA REALTY TRUST	アメリカ	4.83%
3	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	4.35%
4	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	4.22%
5	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	アメリカ	3.86%
6	LIBERTY PROPERTY TRUST	アメリカ	3.56%
7	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	3.23%
8	KITE REALTY GROUP TRUST	アメリカ	3.13%
9	POST PROPERTIES, INC	アメリカ	3.04%
10	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	2.97%

### ■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。

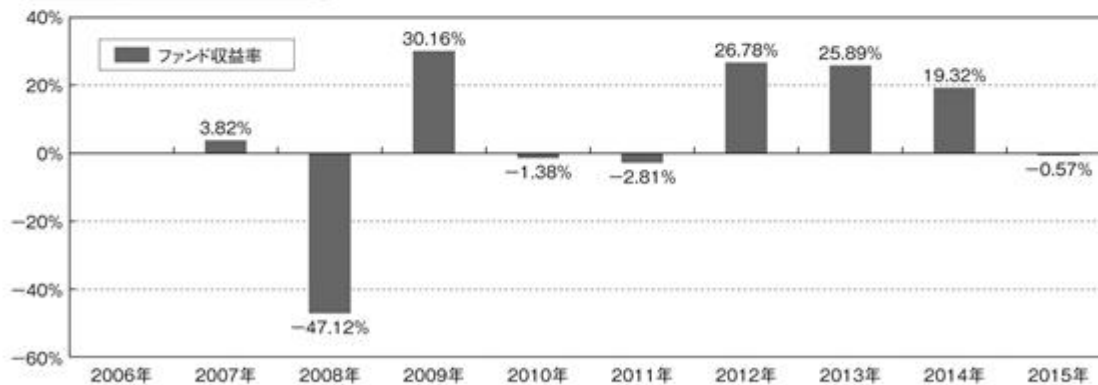
#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	48.96
内 オーストラリア	36.76
内 シンガポール	12.20
投資証券	45.55
内 カナダ	15.47
内 イギリス	9.81
内 ベルギー	5.63
内 フランス	4.92
内 オランダ	4.68
内 その他	5.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5.49
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	NOVION PROPERTY GROUP	オーストラリア	6.46%
2	MIRVAC GROUP	オーストラリア	5.52%
3	CHARTER HALL RETAIL REIT	オーストラリア	5.24%
4	SCENTRE GROUP	オーストラリア	4.85%
5	ALLIED PROPERTIES REIT	カナダ	4.35%
6	WAREHOUSES DE PAUW	ベルギー	3.82%
7	FEDERATION CENTRES	オーストラリア	3.77%
8	GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド	3.38%
9	HAMMERSON PLC	イギリス	3.28%
10	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	3.24%

## 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2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 3【資産管理等の概要】

#### (5)【その他】

<訂正前>

(略)

#### 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/>)

<訂正後>

(略)

#### 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とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

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

## 第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6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8月9日から平成27年2月9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8月8日現在	当 期 平成27年2月9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	16,060,627	14,382,249
親投資信託受益証券	779,528,045	759,155,115
未収入金	-	5,000,000
流動資産合計	795,588,672	778,537,364
資産合計	795,588,672	778,537,364
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,129,446	2,732,469
未払解約金	3,811,006	4,214,144
未払受託者報酬	44,773	44,086
未払委託者報酬	850,844	837,731
その他未払費用	5,299	5,219
流動負債合計	7,841,368	7,833,649
負債合計	7,841,368	7,833,649
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,043,148,731	1,910,823,085
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 255,401,427	2 140,119,370
（分配準備積立金）	27,775,668	19,825,755
元本等合計	787,747,304	770,703,715
純資産合計	787,747,304	770,703,715
負債純資産合計	795,588,672	778,537,364



## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	前 期 自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8日	当 期 自 平成26年8月9日 至 平成27年2月9日
<b>営業収益</b>		
受取利息	3,418	2,796
有価証券売買等損益	52,625,276	114,627,070
<b>営業収益合計</b>	<b>52,628,694</b>	<b>114,629,866</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	261,299	261,543
委託者報酬	24,965,653	24,970,130
その他費用	30,939	30,969
<b>営業費用合計</b>	<b>5,257,891</b>	<b>5,262,642</b>
営業利益又は営業損失（ ）	47,370,803	109,367,224
経常利益又は経常損失（ ）	47,370,803	109,367,224
当期純利益又は当期純損失（ ）	47,370,803	109,367,224
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（ ）	121,808	2,487,459
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	299,903,540	255,401,427
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,988,837	30,108,254
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,988,837	30,108,254
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,492,301	4,294,119
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,492,301	4,294,119
分配金	19,487,034	17,411,843
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	255,401,427	140,119,370

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	前 期 平成26年8月8日現在	当 期 平成27年2月9日現在
1. 1 期首元本額	1,113,772,419円	1,043,148,731円
期中追加設定元本額	23,023,495円	25,135,896円
期中一部解約元本額	93,647,183円	157,461,542円
2. 受益権の総数	1,043,148,731口	910,823,085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255,401,427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140,119,370円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 平成26年2月11日 至 平成26年8月8日	当 期 自 平成26年8月9日 至 平成27年2月9日
1. 1 分配金の計算過程	(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26年8月9日 至平成26年9月8日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,457,578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(35,521,777円)及び分配準備積立金(27,459,506円)より分配対象収益は65,438,861円(1万口当たり633.64円)であり、うち3,098,214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。

(自平成26年9月9日 至平成26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(1,582,852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(35,063,845円)及び分配準備積立金

(26,282,803円)より分配対象収益は62,929,500円(1万口当たり619.26円)であり、うち3,048,608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10月9日 至平成26年11月10日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,278,435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(34,074,027円)及び分配準備積立金

(24,027,790円)より分配対象収益は60,380,252円(1万口当たり612.39円)であり、うち2,957,928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11月11日 至平成26年12月8日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,262,364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(32,432,546円)及び分配準備積立金

(21,878,380円)より分配対象収益は56,573,290円(1万口当たり606.76円)であり、うち2,797,137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26年6月10日 至平成26年7月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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)</p> <p>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>	<p>(自平成26年12月9日 至平成27年1月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,049,342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(32,292,252円)及び分配準備積立金(21,110,210円)より分配対象収益は56,451,804円(1万口当たり609.74円)であり、うち2,777,487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27年1月9日 至平成27年2月9日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,639,235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(31,888,872円)及び分配準備積立金(20,918,989円)より分配対象収益は54,447,096円(1万口当たり597.78円)であり、うち2,732,469円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
	1,054,607円	1,051,656円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成26年8月8日現在	当 期 平成27年2月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前 期 平成26年8月8日現在	当 期 平成27年2月9日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	14,089,394	6,641,464
合計	14,089,394	6,641,464

## (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8月8日現在	当 期 平成27年2月9日現在
1口当たり純資産額	0.7552円	0.8462円
(1万口当たり純資産額)	(7,552円)	(8,462円)

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## （１）株式

該当事項はありません。

## （２）株式以外の有価証券

平成27年2月9日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	D I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マ ザーファンド	34,768,999	100,837,050	
	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	63,932,824	150,421,148	
	D I A M 世界好配当株オープン ・ マザー ファンド	106,516,022	255,958,000	
	高金利ソブリン ・ マザーファンド	178,086,462	251,938,917	
親投資信託受益証券 合計		383,304,307	759,155,115	
合計		383,304,307	759,155,115	

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8月8日現在	平成27年2月9日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,027,505,800	2,543,815,051
コール・ローン		1,340,822,320	2,441,167,517
投資証券		47,013,412,326	52,265,279,208
派生商品評価勘定		400,000	-
未収入金		2,660,340,753	522,310,752
未収配当金		34,652,031	33,087,938
流動資産合計		54,077,133,230	57,805,660,466
資産合計		54,077,133,230	57,805,660,466
負債の部			
流動負債			
未払金		1,287,943,445	1,762,452,372
未払解約金		500,500,000	2,600,000
流動負債合計		1,788,443,445	1,765,052,372
負債合計		1,788,443,445	1,765,052,372
純資産の部			
元本等			
元本	1	24,374,446,753	19,323,197,729
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		27,914,243,032	36,717,410,365
元本等合計		52,288,689,785	56,040,608,094
純資産合計		52,288,689,785	56,040,608,094
負債純資産合計		54,077,133,230	57,805,660,466

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準  外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	27,589,763,927円	24,374,446,753円
	同期中追加設定元本額	35,030,088円	37,362,647円
	同期中一部解約元本額	3,250,347,262円	5,088,611,671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	28,864,897円	18,914,518円
	D I A M世界6資産バランスファンド	123,374,111円	74,652,429円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	175,656,129円	95,144,236円
	D I A M資産形成ファンド(隔月決算型)	3,366,182円	2,153,576円
	D I A M資産形成ファンド(1年決算型)	1,101,189円	837,304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)	22,373,463,206円	17,842,293,180円
	D I A M世界インカム・オープン(毎月決算コース)	425,475,507円	300,657,687円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド(毎月決算型)	762,347,134円	619,869,621円
	D I A M世界3資産オープン(毎月決算型)	322,625,589円	215,519,017円
	D I A Mインカム3資産ファンド(毎月決算型)	49,128,322円	34,768,999円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	109,044,487円	118,387,162円
	計	24,374,446,753円	19,323,197,729円
2 .	受益権の総数	24,374,446,753口	19,323,197,729口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	5,119,123,488	1,947,232,571
合計	5,119,123,488	1,947,232,571

（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8月8日まで及び平成26年12月10日から平成27年2月9日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成26年8月8日 現在				平成27年2月9日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	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

- 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。
- 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。
- 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8月8日現在	平成27年2月9日現在
1口当たり純資産額	2.1452円	2.9002円
(1万口当たり純資産額)	(21,452円)	(29,002円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成27年2月9日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	644,530.000	22,835,697.900	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	140,694.000	13,263,223.380	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	166,154.000	7,302,468.300	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	367,600.000	6,098,484.000	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	314,050.000	5,464,470.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	125,680.000	4,907,804.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	116,000.000	19,622,560.000	
		BIOMED REALTY TRUST INC	289,810.000	6,630,852.800	
		BOSTON PROPERTIES INC	145,900.000	20,564,605.000	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	782,240.000	12,891,315.200	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	64,200.000	4,827,198.000	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	358,500.000	2,652,900.000	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	525,430.000	6,110,750.900	
		CBL & ASSOCIATES	84,130.000	1,717,093.300	
		CEDAR REALTY TRUST INC	836,140.000	6,471,723.600	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	932,380.000	28,036,666.600	
		COUSINS PROPERTIES INC	760,140.000	8,543,973.600	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	65,970.000	5,716,960.200	
		CYRUSONE INC	346,658.000	9,786,155.340	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	493,107.000	18,215,372.580	
		DDR CORP	555,940.000	10,952,018.000	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	330,900.000	4,791,432.000	
		EAST GROUP	74,360.000	4,621,474.000	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	203,643.000	7,182,488.610	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	67,006.000	14,989,242.200			
FEDERAL REALTY INVS TRUST	87,420.000	12,439,866.000			
FIRST INDUSTRIAL RT	413,290.000	8,968,393.000			
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	333,680.000	9,913,632.800			



	HIGHWOODS PROPERTIES INC	175,370.000	8,240,636.300	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	508,050.000	11,766,438.000	
	KITE REALTY GROUP TRUST	507,622.000	15,035,763.640	
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	218,720.000	8,993,766.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	438,250.000	17,069,837.500	
	NATIONAL HEALTH INVS INC	41,600.000	2,991,872.000	
	PARAMOUNT GROUP INC	126,900.000	2,360,340.000	
	POST PROPERTIES, INC	246,750.000	14,326,305.000	
	PROLOGIS INC	267,520.000	11,942,092.800	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	425,600.000	8,299,200.000	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	348,350.000	6,103,092.000	
	SL GREEN	50,530.000	6,446,617.400	
	TAUBMAN CENTERS INC	58,540.000	4,730,617.400	
	TERRENO REALTY CORP	558,043.000	12,466,680.620	
	UDR INC	166,660.000	5,399,784.000	
	URBAN EDGE PROPERTIES	60,523.000	1,462,235.680	
	VORNADO REALTY TRUST	124,246.000	13,995,069.440	
	WP GLIMCHER INC	139,200.000	2,387,280.000	
	アメリカ・ドル 小計	14,088,026.000	439,536,449.490 (52,265,279,208)	
投資証券 合計		14,088,026	52,265,279,208 (52,265,279,208)	
合計			52,265,279,208 (52,265,279,208)	

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 46銘柄	93.26%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,067,911,502	3,207,441,049
コール・ローン		1,201,301,192	1,250,242,369
投資信託受益証券		40,137,016,941	40,737,156,388
投資証券		35,356,023,888	37,535,034,764
未収入金		612,348,484	479,625,894
未収配当金		1,114,485,417	863,659,836
流動資産合計		79,489,087,424	84,073,160,300
資産合計		79,489,087,424	84,073,160,300
負債の部			
流動負債			
未払金		-	6,181,953
未払解約金		500,000	23,000,000
流動負債合計		500,000	29,181,953
負債合計		500,000	29,181,953
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,111,464,157	35,720,967,406
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		40,377,123,267	48,323,010,941
元本等合計		79,488,587,424	84,043,978,347
純資産合計		79,488,587,424	84,043,978,347
負債純資産合計		79,489,087,424	84,073,160,300

## 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8月8日現在	平成27年2月9日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	44,772,217,199円	39,111,464,157円
	同期中追加設定元本額	50,601,614円	77,305,853円
	同期中一部解約元本額	5,711,354,656円	3,467,802,604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	45,497,060円	36,356,512円
	D I A M世界6資産バランスファンド	197,732,196円	150,106,178円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	281,739,867円	198,776,346円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	5,426,319円	4,051,618円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	1,777,753円	1,497,935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）	35,940,733,719円	32,925,651,365円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	667,938,446円	578,040,843円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	1,214,214,197円	1,142,170,098円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	506,304,218円	405,529,280円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	76,798,172円	63,932,824円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	173,302,210円	214,854,407円
	計	39,111,464,157円	35,720,967,406円
2 .	受益権の総数	39,111,464,157口	35,720,967,406口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	3,827,716,299	3,359,715,917
投資証券	3,334,042,443	3,837,255,796
合計	7,161,758,742	7,196,971,713

(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8月8日まで及び平成26年12月10日から平成27年2月9日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
1口当たり純資産額	2.0324円	2.3528円
(1万口当たり純資産額)	(20,324円)	(23,528円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成27年2月9日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ALE PROPERTY GROUP	2,579,620.000	8,770,708.000	
		CHARTER HALL GROUP	5,908,131.000	28,713,516.660	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	10,615,791.000	47,027,954.130	
		DEXUS PROPERTY GROUP	2,717,963.000	21,906,781.780	
		FEDERATION CENTRES	11,467,852.000	34,288,877.480	
		GOODMAN GROUP	679,426.000	4,423,063.260	
		GPT GROUP	1,940,607.000	9,295,507.530	
		MIRVAC GROUP	23,965,870.000	49,849,009.600	
		NATIONAL STORAGE REIT	2,619,968.000	3,903,752.320	
		NOVION PROPERTY GROUP	23,503,224.000	58,523,027.760	
		SCENTRE GROUP	11,274,972.000	44,536,139.400	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	10,362,271.000	21,553,523.680		
	オーストラリア・ドル	小計	107,635,695.000	332,791,861.600 (30,670,097,965)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	6,043,000.000	15,167,930.000	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	14,377,600.000	18,259,552.000	
		CACHE LOGISTICS TRUST	5,662,000.000	6,567,920.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	8,667,000.000	17,507,340.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	4,528,000.000	6,950,480.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	12,519,840.000	19,343,152.800	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		19,701,320.000	23,937,103.800		
シンガポール・ドル	小計	74,351,760.000	114,580,678.600 (10,067,058,423)		
投資信託受益証券	合計		181,987,455	40,737,156,388 (40,737,156,388)	
投資証券	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,778,892.000	14,942,692.800	
		HAMMERSON PLC	2,211,954.000	15,494,737.770	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	532,772.000	6,936,691.440	
		SEGRO PLC	1,925,876.000	8,052,087.550	
	イギリス・ポンド	小計	6,449,494.000	45,426,209.560 (8,233,500,482)	



カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	950,022.000	36,480,844.800	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,361,067.000	21,028,485.150	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	917,649.000	28,474,648.470	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	992,261.000	13,226,839.130	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	847,500.000	10,941,225.000	
	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	325,212.000	8,032,736.400	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	3,200,000.000	15,808,000.000	
カナダ・ドル 小計		8,593,711.000	133,992,778.950 (12,727,974,072)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	26,401,917.000	31,814,309.980	
ニュージーランド・ドル 小計		26,401,917.000	31,814,309.980 (2,779,298,120)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	827,220.000	9,868,734.600	
	BEFIMMO	76,567.000	5,252,496.200	
	COFINIMMO SA	57,159.000	6,167,456.100	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	476,927.000	19,396,621.090	
	GECINA SA	45,322.000	5,404,648.500	
	ICADE	96,588.000	7,759,879.920	
	KLEPIERRE	393,730.000	16,798,490.450	
	VASTNED RETAIL	124,533.000	5,633,872.920	
	WAREHOUSES DE PAUW	330,312.000	22,626,372.000	
	WERELDHAVE NV	58,266.000	3,643,372.980	
ユーロ 小計		2,486,624.000	102,551,944.760 (13,794,262,090)	
投資証券 合計		43,931,746	37,535,034,764 (37,535,034,764)	
合計			78,272,191,152 (78,272,191,152)	

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	-%	9.80%	10.52%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 12銘柄	36.49%	-%	39.18%
カナダ・ドル	投資証券 7銘柄	-%	15.14%	16.26%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 8銘柄	11.98%	-%	12.86%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	3.31%	3.55%
ユーロ	投資証券 10銘柄	-%	16.41%	17.62%

(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8月8日現在	平成27年2月9日現在
資産の部			
流動資産			
預金		136,677,020	156,905,018
コール・ローン		954,558,893	765,223,821
株式		43,257,886,854	45,407,906,367
派生商品評価勘定		67,500	-
未収入金		2,063,102,039	-
未収配当金		74,557,873	64,952,904
流動資産合計		46,486,850,179	46,394,988,110
資産合計		46,486,850,179	46,394,988,110
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		548,548	-
未払金		2,056,515,626	-
未払解約金		500,000	-
流動負債合計		2,057,564,174	-
負債合計		2,057,564,174	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	21,617,827,271	19,307,458,751
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		22,811,458,734	27,087,529,359
元本等合計		44,429,286,005	46,394,988,110
純資産合計		44,429,286,005	46,394,988,110
負債純資産合計		46,486,850,179	46,394,988,110

## 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 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準  外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	22,846,747,219円	21,617,827,271円
	同期中追加設定元本額	1,296,266,734円	1,274,270,892円
	同期中一部解約元本額	2,525,186,682円	3,584,639,412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）	13,222,137,850円	10,723,702,121円
	D I A M世界好配当株式ファン ド（毎月決算型）	4,343,500,893円	5,148,791,760円
	世界6資産アクティブ・ balan ス・ファンド	73,663,494円	56,842,043円
	D I A M世界6資産バランス ファンド	320,943,973円	240,812,751円
	D I A Mグローバル・アクティ ブ・バランスファンド	471,005,705円	337,983,846円
	D I A M資産形成ファンド（隔 月決算型）	27,160,508円	19,552,239円
	D I A M資産形成ファンド（1 年決算型）	8,584,935円	7,421,777円
	D I A M世界インカム・オーブ ン（毎月決算コース）	1,076,803,879円	924,788,095円
	D I A M世界3資産オープン （毎月決算型）	832,521,315円	659,457,957円
	D I A Mインカム3資産ファン ド（毎月決算型）	124,612,325円	106,516,022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）	1,116,892,394円	1,081,590,140円
	計	21,617,827,271円	19,307,458,751円
2 .	受益権の総数	21,617,827,271口	19,307,458,751口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	879,680,545	2,804,528,558
合計	879,680,545	2,804,528,558

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月27日から平成26年8月8日まで及び平成26年5月27日から平成27年2月9日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成26年8月8日 現在				平成27年2月9日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,131,795,000	-	1,131,907,500	112,500	-	-	-	-
アメリカ・ドル	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	1,334,907,000	-	1,334,538,452	368,548	-	-	-	-
カナダ・ドル	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	2,466,702,000	-	2,466,445,952	481,048	-	-	-	-

## （注）時価の算定方法

- 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。
- 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8月8日現在	平成27年2月9日現在
1口当たり純資産額	2.0552円	2.4030円
（1万口当たり純資産額）	(20,552円)	(24,030円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成27年2月9日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,978	59.150	2,187,248.700	
	VALERO ENERGY CORP	35,687	54.860	1,957,788.820	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	35,643	66.790	2,380,595.970	
	VERIZON COMM INC	43,181	49.330	2,130,118.730	
	H&R BLOCK INC	59,824	35.380	2,116,573.120	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77,416	59.670	4,619,412.720	
	SEMPRA ENERGY	18,964	108.210	2,052,094.440	
	SEAGATE TECHNOLOGY	30,315	59.940	1,817,081.100	
	CENTURYLINK INC	56,198	38.560	2,166,994.880	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	38,361	51.935	1,992,278.530	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	292,606	7.930	2,320,365.580	
	CISCO SYSTEMS INC	53,689	27.240	1,462,488.360	
	CLOROX COMPANY	24,859	106.930	2,658,172.870	
	CONSOLIDATED EDISON INC	50,113	66.770	3,346,045.010	
	CMS ENERGY CORP	65,753	35.690	2,346,724.570	
	COVANTA HOLDING CORP	104,958	21.020	2,206,217.160	
	DTE ENERGY CO	26,396	85.250	2,250,259.000	
	DUKE ENERGY CORP	39,791	83.110	3,307,030.010	
	DARDEN RESTAURANTS INC	52,207	60.650	3,166,354.550	
	ENTERGY CORP	22,040	82.410	1,816,316.400	
	FORD MOTOR CO	127,231	15.860	2,017,883.660	
	GENERAL ELECTRIC CO	81,338	24.520	1,994,407.760	
	REYNOLDS AMERICAN INC	79,879	69.000	5,511,651.000	
	INTEL CORP	46,189	33.295	1,537,862.750	
	JOHNSON & JOHNSON	41,291	101.100	4,174,520.100	
	KLA-TENCOR CORP	25,123	62.610	1,572,951.030	
	KELLOGG CO	28,313	66.250	1,875,736.250	
	LEGGETT & PLATT INC	45,203	43.560	1,969,042.680	
	VECTOR GROUP LTD	100,846	22.380	2,256,933.480	
	ELI LILLY & CO	54,201	70.360	3,813,582.360	
	L BRANDS INC	28,559	92.960	2,654,844.640	
	LOCKHEED MARTIN CORP	21,934	195.240	4,282,394.160	
	SCANA CORP	34,882	60.470	2,109,314.540	
MERCK & CO. INC.	121,349	58.790	7,134,107.710		
MERCURY GENERAL CORP	34,037	60.200	2,049,027.400		
MICROSOFT CORP	46,335	42.410	1,965,067.350		
UIL HOLDINGS CORP	47,101	43.560	2,051,719.560		
XCEL ENERGY INC	52,132	35.710	1,861,633.720		
NORTHEAST UTILITIES	37,564	53.710	2,017,562.440		
WELLS FARGO & CO	37,814	54.450	2,058,972.300		

PPL CORPORATION	54,118	35.220	1,906,035.960	
PEPSICO INC	23,614	96.710	2,283,709.940	
PFIZER INC	143,203	33.170	4,750,043.510	
CONOCOPHILLIPS	88,619	67.490	5,980,896.310	
PG&E CORP	43,224	56.060	2,423,137.440	
ALTRIA GROUP INC	134,850	53.330	7,191,550.500	
COSTCO WHOLESALE CORP	13,307	148.700	1,978,750.900	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	294,553	15.980	4,706,956.940	
RAYTHEON COMPANY	21,698	107.450	2,331,450.100	
SOUTHERN CO	60,408	48.170	2,909,853.360	
AT&T INC	64,333	34.870	2,243,291.710	
SYMANTEC CORP	89,682	24.775	2,221,871.550	
REGAL ENTERTAINMENT GROUP-A	94,735	21.550	2,041,539.250	
TUPPERWARE BRANDS CORP	28,157	70.200	1,976,621.400	
TECO ENERGY INC	108,605	21.070	2,288,307.350	
CME GROUP INC	22,599	94.210	2,129,051.790	
ALLIANT ENERGY CORP	36,655	65.780	2,411,165.900	
WISCONSIN ENERGY CORP	38,109	53.430	2,036,163.870	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CO LLC	60,108	75.820	4,557,388.560	
PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO	62,534	37.550	2,348,151.700	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	36,836	81.270	2,993,661.720	
LORILLARD INC	35,191	66.030	2,323,661.730	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	65,827	41.410	2,725,896.070	
SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP	47,780	44.740	2,137,677.200	
TARGA RESOURCES CORP	10,912	94.420	1,030,311.040	
KRAFT FOODS GROUP INC	31,116	66.770	2,077,615.320	
ABBVIE INC	76,817	56.900	4,370,887.300	
NEW MEDIA INVESTMENT GROUP INC	86,716	23.240	2,015,279.840	
アメリカ・ドル 小計	4,130,606		183,600,303.670 (21,831,912,109)	
イギリス・ポンド				
BHP BILLITON PLC	76,752	15.050	1,155,117.600	
BT GROUP PLC	497,307	4.430	2,203,070.010	
BAE SYSTEMS PLC	405,737	5.175	2,099,688.970	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	83,927	36.280	3,044,871.560	
COBHAM PLC	324,509	3.360	1,090,350.240	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	43,243	30.440	1,316,316.920	
COMPASS GROUP PLC	99,340	11.300	1,122,542.000	
HSBC HOLDINGS PLC	517,380	6.208	3,211,895.040	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	142,275	9.935	1,413,502.120	

	PRUDENTIAL PLC	179,523	16.200	2,908,272.600	
	RIO TINTO PLC	47,059	30.285	1,425,181.810	
	VODAFONE GROUP PLC	880,732	2.314	2,038,013.840	
	REED ELSEVIER PLC	201,998	11.680	2,359,336.640	
	BP PLC	411,650	4.506	1,854,894.900	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	221,352	15.175	3,359,016.600	
	WOLSELEY PLC	45,999	38.240	1,759,001.760	
	ASTRAZENECA PLC	53,936	44.670	2,409,321.120	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	164,260	22.500	3,695,850.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	379,885	2.711	1,029,868.230	
	INFORMA PLC	261,593	5.200	1,360,283.600	
イギリス・ポンド	小計	5,038,457		40,856,395.560 (7,405,221,696)	
オーストラリア・ドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	72,402	34.900	2,526,829.800	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	221,179	36.960	8,174,775.840	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	191,482	13.330	2,552,455.060	
	TELSTRA CORP LTD	490,026	6.590	3,229,271.340	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	56,319	92.980	5,236,540.620	
	SUNCORP GROUP LTD	187,356	14.790	2,770,995.240	
	SONIC HEALTHCARE	129,490	19.240	2,491,387.600	
オーストラリア・ドル	小計	1,348,254		26,982,255.500 (2,486,684,667)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	30,545	77.790	2,376,095.550	
	BANK OF NOVA SCOTIA	36,609	65.130	2,384,344.170	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,172	47.800	2,446,021.600	
	BCE INC	116,609	56.740	6,616,394.660	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	237,390	10.150	2,409,508.500	
	ROGERS COMM-CL B	51,524	44.620	2,299,000.880	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	25,113	93.540	2,349,070.020	
	AGRIUM INC	20,812	131.310	2,732,823.720	
	FORTIS INC	70,601	40.000	2,824,040.000	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	42,068	46.050	1,937,231.400	
	VERESEN INC	131,406	15.660	2,057,817.960	
	ENBRIDGE INCOME FUND HOLDINGS INC	64,121	41.370	2,652,685.770	
	DH CORP	71,719	38.420	2,755,443.980	
カナダ・ドル	小計	949,689		35,840,478.210 (3,404,487,026)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE EXCHANGE LTD	340,000	8.140	2,767,600.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	713,000	4.150	2,958,950.000	
シンガポール・ドル	小計	1,053,000		5,726,550.000 (503,134,683)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	59,276	71.050	4,211,559.800	

	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	21,960	250.700	5,505,372.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	56,754	91.850	5,212,854.900	
	SWISSCOM AG-REG	4,618	540.500	2,496,029.000	
スイス・フラン 小計		142,608		17,425,815.700 (2,239,914,350)	
スウェーデン・ク ローナ	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	60,414	200.900	12,137,172.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	54,115	377.900	20,450,058.500	
スウェーデン・クローナ 小計		114,529		32,587,231.100 (460,457,576)	
ユーロ	CRH PLC	120,437	23.270	2,802,568.990	
	AXA	100,282	20.860	2,091,882.520	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,585	106.850	2,092,657.250	
	BNP PARIBAS	56,249	47.170	2,653,265.330	
	THALES SA	28,140	48.920	1,376,608.800	
	DEUTSCHE POST AG-REG	49,587	28.965	1,436,287.450	
	VINCI S.A.	53,264	49.405	2,631,507.920	
	SIEMENS AG-REG	17,816	95.300	1,697,864.800	
	UPM-KYMMENE OYJ	86,108	16.320	1,405,282.560	
	DAIMLER AG	15,863	82.350	1,306,318.050	
	ORANGE	199,656	15.970	3,188,506.320	
	SAMPO OYJ-A SHS	41,195	43.710	1,800,633.450	
	ALLIANZ SE	23,110	149.150	3,446,856.500	
	SANOFI	41,679	85.000	3,542,715.000	
	BANCO SANTANDER SA	338,357	6.141	2,077,850.330	
	ENEL SPA	381,766	3.900	1,488,887.400	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	178,798	15.895	2,841,994.210	
	ENAGAS	75,636	27.210	2,058,055.560	
	HERA SPA	751,537	2.142	1,609,792.250	
	FERROVIAL SA	146,625	18.195	2,667,841.870	
GDF SUEZ	127,482	19.010	2,423,432.820		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	67,433	30.880	2,082,331.040		
ユーロ 小計		2,920,605		48,723,140.420 (6,553,749,618)	
香港・ドル	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	279,000	63.650	17,758,350.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	599,000	27.200	16,292,800.000	
香港・ドル 小計		878,000		34,051,150.000 (522,344,642)	
合計		16,575,748		45,407,906,367 (45,407,906,367)	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式 68銘柄	47.06%	48.08%
イギリス・ポンド	株式 20銘柄	15.96%	16.31%
オーストラリア・ドル	株式 7銘柄	5.36%	5.48%
カナダ・ドル	株式 13銘柄	7.34%	7.50%
シンガポール・ドル	株式 2銘柄	1.08%	1.11%
スイス・フラン	株式 4銘柄	4.83%	4.93%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	0.99%	1.01%
ユーロ	株式 22銘柄	14.13%	14.43%
香港・ドル	株式 2銘柄	1.13%	1.15%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「高金利ソブリン・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
資産の部			
流動資産			
預金		41,134,545	3,133
コール・ローン		22,774,485	40,592,179
国債証券		17,108,477,249	16,829,064,733
派生商品評価勘定		558,292	-
未収入金		181,148,399	-
未収利息		161,287,343	199,939,799
前払費用		2,916,329	43,452,882
流動資産合計		17,518,296,642	17,113,052,726
資産合計		17,518,296,642	17,113,052,726
負債の部			
流動負債			
未払解約金		10,000,000	5,000,000
流動負債合計		10,000,000	5,000,000
負債合計		10,000,000	5,000,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	13,176,152,506	12,092,847,002
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,332,144,136	5,015,205,724
元本等合計		17,508,296,642	17,108,052,726
純資産合計		17,508,296,642	17,108,052,726
負債純資産合計		17,518,296,642	17,113,052,726

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2 . 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8月8日現在	平成27年2月9日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,082,497,792円	13,176,152,506円
	同期中追加設定元本額	373,609円	74,238,294円
	同期中一部解約元本額	906,718,895円	1,157,543,798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）	1,651,165,425円	1,333,943,339円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	407,798,078円	329,888,026円
	D I A Mバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	361,318,832円	269,190,747円
	D I A M世界6資産バランスファンド	509,574,618円	403,778,242円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	1,749,236,013円	1,390,520,317円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	14,119,547円	10,511,883円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	4,274,951円	3,883,509円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	197,132,838円	178,086,462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）	8,281,532,204円	8,173,044,477円
	計	13,176,152,506円	12,092,847,002円
2 .	受益権の総数	13,176,152,506口	12,092,847,002口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年8月8日現在	平成27年2月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	57,494,247	161,974,281
合計	57,494,247	161,974,281

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月9日から平成26年8月8日まで及び平成26年5月9日から平成27年2月9日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成26年8月8日 現在				平成27年2月9日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
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8月8日現在	平成27年2月9日現在
1口当たり純資産額	1.3288円	1.4147円
(1万口当たり純資産額)	(13,288円)	(14,147円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成27年2月9日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 3.125 05/15/19	18,100,000.000	19,422,024.000	
	アメリカ・ドル 小計		18,100,000.000 (2,152,271,000)	19,422,024.000 (2,309,472,874)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,200,000.000	4,707,402.000	
		AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,700,000.000	5,308,086.000	
		AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	4,200,000.000	4,630,458.000	
	オーストラリア・ドル 小計		13,100,000.000 (1,207,296,000)	14,645,946.000 (1,349,770,383)	
	カナダ・ドル	CANADA 3.75 06/01/19	2,000,000.000	2,259,340.000	
		CANADA 4.25 06/01/18	12,050,000.000	13,511,062.500	
	カナダ・ドル 小計		14,050,000.000 (1,334,609,500)	15,770,402.500 (1,498,030,533)	
	スウェーデン・クローナ	SWEDEN 4.25 03/12/19	91,000,000.000	107,007,810.000	
	スウェーデン・クローナ 小計		91,000,000.000 (1,285,830,000)	107,007,810.000 (1,512,020,355)	
	タイ・パーツ	THAILAND 3.25 06/16/17	414,300,000.000	425,535,816.000	
		THAILAND 3.65 12/17/21	130,000,000.000	140,153,000.000	
		THAILAND 3.875 06/13/19	50,000,000.000	53,316,500.000	
	タイ・パーツ 小計		594,300,000.000 (2,169,195,000)	619,005,316.000 (2,259,369,403)	
	ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 5.0 03/15/19	9,980,000.000	10,701,254.600	
		NEW ZEALAND 6.0 12/15/17	6,000,000.000	6,470,220.000	
	ニュージーランド・ドル 小計		15,980,000.000 (1,396,012,800)	17,171,474.600 (1,500,100,021)	
	ノルウェー・クローネ	NORWAY 4.25 05/19/17	20,000,000.000	21,580,000.000	
		NORWAY 4.5 05/22/19	32,000,000.000	37,021,440.000	
ノルウェー・クローネ 小計		52,000,000.000 (810,680,000)	58,601,440.000 (913,596,450)		
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.75 04/25/18	17,900,000.000	19,000,850.000		
	POLAND 5.25 10/25/20	5,500,000.000	6,474,050.000		
	POLAND 5.5 10/25/19	17,000,000.000	19,756,550.000		
ポーランド・ズロチ 小計		40,400,000.000 (1,308,556,000)	45,231,450.000 (1,465,046,666)		
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 4.24 02/07/18	56,000,000.000	57,044,960.000		
マレーシア・リングgit 小計		56,000,000.000 (1,870,400,000)	57,044,960.000 (1,905,301,664)		

	メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	143,000,000.000	162,699,680.000	
		MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	90,000,000.000	101,514,600.000	
	メキシコ・ペソ 小計		233,000,000.000 (1,866,330,000)	264,214,280.000 (2,116,356,383)	
国債証券	合計		15,401,180,300 (15,401,180,300)	16,829,064,733 (16,829,064,733)	
合計			15,401,180,300 (15,401,180,300)	16,829,064,733 (16,829,064,733)	

- (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	13.50%	13.72%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	7.89%	8.02%
カナダ・ドル	国債証券 2銘柄	8.76%	8.90%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	8.84%	8.98%
タイ・バーツ	国債証券 3銘柄	13.21%	13.43%
ニュージーランド・ドル	国債証券 2銘柄	8.77%	8.91%
ノルウェー・クローネ	国債証券 2銘柄	5.34%	5.43%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	8.56%	8.71%
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	11.14%	11.32%
メキシコ・ペソ	国債証券 2銘柄	12.37%	12.58%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成27年2月27日現在

資産総額	773,357,653円
負債総額	3,425,264円
純資産総額（ - ）	769,932,389円
発行済数量	903,926,515口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8518円

(参考)

D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産総額	54,493,589,326円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	54,493,589,326円
発行済数量	19,250,847,638口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8307円

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

平成27年2月27日現在

資産総額	83,699,007,272円
負債総額	346,683,064円
純資産総額（ - ）	83,352,324,208円
発行済数量	35,190,291,122口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3686円

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産総額	48,053,483,909円
負債総額	1,239,702,566円
純資産総額（ - ）	46,813,781,343円
発行済数量	19,050,276,173口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4574円

高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年2月27日現在

資産総額	17,105,858,126円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	17,105,858,126円
発行済数量	12,034,505,067口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4214円



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

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

直近5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。

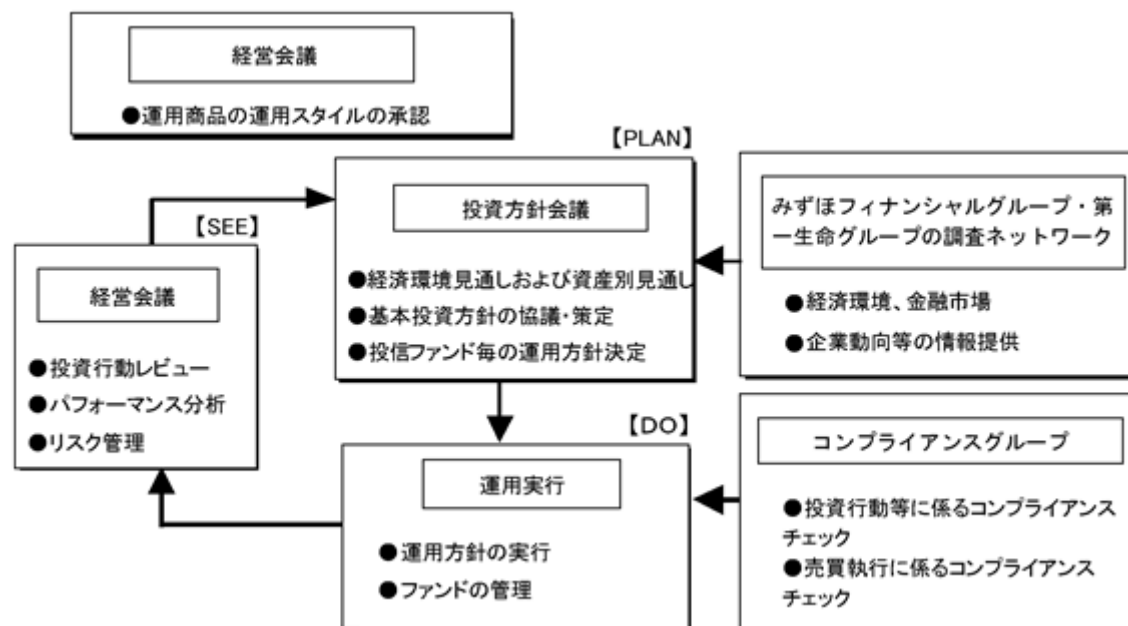
##### 投資運用の意思決定機構

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27年2月27日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

### <更新・訂正後>

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成27年2月27日現在、委託会社の運用する投資信託は353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	20,669,998,430
追加型株式投資信託	323	5,754,565,009,705
単位型公社債投資信託	23	201,073,975,137
追加型公社債投資信託	0	0
合計	353	5,976,308,983,272

### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	第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貸契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

### (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

#### 第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、記載していません。

## 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」には含めていません。

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)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
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。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,723,059
金銭の信託		12,434,692
前払費用		41,958
未収委託者報酬		4,115,165
未収運用受託報酬		2,110,505
未収投資助言報酬		291,921
未収収益		276,092
繰延税金資産		381,830
その他		19,665
	流動資産計	29,394,891
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	112,415
車両運搬具	1	1,278
器具備品	1	155,618
無形固定資産		
商標権	1	148
ソフトウェア	1	1,293,646
ソフトウェア仮勘定		671,614
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	210
投資その他の資産		
投資有価証券		569,502
関係会社株式		1,916,596
繰延税金資産		632,938
差入保証金		731,858
その他		98,609
	固定資産計	6,191,588
資産合計		35,586,479

（単位：千円）

	第30期中間会計期間末 （平成26年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	1,166,764
未払金	1,957,162
未払償還金	51,109
未払手数料	1,643,563
その他未払金	262,489
未払費用	1,591,500
未払法人税等	1,472,835
未払消費税等	371,933
賞与引当金	654,870
その他	20,000
	流動負債計
	7,235,067
固定負債	
退職給付引当金	812,666
役員退職慰労引当金	83,180
	固定負債計
	895,847
負債合計	8,130,914
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	22,814,599
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	19,480,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,711,306
	株主資本計
	27,243,077
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	212,487
	評価・換算差額等計
	212,487
純資産合計	27,455,565
負債・純資産合計	35,586,479



## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日至平成26年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	13,286,051	
運用受託報酬	3,381,064	
投資助言報酬	490,761	
その他営業収益	421,279	
	営業収益計	17,579,156
営業費用		
支払手数料	5,909,864	
広告宣伝費	92,826	
公告費	159	
調査費	2,887,318	
調査費	2,043,582	
委託調査費	843,735	
委託計算費	190,750	
営業雑経費	236,536	
通信費	17,081	
印刷費	205,572	
協会費	12,088	
諸会費	15	
支払販売手数料	1,778	
	営業費用計	9,317,455
一般管理費		
給料	2,293,163	
役員報酬	121,968	
給料・手当	2,171,195	
交際費	15,267	
寄付金	2,697	
旅費交通費	108,306	
租税公課	63,009	
不動産賃借料	344,346	
退職給付費用	109,300	
固定資産減価償却費	1 271,644	
福利厚生費	11,154	
修繕費	4,020	
賞与引当金繰入額	654,870	
役員退職慰労引当金繰入額	23,042	
役員退職慰労金	25,501	
機器リース料	23	
事務委託費	102,506	
事務用消耗品費	33,911	
器具備品費	1,141	
諸経費	73,631	
	一般管理費計	4,137,538
営業利益		4,124,161

（単位：千円）

	第30期中間会計期間 （自平成26年4月1日至平成26年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,686	
受取利息	1,115	
雑収入	1,165	
営業外収益計		8,967
営業外費用		
為替差損	896	
金銭の信託運用損	2,943	
営業外費用計		3,839
経常利益		4,129,289
特別損失		
関係会社株式評価損	202,477	
特別損失計		202,477
税引前中間純利益		3,926,811
法人税、住民税及び事業税		1,450,315
法人税等調整額		46,321
法人税等合計		1,403,993
中間純利益		2,522,818

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	株主資本 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	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変更による累積的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の積立				2,350,000			2,350,000	-	-
中間純利益							2,522,818	2,522,818	2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	2,155,181	194,818	194,818
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	2,711,306	22,814,599	27,243,077

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変更による累積的影響額		131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	243,159	27,291,419
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の積立		-
中間純利益		2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	30,671	30,671
当中間期変動額合計	30,671	164,146
当中間期末残高	212,487	27,455,565

## 重要な会計方針

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法  (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年  (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。  (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。  (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の際会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理  (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
<p>「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ4,584千円増加しております。なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。</p>	

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

項目	第30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
	1. 固定資産の減価償却累計額	建物
	車両運搬具	3,645千円
	器具備品	690,539千円
	商標権	789千円
	ソフトウェア	1,737,240千円
	電信電話専用施設利用権	1,386千円

## (中間損益計算書関係)

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産
	無形固定資産	235,019千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成26年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	9,723,059	9,723,059	-
(2) 金銭の信託	12,434,692	12,434,692	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	489,256	489,256	-
資産計	22,647,008	22,647,008	-
(1) 未払法人税等	1,472,835	1,472,835	-
負債計	1,472,835	1,472,835	-

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	1,916,596
差入保証金	731,858

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

なお、当中間会計期間において、関係会社株式について202,477千円減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃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、時価開示の対象としておりません。

## (有価証券関係)

## 第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

## 1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額1,916,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 3. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	474,395	146,101	328,293
債券	-	-	-
その他（投資信託）	14,861	13,000	1,861
小計	489,256	159,101	330,154
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	489,256	159,101	330,154

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

## (金銭の信託関係)

## 第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

## 1. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。



## （セグメント情報等）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	13,286,051	3,871,825	421,279	17,579,156

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益 （千円）
第一生命グループ	1,799,530

## （1株当たり情報）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,143,981円	89銭
1株当たり中間純利益金額	105,117円	43銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注1）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第30期中間会計期間 （自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）
中間純利益	2,522,818千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,522,818千円
期中平均株式数	24,000株

（注2）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額が5,582円81銭増加し、1株当たり中間純利益金額が122円93銭増加しております。

（重要な後発事象）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）
該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

<更新・訂正後>

#### (1)受託会社

##### a.名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b.資本金の額

平成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 (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。

(注) 資本金の額は平成26年3月末日現在

( 1) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

#### (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26年12月末日現在 659,663,244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26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26年12月末日現在 400万ポンド

c.事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

(6)投資顧問会社

a.名称

DIAM U.S.A., Inc.

b.資本金の額

平成26年12月末日現在 400万米ドル

c.事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年3月18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8月9日から平成27年2月9日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）の平成27年2月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

D I A Mアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成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。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。