

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成27年11月10日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

D I A Mインカム3 資産ファンド（毎月決算型）

また、愛称として「インカム・パスポート」という名称を用いる場合があります。（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

- ・ 計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：インカムパス）

(5) 【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「累積投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成27年11月11日から平成28年11月8日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（ 1 1 ） 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ） 【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続が完了したものを当日のお申込みとします。ただし、委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

* 高金利ソブリン・マザーファンド、DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド、DIAM US・リート・オープン・マザーファンド、DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

（注）「不動産投資信託証券」（以下「リート（REIT）」という場合があります。）とは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資者から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入などが投資者に分配される商品をいいます。

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

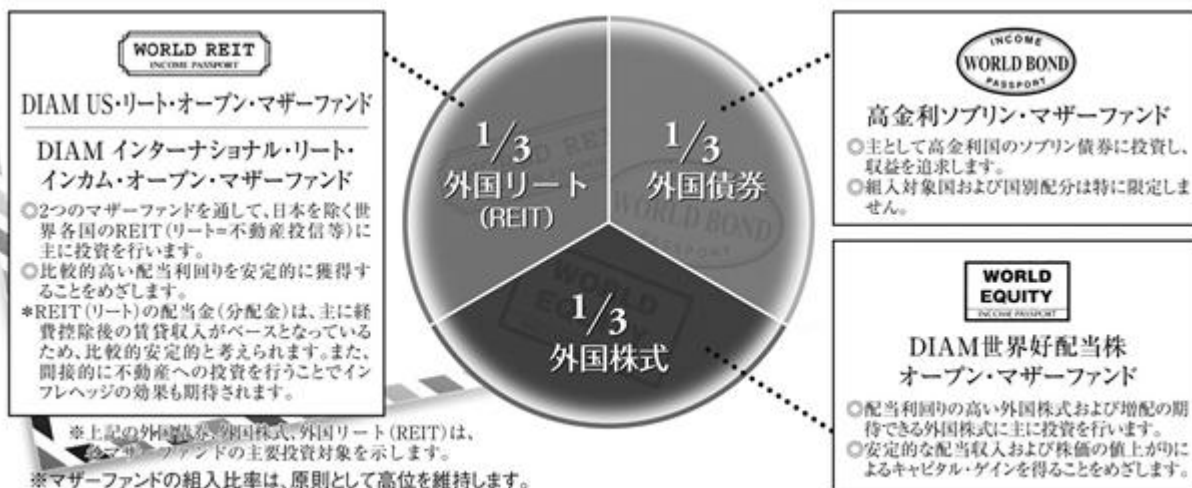
< ファンドの特色 >

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

- ◎3つの資産への投資は、各マザーファンドを通じて行います。
- ◎各マザーファンドの配分比率は、3分の1ずつを基本とします。
ただし、「DIAM US・リート・オープン・マザーファンド」、「DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド」については、合算して3分の1とします。
- ◎各マザーファンドの時価の変動などにより、時価構成比が変化した場合には、定期的に基本配分比率に修正します。
- ◎実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。

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

*2 外国リート(REIT)とは、外国不動産投資信託証券を指します。

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

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

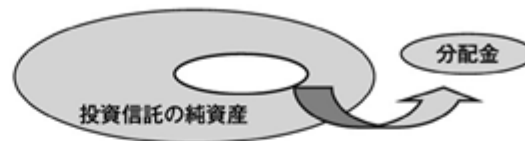
・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

投資信託の収益分配金に関するご説明

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

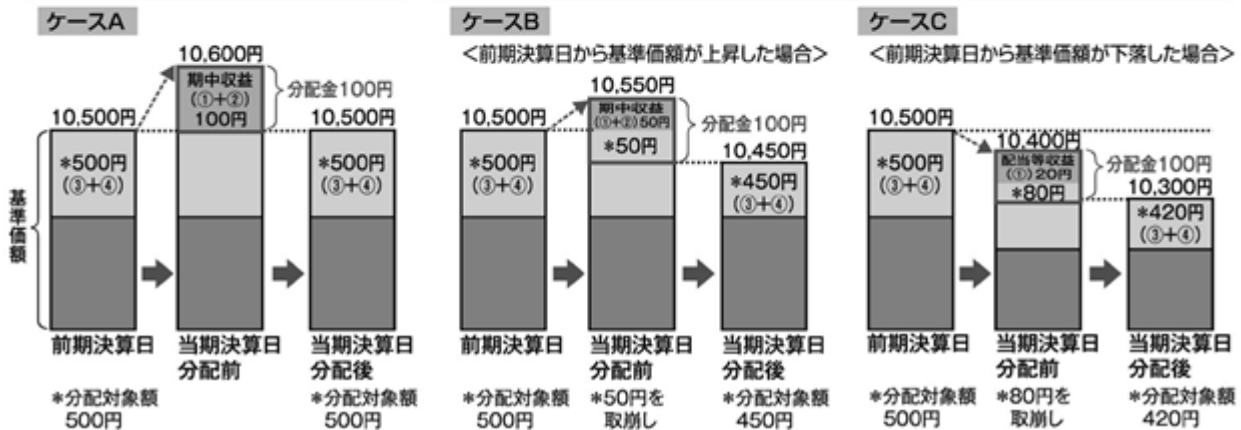
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

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

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

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

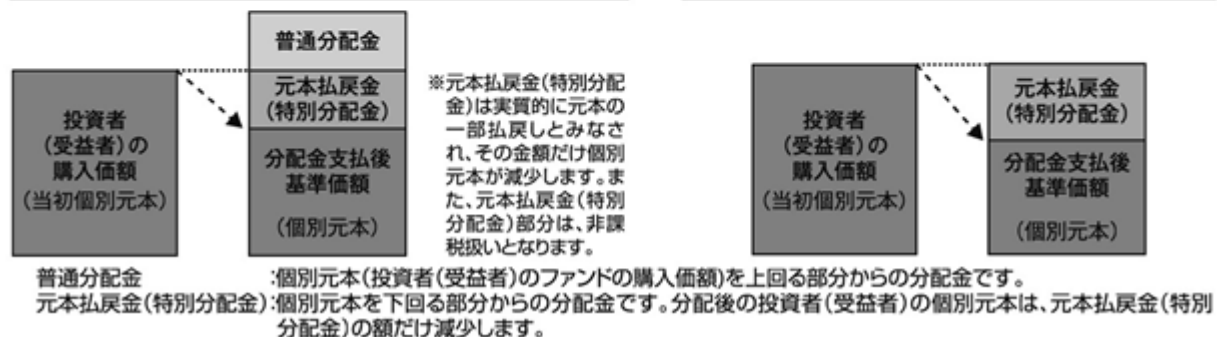
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

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

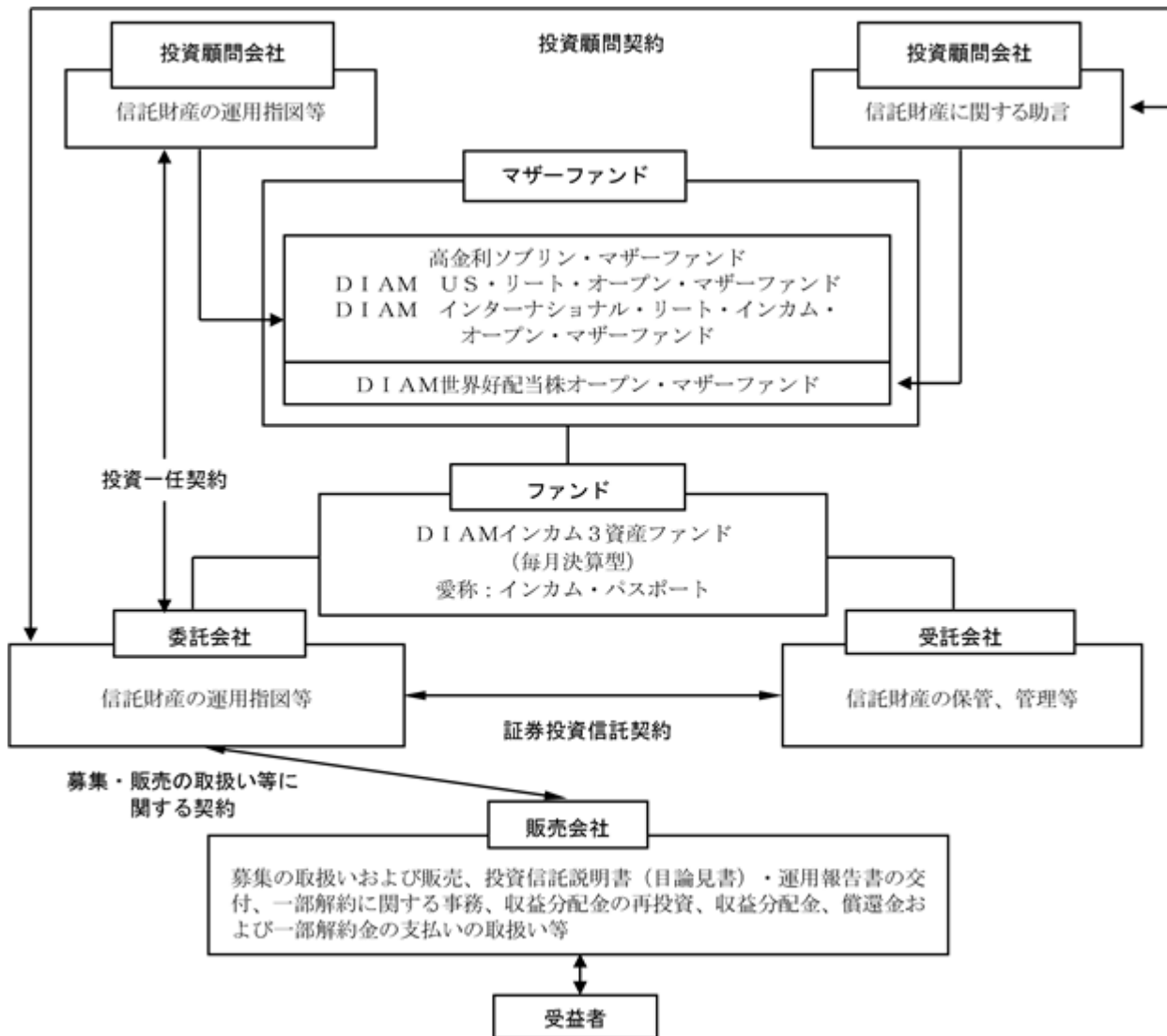
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

(2)【ファンドの沿革】

平成19年8月20日 信託契約締結、当初設定日、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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

販売会社

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

投資顧問会社

デービス・セレクトド・アドバイザーズ

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

コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント

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

DIAM International Ltd

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

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

DIAM U.S.A., Inc.

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

・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資一任契約」の概要

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

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

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

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

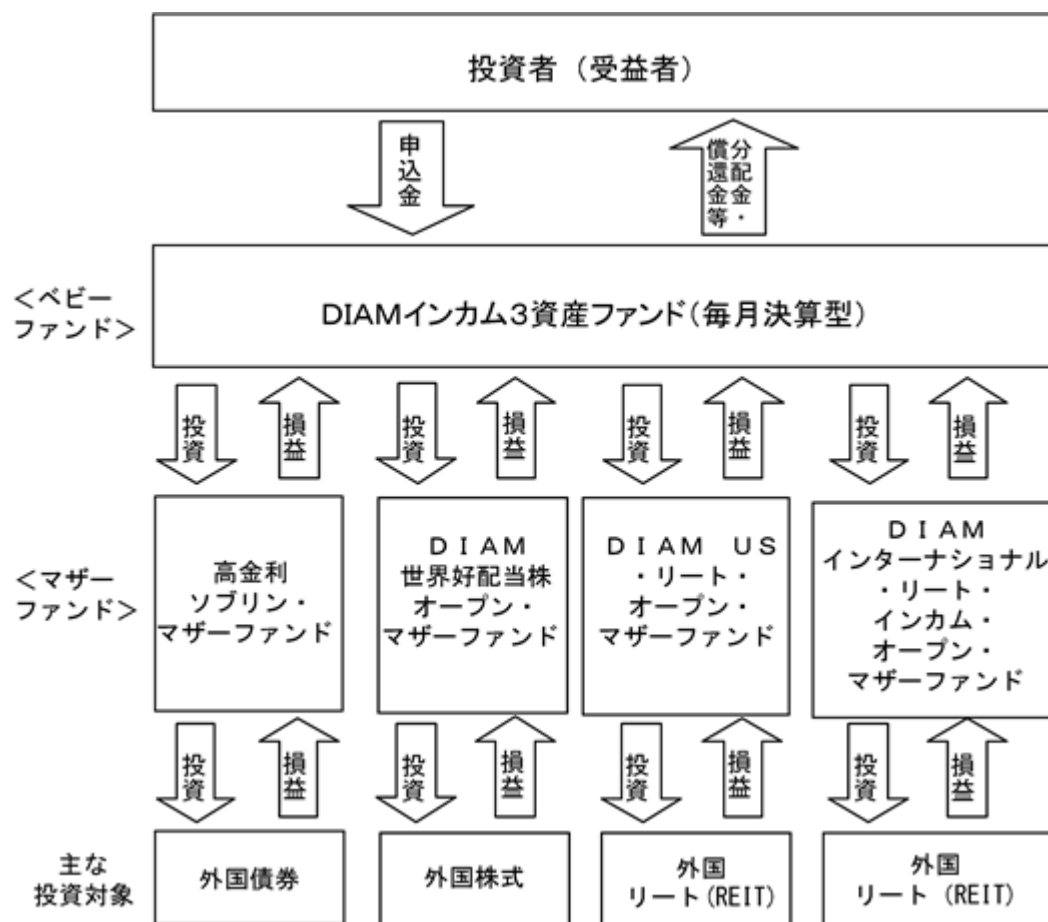
・「投資顧問契約」の概要

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

(1)資本金の額

20億円（平成27年8月31日現在）

(2)委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日 会社設立

平成10年 3月31日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

平成10年12月1日 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

平成20年 1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

(3)大株主の状況

（平成27年8月31日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

高金利ソブリン・マザーファンド受益証券、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド受益証券、D I A M US・リート・オープン・マザーファンド受益証券およびD I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

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

マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。

各資産への投資は、原則として3分の1を基本資産配分比率とし、各マザーファンド受益証券を通じて行います。ただし、外国不動産投資信託証券への投資については、D I A M US・リート・オープン・マザーファンド受益証券およびD I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド受益証券の純資産総額を合算して資産配分を算出しま

す。なお、時価変動等により各マザーファンド受益証券の時価構成比率が基本資産配分比率から乖離した場合は、原則として定期的に基本資産配分比率に近づけるものとします。

実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

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

不動産投資信託証券（REIT）とは

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された、高金利ソブリン・マザーファンド、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド、D I A M US・リート・オープン・マザーファンド、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの各受益証券のほか、

次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲(約款第17条第2項)

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

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

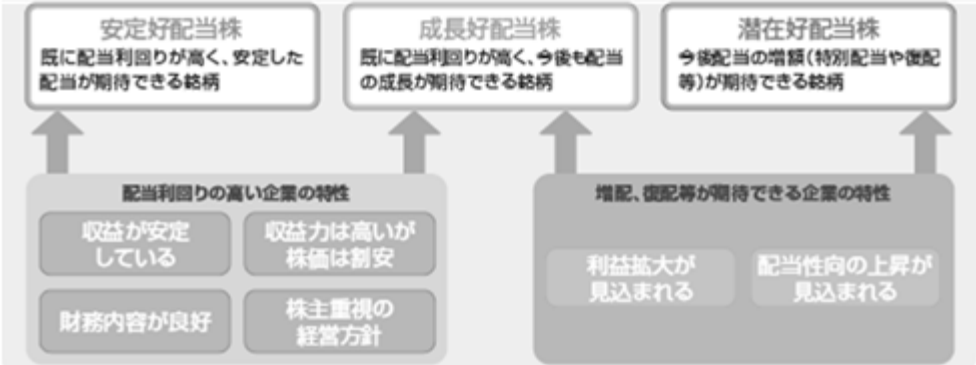
金融商品の指図範囲（約款第17条第3項）

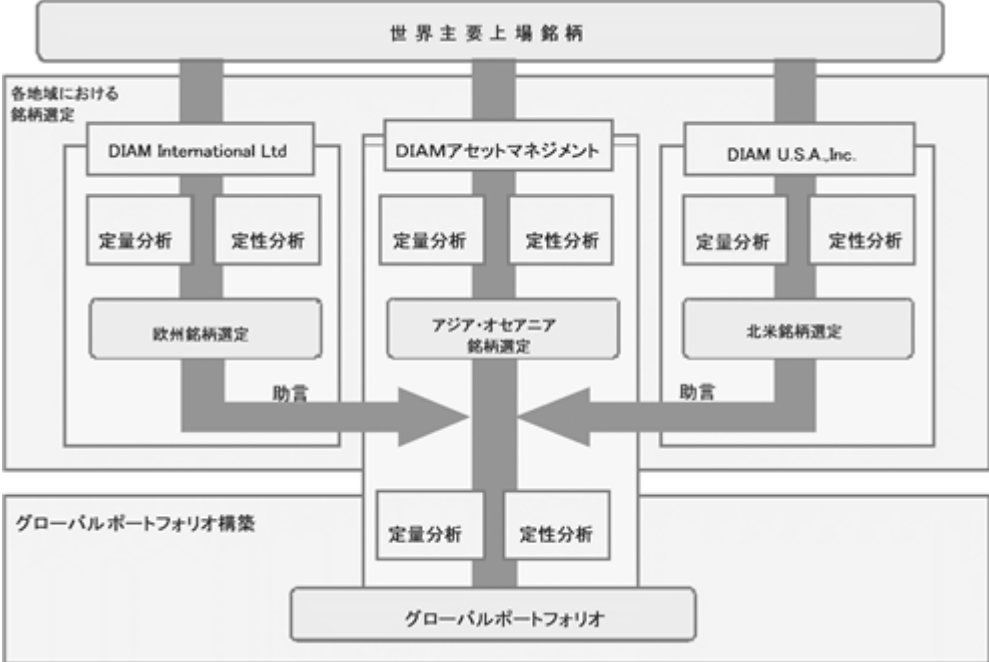
上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と定めるときは、委託会社は、信託金を、上記 1.から4.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

<p>運用 プロセス</p>	<p>地域配分（通貨アロケーション）の決定</p> <p>各国の金利はその国の名目経済成長率と密接な関係があるため、経済分析を中心に、名目経済成長率のサイクルとリスク・プレミアムがピークに近いと判断される国に注目します。これらの国の実体経済、財政政策、金融政策等のファンダメンタルズ分析をもとに、為替リスク、金利リスク、信用リスクを判断し、リスクの相対的に小さな国に重点投資します。</p> <p>投資銘柄の決定</p> <p>当該国のイールドカーブの形状や銘柄毎の流動性を勘案した上で銘柄選定を行い、ポートフォリオを構築します。</p> <p>リスク管理とモニタリング</p> <ul style="list-style-type: none"> ・日次で、保有債券のスプレッドや信用格付けをモニターすると同時に、保有国に関するニュースのフォロー、およびマクロ経済分析を実施いたします。（ファンドマネジャー） ・週次で、ポートフォリオのリスク量や寄与度分析等を中心に、パフォーマンス評価を実施します。（ミドル・オフィサー） ・月次で、コンプライアンス・オフィサーが運用ガイドライン等の契約項目をチェックします。 <p>上記は、平成27年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。</p>
<p>主な投資 制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式（株式投資信託証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

ファンド名	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界各国の好配当株式に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>組入銘柄の選定に当たっては、配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄を選定し、安定的な配当収入およびキャピタルゲインを享受することをめざします。</p> <p>北米地域の銘柄選定に当たってはDIAM U.S.A., Inc.、欧州地域の銘柄選定に当たってはDIAM International Ltdの投資助言を受けます。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向の急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、株式組入比率を引き下げることがあります。</p> <p>外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資対象銘柄イメージ</p> <p>世界の株式の中でも配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄に着目します。</p>  <p>安定好配当株 既に配当利回りが高く、安定的な配当が期待できる銘柄</p> <p>成長好配当株 既に配当利回りが高く、今後も配当の成長が期待できる銘柄</p> <p>潜在好配当株 今後配当の増額（特別配当や償配等）が期待できる銘柄</p> <p>配当利回りの高い企業の特徴</p> <ul style="list-style-type: none"> 収益が安定している 収益力は高いが株価は割安 財務内容が良好 株主重視の経営方針 <p>増配、償配等が期待できる企業の特徴</p> <ul style="list-style-type: none"> 利益拡大が見込まれる 配当性向の上昇が見込まれる <p>上記企業の特徴はあくまでも一般論であり、すべての企業にあてはまるわけではありません。</p>

運用 プロセス	<p>組入れ銘柄選定にあたっては、世界を三極（北米、欧州、アジア・オセアニア）に区分し、DIAM International Ltdは欧州における銘柄を、DIAM U.S.A., Inc.は北米における銘柄をそれぞれ選定し、委託会社に助言します。委託会社はアジア・オセアニアにおける銘柄を選定します。</p> <p>委託会社は、選定された各地域の組入れ銘柄について、平均配当利回り、地域配分、業種配分等を考慮し、最終的にグローバルポートフォリオとして集約・構築します。</p>  <p>上記は、平成27年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。</p>
主な投資 制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

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

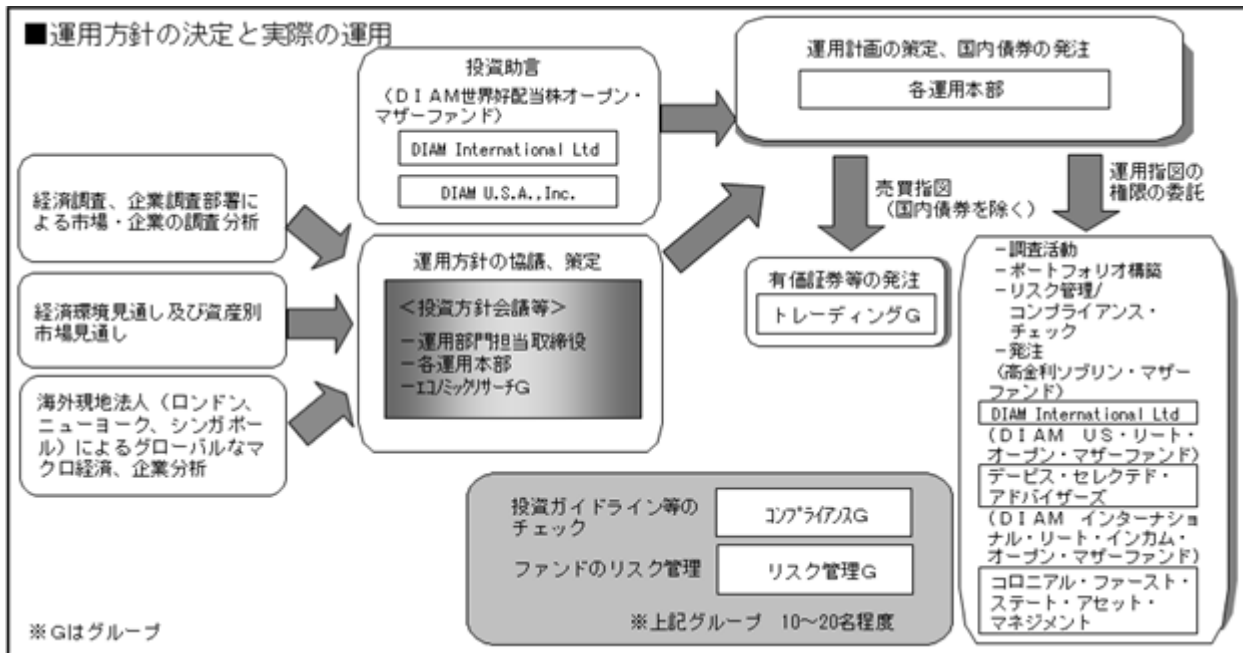
投資態度	<p>運用指図に関する権限はデービス・セレクトド・アドバイザーズ(米国)に委託します。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>デービス・セレクトド・アドバイザーズとは・・・</p> <p>Davis Selected Advisers, LP</p> <ul style="list-style-type: none"> ・1969年設立。創業者一族であるDavis家が約80%を出資する独立系運用会社。 ・運用受託資産は、約4兆1,453億円(約33,853百万米ドル、1米ドル=122.45円で換算)。そのうち、不動産関連証券投資は約815億円(2015年6月末現在)。 ・不動産関連証券投資では1994年からの実績。 ・運用スタイルは、個別銘柄選択による割安銘柄投資を特徴としています。 </div> <p>不動産投信等への投資は、原則として高位を維持することをめざします。</p> <p>外貨建資産については、対円で為替ヘッジは行いません。</p>
運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> ・米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等を主な投資対象とします。 ・トップダウン・アプローチによる分析とボトムアップ・アプローチによる分析を相互補完的に実施した上で投資銘柄を選定し、ポートフォリオを構築します。
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>

ファンド名	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。</p>
主な投資対象	<p>米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。</p>
投資態度	<p>運用指図に関する権限はコロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント(豪州)に委託します。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントとは・・・</p> <p>Colonial First State Asset Management (Australia) Limited</p> <ul style="list-style-type: none"> ・オーストラリア・コモンウェルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。 ・運用受託資産は、約18兆9,896億円(約202,168百万豪ドル、1豪ドル=93.93円換算)と豪州を代表する資産運用会社の一つです。そのうち、不動産関連証券投資は約2,920億円(2015年6月末現在)。 ・不動産関連証券投資では1991年からの実績。 ・運用スタイルは、マクロ分析によるトップダウンと個別銘柄調査によるボトムアップ運用の融合を特徴としています。 </div> <p>不動産投信等への投資は、原則として高位を維持することをめざします。</p> <p>外貨建資産について、対円で為替ヘッジは行いません。</p>

運用 プロセス	<ul style="list-style-type: none">・米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等を主な投資対象とします。・個別銘柄調査に基づくファンダメンタルズ分析などのボトムアップ・アプローチにより投資銘柄を選定し、ポートフォリオを構築します。
主な投資 制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



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、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

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

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。

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。

・D I A M 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D I A M International Ltdに委託します。

運用体制	<ul style="list-style-type: none"> ・D I A M International Ltdでは、資産クラス別運用体制ではなく、マルチプラットフォーム体制を採用しており、全ての運用担当者は3つまたは4つのプラットフォームに所属しております。 ・マクロ分析・市場分析・企業分析プラットフォームにおいては、株式や債券などの特定の資産クラスのみならず、幅広い資産クラスに関連する様々なレベルの分析が行われております。
------	--

運用プロセス	<p>情報収集・分析</p> <ul style="list-style-type: none"> マルチプラットフォーム体制のもと、DIAM International Ltd内の他の運用担当者との情報交換や議論を通じ、投資対象国・地域のマクロ経済環境や対象資産に関する情報収集や分析を行います。 <p>運用方針・戦略の決定</p> <ul style="list-style-type: none"> 月次の各種テーマ別運用方針会議におけるマクロ経済環境や金融市場環境などに関する議論を踏まえ、当該ファンドの運用目標・ガイドラインに沿った運用方針・戦略を策定します。 <p>ポートフォリオの構築</p> <ul style="list-style-type: none"> 策定した運用方針・戦略に基づき、運用担当者がポートフォリオを構築します。運用対象となる銘柄の執行については基本的にはそれぞれの運用担当者が自ら行います。 運用担当者は使用するポートフォリオ・マネジメント・システムでポートフォリオのリスク量やその変化をリアルタイムで把握することができる体制となっています。 <p>運用モニタリング</p> <ul style="list-style-type: none"> 運用ガイドラインチェックは運用部門からは独立したコンプライアンスチームによってシステムを用いて日次で行われています。 同じく運用部門から独立したリスク管理チームが各ファンドのパフォーマンス評価や各種リスクのモニタリングを行っており、週次で開催されるモニタリング会議で報告されています。
--------	---

・デビス・セレクトド・アドバイザーズの運用体制

D I A M U S・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、システムティックに行われます。
運用評価	委託会社において、マザーファンドの運用実績を、原則として月1回開催される経営会議において、評価いたします。

上記体制は、平成27年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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

（４）【分配方針】

収益分配方針

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

1)分配対象額の範囲

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

2)分配対象額についての分配方針

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

3)留保益の運用方針

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

収益の分配方式

1)信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

2)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

（５）【投資制限】

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

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

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

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

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

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

信用取引の指図および範囲（約款第23条）

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券

4. 売出しにより取得する株券

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

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

先物取引等の運用指図（約款第24条）

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

スワップ取引の運用指図(約款第25条)

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第26条)

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

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)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

- 2)上記1)1.～2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建資産への投資制限（約款第28条）

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

外貨為替予約の指図および範囲（約款第29条）

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第36条）

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

資産配分リスク

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

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

株価変動リスク

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

金利リスク

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

リート（REIT）の価格変動リスク

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

為替リスク

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

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

カントリーリスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取

引できないことや、値動きが大きくなることもあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

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

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

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

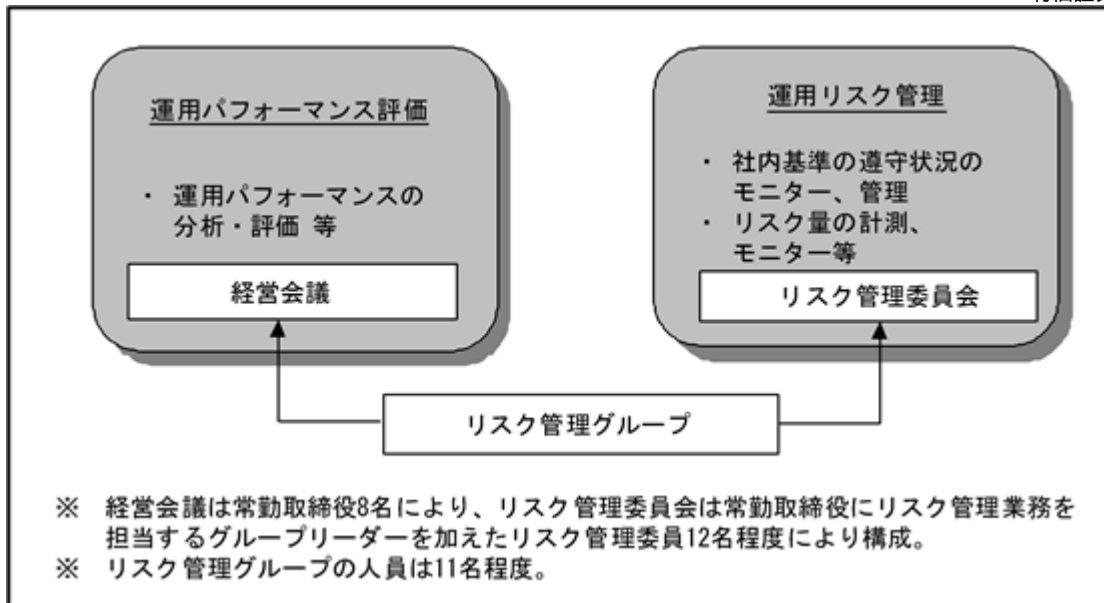
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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

注意事項

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

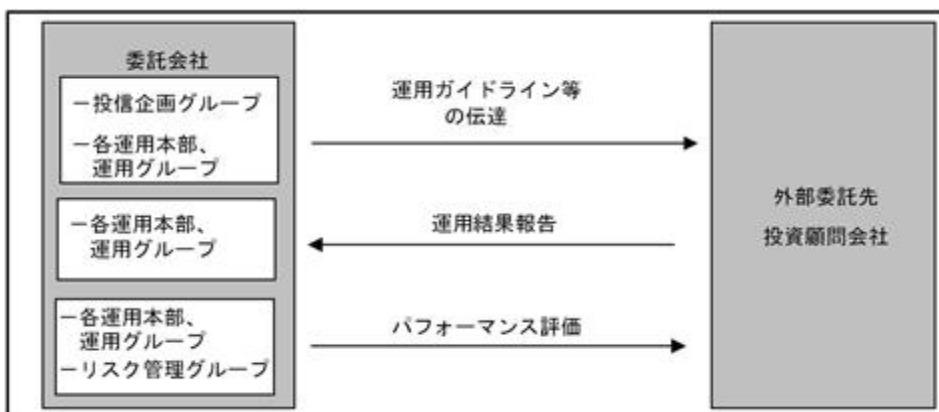
<運用評価・運用リスク管理体制>



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

運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

< 外部委託先に関する管理体制 >



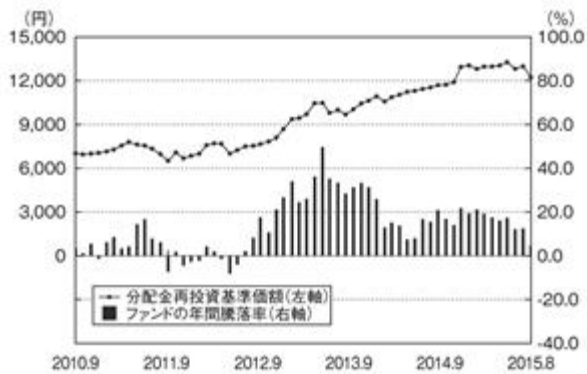
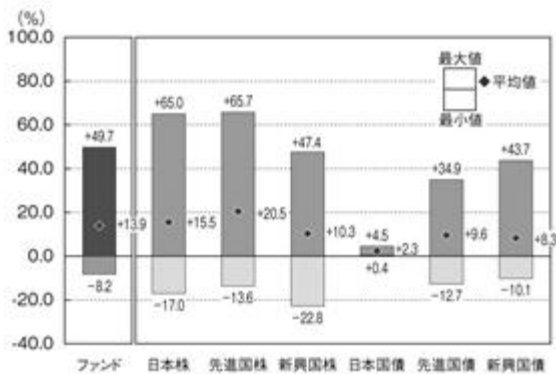
マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。

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8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

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9月～2015年8月

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

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

* 各資産クラスの指数

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

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

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.296%（税抜1.20%）

信託報酬の配分（税抜）		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】

イ.信託財産留保額

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

ロ.その他の費用

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。

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・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。
- ・有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。
上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
上場投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託（リート）の費用は表示しておりません。
税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等が追加される予定です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円（平成28年1月1日以降、年間120万円）の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、平成28年4月1日より、未成年者口座内の少額上場株式等に係る配当所得及び譲渡所得等の非課税措置（ジュニアNISA）が開始され、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成27年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成27年8月31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	636,310,254	98.53
内 日本	636,310,254	98.53
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,487,564	1.47
純資産総額	645,797,818	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8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	39,901,325,155	89.25
内 アメリカ	39,901,325,155	89.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,804,677,332	10.75
純資産総額	44,706,002,487	100.00

その他資産の投資状況

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	605,850,000	1.36
-	605,850,000	1.36

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

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

(注3) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

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

平成27年8月31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	29,731,912,799	43.48
内 オーストラリア	21,363,638,973	31.24
内 シンガポール	8,368,273,826	12.24
投資証券	34,598,889,994	50.60
内 カナダ	11,323,043,287	16.56
内 イギリス	8,078,685,349	11.81
内 ベルギー	4,571,264,037	6.68
内 オランダ	4,115,978,789	6.02
内 フランス	2,626,406,915	3.84
内 ニュージーランド	2,538,520,557	3.71
内 ドイツ	1,344,991,060	1.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,050,566,269	5.92
純資産総額	68,381,369,062	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8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	39,158,351,052	97.27
内 アメリカ	17,513,339,328	43.50
内 イギリス	6,642,215,533	16.50
内 フランス	2,888,106,257	7.17
内 カナダ	2,695,851,038	6.70
内 スイス	1,778,427,527	4.42
内 ドイツ	1,299,016,653	3.23
内 オーストラリア	1,216,335,210	3.02
内 スペイン	1,206,623,341	3.00
内 イタリア	958,011,478	2.38
内 香港	630,638,895	1.57
内 バミューダ	466,088,890	1.16
内 デンマーク	313,837,394	0.78
内 スウェーデン	304,278,707	0.76
内 フィンランド	231,052,188	0.57
内 アイルランド	215,892,051	0.54
内 ジャージー	204,073,062	0.51
内 オランダ	202,451,679	0.50
内 ルクセンブルグ	202,223,567	0.50
内 ベルギー	189,888,254	0.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,101,078,800	2.73
純資産総額	40,259,429,852	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	14,991,365,666	98.44
内 アメリカ	2,147,727,973	14.10
内 イギリス	1,883,985,868	12.37
内 カナダ	1,533,974,781	10.07
内 タイ	1,428,883,328	9.38
内 ポーランド	1,420,254,667	9.33
内 メキシコ	1,416,889,766	9.30
内 ニュージーランド	1,387,298,076	9.11
内 オーストラリア	1,298,778,127	8.53
内 マレーシア	1,278,979,680	8.40
内 シンガポール	1,194,593,400	7.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	237,011,645	1.56
純資産総額	15,228,377,311	100.00

その他資産の投資状況

平成27年8月31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）	326,169,525	2.14
-	326,169,525	2.14
為替予約取引（売建）	192,790,968	1.27
-	192,790,968	1.27

（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。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	高金利ソブリン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	159,101,539	1.4143 225,033,216	1.3558 215,709,866	- -	33.40%
2	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	88,433,777	2.5145 222,366,733	2.3436 207,253,399	- -	32.09%
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	57,570,964	2.3726 136,598,626	2.1984 126,564,007	- -	19.60%
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	32,392,588	2.8630 92,743,218	2.6791 86,782,982	- -	13.44%

（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8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.53%
合計	98.53%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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8月31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	CYRUSONE INC アメリカ	投資証券	543,288	3,499.94 1,901,475,820	3,914.11 2,126,491,166	- -	4.76%
2	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	139,870	15,428.15 2,157,935,662	14,132.01 1,976,644,462	- -	4.42%
3	DCT INDUSTRIAL TRUST INC アメリカ	投資証券	459,367	4,225.22 1,940,928,736	3,980.76 1,828,631,157	- -	4.09%
4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	77,950	23,058.87 1,797,439,308	22,335.89 1,741,083,217	- -	3.89%
5	KITE REALTY GROUP TRUST アメリカ	投資証券	544,082	3,378.75 1,838,320,454	2,907.10 1,581,705,243	- -	3.54%
6	TERRENO REALTY CORP アメリカ	投資証券	631,513	2,539.15 1,603,511,894	2,482.97 1,568,033,012	- -	3.51%

7	LIBERTY PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	393,990	4,398.53 1,732,980,690	3,812.32 1,502,017,059	- -	3.36%
8	ACADIA REALTY TRUST アメリカ	投資証券	409,270	3,926.24 1,606,893,095	3,645.09 1,491,827,785	- -	3.34%
9	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	133,206	12,442.48 1,657,414,200	10,848.03 1,445,023,163	- -	3.23%
10	POST PROPERTIES, INC アメリカ	投資証券	198,490	7,048.57 1,399,072,523	6,869.69 1,363,565,601	- -	3.05%
11	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES アメリカ	投資証券	291,774	4,933.09 1,439,348,425	4,241.29 1,237,501,066	- -	2.77%
12	CATCHMARK TIMBER TRUST INC アメリカ	投資証券	992,460	1,318.94 1,308,998,581	1,222.70 1,213,486,995	- -	2.71%
13	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	120,740	9,663.57 1,166,780,586	9,396.29 1,134,508,923	- -	2.54%
14	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	229,810	5,243.65 1,205,043,617	4,712.69 1,083,023,334	- -	2.42%
15	FIRST INDUSTRIAL RT アメリカ	投資証券	447,440	2,587.43 1,157,723,771	2,375.12 1,062,727,272	- -	2.38%
16	EDUCATION REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	257,293	4,287.95 1,103,261,420	3,613.58 929,750,794	- -	2.08%
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	34,021	24,990.71 850,209,049	26,739.57 909,707,210	- -	2.03%
18	COUSINS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	797,430	1,358.12 1,083,007,375	1,139.09 908,346,133	- -	2.03%
19	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	114,990	8,586.05 987,310,240	7,886.39 906,856,492	- -	2.03%
20	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES アメリカ	投資証券	460,760	2,191.21 1,009,624,900	1,917.06 883,308,067	- -	1.98%
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	54,870	16,368.69 898,150,079	16,080.58 882,341,753	- -	1.97%
22	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	42,690	20,047.79 855,840,268	20,444.27 872,766,219	- -	1.95%
23	VENTAS INC アメリカ	投資証券	121,210	7,068.73 856,801,034	6,869.69 832,675,633	- -	1.86%
24	CEDAR REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,077,060	882.78 950,807,610	769.49 828,790,130	- -	1.85%
25	HIGHWOODS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	173,140	5,384.37 932,250,462	4,722.38 817,633,669	- -	1.83%
26	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP アメリカ	投資証券	377,130	2,074.67 782,423,050	1,992.19 751,318,084	- -	1.68%
27	BRANDYWINE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	488,650	1,905.64 931,194,162	1,515.96 740,774,733	- -	1.66%
28	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	251,430	3,155.89 793,487,305	2,839.24 713,871,973	- -	1.60%
29	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	362,930	2,061.23 748,084,805	1,953.42 708,955,301	- -	1.59%

30	AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	340,000	2,133.21 725,294,406	2,051.57 697,536,316	- -	1.56%
----	--	------	---------	-------------------------	-------------------------	--------	-------

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
投資証券	89.25%
合計	89.25%

（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8月31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	FEDERATION CENTRES オーストラリア	投資信託受益 証券	21,443,428	234.32 5,024,773,725	242.33 5,196,600,341	- -	7.60%
2	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	10,615,791	360.04 3,822,194,317	347.93 3,693,562,778	- -	5.40%
3	WAREHOUSES DE PAUW ベルギー	投資証券	330,312	8,102.37 2,676,311,030	9,498.34 3,137,418,522	- -	4.59%
4	ALLIED PROPERTIES REIT カナダ	投資証券	950,022	3,393.40 3,223,813,680	3,190.07 3,030,645,896	- -	4.43%
5	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,032,649	2,476.43 2,557,286,466	2,687.25 2,774,986,644	- -	4.06%
6	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	1,778,892	1,441.77 2,564,769,484	1,532.41 2,726,002,563	- -	3.99%
7	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV オランダ	投資証券	506,927	4,842.57 2,454,834,369	5,245.11 2,658,889,397	- -	3.89%
8	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	2,211,954	1,154.91 2,554,626,374	1,173.60 2,595,963,370	- -	3.80%
9	GOODMAN PROPERTY TRUST ニュージーランド	投資証券	26,401,917	86.37 2,280,540,825	96.14 2,538,520,557	- -	3.71%
10	CHARTER HALL GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,908,131	412.84 2,439,133,480	385.14 2,275,501,884	- -	3.33%
11	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,819,678	1,348.67 2,454,149,126	1,126.55 2,049,970,988	- -	3.00%
12	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA オーストラリア	投資信託受益 証券	10,362,271	158.81 1,645,728,108	171.80 1,780,256,291	- -	2.60%
13	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,717,963	611.04 1,660,792,265	641.33 1,743,126,159	- -	2.55%

14	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,147,091	302.05 1,554,727,733	334.08 1,719,555,602	- -	2.51%
15	MAPLETREE LOGISTICS TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	19,701,320	98.85 1,947,495,932	87.08 1,715,728,854	- -	2.51%
16	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	12,519,840	127.78 1,599,809,443	131.27 1,643,529,476	- -	2.40%
17	NATIONAL STORAGE REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	11,358,265	129.94 1,475,980,977	139.77 1,587,638,404	- -	2.32%
18	ASCOTT RESIDENCE TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	14,377,600	104.47 1,502,041,358	105.53 1,517,325,638	- -	2.22%
19	SEGRO PLC イギリス	投資証券	1,925,876	718.92 1,384,564,947	784.14 1,510,172,736	- -	2.21%
20	FRASERS CENTREPOINT TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	8,667,000	163.87 1,420,330,626	169.45 1,468,666,485	- -	2.15%
21	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	9,478,152	157.95 1,497,109,654	152.76 1,447,889,608	- -	2.12%
22	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券	827,220	1,360.60 1,125,515,532	1,625.91 1,344,991,060	- -	1.97%
23	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST カナダ	投資証券	3,200,000	403.91 1,292,518,080	410.32 1,313,034,240	- -	1.92%
24	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	532,772	2,205.18 1,174,860,290	2,339.73 1,246,546,680	- -	1.82%
25	CROMBIE REAL ESTATE INV カナダ	投資証券	992,261	1,142.12 1,133,288,376	1,176.93 1,167,823,227	- -	1.71%
26	KLEPIERRE フランス	投資証券	202,077	4,830.16 976,065,317	5,377.77 1,086,723,930	- -	1.59%
27	ASCENDAS REAL ESTATE INVT シンガポール	投資信託受益 証券	5,365,100	196.46 1,054,048,195	189.61 1,017,319,531	- -	1.49%
28	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	847,500	1,124.72 953,204,607	1,164.10 986,582,292	- -	1.44%
29	COFINIMMO SA ベルギー	投資証券	66,685	12,832.39 855,728,216	12,876.71 858,683,966	- -	1.26%
30	ICADE フランス	投資証券	96,588	8,992.20 868,539,135	8,729.60 843,175,532	- -	1.23%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	43.48%
投資証券	50.60%
合計	94.08%

（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8月31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	147,470	6,189.46 912,760,962	6,564.32 968,040,358	- -	2.40%
2	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC アメリカ	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	381,568	2,140.03 816,568,098	2,137.61 815,645,556	- -	2.03%
3	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	121,349	7,195.66 873,187,164	6,709.73 814,219,826	- -	2.02%
4	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	83,122	10,178.50 846,057,852	9,736.81 809,343,370	- -	2.01%
5	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	198,336	4,189.30 830,890,571	3,957.73 784,962,082	- -	1.95%
6	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	172,794	4,237.18 732,160,384	4,034.08 697,065,199	- -	1.73%
7	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	20,879	35,087.65 732,595,127	33,231.63 693,843,244	- -	1.72%
8	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	213,386	3,712.41 792,176,340	3,189.10 680,510,828	- -	1.69%
9	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP アメリカ	株式 運送インフラ	71,837	10,314.60 740,970,452	9,444.76 678,483,885	- -	1.69%
10	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 タバコ	92,673	6,832.27 633,167,244	6,501.55 602,518,625	- -	1.50%
11	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品	76,412	7,949.56 607,442,479	7,753.09 592,429,602	- -	1.47%
12	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	48,969	12,386.10 606,535,224	11,893.69 582,422,203	- -	1.45%

13	BCE INC カナダ	株式 各種電気通信 サービス	116,609	4,954.10 577,693,008	4,884.49 569,576,042	- -	1.41%
14	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品	70,921	8,248.27 584,975,926	7,699.45 546,053,118	- -	1.36%
15	LOCKHEED MARTIN CORP アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	20,444	24,427.58 499,397,626	24,708.60 505,142,659	- -	1.25%
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	56,096	9,273.79 520,222,916	8,951.83 502,162,080	- -	1.25%
17	REYNOLDS AMERICAN INC アメリカ	株式 タバコ	47,588	9,134.95 434,714,421	10,260.31 488,267,660	- -	1.21%
18	DUKE ENERGY CORP アメリカ	株式 電力	53,842	9,224.31 496,655,455	8,772.22 472,313,880	- -	1.17%
19	PPL CORPORATION アメリカ	株式 電力	124,020	3,896.08 483,192,775	3,801.41 471,451,686	- -	1.17%
20	PACWEST BANCORP アメリカ	株式 商業銀行	88,858	5,680.33 504,743,237	5,124.70 455,370,788	- -	1.13%
21	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サー ビス	1,060,039	468.00 496,098,355	423.65 449,092,899	- -	1.12%
22	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	42,650	9,003.67 384,006,696	10,080.96 429,953,123	- -	1.07%
23	ALLIANZ SE ドイツ	株式 保険	22,152	20,681.11 458,128,170	19,306.91 427,686,758	- -	1.06%
24	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	36,590	12,281.59 449,383,487	11,532.70 421,981,514	- -	1.05%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	431,821	1,141.57 492,957,109	969.34 418,584,199	- -	1.04%
26	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	78,477	5,683.34 446,011,630	5,323.43 417,767,396	- -	1.04%
27	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	74,552	5,887.49 438,924,177	5,582.76 416,206,117	- -	1.03%
28	SANOFI フランス	株式 医薬品	34,520	12,426.35 428,957,940	12,033.14 415,384,213	- -	1.03%
29	GENERAL MILLS INC アメリカ	株式 食品	59,841	6,884.79 411,992,969	6,923.01 414,280,044	- -	1.03%
30	ORANGE フランス	株式 各種電気通信 サービス	213,246	1,986.70 423,656,595	1,924.56 410,406,577	- -	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8月31日現在

種類	投資比率
株式	97.27%
合計	97.27%

(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

平成27年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品	外国	14.37%
商業銀行		13.00%
石油・ガス・消耗燃料		9.80%
タバコ		8.73%
各種電気通信サービス		8.02%
電力		6.93%
保険		6.33%
メディア		3.62%
食品		3.09%
総合公益事業		2.21%
航空宇宙・防衛		2.13%
貯蓄・抵当・不動産金融		2.03%
建設・土木		1.99%
運送インフラ		1.69%
無線通信サービス		1.12%
ソフトウェア		1.04%
ホテル・レストラン・レジャー		1.01%
水道		0.99%
航空貨物・物流サービス		0.93%
金属・鉱業		0.88%
家庭用品		0.81%
自動車		0.59%
通信機器		0.55%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.54%
建設資材		0.54%
情報技術サービス		0.53%
化学		0.50%
機械		0.50%
各種金融サービス		0.50%
半導体・半導体製造装置		0.50%
専門小売り		0.48%
レジャー用品	0.47%	
商業サービス・用品	0.46%	
ガス	0.41%	
合計	97.27%	

(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。

高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年8月31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 1.375 02/29/20 アメリカ	国債証券	2,153,974,500	99.14 2,135,617,487	99.70 2,147,727,973	1.375000 2020/2/29	14.10%
2	UK TREASURY 2.0 07/22/20 イギリス	国債証券	1,831,424,000	102.63 1,879,701,457	102.86 1,883,985,868	2.000000 2020/7/22	12.37%
3	CANADA 1.5 03/01/20 カナダ	国債証券	1,348,204,800	102.28 1,379,013,661	103.89 1,400,717,376	1.500000 2020/3/1	9.20%
4	MALAYSIA 4.378 11/29/19 マレーシア	国債証券	1,270,720,000	103.15 1,310,747,680	100.65 1,278,979,680	4.378000 2019/11/29	8.40%
5	SINGAPORE 1.625 10/01/19 シンガポール	国債証券	1,201,200,000	99.68 1,197,464,268	99.45 1,194,593,400	1.625000 2019/10/1	7.84%
6	NEW ZEALAND 5.0 03/15/19 ニュージーランド	国債証券	983,378,600	106.49 1,047,249,040	108.05 1,062,589,746	5.000000 2019/3/15	6.98%
7	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 メキシコ	国債証券	765,320,000	111.63 854,364,982	112.04 857,518,100	8.000000 2020/6/11	5.63%
8	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20 オーストラリア	国債証券	683,745,000	109.86 751,205,791	111.00 758,956,950	4.500000 2020/4/15	4.98%
9	THAILAND 3.875 06/13/19 タイ	国債証券	591,500,000	106.76 631,491,315	106.83 631,952,685	3.875000 2019/6/13	4.15%
10	POLAND 5.5 10/25/19 ポーランド	国債証券	547,230,000	113.69 622,145,787	112.76 617,056,548	5.500000 2019/10/25	4.05%
11	POLAND 3.75 04/25/18 ポーランド	国債証券	576,201,000	105.11 605,673,681	104.53 602,331,715	3.750000 2018/4/25	3.96%
12	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18 メキシコ	国債証券	505,400,000	111.20 562,030,070	110.67 559,371,666	8.500000 2018/12/13	3.67%
13	THAILAND 3.65 12/17/21 タイ	国債証券	439,400,000	106.97 470,034,968	106.59 468,382,824	3.650000 2021/12/17	3.08%
14	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19 オーストラリア	国債証券	363,510,000	111.21 404,284,916	111.62 405,771,672	5.250000 2019/3/15	2.66%
15	THAILAND 3.25 06/16/17 タイ	国債証券	318,734,000	103.38 329,526,333	103.07 328,547,819	3.250000 2017/6/16	2.16%
16	NEW ZEALAND 3.0 04/15/20 ニュージーランド	国債証券	320,497,000	101.51 325,349,664	101.31 324,708,330	3.000000 2020/4/15	2.13%
17	POLAND 5.25 10/25/20 ポーランド	国債証券	177,045,000	114.64 202,964,388	113.45 200,866,404	5.250000 2020/10/25	1.32%
18	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19 オーストラリア	国債証券	129,825,000	103.29 134,106,628	103.25 134,049,505	2.750000 2019/10/21	0.88%
19	CANADA 3.75 06/01/19 カナダ	国債証券	119,067,000	111.37 132,606,108	111.91 133,257,405	3.750000 2019/6/1	0.88%

(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8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	98.44%
合計	98.44%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

D I A M U S・リート・オープン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2015年09月	売建	5,000,000	605,600,000	605,850,000	1.36%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

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

該当事項はありません。

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

該当事項はありません。

高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	カナダ・ドル買/円売 2015年09月	買建	2,083,291	189,703,453	190,787,798	1.25%
		オーストラリア・ドル 買/円売2015年0 9月	買建	1,564,564	134,507,135	135,381,727	0.89%
		イギリス・ポンド売/ 円買2015年09月	売建	1,031,684	192,127,595	192,790,968	1.27%

（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。

（ 3 ） 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成27年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成20年2月8日)	1,578	1,583	0.9077	0.9107
第2特定期間末 (平成20年8月8日)	1,568	1,573	0.8930	0.8960
第3特定期間末 (平成21年2月9日)	811	816	0.4861	0.4891
第4特定期間末 (平成21年8月10日)	1,015	1,020	0.6107	0.6137
第5特定期間末 (平成22年2月8日)	941	946	0.5723	0.5753
第6特定期間末 (平成22年8月9日)	921	926	0.5760	0.5790
第7特定期間末 (平成23年2月8日)	915	920	0.5958	0.5988
第8特定期間末 (平成23年8月8日)	808	812	0.5483	0.5513
第9特定期間末 (平成24年2月8日)	755	759	0.5519	0.5549
第10特定期間末 (平成24年8月8日)	745	749	0.5648	0.5678
第11特定期間末 (平成25年2月8日)	876	879	0.6899	0.6929
第12特定期間末 (平成25年8月8日)	816	820	0.6912	0.6942
第13特定期間末 (平成26年2月10日)	813	817	0.7307	0.7337
第14特定期間末 (平成26年8月8日)	787	790	0.7552	0.7582
第15特定期間末 (平成27年2月9日)	770	773	0.8462	0.8492
第16特定期間末 (平成27年8月10日)	690	692	0.8360	0.8390
平成26年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	-
3月末日	744	-	0.8491	-
4月末日	726	-	0.8504	-

5月末日	733	-	0.8622	-
6月末日	692	-	0.8299	-
7月末日	692	-	0.8381	-
8月末日	645	-	0.7863	-

【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
第16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
第16特定期間	0.9

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	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
第16特定期間	14,578,152	99,796,099

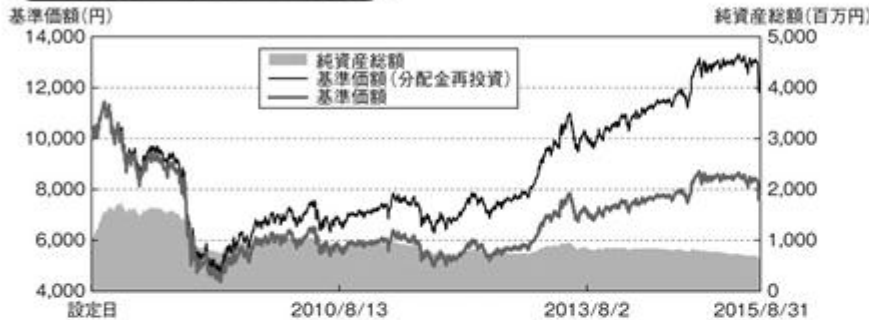
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2015年8月31日

基準価額・純資産の推移 《設定日(2007年8月20日)~2015年8月31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91期(2015.04.08)	30円
第92期(2015.05.08)	30円
第93期(2015.06.08)	30円
第94期(2015.07.08)	30円
第95期(2015.08.10)	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	2,940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	高金利ソブリン・マザーファンド	33.40%
2	DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	32.09%
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	19.60%
4	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	13.44%

■高金利ソブリン・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	98.44
内 アメリカ	14.10
内 イギリス	12.37
内 カナダ	10.07
内 タイ	9.38
内 ポーランド	9.33
内 その他	43.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.56
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2.14
為替予約取引(売建)	△1.27

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 1.375 02/29/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/2/29	14.10%
2	UK TREASURY 2.0 07/22/20	国債証券	イギリス	2.000000	2020/7/22	12.37%
3	CANADA 1.5 03/01/20	国債証券	カナダ	1.500000	2020/3/1	9.20%
4	MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	マレーシア	4.378000	2019/11/29	8.40%
5	SINGAPORE 1.625 10/01/19	国債証券	シンガポール	1.625000	2019/10/1	7.84%
6	NEW ZEALAND 5.0 03/15/19	国債証券	ニュージーランド	5.000000	2019/3/15	6.98%
7	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	メキシコ	8.000000	2020/6/11	5.63%
8	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	オーストラリア	4.500000	2020/4/15	4.98%
9	THAILAND 3.875 06/13/19	国債証券	タイ	3.875000	2019/6/13	4.15%
10	POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	ポーランド	5.500000	2019/10/25	4.05%

■DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.27
内 アメリカ	43.50
内 イギリス	16.50
内 フランス	7.17
内 カナダ	6.70
内 スイス	4.42
内 その他	18.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.73
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	ALTRIA GROUP INC	アメリカ	タバコ	2.40%
2	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	アメリカ	貯蓄・貸付・不動産金融	2.03%
3	MERCK & CO. INC.	アメリカ	医薬品	2.02%
4	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	タバコ	2.01%
5	PFIZER INC	アメリカ	医薬品	1.95%
6	AT&T INC	アメリカ	各種電気通信サービス	1.73%
7	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	スイス	医薬品	1.72%
8	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	イギリス	石油・ガス・消耗燃料	1.69%
9	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	アメリカ	運送インフラ	1.69%
10	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	タバコ	1.50%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	医薬品	14.37%
2	商業銀行	13.00%
3	石油・ガス・消耗燃料	9.80%
4	タバコ	8.73%
5	各種電気通信サービス	8.02%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2015年8月31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	89.25
内 アメリカ	89.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10.75
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△1.36

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	CYRUSONE INC	アメリカ	4.76%
2	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	4.42%
3	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	アメリカ	4.09%
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.89%
5	KITE REALTY GROUP TRUST	アメリカ	3.54%
6	TERRENO REALTY CORP	アメリカ	3.51%
7	LIBERTY PROPERTY TRUST	アメリカ	3.36%
8	ACADIA REALTY TRUST	アメリカ	3.34%
9	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	3.23%
10	POST PROPERTIES, INC	アメリカ	3.05%

■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。

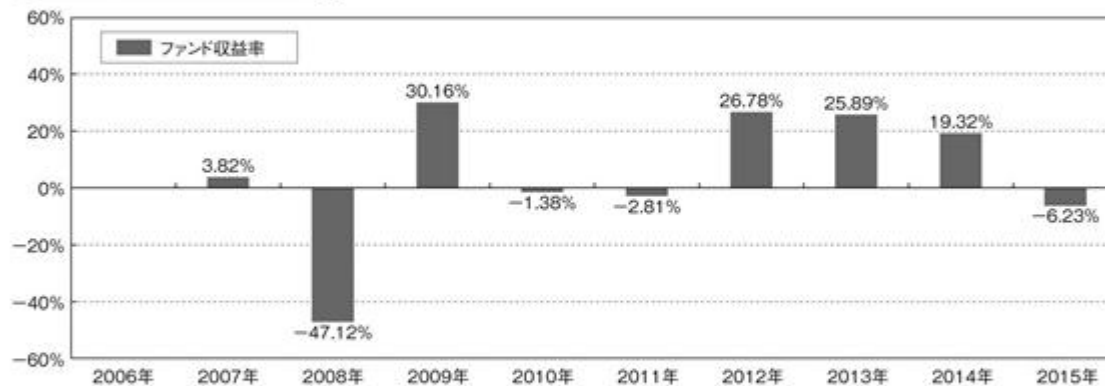
ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	43.48
内 オーストラリア	31.24
内 シンガポール	12.24
投資証券	50.60
内 カナダ	16.56
内 イギリス	11.81
内 ベルギー	6.68
内 オランダ	6.02
内 フランス	3.84
内 その他	5.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5.92
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	FEDERATION CENTRES	オーストラリア	7.60%
2	CHARTER HALL RETAIL REIT	オーストラリア	5.40%
3	WAREHOUSES DE PAUW	ベルギー	4.59%
4	ALLIED PROPERTIES REIT	カナダ	4.43%
5	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	カナダ	4.06%
6	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	3.99%
7	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	オランダ	3.89%
8	HAMMERSON PLC	イギリス	3.80%
9	GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド	3.71%
10	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	3.33%

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】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ お申込手数料

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

・ 解約のお申込み方法

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続が完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

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

解約価額 = 基準価額 - 信託財産留保額

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

信託期間は平成19年8月20日から無期限です。

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

（４）【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎月9日から翌月8日までとします。

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

（５）【その他】

イ. 償還規定

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

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

ロ. 信託約款の変更

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

ハ. 関係法人との契約の更改

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

投資一任契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、各マザーファンド(高金利ソブリン・マザーファンド、D I A M U S・

リート・オープン・マザーファンド、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド)の信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

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

二. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

・委託会社は、毎年2月8日、8月8日（休業日の場合は翌営業日とします。）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/>)

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金受領権

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

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

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

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

(2) 償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

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

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年2月10日から平成27年8月10日まで）の財務諸表について、PwC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27年2月9日現在	当 期 平成27年8月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,382,249	10,734,224
親投資信託受益証券	759,155,115	682,741,794
未収入金	5,000,000	-
流動資産合計	778,537,364	693,476,018
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,732,469	2,476,815
未払解約金	4,214,144	83
未払受託者報酬	44,086	40,486
未払委託者報酬	837,731	769,343
その他未払費用	5,219	3,622
流動負債合計	7,833,649	3,290,349
負債合計	7,833,649	3,290,349
純資産の部		
元本等		
元本	1,910,823,085	1,825,605,138
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 140,119,370	2 135,419,469
（分配準備積立金）	19,825,755	14,446,597
元本等合計	770,703,715	690,185,669
純資産合計	770,703,715	690,185,669
負債純資産合計	778,537,364	693,476,018

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前 期 自 平成26年8月9日 至 平成27年2月9日	当 期 自 平成27年2月10日 至 平成27年8月10日
営業収益		
受取利息	2,796	2,556
有価証券売買等損益	114,627,070	11,586,679
営業収益合計	114,629,866	11,589,235
営業費用		
受託者報酬	261,543	234,647
委託者報酬	2 4,970,130	2 4,459,156
その他費用	30,969	26,609
営業費用合計	5,262,642	4,720,412
営業利益又は営業損失（ ）	109,367,224	6,868,823
経常利益又は経常損失（ ）	109,367,224	6,868,823
当期純利益又は当期純損失（ ）	109,367,224	6,868,823
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（ ）	2,487,459	245,485
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	255,401,427	140,119,370
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,108,254	15,660,484
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	30,108,254	15,660,484
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,294,119	2,228,465
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,294,119	2,228,465
分配金	1 17,411,843	1 15,355,456
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	140,119,370	135,419,469

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月8日及び8月8日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を平成27年2月9日、当特定期間末日を平成27年8月10日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前 期 平成27年2月9日現在	当 期 平成27年8月10日現在
1. 1 期首元本額	1,043,148,731円	910,823,085円
期中追加設定元本額	25,135,896円	14,578,152円
期中一部解約元本額	157,461,542円	99,796,099円
2. 受益権の総数	910,823,085口	825,605,138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140,119,370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135,419,469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8月9日 至 平成27年2月9日	当 期 自 平成27年2月10日 至 平成27年8月10日
1. 1 分配金の計算過程	(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27年2月10日 至平成27年3月9日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,717,363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(31,519,573円)及び分配準備積立金(19,545,562円)より分配対象収益は52,782,498円(1万口当たり586.89円)であり、うち2,698,056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。

(自平成27年3月10日 至平成27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(2,115,653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(30,564,505円)及び分配準備積立金(17,956,559円)より分配対象収益は50,636,717円(1万口当たり581.20円)であり、うち2,613,746円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自平成27年4月9日 至平成27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(1,913,653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(30,005,490円)及び分配準備積立金(17,070,517円)より分配対象収益は48,989,660円(1万口当たり573.63円)であり、うち2,562,103円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自平成27年5月9日 至平成27年6月8日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,115,706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(29,588,919円)及び分配準備積立金(16,024,507円)より分配対象収益は47,729,132円(1万口当たり568.93円)であり、うち2,516,773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12月9日 至平成27年1月8日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（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） 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>	<p>（自平成27年6月9日 至平成27年7月8日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,588,562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（29,309,792円）及び分配準備積立金（15,388,081円）より分配対象収益は47,286,435円（1万口当たり570.18円）であり、うち2,487,963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7月9日 至平成27年8月10日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,520,527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（29,195,391円）及び分配準備積立金（15,402,885円）より分配対象収益は46,118,803円（1万口当たり558.61円）であり、うち2,476,815円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>
	1,051,656円	941,397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8月9日 至 平成27年2月9日	当 期 自 平成27年2月10日 至 平成27年8月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成27年2月9日現在	当 期 平成27年8月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前 期 平成27年2月9日現在	当 期 平成27年8月10日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	6,641,464	14,852,983
合計	6,641,464	14,852,983

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前 期 平成27年2月9日現在	当 期 平成27年8月10日現在
1口当たり純資産額	0.8462円	0.8360円
(1万口当たり純資産額)	(8,462円)	(8,360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8月10日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	D I A M US・リート・オープン・マ ザーファンド	32,392,588	92,743,218	
	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	57,570,964	136,598,626	
	D I A M世界好配当株オープン・マザー ファンド	90,819,938	228,366,734	
	高金利ソブリン・マザーファンド	159,101,539	225,033,216	
親投資信託受益証券 合計		339,885,029	682,741,794	
合計		339,885,029	682,741,794	

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27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,543,815,051	553,653,910
コール・ローン		2,441,167,517	1,711,946,417
投資証券		52,265,279,208	46,102,637,928
未収入金		522,310,752	2,344,115,235
未収配当金		33,087,938	46,653,699
流動資産合計		57,805,660,466	50,759,007,189
資産合計		57,805,660,466	50,759,007,189
負債の部			
流動負債			
未払金		1,762,452,372	1,825,881,680
未払解約金		2,600,000	-
流動負債合計		1,765,052,372	1,825,881,680
負債合計		1,765,052,372	1,825,881,680
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,323,197,729	17,090,892,179
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		36,717,410,365	31,842,233,330
元本等合計		56,040,608,094	48,933,125,509
純資産合計		56,040,608,094	48,933,125,509
負債純資産合計		57,805,660,466	50,759,007,189

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	24,374,446,753円	19,323,197,729円
	同期中追加設定元本額	37,362,647円	8,940,675円
	同期中一部解約元本額	5,088,611,671円	2,241,246,225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	18,914,518円	15,399,319円
	D I A M世界6資産バランス ファンド	74,652,429円	69,347,201円
	D I A Mグローバル・アクティ ブ・バランスファンド	95,144,236円	86,382,183円
	D I A M資産形成ファンド（隔 月決算型）	2,153,576円	- 円
	D I A M資産形成ファンド（1 年決算型）	837,304円	- 円
	D I A M ワールド・リート・ インカム・オープン（毎月決算 コース）	17,842,293,180円	15,758,476,030円
	D I A M世界インカム・オープ ン（毎月決算コース）	300,657,687円	283,878,037円
	D I A M ワールドREITア クティブファンド（毎月決算 型）	619,869,621円	563,239,711円
	D I A M世界3資産オープン （毎月決算型）	215,519,017円	191,052,941円
	D I A Mインカム3資産ファン ド（毎月決算型）	34,768,999円	32,392,588円
	D I A M ワールドREITア クティブファンド<DC年金>	118,387,162円	89,461,581円
	D I A M米国リート・オープ ン（毎月決算型）	- 円	1,262,588円
	計	19,323,197,729円	17,090,892,179円
2 .	受益権の総数	19,323,197,729口	17,090,892,179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8月9日 至 平成27年2月9日	自 平成27年2月10日 至 平成27年8月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	1,947,232,571	1,484,979,389
合計	1,947,232,571	1,484,979,389

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年12月10日から平成27年2月9日まで及び平成26年12月10日から平成27年8月10日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1口当たり純資産額	2.9002円	2.8631円
（1万口当たり純資産額）	(29,002円)	(28,631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8月10日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	383,480.000	12,233,012.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	82,984.000	7,685,148.240	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	291,774.000	10,836,486.360	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	362,930.000	5,763,328.400	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	313,010.000	5,571,578.000	
		AMERICAN TOWER CORP	44,490.000	4,433,428.500	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	124,080.000	4,880,066.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	64,720.000	11,251,572.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	106,970.000	12,854,584.900	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	488,650.000	6,630,980.500	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	251,430.000	6,197,749.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	63,380.000	5,046,315.600	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	932,870.000	10,093,653.400	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,027,640.000	7,152,374.400	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	58,860.000	1,362,020.400	
		COUSINS PROPERTIES INC	797,430.000	7,862,659.800	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	65,130.000	5,362,804.200	
		CYRUSONE INC	510,458.000	15,727,210.980	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	459,367.000	15,894,098.200	
		DDR CORP	296,950.000	4,864,041.000	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	316,560.000	3,941,172.000	
		EAST GROUP	71,140.000	4,158,844.400	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	257,293.000	7,857,728.220	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	42,556.000	9,660,212.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	69,140.000	9,445,215.400			
FIRST INDUSTRIAL RT	447,440.000	9,391,765.600			
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	329,440.000	9,141,960.000			
HEALTH CARE REIT INC	114,990.000	7,819,320.000			

	HIGHWOODS PROPERTIES INC	173,140.000	7,256,297.400	
	KITE REALTY GROUP TRUST	544,082.000	14,053,638.060	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	403,990.000	13,557,904.400	
	NATIONAL HEALTH INVS INC	41,600.000	2,647,840.000	
	POST PROPERTIES, INC	252,180.000	14,654,179.800	
	PROLOGIS INC	425,600.000	17,347,456.000	
	QTS REALTY TRUST INC	20,870.000	889,062.000	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	434,870.000	7,201,447.200	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	377,130.000	6,339,555.300	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	77,950.000	14,942,235.500	
	TERRENO REALTY CORP	598,593.000	12,510,593.700	
	THE MACERICH COMPANY	120,740.000	9,702,666.400	
	UDR INC	159,440.000	5,476,764.000	
	VENTAS INC	121,210.000	8,169,554.000	
	VORNADO REALTY TRUST	133,206.000	12,671,886.780	
	アメリカ・ドル 小計	12,259,763.000	370,540,410.940 (46,102,637,928)	
投資証券 合計		12,259,763	46,102,637,928 (46,102,637,928)	
合計			46,102,637,928 (46,102,637,928)	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 43銘柄	94.22%	100%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,207,441,049	1,020,035,122
コール・ローン		1,250,242,369	2,091,343,541
投資信託受益証券		40,737,156,388	32,387,250,217
投資証券		37,535,034,764	37,324,733,468
未収入金		479,625,894	187,916,256
未収配当金		863,659,836	798,025,448
流動資産合計		84,073,160,300	73,809,304,052
資産合計		84,073,160,300	73,809,304,052
負債の部			
流動負債			
未払金		6,181,953	-
未払解約金		23,000,000	-
流動負債合計		29,181,953	-
負債合計		29,181,953	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	35,720,967,406	31,107,492,336
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		48,323,010,941	42,701,811,716
元本等合計		84,043,978,347	73,809,304,052
純資産合計		84,043,978,347	73,809,304,052
負債純資産合計		84,073,160,300	73,809,304,052

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	39,111,464,157円	35,720,967,406円
	同期中追加設定元本額	77,305,853円	11,969,573円
	同期中一部解約元本額	3,467,802,604円	4,625,444,643円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	世界6資産アクティブ・ balan ス・ファンド	36,356,512円	28,045,541円
	D I A M世界6資産バランス ファンド	150,106,178円	120,566,198円
	D I A Mグローバル・アクティ ブ・バランスファンド	198,776,346円	162,501,485円
	D I A M資産形成ファンド(隔 月決算型)	4,051,618円	- 円
	D I A M資産形成ファンド(1 年決算型)	1,497,935円	- 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)	32,925,651,365円	28,721,739,616円
	D I A M世界インカム・オープ ン(毎月決算コース)	578,040,843円	483,680,912円
	D I A M ワールドREITア クティブファンド(毎月決算 型)	1,142,170,098円	1,027,477,802円
	D I A M世界3資産オープン (毎月決算型)	405,529,280円	342,389,686円
	D I A Mインカム3資産ファン ド(毎月決算型)	63,932,824円	57,570,964円
	D I A M ワールドREITア クティブファンド<DC年金>	214,854,407円	163,520,132円
	計	35,720,967,406円	31,107,492,336円
2 .	受益権の総数	35,720,967,406口	31,107,492,336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8月9日 至 平成27年2月9日	自 平成27年2月10日 至 平成27年8月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	3,359,715,917	1,454,679,135
投資証券	3,837,255,796	3,227,671,772
合計	7,196,971,713	4,682,350,907

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成26年12月10日から平成27年2月9日まで及び平成26年12月10日から平成27年8月10日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1口当たり純資産額	2.3528円	2.3727円
(1万口当たり純資産額)	(23,528円)	(23,727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8月10日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ALE PROPERTY GROUP	2,579,620.000	9,596,186.400	
		CHARTER HALL GROUP	5,908,131.000	27,886,378.320	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	10,615,791.000	45,010,953.840	
		DEXUS PROPERTY GROUP	2,717,963.000	20,765,237.320	
		FEDERATION CENTRES	21,443,428.000	60,899,335.520	
		GOODMAN GROUP	679,426.000	4,253,206.760	
		GPT GROUP	1,940,607.000	9,082,040.760	
		MIRVAC GROUP	9,478,152.000	17,487,190.440	
		NATIONAL STORAGE REIT	9,508,663.000	15,974,553.840	
		SCENTRE GROUP	5,147,091.000	20,382,480.360	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	10,362,271.000	21,864,391.810		
	オーストラリア・ドル	小計	80,381,143.000	253,201,955.370 (23,299,643,933)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	5,365,100.000	12,929,891.000	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	14,377,600.000	18,475,216.000	
		CACHE LOGISTICS TRUST	5,662,000.000	5,973,410.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	8,667,000.000	17,767,350.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	12,519,840.000	18,717,160.800	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	19,701,320.000	21,080,412.400	
	シンガポール・ドル	小計	68,841,260.000	101,187,020.200 (9,087,606,284)	
	投資信託受益証券	合計	149,222,403	32,387,250,217 (32,387,250,217)	
	投資証券	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,778,892.000	15,476,360.400
HAMMERSON PLC			2,211,954.000	15,107,645.820	
LAND SECURITIES GROUP PLC			532,772.000	7,075,212.160	
SEGRO PLC			1,925,876.000	8,816,660.320	
イギリス・ポンド		小計	6,449,494.000	46,475,878.700 (8,955,437,067)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	950,022.000	34,599,801.240		

	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,819,678.000	23,892,372.140	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	992,261.000	12,879,547.780	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	847,500.000	10,695,450.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	3,200,000.000	14,848,000.000	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,032,649.000	30,876,205.100	
カナダ・ドル 小計		8,842,110.000	127,791,376.260 (12,090,342,108)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	26,401,917.000	32,738,377.080	
ニュージーランド・ドル 小計		26,401,917.000	32,738,377.080 (2,691,749,364)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	827,220.000	10,621,504.800	
	BEFIMMO	76,567.000	4,511,327.640	
	COFINIMMO SA	66,685.000	6,645,160.250	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	506,927.000	20,657,275.250	
	GECINA SA	45,322.000	5,427,309.500	
	ICADE	96,588.000	6,761,160.000	
	KLEPIERRE	228,034.000	9,473,672.530	
	VASTNED RETAIL	124,533.000	5,333,748.390	
	WAREHOUSES DE PAUW	330,312.000	24,238,294.560	
	WERELDHAVE NV	108,266.000	6,053,152.060	
ユーロ 小計		2,410,454.000	99,722,604.980 (13,587,204,929)	
投資証券 合計		44,103,975	37,324,733,468 (37,324,733,468)	
合計			69,711,983,685 (69,711,983,685)	

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	-%	12.13%	12.85%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 11銘柄	31.57%	-%	33.42%
カナダ・ドル	投資証券 6銘柄	-%	16.38%	17.34%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 7銘柄	12.31%	-%	13.04%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	3.65%	3.86%
ユーロ	投資証券 10銘柄	-%	18.41%	19.49%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
資産の部			
流動資産			
預金		156,905,018	157,356,744
コール・ローン		765,223,821	802,065,261
株式		45,407,906,367	42,541,507,656
派生商品評価勘定		-	839,696
未収入金		-	1,591,001,128
未収配当金		64,952,904	79,637,870
流動資産合計		46,394,988,110	45,172,408,355
資産合計		46,394,988,110	45,172,408,355
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	1,897,600
未払金		-	1,459,454,898
流動負債合計		-	1,461,352,498
負債合計		-	1,461,352,498
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,307,458,751	17,383,623,131
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		27,087,529,359	26,327,432,726
元本等合計		46,394,988,110	43,711,055,857
純資産合計		46,394,988,110	43,711,055,857
負債純資産合計		46,394,988,110	45,172,408,355

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	21,617,827,271円	19,307,458,751円
	同期中追加設定元本額	1,274,270,892円	461,278,836円
	同期中一部解約元本額	3,584,639,412円	2,385,114,456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）	10,723,702,121円	9,158,932,335円
	D I A M世界好配当株式ファン ド（毎月決算型）	5,148,791,760円	5,282,788,128円
	世界6資産アクティブ・ balan ス・ファンド	56,842,043円	44,738,439円
	D I A M世界6資産バランス ファンド	240,812,751円	196,850,105円
	D I A Mグローバル・アクティ ブ・バランスファンド	337,983,846円	269,379,525円
	D I A M資産形成ファンド（隔 月決算型）	19,552,239円	- 円
	D I A M資産形成ファンド（1 年決算型）	7,421,777円	- 円
	D I A M世界インカム・オーブ ン（毎月決算コース）	924,788,095円	750,810,218円
	D I A M世界3資産オープン （毎月決算型）	659,457,957円	535,265,766円
	D I A Mインカム3資産ファン ド（毎月決算型）	106,516,022円	90,819,938円
	D I A M世界好配当株私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	1,081,590,140円	1,054,038,677円
	計	19,307,458,751円	17,383,623,131円
2 .	受益権の総数	19,307,458,751口	17,383,623,131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8月9日 至 平成27年2月9日	自 平成27年2月10日 至 平成27年8月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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 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>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	2,804,528,558	564,181,769
合計	2,804,528,558	564,181,769

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月27日から平成27年2月9日まで及び平成27年5月27日から平成27年8月10日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年2月9日 現在				平成27年8月10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	-	-	-	-	473,815,096	-	473,943,000	127,904
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	216,176,000	-	217,143,600	967,600
シンガポール・ドル	-	-	-	-	257,639,096	-	256,799,400	839,696
買 建	-	-	-	-	374,160,000	-	373,230,000	930,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	374,160,000	-	373,230,000	930,000
合計	-	-	-	-	847,975,096	-	847,173,000	1,057,904

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1口当たり純資産額	2,4030円	2,5145円
(1万口当たり純資産額)	(24,030円)	(25,145円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年8月10日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMERICAN ELECTRIC POWER	49,418	56.770	2,805,459.860	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	45,929	62.620	2,876,073.980	
	AMEREN CORP	68,961	42.120	2,904,637.320	
	VERIZON COMM INC	74,552	46.360	3,456,230.720	
	NORDIC AMERICAN TANKERS LTD	174,883	14.870	2,600,510.210	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	33,307	63.410	2,111,996.870	
	ONEOK INC	43,075	34.320	1,478,334.000	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	32,042	55.330	1,772,883.860	
	CISCO SYSTEMS INC	70,135	28.150	1,974,300.250	
	CRACKER BARREL OLD COUNTRY STORE INC	11,139	152.640	1,700,256.960	
	RR DONNELLEY & SONS CO	97,346	16.660	1,621,784.360	
	DUKE ENERGY CORP	36,819	75.150	2,766,947.850	
	GENERAL MILLS INC	59,841	59.110	3,537,201.510	
	GOLAR LNG LTD	35,514	39.440	1,400,672.160	
	REYNOLDS AMERICAN INC	47,588	86.160	4,100,182.080	
	JOHNSON & JOHNSON	36,590	98.850	3,616,921.500	
	KIMBERLY-CLARK CORP	25,247	116.710	2,946,577.370	
	VECTOR GROUP LTD	140,273	24.970	3,502,616.810	
	ELI LILLY & CO	42,650	82.270	3,508,815.500	
	LOCKHEED MARTIN CORP	20,444	209.090	4,274,635.960	
	MATTEL INC	67,009	22.820	1,529,145.380	
	MERCK & CO. INC.	121,349	57.970	7,034,601.530	
	MICROSOFT CORP	78,477	46.740	3,668,014.980	
	PACWEST BANCORP	88,858	46.370	4,120,345.460	
	WELLS FARGO & CO	31,719	57.470	1,822,890.930	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,648	68.780	2,795,769.440	
	OLD REPUBLIC INTL CORP	107,202	16.530	1,772,049.060	
	PPL CORPORATION	89,601	32.360	2,899,488.360	
	PFIZER INC	198,336	35.190	6,979,443.840	
	CONOCOPHILLIPS	47,615	48.840	2,325,516.600	
	ALTRIA GROUP INC	147,470	55.490	8,183,110.300	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	381,568	18.200	6,944,537.600	
SOUTHERN CO	62,615	45.530	2,850,860.950		
AT&T INC	172,794	34.210	5,911,282.740		
CHEVRON CORP	36,420	83.750	3,050,175.000		
REGAL ENTERTAINMENT GROUP-A	83,747	19.680	1,648,140.960		

	WILLIAMS COS INC	32,052	48.800	1,564,137.600	
	XILINX INC	38,906	43.200	1,680,739.200	
	ALLETE INC	56,379	51.210	2,887,168.590	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	71,837	76.360	5,485,473.320	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	37,630	45.170	1,699,747.100	
	AIRCATTLE LTD	76,076	23.380	1,778,656.880	
	SPECTRA ENERGY CORP	55,755	29.200	1,628,046.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	83,122	85.090	7,072,850.980	
	KINDER MORGAN INC/DELAWARE	49,393	32.140	1,587,491.020	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	19,556	86.990	1,701,176.440	
	SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP	38,431	45.790	1,759,755.490	
	TARGA RESOURCES CORP	18,075	73.920	1,336,104.000	
	ABBVIE INC	76,412	68.620	5,243,391.440	
	KRAFT HEINZ CO	36,020	78.460	2,826,129.200	
アメリカ・ドル 小計		3,590,825		156,743,279.520 (19,501,998,838)	
イギリス・ポンド	SEVERN TRENT PLC	47,469	21.900	1,039,571.100	
	BHP BILLITON PLC	73,510	11.910	875,504.100	
	BARCLAYS PLC	576,321	2.812	1,620,614.650	
	BT GROUP PLC	290,955	4.653	1,353,813.610	
	AVIVA PLC	402,521	5.230	2,105,184.830	
	BAE SYSTEMS PLC	415,057	4.715	1,956,993.750	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	92,673	38.050	3,526,207.650	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	40,548	33.520	1,359,168.960	
	HSBC HOLDINGS PLC	431,821	5.877	2,537,812.010	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	134,229	8.875	1,191,282.370	
	PRUDENTIAL PLC	71,174	15.285	1,087,894.590	
	RIO TINTO PLC	44,820	25.875	1,159,717.500	
	VODAFONE GROUP PLC	1,060,039	2.418	2,563,174.300	
	RELX PLC	124,608	10.930	1,361,965.440	
	BP PLC	323,382	3.856	1,246,960.990	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	103,866	14.500	1,506,057.000	
	ASTRAZENECA PLC	70,921	43.205	3,064,141.800	
	UNITED BUSINESS MEDIA LTD	221,726	5.320	1,179,582.320	
	ITV PLC	417,748	2.626	1,097,006.240	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	213,386	19.060	4,067,137.160	
MELROSE INDUSTRIES PLC	403,570	2.680	1,081,567.600		
INFORMA PLC	208,532	5.865	1,223,040.180		
ROYAL MAIL PLC	213,905	5.015	1,072,733.570		

イギリス・ポンド 小計		5,982,781		39,277,131.720 (7,568,310,512)	
オーストラリア・ドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	74,005	30.140	2,230,510.700	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	71,245	32.350	2,304,775.750	
	TELSTRA CORP LTD	490,026	6.290	3,082,263.540	
	AMP LTD	381,353	6.380	2,433,032.140	
	ASX LTD	57,785	43.080	2,489,377.800	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	71,714	32.820	2,353,653.480	
オーストラリア・ドル 小計		1,146,128		14,893,613.410 (1,370,510,305)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	30,545	72.750	2,222,148.750	
	BANK OF NOVA SCOTIA	36,609	62.490	2,287,696.410	
	NATIONAL BANK OF CANADA	80,997	45.870	3,715,332.390	
	BCE INC	116,609	54.140	6,313,211.260	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	237,390	9.050	2,148,379.500	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26,487	92.340	2,445,809.580	
	ROYAL BANK OF CANADA	31,994	76.330	2,442,102.020	
	SUNCOR ENERGY INC	61,670	37.350	2,303,374.500	
	WHITECAP RESOURCES INC	156,563	11.590	1,814,565.170	
	PEMBINA PIPELINE CORP	50,577	36.390	1,840,497.030	
	DH CORP	55,171	42.390	2,338,698.690	
カナダ・ドル 小計		884,612		29,871,815.300 (2,826,172,445)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	56,096	73.300	4,111,836.800	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	20,879	276.400	5,770,955.600	
	NOVARTIS AG-REG SHS	48,969	100.100	4,901,796.900	
スイス・フラン 小計		125,944		14,784,589.300 (1,868,328,549)	
スウェーデン・クローナ	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	214,250	103.200	22,110,600.000	
スウェーデン・クローナ 小計		214,250		22,110,600.000 (313,086,097)	
デンマーク・クローネ	DANSKE BANK A/S	83,046	210.900	17,514,401.400	
デンマーク・クローネ 小計		83,046		17,514,401.400 (319,812,969)	
ユーロ	CRH PLC	60,528	27.470	1,662,704.160	
	AXA	127,695	24.725	3,157,258.870	
	INTESA SANPAOLO	690,486	3.436	2,372,509.890	
	BNP PARIBAS	40,339	60.250	2,430,424.750	
	IBERDROLA SA	340,207	6.391	2,174,262.930	
	ENI SPA	97,396	16.130	1,570,997.480	
	LAGARDERE S.C.A.	58,010	26.745	1,551,477.450	
	SOCIETE GENERALE-A	43,835	47.875	2,098,600.620	

	VINCI S.A.	50,907	59.200	3,013,694.400	
	TELEFONICA S.A	204,754	14.000	2,866,556.000	
	TOTAL SA	32,729	45.795	1,498,824.550	
	DAIMLER AG	23,938	83.800	2,006,004.400	
	ORANGE	213,246	14.985	3,195,491.310	
	SAMPO OYJ-A SHS	39,428	45.590	1,797,522.520	
	ALLIANZ SE	22,152	153.250	3,394,794.000	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,176	173.200	2,628,483.200	
	SANOFI	34,520	98.240	3,391,244.800	
	ENEL SPA	438,446	4.376	1,918,639.690	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	143,285	16.865	2,416,501.520	
	ENAGAS	49,720	26.210	1,303,161.200	
	HERA SPA	714,670	2.302	1,645,170.340	
	FERROVIAL SA	139,945	21.470	3,004,619.150	
	ENGIE	148,222	17.910	2,654,656.020	
	RTL GROUP SA	19,163	81.310	1,558,143.530	
	BPOST SA	63,946	24.000	1,534,704.000	
	ユーロ 小計	3,812,743		56,846,446.780 (7,745,328,374)	
香港・ドル	HANG SENG BANK LTD	189,600	160.500	30,430,800.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,065,500	31.550	33,616,525.000	
	香港・ドル 小計	1,255,100		64,047,325.000 (1,027,959,567)	
	合計	17,095,429		42,541,507,656 (42,541,507,656)	

(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 50銘柄	44.62%	45.84%
イギリス・ポンド	株式 23銘柄	17.31%	17.79%
オーストラリア・ドル	株式 6銘柄	3.14%	3.22%
カナダ・ドル	株式 11銘柄	6.47%	6.64%
スイス・フラン	株式 3銘柄	4.27%	4.39%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	0.72%	0.74%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	0.73%	0.75%
ユーロ	株式 25銘柄	17.72%	18.21%
香港・ドル	株式 2銘柄	2.35%	2.42%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「高金利ソブリン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,133	-
コール・ローン		40,592,179	303,080,391
国債証券		16,829,064,733	15,705,827,611
未収利息		199,939,799	133,842,538
前払費用		43,452,882	16,906,771
流動資産合計		17,113,052,726	16,159,657,311
資産合計		17,113,052,726	16,159,657,311
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	2,434,524
未払金		-	197,121,870
未払解約金		5,000,000	10,000,000
流動負債合計		5,000,000	209,556,394
負債合計		5,000,000	209,556,394
純資産の部			
元本等			
元本	1	12,092,847,002	11,276,882,250
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		5,015,205,724	4,673,218,667
元本等合計		17,108,052,726	15,950,100,917
純資産合計		17,108,052,726	15,950,100,917
負債純資産合計		17,113,052,726	16,159,657,311

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	13,176,152,506円	12,092,847,002円
	同期中追加設定元本額	74,238,294円	- 円
	同期中一部解約元本額	1,157,543,798円	815,964,752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）	1,333,943,339円	1,047,988,245円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	329,888,026円	271,198,248円
	D I A Mバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	269,190,747円	243,182,877円
	D I A M世界6資産バランスファンド	403,778,242円	351,296,531円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	1,390,520,317円	1,176,749,697円
	D I A M資産形成ファンド（隔月決算型）	10,511,883円	- 円
	D I A M資産形成ファンド（1年決算型）	3,883,509円	- 円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	178,086,462円	159,101,539円
	D I A M高金利ソブリン私募ファンド（適格機関投資家向け）	8,173,044,477円	8,027,365,113円
	計	12,092,847,002円	11,276,882,250円
2 .	受益権の総数	12,092,847,002口	11,276,882,250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8月9日 至 平成27年2月9日	自 平成27年2月10日 至 平成27年8月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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 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>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	161,974,281	20,867,827
合計	161,974,281	20,867,827

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月9日から平成27年2月9日まで及び平成27年5月9日から平成27年8月10日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年2月9日 現在				平成27年8月10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								
買 建	-	-	-	-	199,755,599	-	197,321,075	2,434,524
イギリス・ボンド	-	-	-	-	199,755,599	-	197,321,075	2,434,524
合計	-	-	-	-	199,755,599	-	197,321,075	2,434,524

（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27年2月9日現在	平成27年8月10日現在
1口当たり純資産額	1.4147円	1.4144円
(1万口当たり純資産額)	(14,147円)	(14,144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8月10日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.375 02/29/20	17,775,000.000	17,672,082.750		
	アメリカ・ドル 小計		17,775,000.000 (2,211,565,500)	17,672,082.750 (2,198,760,536)		
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 2.0 07/22/20	10,800,000.000	11,084,148.000		
	イギリス・ポンド 小計		10,800,000.000 (2,081,052,000)	11,084,148.000 (2,135,804,478)		
	オーストラリア・ドル		AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	7,900,000.000	8,718,835.000	
			AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,200,000.000	4,668,426.000	
	オーストラリア・ドル 小計		12,100,000.000 (1,113,442,000)	13,387,261.000 (1,231,895,757)		
	カナダ・ドル		CANADA 1.5 03/01/20	12,720,000.000	13,211,373.600	
			CANADA 3.75 06/01/19	1,300,000.000	1,458,015.000	
	カナダ・ドル 小計		14,020,000.000 (1,326,432,200)	14,669,388.600 (1,387,870,855)		
	シンガポール・ドル		SINGAPORE 1.625 10/01/19	14,000,000.000	13,930,000.000	
	シンガポール・ドル 小計			14,000,000.000 (1,257,340,000)	13,930,000.000 (1,251,053,300)	
	タイ・パーツ		THAILAND 3.25 06/16/17	94,300,000.000	97,303,455.000	
			THAILAND 3.65 12/17/21	130,000,000.000	138,981,700.000	
			THAILAND 3.875 06/13/19	175,000,000.000	187,360,250.000	
	タイ・パーツ 小計		399,300,000.000 (1,413,522,000)	423,645,405.000 (1,499,704,734)		
	ニュージーランド・ドル		NEW ZEALAND 3.0 04/15/20	4,100,000.000	4,148,175.000	
			NEW ZEALAND 5.0 03/15/19	12,580,000.000	13,588,538.600	
	ニュージーランド・ドル 小計		16,680,000.000 (1,371,429,600)	17,736,713.600 (1,458,312,592)		
	ポーランド・ズロチ		POLAND 3.75 04/25/18	17,900,000.000	18,709,080.000	
			POLAND 5.25 10/25/20	5,500,000.000	6,219,675.000	
			POLAND 5.5 10/25/19	17,000,000.000	19,142,850.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		40,400,000.000 (1,315,020,000)	44,071,605.000 (1,434,530,743)		
マレーシア・リングgit		MALAYSIA 4.378 11/29/19	44,000,000.000	45,078,000.000		
マレーシア・リングgit 小計		44,000,000.000 (1,394,800,000)	45,078,000.000 (1,428,972,600)			
メキシコ・ペソ		MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	106,000,000.000	118,329,920.000		

	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	90,000,000.000	99,711,900.000	
	メキシコ・ペソ 小計	196,000,000.000 (1,509,200,000)	218,041,820.000 (1,678,922,014)	
国債証券	合計	14,993,803,300 (14,993,803,300)	15,705,827,611 (15,705,827,611)	
合計		14,993,803,300 (14,993,803,300)	15,705,827,611 (15,705,827,611)	

- (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	13.79%	14.00%
イギリス・ポンド	国債証券 1銘柄	13.39%	13.60%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄	7.72%	7.84%
カナダ・ドル	国債証券 2銘柄	8.70%	8.84%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	7.84%	7.97%
タイ・バーツ	国債証券 3銘柄	9.40%	9.55%
ニュージーランド・ドル	国債証券 2銘柄	9.14%	9.29%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	8.99%	9.13%
マレーシア・リングギット	国債証券 1銘柄	8.96%	9.10%
メキシコ・ペソ	国債証券 2銘柄	10.53%	10.69%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成27年8月31日現在

資産総額	647,095,321円
負債総額	1,297,503円
純資産総額（ - ）	645,797,818円
発行済数量	821,305,770口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7863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8月31日現在

資産総額	45,154,749,158円
負債総額	448,746,671円
純資産総額（ - ）	44,706,002,487円
発行済数量	16,686,936,651口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6791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8月31日現在

資産総額	68,533,671,194円
負債総額	152,302,132円
純資産総額（ - ）	68,381,369,062円
発行済数量	31,104,977,474口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1984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8月31日現在

資産総額	40,259,429,852円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	40,259,429,852円
発行済数量	17,178,371,259口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3436円

高金利ソブリン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	15,553,952,181円
負債総額	325,574,870円
純資産総額（ - ）	15,228,377,311円
発行済数量	11,231,999,748口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3558円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

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

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

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

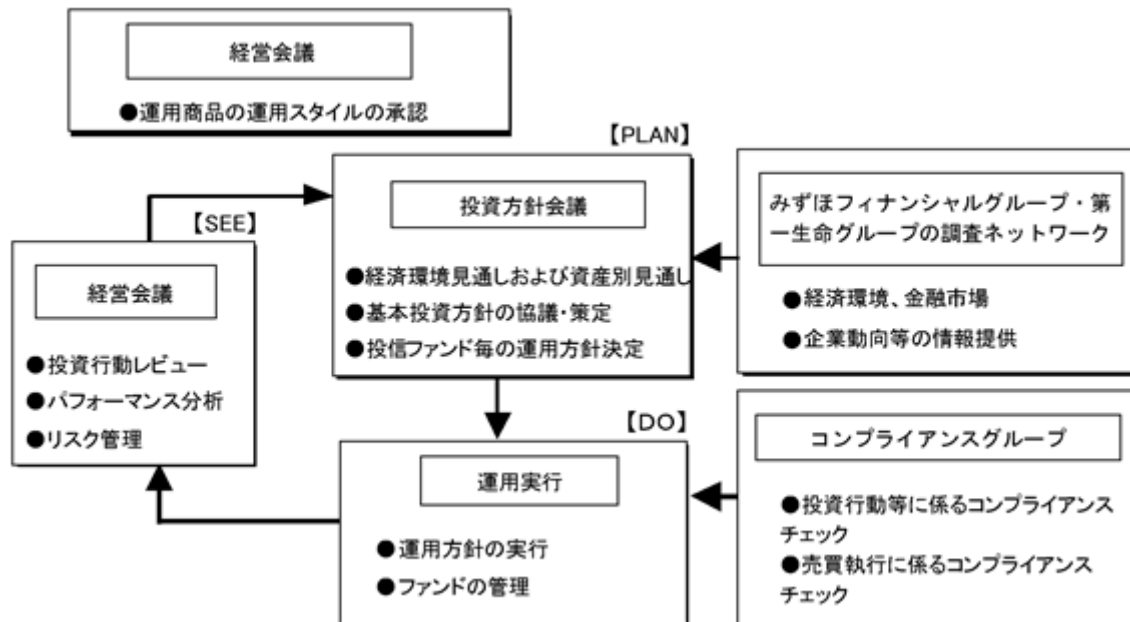
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成27年8月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は377本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	5	22,940,325,967
追加型株式投資信託	341	5,696,703,539,881
単位型公社債投資信託	31	246,234,027,023
追加型公社債投資信託	0	0
合計	377	5,965,877,892,871

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）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。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	4,178,284	4,343,365
関係会社株式	617,159	613,137
繰延税金資産	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

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

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

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

（単位：千円）

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

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

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

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

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

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

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	2,217,439 551,351 2,139	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	306,365 11,276,198 71
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	407,531 8,540	未払 費用 未払金	240,725 6,501
	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 8,254	金銭の 信託	14,169,657

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

平成27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27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27年10月末日現在 900万ポンド

c.事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

(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。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

- (4) DIAM U.S.A., Inc.は、委託会社との投資顧問契約に基づき、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの信託財産について運用助言を行います。

3【資本関係】

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

その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年9月16日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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10日から平成27年8月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）の平成27年8月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。