

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年5月6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 恵正
【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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書の提出に伴い、平成27年11月10日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】**(4)【発行(売出)価格】**

<訂正前>

(略)

<基準価額の照会方法等>

(略)

・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)

<訂正後>

(略)

<基準価額の照会方法等>

(略)

・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。

(当ファンドの略称：インカムパス)

第二部【ファンド情報】**第1【ファンドの状況】****1【ファンドの性格】****(3)【ファンドの仕組み】**

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

(1)資本金の額

20億円（平成27年8月31日現在）

(略)

(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%

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

(1)資本金の額

20億円（平成28年2月29日現在）

(略)

(3)大株主の状況

(平成28年2月29日現在)

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

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

(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
(略)	
運用 プロセス	(略) 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。
(略)	

ファンド名	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド
(略)	
運用 プロセス	(略) 上記は、平成27年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
(略)	

ファンド名	D I A M US・リート・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	(略) <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>デビス・セレクトド・アドバイザーズとは・・・ 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>
(略)	

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

投資態度	(略)
	<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。
	(略)
	(略)

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

<訂正後>

(略)

(参考)当ファンドが投資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
	(略)
運用プロセス	(略)
	上記は、平成28年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
	(略)

ファンド名	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド
	(略)
運用プロセス	(略)
	上記は、平成28年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
	(略)

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

投資態度	(略)
	<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3兆4,941億円（約28,970百万米ドル、1米ドル=120.61円で換算）。そのうち、不動産関連証券投資は約772億円（2015年12月末現在）。 ・不動産関連証券投資では1994年からの実績。 ・運用スタイルは、個別銘柄選択による割安銘柄投資を特徴としています。
	(略)
(略)	

ファンド名	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド
	(略)
投資態度	(略)
	<p>コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントとは・・・</p> <p>Colonial First State Asset Management (Australia) Limited</p> <ul style="list-style-type: none"> ・オーストラリア・コモンウェルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。 ・運用受託資産は、約17兆1,662億円（約195,248百万豪ドル、1豪ドル=87.92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2,777億円（2015年12月末現在）。 ・不動産関連証券投資では1991年からの実績。 ・運用スタイルは、マクロ分析によるトップダウンと個別銘柄調査によるボトムアップ運用の融合を特徴としています。
	(略)
(略)	

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

<訂正前>

(略)

各ファンドの運用指図の委託先の運用体制は以下の通りです。

・DIAM International Ltdの運用体制

高金利ソブリン・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。

運用体制	<ul style="list-style-type: none"> ・DIAM International Ltdでは、資産クラス別運用体制ではなく、マルチプラットフォーム体制を採用しており、全ての運用担当者は3つまたは4つのプラットフォームに所属しております。 ・マクロ分析・市場分析・企業分析プラットフォームにおいては、株式や債券などの特定の資産クラスのみならず、幅広い資産クラスに関連する様々なレベルの分析が行われております。
運用プロセス	<p>情報収集・分析</p> <ul style="list-style-type: none"> ・マルチプラットフォーム体制のもと、DIAM International Ltd内の他の運用担当者との情報交換や議論を通じ、投資対象国・地域のマクロ経済環境や対象資産に関する情報収集や分析を行います。 <p>運用方針・戦略の決定</p> <ul style="list-style-type: none"> ・月次の各種テーマ別運用方針会議におけるマクロ経済環境や金融市場環境などに関する議論を踏まえ、当該ファンドの運用目標・ガイドラインに沿った運用方針・戦略を策定します。 <p>(略)</p>

(略)

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。

(略)

<訂正後>

(略)

各ファンドの運用指図の委託先の運用体制は以下の通りです。

・DIAM International Ltdの運用体制

高金利ソブリン・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。	
運用体制	<ul style="list-style-type: none"> ・DIAM International Ltdの運用部門は、債券（含む、エマージング、クレジット）、為替、株式、トレーディングの担当で構成されています。 ・DIAM International Ltdの債券、為替、株式の運用担当者は、欧州およびその近接地域の市場を中心に、マクロ分析、市場分析、企業分析を行います。 ・グローバル運用体制を採用しており、アジア、オセアニア、米州等の地域に関しては、東京およびNYオフィスの運用担当者からの情報、分析を投資判断に活用しています。

運用プロセス	<p>情報収集・分析</p> <p>・運用担当者は、欧州およびその近接地域の市場を中心に、マクロ分析、市場分析、企業分析を行います。アジア、オセアニア、米州等の地域に関しては、東京およびNYオフィスの運用担当者との情報交換や議論を活用し、投資対象国・地域のマクロ経済環境や対象資産に関する分析を行います。</p> <p>運用方針・戦略の決定</p> <p>・月次の運用方針会議におけるマクロ経済環境や金融市場環境などに関する議論を踏まえ、当該ファンドの運用目標・ガイドラインに沿った運用方針・戦略を策定します。さらに市場環境の変化に対応するため、週次の担当者ミーティングで運用方針・戦略の確認・見直しを行います。</p> <p>(略)</p>
--------	---

(略)

上記体制は、平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

3【投資リスク】

< 外部委託先に関する管理体制 >

< 訂正前 >

(略)

上記体制は平成27年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。

< 訂正後 >

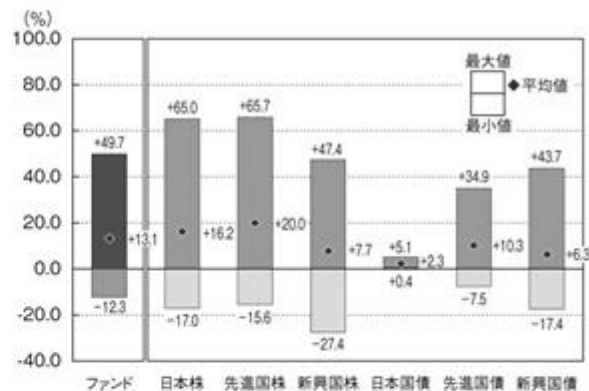
(略)

上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

< 更新・訂正後 >

(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

2011年3月～2016年2月

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

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

*各資産クラスの指数

- 日本株……東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
 - 先進国株……MSCIコクサイ・インデックス (円ベース、配当込み)
 - 新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス (円ベース、配当込み)
 - 日本国債……NOMURA-BPI国債
 - 先進国債……シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 - 新興国債……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 (後東京証券取引所) 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、後東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、後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、後東京証券取引所は、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】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.296%（税抜1.20%）

信託報酬の配分（税抜）	主な役務
（略）	

（略）

<訂正後>

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.296%（税抜1.20%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
（略）		

（略）

(4)【その他の手数料等】

<訂正前>

（略）

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。

（略）

- ・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。

（略）

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。

（略）

<訂正後>

（略）

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、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

- ・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、信託財産から支払われます。

（略）

- ・有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

（略）

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

（略）

（５）【課税上の取扱い】

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

<更新・訂正後>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアN I S A」をご利用の場合

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

上記は、平成28年4月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	563,287,527	98.79
内 日本	563,287,527	98.79
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,913,955	1.21
純資産総額	570,201,482	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28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	35,936,098,506	89.64
内 アメリカ	35,936,098,506	89.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,155,242,775	10.36
純資産総額	40,091,341,281	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

平成28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	28,985,323,464	47.26
内 オーストラリア	21,211,418,631	34.58
内 シンガポール	7,773,904,833	12.68
投資証券	28,335,178,171	46.20
内 イギリス	6,626,107,042	10.80
内 カナダ	6,534,275,269	10.65
内 ベルギー	4,512,387,781	7.36
内 フランス	3,990,642,297	6.51
内 オランダ	3,022,050,978	4.93
内 ニュージーランド	2,456,732,698	4.01
内 ドイツ	1,192,982,106	1.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,011,247,641	6.54
純資産総額	61,331,749,276	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28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	35,644,197,149	98.42
内 アメリカ	17,855,855,644	49.30
内 イギリス	5,977,301,117	16.50
内 フランス	2,813,834,478	7.77
内 ドイツ	1,442,223,762	3.98
内 オーストラリア	1,365,162,219	3.77
内 カナダ	1,269,118,858	3.50
内 スイス	1,117,711,340	3.09
内 イタリア	805,809,253	2.22
内 フィンランド	560,133,271	1.55
内 ベルギー	374,755,127	1.03
内 スペイン	369,001,302	1.02
内 アイルランド	354,876,710	0.98
内 オランダ	339,412,528	0.94
内 デンマーク	323,420,672	0.89
内 ジャージー	204,318,735	0.56
内 スウェーデン	161,141,866	0.44
内 シンガポール	160,510,064	0.44
内 バミューダ	149,610,203	0.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	572,857,707	1.58
純資産総額	36,217,054,856	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28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	13,642,503,830	98.11
内 アメリカ	1,704,345,021	12.26
内 カナダ	1,676,982,885	12.06
内 メキシコ	1,409,336,681	10.13
内 マレーシア	1,384,875,250	9.96
内 タイ	1,362,327,807	9.80
内 イギリス	1,331,144,812	9.57
内 シンガポール	1,302,496,000	9.37
内 ポーランド	1,246,368,080	8.96
内 オーストラリア	1,209,459,944	8.70
内 ニュージーランド	1,015,167,350	7.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	263,247,091	1.89
純資産総額	13,905,750,921	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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	149,461,035	1.3115 196,033,093	1.2706 189,905,191	- -	33.30%
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	87,549,720	2.1578 188,923,540	2.1164 185,290,227	- -	32.50%
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	55,379,423	2.1272 117,808,646	2.0724 114,768,316	- -	20.13%
4	D I A M US・リート・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	27,383,125	2.7072 74,134,334	2.6777 73,323,793	- -	12.86%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.79%
合計	98.79%

(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28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	155,730	14,153.48 2,204,121,742	12,941.31 2,015,351,452	- -	5.03%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	92,100	21,315.34 1,963,143,584	21,633.24 1,992,422,140	- -	4.97%
3	KITE REALTY GROUP TRUST アメリカ	投資証券	642,862	2,967.51 1,907,700,890	3,072.28 1,975,055,151	- -	4.93%
4	CYRUSONE INC アメリカ	投資証券	406,598	4,081.50 1,659,533,542	4,560.70 1,854,374,263	- -	4.63%
5	CATCHMARK TIMBER TRUST INC アメリカ	投資証券	1,464,150	1,248.09 1,827,402,429	1,194.14 1,748,409,158	- -	4.36%
6	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES アメリカ	投資証券	336,654	4,404.00 1,482,624,628	4,992.46 1,680,732,571	- -	4.19%
7	TERRENO REALTY CORP アメリカ	投資証券	645,733	2,507.24 1,619,013,570	2,542.81 1,641,979,945	- -	4.10%
8	EAST GROUP アメリカ	投資証券	227,240	6,322.54 1,436,736,155	6,192.28 1,407,135,979	- -	3.51%
9	ACADIA REALTY TRUST アメリカ	投資証券	361,980	3,715.39 1,344,900,325	3,783.54 1,369,567,981	- -	3.42%
10	POST PROPERTIES, INC アメリカ	投資証券	215,080	6,639.97 1,428,125,155	6,329.77 1,361,406,974	- -	3.40%
11	EDUCATION REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	262,713	4,077.35 1,071,175,333	4,522.07 1,188,008,152	- -	2.96%
12	COUSINS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	1,154,610	1,016.79 1,173,997,253	989.63 1,142,636,925	- -	2.85%
13	FIRST INDUSTRIAL RT アメリカ	投資証券	438,590	2,536.03 1,112,279,781	2,451.91 1,075,387,417	- -	2.68%
14	DCT INDUSTRIAL TRUST INC アメリカ	投資証券	255,137	4,275.52 1,090,843,499	4,140.31 1,056,346,986	- -	2.63%
15	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES アメリカ	投資証券	544,410	1,872.74 1,019,539,005	1,932.67 1,052,168,250	- -	2.62%
16	HIGHWOODS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	192,770	4,797.24 924,765,019	5,044.72 972,472,216	- -	2.43%
17	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	49,260	20,330.58 1,001,484,422	19,476.74 959,424,232	- -	2.39%
18	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP アメリカ	投資証券	445,600	2,047.92 912,554,909	2,119.01 944,232,192	- -	2.36%
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	38,781	26,219.13 1,016,804,324	23,857.92 925,234,290	- -	2.31%
20	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	105,565	9,011.75 951,325,768	8,470.37 894,174,714	- -	2.23%

21	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC アメリカ	投資証券	215,010	3,644.94 783,700,477	4,044.87 869,687,928	- -	2.17%
22	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	114,190	7,509.86 857,552,016	7,214.86 823,866,005	- -	2.05%
23	FOREST CITY REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	361,570	2,435.41 880,573,055	2,149.69 777,263,557	- -	1.94%
24	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	76,960	9,739.95 749,587,063	9,747.45 750,164,506	- -	1.87%
25	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	81,350	8,362.55 680,293,769	8,439.69 686,569,074	- -	1.71%
26	CEDAR REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	775,810	805.98 625,289,453	787.38 610,862,398	- -	1.52%
27	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	35,420	16,439.67 582,293,387	16,865.75 597,384,964	- -	1.49%
28	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	362,930	1,833.82 665,550,760	1,614.54 585,965,074	- -	1.46%
29	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	61,400	9,597.01 589,256,993	9,442.95 579,797,633	- -	1.45%
30	DDR CORP アメリカ	投資証券	296,950	1,897.45 563,448,965	1,897.45 563,448,965	- -	1.41%

(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28年2月29日現在

種類	投資比率
投資証券	89.64%
合計	89.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

平成28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	VICINITY CENTRES オーストラリア	投資信託受益 証券	21,443,428	225.85 4,843,008,935	252.56 5,415,837,949	- -	8.83%
2	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	10,615,791	337.56 3,583,482,333	350.51 3,720,978,058	- -	6.07%
3	WAREHOUSES DE PAUW ベルギー	投資証券	330,312	9,393.88 3,102,913,239	9,644.58 3,185,723,184	- -	5.19%
4	GOODMAN PROPERTY TRUST ニュージーランド	投資証券	26,401,917	93.42 2,466,599,095	93.05 2,456,732,698	- -	4.01%
5	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV オランダ	投資証券	506,927	4,886.83 2,477,266,704	4,768.92 2,417,497,729	- -	3.94%
6	CHARTER HALL GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,908,131	365.89 2,161,749,684	361.03 2,133,053,891	- -	3.48%
7	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	69,923	27,659.59 1,934,041,827	28,241.23 1,974,711,560	- -	3.22%
8	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	2,211,954	949.84 2,101,014,774	863.20 1,909,379,927	- -	3.11%
9	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA オーストラリア	投資信託受益 証券	10,362,271	170.80 1,769,922,517	183.75 1,904,134,651	- -	3.10%
10	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	1,778,892	1,266.46 2,252,896,985	1,038.05 1,846,590,937	- -	3.01%
11	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,147,091	335.13 1,724,960,048	357.79 1,841,624,012	- -	3.00%
12	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	1,013,101	1,882.63 1,907,297,040	1,584.65 1,605,411,715	- -	2.62%
13	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	12,519,840	122.51 1,533,830,638	124.52 1,559,058,115	- -	2.54%
14	MAPLETREE LOGISTICS TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	19,701,320	80.75 1,591,022,848	78.58 1,548,228,232	- -	2.52%
15	ALLIED PROPERTIES REIT カナダ	投資証券	559,122	2,650.91 1,482,182,268	2,717.95 1,519,670,280	- -	2.48%
16	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	562,873	2,619.06 1,474,199,566	2,664.31 1,499,673,735	- -	2.45%
17	NATIONAL STORAGE REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	12,019,303	128.30 1,542,145,685	123.85 1,488,632,744	- -	2.43%
18	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	9,478,152	155.42 1,473,132,296	148.54 1,407,915,502	- -	2.30%
19	FRASERS CENTREPOINT TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	8,667,000	150.72 1,306,307,574	158.78 1,376,163,594	- -	2.24%
20	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,219,673	631.40 1,401,523,728	608.74 1,351,212,620	- -	2.20%
21	ASCOTT RESIDENCE TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	14,377,600	92.37 1,328,151,877	89.06 1,280,512,188	- -	2.09%

22	SEGRO PLC イギリス	投資証券	1,925,876	686.78 1,322,666,985	656.70 1,264,724,463	- -	2.06%
23	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券	827,220	1,493.04 1,235,075,278	1,442.15 1,192,982,106	- -	1.95%
24	ASCENDAS REAL ESTATE INV シンガポール	投資信託受益 証券	5,566,291	191.34 1,065,074,290	193.43 1,076,743,331	- -	1.76%
25	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,047,168	1,066.90 1,117,224,900	1,016.61 1,064,567,010	- -	1.74%
26	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	847,500	1,102.10 934,031,021	1,167.47 989,433,621	- -	1.61%
27	COFINIMMO SA ベルギー	投資証券	66,685	12,008.88 800,812,402	12,559.93 837,559,065	- -	1.37%
28	CROMBIE REAL ESTATE INV カナダ	投資証券	736,461	1,052.65 775,238,322	1,112.99 819,678,736	- -	1.34%
29	ALE PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,579,620	310.84 801,869,717	313.27 808,134,324	- -	1.32%
30	GPT GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,940,607	381.27 739,903,963	402.32 780,747,919	- -	1.27%

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	47.26%
投資証券	46.20%
合計	93.46%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	191,327	3,990.08 763,411,054	4,218.71 807,153,242	- -	2.23%
2	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	61,954	11,615.45 719,623,625	12,018.72 744,608,001	- -	2.06%
3	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	71,131	9,543.52 678,840,348	10,390.54 739,090,140	- -	2.04%
4	ALTRIA GROUP INC アメリカ	株式 タバコ	96,059	5,803.36 557,465,823	6,992.17 671,661,319	- -	1.85%
5	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	69,468	8,925.09 620,008,440	9,288.43 645,249,002	- -	1.78%
6	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	110,354	6,746.75 744,531,467	5,753.71 634,945,663	- -	1.75%
7	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	275,346	2,241.43 617,169,775	2,221.81 611,769,139	- -	1.69%
8	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	62,990	11,084.06 698,185,084	9,583.84 603,686,522	- -	1.67%
9	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	171,137	3,927.96 672,220,777	3,434.73 587,809,832	- -	1.62%
10	PPL CORPORATION アメリカ	株式 電力	146,396	3,680.46 538,804,945	3,956.24 579,178,940	- -	1.60%
11	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 タバコ	92,673	5,758.88 533,692,766	6,166.90 571,505,865	- -	1.58%
12	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	96,126	5,449.06 523,796,955	5,828.70 560,290,192	- -	1.55%
13	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	213,386	3,129.16 667,720,553	2,575.45 549,565,400	- -	1.52%
14	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サー ビス	1,543,666	382.36 590,244,721	344.65 532,030,289	- -	1.47%
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	55,677	9,111.91 507,324,137	9,214.58 513,040,282	- -	1.42%
16	ORANGE フランス	株式 各種電気通信 サービス	258,378	1,861.31 480,923,849	1,962.17 506,983,911	- -	1.40%
17	TOTAL SA フランス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	98,289	5,673.19 557,612,468	5,068.03 498,131,781	- -	1.38%

18	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	15,348	31,666.70 486,020,588	29,638.39 454,890,086	- -	1.26%
19	MCDONALD'S CORPORATION アメリカ	株式 ホテル・レス トラン・レ ジャー	31,230	13,226.16 413,053,185	13,300.35 415,370,155	- -	1.15%
20	REYNOLDS AMERICAN INC アメリカ	株式 タバコ	72,039	4,366.24 314,539,864	5,712.81 411,545,378	- -	1.14%
21	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	70,445	5,411.07 381,182,932	5,796.89 408,362,085	- -	1.13%
22	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	738,576	640.93 473,377,468	550.53 406,610,017	- -	1.12%
23	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC アメリカ	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	229,947	1,975.80 454,329,506	1,750.88 402,610,569	- -	1.11%
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノ ロジー	59,870	7,453.63 446,249,036	6,362.71 380,936,046	- -	1.05%
25	KIMBERLY-CLARK CORP アメリカ	株式 家庭用品	25,247	12,424.34 313,677,488	14,918.30 376,642,471	- -	1.04%
26	SIEMENS AG-REG ドイツ	株式 コングロマ リット	35,000	10,988.32 384,591,382	10,711.93 374,917,693	- -	1.04%
27	SPECTRA ENERGY CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	112,405	2,928.97 329,231,304	3,319.97 373,181,947	- -	1.03%
28	LOCKHEED MARTIN CORP アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	14,930	23,264.58 347,340,316	24,682.80 368,514,335	- -	1.02%
29	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	46,193	8,013.43 370,164,431	7,930.67 366,341,716	- -	1.01%
30	IMPERIAL BRANDS PLC イギリス	株式 タバコ	61,484	5,333.16 327,904,291	5,940.86 365,268,254	- -	1.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
株式	98.42%
合計	98.42%

(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28年2月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品	外国	11.23%
石油・ガス・消耗燃料		10.00%
タバコ		8.22%
各種電気通信サービス		7.76%
保険		7.21%
総合公益事業		6.51%
電力		6.27%
商業銀行		4.95%
食品		3.18%
家庭用品		2.46%
無線通信サービス		2.38%
ホテル・レストラン・レジャー		2.25%
建設・土木		2.20%
航空宇宙・防衛		1.93%
コングロマリット		1.65%
メディア		1.59%
ソフトウェア		1.55%
ガス		1.49%
半導体・半導体製造装置		1.42%
水道		1.12%
貯蓄・抵当・不動産金融		1.11%
通信機器		1.09%
バイオテクノロジー		1.05%
化学		1.04%
電気設備		1.01%
金属・鉱業		0.99%
航空貨物・物流サービス		0.92%
レジャー用品		0.68%
パーソナル用品		0.60%
複合小売り		0.52%
紙製品・林産品		0.48%
建設資材		0.48%
運送インフラ	0.47%	
商業サービス・用品	0.45%	
専門小売り	0.45%	
資本市場	0.43%	
自動車	0.43%	
家庭用耐久財	0.42%	
商社・流通業	0.41%	
合計		98.42%

(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28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.375 02/29/20 アメリカ	国債証券	1,690,097,500	99.35 1,679,275,173	100.84 1,704,345,021	1.375000 2020/2/29	12.26%
2	CANADA 1.5 03/01/20 カナダ	国債証券	1,501,875,200	102.73 1,542,926,846	103.65 1,556,783,757	1.500000 2020/3/1	11.20%
3	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 メキシコ	国債証券	1,281,320,000	111.10 1,423,598,303	109.99 1,409,336,681	8.000000 2020/6/11	10.13%
4	MALAYSIA 4.378 11/29/19 マレーシア	国債証券	1,346,500,000	103.02 1,387,202,002	102.85 1,384,875,250	4.378000 2019/11/29	9.96%
5	UK TREASURY 2.0 07/22/20 イギリス	国債証券	1,260,160,000	102.61 1,293,123,580	105.63 1,331,144,812	2.000000 2020/7/22	9.57%
6	SINGAPORE 1.625 10/01/19 シンガポール	国債証券	1,289,600,000	99.80 1,287,073,996	101.00 1,302,496,000	1.625000 2019/10/1	9.37%
7	NEW ZEALAND 3.0 04/15/20 ニュージーランド	国債証券	992,547,200	100.58 998,314,752	102.27 1,015,167,350	3.000000 2020/4/15	7.30%
8	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20 オーストラリア	国債証券	760,930,000	109.95 836,683,252	110.72 842,524,523	4.500000 2020/4/15	6.06%
9	THAILAND 3.875 06/13/19 タイ	国債証券	556,500,000	106.76 594,124,965	107.49 598,181,850	3.875000 2019/6/13	4.30%
10	POLAND 5.5 10/25/19 ポーランド	国債証券	482,800,000	113.69 548,895,320	113.12 546,143,360	5.500000 2019/10/25	3.93%
11	THAILAND 3.65 12/17/21 タイ	国債証券	413,400,000	106.97 442,222,248	110.56 457,083,978	3.650000 2021/12/17	3.29%
12	POLAND 3.75 04/25/18 ポーランド	国債証券	309,560,000	105.11 325,393,994	104.96 324,914,176	3.750000 2018/4/25	2.34%
13	THAILAND 3.25 06/16/17 タイ	国債証券	299,874,000	103.38 310,027,733	102.39 307,061,979	3.250000 2017/6/16	2.21%
14	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19 オーストラリア	国債証券	218,565,000	111.21 243,081,436	110.39 241,284,831	5.250000 2019/3/15	1.74%
15	POLAND 2.0 04/25/21 ポーランド	国債証券	198,800,000	98.85 196,513,800	99.13 197,086,344	2.000000 2021/4/25	1.42%
16	POLAND 5.25 10/25/20 ポーランド	国債証券	156,200,000	114.64 179,067,680	114.10 178,224,200	5.250000 2020/10/25	1.28%
17	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19 オーストラリア	国債証券	121,425,000	103.29 125,429,596	103.48 125,650,590	2.750000 2019/10/21	0.90%
18	CANADA 3.75 06/01/19 カナダ	国債証券	108,953,000	111.37 121,342,045	110.32 120,199,128	3.750000 2019/6/1	0.86%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
国債証券	98.11%
合計	98.11%

（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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成28年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成20年2月8日)	1,578	1,583	0.9077	0.9107
第2特定期間末 (平成20年8月8日)	1,568	1,573	0.8930	0.8960
第3特定期間末 (平成21年2月9日)	811	816	0.4861	0.4891
第4特定期間末 (平成21年8月10日)	1,015	1,020	0.6107	0.6137
第5特定期間末 (平成22年2月8日)	941	946	0.5723	0.5753
第6特定期間末 (平成22年8月9日)	921	926	0.5760	0.5790
第7特定期間末 (平成23年2月8日)	915	920	0.5958	0.5988
第8特定期間末 (平成23年8月8日)	808	812	0.5483	0.5513
第9特定期間末 (平成24年2月8日)	755	759	0.5519	0.5549
第10特定期間末 (平成24年8月8日)	745	749	0.5648	0.5678
第11特定期間末 (平成25年2月8日)	876	879	0.6899	0.6929
第12特定期間末 (平成25年8月8日)	816	820	0.6912	0.6942
第13特定期間末 (平成26年2月10日)	813	817	0.7307	0.7337
第14特定期間末 (平成26年8月8日)	787	790	0.7552	0.7582
第15特定期間末 (平成27年2月9日)	770	773	0.8462	0.8492
第16特定期間末 (平成27年8月10日)	690	692	0.8360	0.8390
第17特定期間末 (平成28年2月8日)	584	587	0.7319	0.7349
平成27年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	-

9月末日	619	-	0.7569	-
10月末日	654	-	0.8021	-
11月末日	645	-	0.8005	-
12月末日	633	-	0.7865	-
平成28年1月末日	603	-	0.7516	-
2月末日	570	-	0.7144	-

【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
第17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
第17特定期間	10.3

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,764,046,378	24,791,049
第2特定期間	40,714,816	23,863,656
第3特定期間	2,131,244	89,278,252
第4特定期間	10,856,290	16,484,516
第5特定期間	8,101,863	26,743,189
第6特定期間	3,257,201	47,437,282
第7特定期間	5,059,112	68,827,822
第8特定期間	2,582,669	65,396,213
第9特定期間	5,514,726	110,355,631
第10特定期間	13,441,504	62,458,346
第11特定期間	17,391,808	67,620,316
第12特定期間	27,505,788	116,107,063
第13特定期間	20,079,763	87,547,408
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
第17特定期間	9,102,080	35,878,154

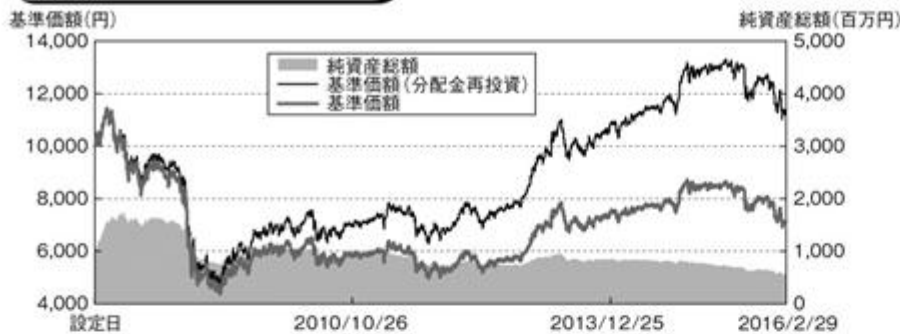
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(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:2016年2月29日

基準価額・純資産の推移 《設定日(2007年8月20日)~2016年2月29日》



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと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97期(2015.10.08)	30円
第98期(2015.11.09)	30円
第99期(2015.12.08)	30円
第100期(2016.01.08)	30円
第101期(2016.02.08)	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	3,120円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 (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。

順位	銘柄名	投資比率
1	高金利ソブリン・マザーファンド	33.30%
2	DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	32.50%
3	DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	20.13%
4	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	12.86%

■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(%)	順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
国債証券	98.11	1	US T N/B 1.375 02/29/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/2/29	12.26%
内 アメリカ	12.26	2	CANADA 1.5 03/01/20	国債証券	カナダ	1.500000	2020/3/1	11.20%
内 カナダ	12.06	3	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	メキシコ	8.000000	2020/6/11	10.13%
内 メキシコ	10.13	4	MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	マレーシア	4.378000	2019/11/29	9.96%
内 マレーシア	9.96	5	UK TREASURY 2.0 07/22/20	国債証券	イギリス	2.000000	2020/7/22	9.57%
内 タイ	9.80	6	SINGAPORE 1.625 10/01/19	国債証券	シンガポール	1.625000	2019/10/1	9.37%
内 その他	43.90	7	NEW ZEALAND 3.0 04/15/20	国債証券	ニュージーランド	3.000000	2020/4/15	7.30%
コール・ローンその他の資産(負債控除後)	1.89	8	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	オーストラリア	4.500000	2020/4/15	6.06%
純資産総額	100.00	9	THAILAND 3.875 06/13/19	国債証券	タイ	3.875000	2019/6/13	4.30%
		10	POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	ポーランド	5.500000	2019/10/25	3.93%

■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(%)	順位	銘柄名	発行体の国/地域	業種	投資比率	順位	業種	投資比率
株式	98.42	1	AT&T INC	アメリカ	各種電気通信サービス	2.23%	1	医薬品	11.23%
内 アメリカ	49.30	2	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品	2.06%	2	石油・ガス・消耗燃料	10.00%
内 イギリス	16.50	3	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	タバコ	2.04%	3	タバコ	8.22%
内 フランス	7.77	4	ALTRIA GROUP INC	アメリカ	タバコ	1.85%	4	各種電気通信サービス	7.76%
内 ドイツ	3.98	5	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.78%	5	保険	7.21%
内 オーストラリア	3.77	6	MERCK & CO. INC.	アメリカ	医薬品	1.75%			
内 その他	17.10	7	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	医薬品	1.69%			
コール・ローンその他の資産(負債控除後)	1.58	8	CHEVRON CORP	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.67%			
純資産総額	100.00	9	PFIZER INC	アメリカ	医薬品	1.62%			
		10	PPL CORPORATION	アメリカ	電力	1.60%			

○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:2016年2月29日

主要な資産の状況

■DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	89.64
内 アメリカ	89.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10.36
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	5.03%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	4.97%
3	KITE REALTY GROUP TRUST	アメリカ	4.93%
4	CYRUSONE INC	アメリカ	4.63%
5	CATCHMARK TIMBER TRUST INC	アメリカ	4.36%
6	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	アメリカ	4.19%
7	TERRENO REALTY CORP	アメリカ	4.10%
8	EAST GROUP	アメリカ	3.51%
9	ACADIA REALTY TRUST	アメリカ	3.42%
10	POST PROPERTIES, INC	アメリカ	3.40%

■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。

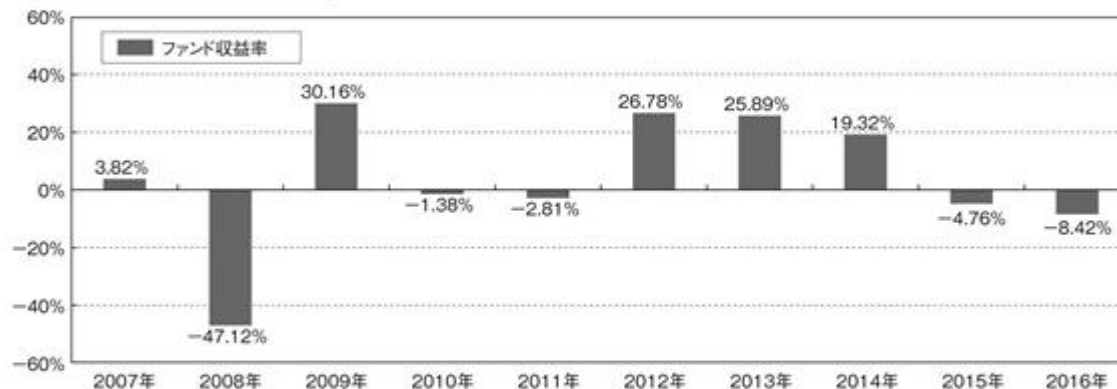
ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	47.26
内 オーストラリア	34.58
内 シンガポール	12.68
投資証券	46.20
内 イギリス	10.80
内 カナダ	10.65
内 ベルギー	7.36
内 フランス	6.51
内 オランダ	4.93
内 その他	5.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6.54
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	VICINITY CENTRES	オーストラリア	8.83%
2	CHARTER HALL RETAIL REIT	オーストラリア	6.07%
3	WAREHOUSES DE PAUW	ベルギー	5.19%
4	GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド	4.01%
5	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	オランダ	3.94%
6	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	3.48%
7	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	3.22%
8	HAMMERSON PLC	イギリス	3.11%
9	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	オーストラリア	3.10%
10	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	3.01%

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2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年8月11日から平成28年2月8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8月10日現在	当 期 平成28年2月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,734,224	9,294,549
親投資信託受益証券	682,741,794	576,899,613
未収入金	-	5,000,000
流動資産合計	693,476,018	591,194,162
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,476,815	2,396,487
未払解約金	83	3,456,193
未払受託者報酬	40,486	32,357
未払委託者報酬	769,343	614,907
その他未払費用	3,622	2,543
流動負債合計	3,290,349	6,502,487
負債合計	3,290,349	6,502,487
純資産の部		
元本等		
元本	1,825,605,138	1,798,829,064
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 135,419,469	2 214,137,389
（分配準備積立金）	14,446,597	7,439,583
元本等合計	690,185,669	584,691,675
純資産合計	690,185,669	584,691,675
負債純資産合計	693,476,018	591,194,162

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	前 期 自 平成27年2月10日 至 平成27年8月10日	当 期 自 平成27年8月11日 至 平成28年2月8日
営業収益		
受取利息	2,556	2,366
有価証券売買等損益	11,586,679	65,842,181
営業収益合計	11,589,235	65,839,815
営業費用		
受託者報酬	234,647	204,046
委託者報酬	2 4,459,156	2 3,877,785
その他費用	26,609	16,060
営業費用合計	4,720,412	4,097,891
営業利益又は営業損失（ ）	6,868,823	69,937,706
経常利益又は経常損失（ ）	6,868,823	69,937,706
当期純利益又は当期純損失（ ）	6,868,823	69,937,706
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（ ）	245,485	154,364
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	140,119,370	135,419,469
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,660,484	7,667,766
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,660,484	7,667,766
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,228,465	2,023,074
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,228,465	2,023,074
分配金	1 15,355,456	1 14,579,270
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	135,419,469	214,137,389

(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8月10日現在	当 期 平成28年2月8日現在
1 . 1 期首元本額	910,823,085円	825,605,138円
期中追加設定元本額	14,578,152円	9,102,080円
期中一部解約元本額	99,796,099円	35,878,154円
2 . 受益権の総数	825,605,138口	798,829,064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135,419,469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214,137,389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27年2月10日 至 平成27年8月10日	当 期 自 平成27年8月11日 至 平成28年2月8日
1 . 1 分配金の計算過程	(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27年8月11日 至平成27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(933,611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(29,087,983円)及び分配準備積立金(14,342,558円)より分配対象収益は44,364,152円(1万口当たり539.99円)であり、うち2,464,699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。

(自平成27年9月9日 至平成27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(1,834,690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(28,878,562円)及び分配準備積立金

(12,691,262円)より分配対象収益は43,404,514円(1万口当たり532.52円)であり、うち2,445,241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10月9日 至平成27年11月9日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,627,430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(28,913,431円)及び分配準備積立金

(12,075,160円)より分配対象収益は42,616,021円(1万口当たり522.48円)であり、うち2,446,948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11月10日 至平成27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(1,088,339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(28,618,912円)及び分配準備積立金

(11,123,476円)より分配対象収益は40,830,727円(1万口当たり505.98円)であり、うち2,420,904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27年6月9日 至平成27年7月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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)</p> <p>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> <p style="text-align: right;">941,397円</p>	<p>(自平成27年12月9日 至平成28年1月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,170,598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(28,459,103円)及び分配準備積立金(9,700,163円)より分配対象収益は40,329,864円(1万口当たり503.08円)であり、うち2,404,991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28年1月9日 至平成28年2月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(426,481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(28,381,792円)及び分配準備積立金(9,409,589円)より分配対象収益は38,217,862円(1万口当たり478.42円)であり、うち2,396,487円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p style="text-align: right;">821,569円</p>
--	---	---

（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27年2月10日 至 平成27年8月10日	当 期 自 平成27年8月11日 至 平成28年2月8日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成27年8月10日現在	当 期 平成28年2月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前 期 平成27年8月10日現在	当 期 平成28年2月8日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	14,852,983	1,698,905
合計	14,852,983	1,698,905

(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8月10日現在	当 期 平成28年2月8日現在
1口当たり純資産額	0.8360円	0.7319円
(1万口当たり純資産額)	(8,360円)	(7,319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28年2月8日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	D I A M US・リート・オープン・マ ザーファンド	27,383,125	74,134,334	
	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	55,379,423	117,808,646	
	D I A M世界好配当株オープン・マザー ファンド	87,549,720	188,923,540	
	高金利ソブリン・マザーファンド	149,461,035	196,033,093	
親投資信託受益証券 合計		319,773,303	576,899,613	
合計		319,773,303	576,899,613	

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8月10日現在	平成28年2月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		553,653,910	2,710,969,440
コール・ローン		1,711,946,417	1,373,701,849
投資証券		46,102,637,928	36,436,614,342
未収入金		2,344,115,235	-
未収配当金		46,653,699	47,711,411
流動資産合計		50,759,007,189	40,568,997,042
資産合計		50,759,007,189	40,568,997,042
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	546,000
未払金		1,825,881,680	31,989,753
流動負債合計		1,825,881,680	32,535,753
負債合計		1,825,881,680	32,535,753
純資産の部			
元本等			
元本	1	17,090,892,179	14,973,254,925
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		31,842,233,330	25,563,206,364
元本等合計		48,933,125,509	40,536,461,289
純資産合計		48,933,125,509	40,536,461,289
負債純資産合計		50,759,007,189	40,568,997,042

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	19,323,197,729円	17,090,892,179円
	同期中追加設定元本額	8,940,675円	2,105,503円
	同期中一部解約元本額	2,241,246,225円	2,119,742,757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	15,399,319円	12,657,339円
	D I A M世界6資産バランス ファンド	69,347,201円	55,503,662円
	D I A Mグローバル・アクティ ブ・バランスファンド	86,382,183円	67,555,383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）	15,758,476,030円	13,838,677,537円
	D I A M世界インカム・オープ ン（毎月決算コース）	283,878,037円	228,199,146円
	D I A M ワールドREITア クティブファンド（毎月決算 型）	563,239,711円	500,914,181円
	D I A M世界3資産オープン （毎月決算型）	191,052,941円	159,343,957円
	D I A Mインカム3資産ファン ド（毎月決算型）	32,392,588円	27,383,125円
	D I A M ワールドREITア クティブファンド<DC年金>	89,461,581円	81,779,316円
	D I A M米国リート・オープン （毎月決算型）	1,262,588円	1,241,279円
	計	17,090,892,179円	14,973,254,925円
2 .	受益権の総数	17,090,892,179口	14,973,254,925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27年2月10日 至 平成27年8月10日	自 平成27年8月11日 至 平成28年2月8日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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8月10日現在	平成28年2月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	1,484,979,389	1,104,488,819
合計	1,484,979,389	1,104,488,819

（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8月10日まで及び平成27年12月10日から平成28年2月8日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年8月10日 現在				平成28年2月8日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	490,896,000	-	491,442,000	546,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	490,896,000	-	491,442,000	546,000
合計	-	-	-	-	490,896,000	-	491,442,000	546,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1口当たり純資産額	2.8631円	2.7073円
(1万口当たり純資産額)	(28,631円)	(27,073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28年2月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	354,510.000	11,893,810.500	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,384.000	4,009,995.200	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	329,704.000	14,183,866.080	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	362,930.000	5,287,890.100	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	124,080.000	4,592,200.800	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	48,240.000	8,020,864.800	
		BOSTON PROPERTIES INC	152,510.000	17,552,375.900	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	290,940.000	7,686,634.800	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	79,670.000	5,890,003.100	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	1,433,920.000	14,941,446.400	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,246,340.000	8,699,453.200	
		COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	109,310.000	1,662,605.100	
		COUSINS PROPERTIES INC	922,760.000	7,677,363.200	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	75,370.000	6,335,602.200	
		CYRUSONE INC	398,208.000	13,694,373.120	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	255,137.000	9,151,764.190	
		DDR CORP	296,950.000	4,997,668.500	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	210,570.000	7,237,290.900	
		EAST GROUP	222,550.000	11,403,462.000	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	257,293.000	9,854,321.900	
		EQUITY RESIDENTIAL	105,565.000	7,768,528.350	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,981.000	7,691,152.500	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	35,420.000	5,338,148.200	
		FIRST INDUSTRIAL RT	429,540.000	8,663,821.800	
		FOREST CITY REALTY TRUST INC	361,570.000	6,649,272.300	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	188,790.000	8,065,108.800	
KITE REALTY GROUP TRUST	629,592.000	16,992,688.080			
NATIONAL HEALTH INVS INC	41,600.000	2,577,536.000			
POST PROPERTIES, INC	210,640.000	11,507,263.200			

	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	533,170.000	9,106,543.600	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	436,400.000	8,055,944.000	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	40,730.000	681,820.200	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	90,200.000	16,594,996.000	
	TERRENO REALTY CORP	555,043.000	12,183,193.850	
	VORNADO REALTY TRUST	90,946.000	7,663,109.960	
	WELLTOWER INC	111,830.000	7,058,709.600	
	アメリカ・ドル 小計	11,122,393.000	311,370,828.430 (36,436,614,342)	
投資証券 合計		11,122,393	36,436,614,342 (36,436,614,342)	
合計			36,436,614,342 (36,436,614,342)	

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 36銘柄	89.89%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,020,035,122	1,540,089,055
コール・ローン		2,091,343,541	1,887,619,411
投資信託受益証券		32,387,250,217	29,273,638,073
投資証券		37,324,733,468	28,724,392,361
派生商品評価勘定		-	4,680,000
未収入金		187,916,256	1,450,498,303
未収配当金		798,025,448	657,632,005
流動資産合計		73,809,304,052	63,538,549,208
資産合計		73,809,304,052	63,538,549,208
負債の部			
流動負債			
未払金		-	51,587,744
未払解約金		-	525,000,000
流動負債合計		-	576,587,744
負債合計		-	576,587,744
純資産の部			
元本等			
元本	1	31,107,492,336	29,597,583,061
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		42,701,811,716	33,364,378,403
元本等合計		73,809,304,052	62,961,961,464
純資産合計		73,809,304,052	62,961,961,464
負債純資産合計		73,809,304,052	63,538,549,208

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 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3 . 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>
4 . 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8月10日現在	平成28年2月8日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	35,720,967,406円	31,107,492,336円
	同期中追加設定元本額	11,969,573円	6,220,329円
	同期中一部解約元本額	4,625,444,643円	1,516,129,604円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	世界6資産アクティブ・バラン ス・ファンド	28,045,541円	23,601,096円
	D I A M世界6資産バランス ファンド	120,566,198円	107,199,700円
	D I A Mグローバル・アクティ ブ・バランスファンド	162,501,485円	142,429,060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）	28,721,739,616円	27,345,321,284円
	D I A M世界インカム・オーブ ン（毎月決算コース）	483,680,912円	450,305,516円
	D I A M ワールドREITア クティブファンド（毎月決算 型）	1,027,477,802円	993,933,507円
	D I A M世界3資産オープン （毎月決算型）	342,389,686円	317,184,096円
	D I A Mインカム3資産ファン ド（毎月決算型）	57,570,964円	55,379,423円
	D I A M ワールドREITア クティブファンド< D C年金>	163,520,132円	162,229,379円
	計	31,107,492,336円	29,597,583,061円
2 .	受益権の総数	31,107,492,336口	29,597,583,061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27年2月10日 至 平成27年8月10日	自 平成27年8月11日 至 平成28年2月8日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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8月10日現在	平成28年2月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	1,454,679,135	361,200,174
投資証券	3,227,671,772	1,093,974,858
合計	4,682,350,907	732,774,684

（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8月10日まで及び平成27年12月10日から平成28年2月8日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年8月10日 現在				平成28年2月8日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	509,880,000	-	505,200,000	4,680,000
カナダ・ドル	-	-	-	-	509,880,000	-	505,200,000	4,680,000
合計	-	-	-	-	509,880,000	-	505,200,000	4,680,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1口当たり純資産額	2.3727円	2.1273円
(1万口当たり純資産額)	(23,727円)	(21,273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28年2月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ALE PROPERTY GROUP	2,579,620.000	9,931,537.000	
		CHARTER HALL GROUP	5,908,131.000	26,409,345.570	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	10,615,791.000	45,117,111.750	
		DEXUS PROPERTY GROUP	2,219,673.000	16,603,154.040	
		GOODMAN GROUP	679,426.000	4,096,938.780	
		GPT GROUP	1,940,607.000	9,547,786.440	
		MIRVAC GROUP	9,478,152.000	17,961,098.040	
		NATIONAL STORAGE REIT	12,019,303.000	18,629,919.650	
		SCENTRE GROUP	5,147,091.000	22,698,671.310	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	10,362,271.000	22,693,373.490	
		VICINITY CENTRES	21,443,428.000	63,258,112.600	
	オーストラリア・ドル 小計		82,393,493.000	256,947,048.670 (21,336,882,922)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	5,566,291.000	13,303,435.490	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	14,377,600.000	16,318,576.000	
		CACHE LOGISTICS TRUST	5,662,000.000	4,784,390.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	300,600.000	628,254.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	8,667,000.000	16,770,645.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	12,519,840.000	19,280,553.600	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	19,701,320.000	18,814,760.600	
		PARKWAY LIFE REIT	2,548,400.000	5,504,544.000	
	シンガポール・ドル 小計		69,343,051.000	95,405,158.690 (7,936,755,151)	
投資信託受益証券 合計			151,736,544	29,273,638,073 (29,273,638,073)	
投資証券	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,778,892.000	12,727,972.260	
		HAMMERSON PLC	2,211,954.000	12,530,719.410	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,013,101.000	10,799,656.660	
		SEGRO PLC	1,925,876.000	8,186,898.870	
		イギリス・ポンド 小計		6,929,823.000	44,245,247.200 (7,514,612,784)
	カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	609,122.000	19,242,163.980	

	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,127,168.000	13,176,593.920	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	786,461.000	10,318,368.320	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	847,500.000	11,763,300.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	1,775,299.000	7,935,586.530	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	632,873.000	20,011,444.260	
カナダ・ドル 小計		5,778,423.000	82,447,457.010 (6,942,900,355)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	26,401,917.000	33,398,425.000	
ニュージーランド・ドル 小計		26,401,917.000	33,398,425.000 (2,594,389,654)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	827,220.000	9,335,177.700	
	BEFIMMO	76,567.000	3,926,355.760	
	COFINIMMO SA	66,685.000	6,473,112.950	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	506,927.000	19,217,602.570	
	GECINA SA	45,322.000	5,132,716.500	
	ICADE	96,588.000	6,152,655.600	
	KLEPIERRE	130,772.000	4,980,451.620	
	VASTNED RETAIL	124,533.000	4,925,280.150	
	WAREHOUSES DE PAUW	330,312.000	24,112,776.000	
	WERELDHAVE NV	108,266.000	5,277,426.170	
ユーロ 小計		2,313,192.000	89,533,555.020 (11,672,489,568)	
投資証券 合計		41,423,355	28,724,392,361 (28,724,392,361)	
合計			57,998,030,434 (57,998,030,434)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
イギリス・ポンド	投資証券 4銘柄	-%	11.94%	12.96%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 11銘柄	33.89%	-%	36.79%
カナダ・ドル	投資証券 6銘柄	-%	11.03%	11.97%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 8銘柄	12.61%	-%	13.68%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	4.12%	4.47%
ユーロ	投資証券 10銘柄	-%	18.54%	20.13%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「D I A M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8月10日現在	平成28年2月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		157,356,744	296,666,255
コール・ローン		802,065,261	422,264,221
株式		42,541,507,656	36,480,434,785
派生商品評価勘定		839,696	-
未収入金		1,591,001,128	688,644,266
未収配当金		79,637,870	37,269,502
流動資産合計		45,172,408,355	37,925,279,029
資産合計		45,172,408,355	37,925,279,029
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	876,937,900
未払解約金		-	20,000,000
流動負債合計		1,461,352,498	896,937,900
負債合計		1,461,352,498	896,937,900
純資産の部			
元本等			
元本	1	17,383,623,131	17,159,828,687
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		26,327,432,726	19,868,512,442
元本等合計		43,711,055,857	37,028,341,129
純資産合計		43,711,055,857	37,028,341,129
負債純資産合計		45,172,408,355	37,925,279,029

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	19,307,458,751円	17,383,623,131円
	同期中追加設定元本額	461,278,836円	843,897,193円
	同期中一部解約元本額	2,385,114,456円	1,067,691,637円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M世界好配当株オープン(毎月決算コース)	9,158,932,335円	8,369,491,995円
	D I A M世界好配当株式ファンド(毎月決算型)	5,282,788,128円	5,962,914,836円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	44,738,439円	41,958,454円
	D I A M世界6資産バランスファンド	196,850,105円	180,823,562円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	269,379,525円	256,859,144円
	D I A M世界インカム・オープン(毎月決算コース)	750,810,218円	724,854,914円
	D I A M世界3資産オープン(毎月決算型)	535,265,766円	502,065,352円
	D I A Mインカム3資産ファンド(毎月決算型)	90,819,938円	87,549,720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)	1,054,038,677円	1,033,310,710円
	計	17,383,623,131円	17,159,828,687円
2 .	受益権の総数	17,383,623,131口	17,159,828,687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27年2月10日 至 平成27年8月10日	自 平成27年8月11日 至 平成28年2月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	564,181,769	1,872,875,169
合計	564,181,769	1,872,875,169

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年5月27日から平成27年8月10日まで及び平成27年5月27日から平成28年2月8日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年8月10日 現在				平成28年2月8日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	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8月10日現在	平成28年2月8日現在
1口当たり純資産額	2,5145円	2,1579円
(1万口当たり純資産額)	(25,145円)	(21,579円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年2月8日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMERICAN ELECTRIC POWER	29,901	62.840	1,878,978.840	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	26,635	68.520	1,825,030.200	
	AMEREN CORP	36,649	46.490	1,703,812.010	
	VERIZON COMM INC	70,445	50.970	3,590,581.650	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	27,919	59.630	1,664,809.970	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	32,042	60.250	1,930,530.500	
	CISCO SYSTEMS INC	70,135	22.890	1,605,390.150	
	CONSOLIDATED EDISON INC	28,431	72.040	2,048,169.240	
	RR DONNELLEY & SONS CO	97,346	13.500	1,314,171.000	
	DOW CHEMICAL	36,119	46.690	1,686,396.110	
	DUKE ENERGY CORP	36,668	79.040	2,898,238.720	
	ENTERGY CORP	21,768	72.220	1,572,084.960	
	EXXON MOBIL CORP	69,468	80.080	5,562,997.440	
	GENERAL MILLS INC	34,047	55.370	1,885,182.390	
	GENERAL ELECTRIC CO	66,427	28.540	1,895,826.580	
	REYNOLDS AMERICAN INC	72,039	47.530	3,424,013.670	
	CENTERPOINT ENERGY INC	90,220	18.850	1,700,647.000	
	INTEL CORP	102,458	29.040	2,975,380.320	
	JOHNSON & JOHNSON	61,954	100.540	6,228,855.160	
	WESTAR ENERGY INC	38,624	45.260	1,748,122.240	
	KIMBERLY-CLARK CORP	25,247	129.150	3,260,650.050	
	VECTOR GROUP LTD	83,126	22.790	1,894,441.540	
	ELI LILLY & CO	19,950	74.320	1,482,684.000	
	L BRANDS INC	17,083	85.060	1,453,079.980	
	LOCKHEED MARTIN CORP	14,930	211.940	3,164,264.200	
	SCANA CORP	34,898	64.560	2,253,014.880	
	MCDONALD'S CORPORATION	31,230	115.400	3,603,942.000	
	MATTEL INC	67,009	31.810	2,131,556.290	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	43,838	31.270	1,370,814.260	
	MERCK & CO. INC.	110,354	49.380	5,449,280.520	
	MICROSOFT CORP	96,126	50.160	4,821,680.160	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	46,193	65.470	3,024,255.710	
	OLD REPUBLIC INTL CORP	107,202	17.600	1,886,755.200	
EXELON CORP	50,513	32.900	1,661,877.700		
PPL CORPORATION	146,396	36.160	5,293,679.360		
PFIZER INC	171,137	29.030	4,968,107.110		
CONOCOPHILLIPS	45,848	32.900	1,508,399.200		
ALTRIA GROUP INC	96,059	59.800	5,744,328.200		

	PROCTER & GAMBLE CO	55,677	81.200	4,520,972.400	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	229,947	15.380	3,536,584.860	
	SOUTHERN CO	32,915	48.220	1,587,161.300	
	AT&T INC	191,327	36.880	7,056,139.760	
	CHEVRON CORP	62,990	82.880	5,220,611.200	
	STEEL DYNAMICS INC	91,063	18.160	1,653,704.080	
	AVISTA CORP	57,726	37.540	2,167,034.040	
	ALLIANT ENERGY CORP	25,487	67.770	1,727,253.990	
	ALLETE INC	56,379	53.450	3,013,457.550	
	B&G FOODS INC	48,242	35.180	1,697,153.560	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	24,195	62.870	1,521,139.650	
	SPECTRA ENERGY CORP	112,405	29.520	3,318,195.600	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	71,131	89.550	6,369,781.050	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	19,556	79.750	1,559,591.000	
	SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP	38,431	48.180	1,851,605.580	
	ABBVIE INC	59,870	53.120	3,180,294.400	
	KRAFT HEINZ CO	41,251	72.780	3,002,247.780	
	アメリカ・ドル 小計	3,475,026		157,094,956.310 (18,383,251,787)	
イギリス・ボンド	SEVERN TRENT PLC	47,469	21.400	1,015,836.600	
	BT GROUP PLC	231,421	4.759	1,101,332.530	
	AVIVA PLC	234,809	4.316	1,013,435.640	
	NATIONAL GRID PLC	169,098	9.590	1,621,649.820	
	BAE SYSTEMS PLC	410,069	4.790	1,964,230.510	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	92,673	37.265	3,453,459.340	
	MAN GROUP PLC	644,173	1.516	976,566.260	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	61,484	34.995	2,151,632.580	
	HSBC HOLDINGS PLC	230,256	4.578	1,054,111.960	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	434,422	2.119	920,540.210	
	UNILEVER PLC	44,744	29.675	1,327,778.200	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	169,201	9.230	1,561,725.230	
	RIO TINTO PLC	58,596	18.180	1,065,275.280	
	VODAFONE GROUP PLC	1,543,666	2.070	3,195,388.620	
	RELX PLC	92,785	11.700	1,085,584.500	
	BP PLC	738,576	3.506	2,589,447.450	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	275,346	14.010	3,857,597.460	
	ASTRAZENECA PLC	38,831	41.095	1,595,759.940	
	UNITED BUSINESS MEDIA LTD	221,726	4.979	1,103,973.750	

	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	28,966	33.900	981,947.400	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	213,386	15.365	3,278,675.890	
	INMARSAT PLC	102,588	10.200	1,046,397.600	
	ROYAL MAIL PLC	213,905	4.353	931,128.460	
イギリス・ポンド	小計	6,298,190		38,893,475.230 (6,605,667,834)	
オーストラリア・ドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	116,828	30.350	3,545,729.800	
	AMP LTD	381,353	5.220	1,990,662.660	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	510,292	4.290	2,189,152.680	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	34,354	76.600	2,631,516.400	
	TATTS GROUP LTD	544,944	4.000	2,179,776.000	
	AUSNET SERVICES	1,556,445	1.490	2,319,103.050	
	AGL ENERGY LTD	126,560	18.470	2,337,563.200	
オーストラリア・ドル	小計	3,270,776		17,193,503.790 (1,427,748,554)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	49,966	74.330	3,713,972.780	
	NATIONAL BANK OF CANADA	76,495	39.830	3,046,795.850	
	BCE INC	50,739	58.160	2,950,980.240	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	39,064	89.570	3,498,962.480	
	ROYAL BANK OF CANADA	31,994	71.140	2,276,053.160	
カナダ・ドル	小計	248,258		15,486,764.510 (1,304,140,440)	
シンガポール・ドル	UNITED OVERSEAS BANK LTD	116,800	17.870	2,087,216.000	
シンガポール・ドル	小計	116,800		2,087,216.000 (173,635,499)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	44,786	73.350	3,285,053.100	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15,348	252.200	3,870,765.600	
	NOVARTIS AG-REG SHS	36,941	73.900	2,729,939.900	
スイス・フラン	小計	97,075		9,885,758.600 (1,165,234,366)	
スウェーデン・クローナ	TELE2 AB-B SHS	171,994	69.300	11,919,184.200	
スウェーデン・クローナ	小計	171,994		11,919,184.200 (164,842,318)	
デンマーク・クローネ	TDC A/S	307,940	31.490	9,697,030.600	
	TRYG A/S	83,495	125.900	10,512,020.500	
デンマーク・クローネ	小計	391,435		20,209,051.100 (353,052,123)	
ユーロ	CRH PLC	60,528	22.990	1,391,538.720	
	AXA	86,725	20.330	1,763,119.250	
	BOUYGUES	65,280	34.150	2,229,312.000	

LAGARDERE S.C.A.	56,435	25.935	1,463,641.720	
SOCIETE GENERALE-A	35,989	32.110	1,155,606.790	
VINCI S.A.	40,887	60.750	2,483,885.250	
TOTAL SA	98,289	38.905	3,823,933.540	
SIEMENS AG-REG	35,000	84.550	2,959,250.000	
UPM-KYMMENE OYJ	90,420	14.960	1,352,683.200	
DAIMLER AG	20,125	61.290	1,233,461.250	
ORANGE	258,378	15.205	3,928,637.490	
SAMPO OYJ-A SHS	39,428	41.200	1,624,433.600	
ALLIANZ SE	19,588	138.050	2,704,123.400	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10,299	170.650	1,757,524.350	
AGEAS	45,981	34.445	1,583,815.540	
SANOFI	30,014	71.700	2,152,003.800	
ELISA OYJ	44,481	32.640	1,451,859.840	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	91,017	14.890	1,355,243.130	
UNIPOLSAI SPA	663,603	1.728	1,146,705.980	
SNAM SPA	581,044	4.938	2,869,195.270	
ENAGAS	57,058	26.185	1,494,063.730	
HERA SPA	893,668	2.618	2,339,622.820	
FERROVIAL SA	85,225	18.950	1,615,013.750	
ENGIE	115,367	14.035	1,619,175.840	
FREENET AG	49,304	27.070	1,334,659.280	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	85,129	16.625	1,415,269.620	
BPOST SA	63,946	21.770	1,392,104.420	
NN GROUP NV	45,508	28.750	1,308,355.000	
ユーロ 小計	3,768,716		52,948,238.580 (6,902,861,864)	
合計	17,838,270		36,480,434,785 (36,480,434,785)	

(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 55銘柄	49.65%	50.39%
イギリス・ポンド	株式 23銘柄	17.84%	18.11%
オーストラリア・ドル	株式 7銘柄	3.86%	3.91%
カナダ・ドル	株式 5銘柄	3.52%	3.57%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	0.47%	0.48%
スイス・フラン	株式 3銘柄	3.15%	3.19%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	0.45%	0.45%
デンマーク・クローネ	株式 2銘柄	0.95%	0.97%
ユーロ	株式 28銘柄	18.64%	18.92%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「高金利ソブリン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		-	13,654,963
コール・ローン		303,080,391	378,683,751
国債証券		15,705,827,611	13,865,477,295
未収利息		133,842,538	108,878,566
前払費用		16,906,771	6,438,996
流動資産合計		16,159,657,311	14,373,133,571
資産合計		16,159,657,311	14,373,133,571
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		10,000,000	10,000,000
流動負債合計		209,556,394	10,000,000
負債合計		209,556,394	10,000,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,276,882,250	10,950,862,708
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,673,218,667	3,412,270,863
元本等合計		15,950,100,917	14,363,133,571
純資産合計		15,950,100,917	14,363,133,571
負債純資産合計		16,159,657,311	14,373,133,571

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,092,847,002円	11,276,882,250円
	同期中追加設定元本額	- 円	- 円
	同期中一部解約元本額	815,964,752円	326,019,542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）	1,047,988,245円	944,180,821円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	271,198,248円	257,978,779円
	D I A Mバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	243,182,877円	228,699,964円
	D I A M世界6資産バランスファンド	351,296,531円	318,218,018円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	1,176,749,697円	1,056,019,702円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	159,101,539円	149,461,035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）	8,027,365,113円	7,996,304,389円
	計	11,276,882,250円	10,950,862,708円
2 .	受益権の総数	11,276,882,250口	10,950,862,708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27年2月10日 至 平成27年8月10日	自 平成27年8月11日 至 平成28年2月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年8月10日現在	平成28年2月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	20,867,827	117,074,398
合計	20,867,827	117,074,398

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年5月9日から平成27年8月10日まで及び平成27年5月9日から平成28年2月8日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年8月10日 現在				平成28年2月8日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
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8月10日現在	平成28年2月8日現在
1口当たり純資産額	1.4144円	1.3116円
(1万口当たり純資産額)	(14,144円)	(13,116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28年2月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.375 02/29/20	16,875,000.000	17,025,187.500		
	アメリカ・ドル 小計		16,875,000.000 (1,974,712,500)	17,025,187.500 (1,992,287,441)		
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 2.0 07/22/20	8,000,000.000	8,386,880.000		
	イギリス・ポンド 小計		8,000,000.000 (1,358,720,000)	8,386,880.000 (1,424,427,699)		
	オーストラリア・ドル		AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	9,400,000.000	10,368,670.000	
			AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,700,000.000	2,976,156.000	
			AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,545,915.000	
	オーストラリア・ドル 小計		13,600,000.000 (1,129,344,000)	14,890,741.000 (1,236,527,133)		
	カナダ・ドル		CANADA 1.5 03/01/20	14,720,000.000	15,353,548.800	
			CANADA 3.75 06/01/19	1,300,000.000	1,442,441.000	
	カナダ・ドル 小計		16,020,000.000 (1,349,044,200)	16,795,989.800 (1,414,390,301)		
	シンガポール・ドル		SINGAPORE 1.625 10/01/19	16,000,000.000	16,155,200.000	
	シンガポール・ドル 小計		16,000,000.000 (1,331,040,000)	16,155,200.000 (1,343,951,088)		
	タイ・パーツ		THAILAND 3.25 06/16/17	94,300,000.000	96,682,018.000	
			THAILAND 3.65 12/17/21	130,000,000.000	142,286,300.000	
			THAILAND 3.875 06/13/19	175,000,000.000	188,023,500.000	
	タイ・パーツ 小計		399,300,000.000 (1,313,697,000)	426,991,818.000 (1,404,803,081)		
	ニュージーランド・ドル		NEW ZEALAND 3.0 04/15/20	13,280,000.000	13,480,793.600	
	ニュージーランド・ドル 小計		13,280,000.000 (1,031,590,400)	13,480,793.600 (1,047,188,047)		
	ポーランド・ズロチ		POLAND 3.75 04/25/18	17,900,000.000	18,791,420.000	
			POLAND 5.25 10/25/20	5,500,000.000	6,297,500.000	
			POLAND 5.5 10/25/19	17,000,000.000	19,125,000.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		40,400,000.000 (1,193,820,000)	44,213,920.000 (1,306,521,336)		
マレーシア・リングgit		MALAYSIA 4.378 11/29/19	50,000,000.000	51,742,500.000		
マレーシア・リングgit 小計		50,000,000.000 (1,403,500,000)	51,742,500.000 (1,452,411,975)			
メキシコ・ペソ		MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	106,000,000.000	118,209,080.000		

	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	70,000,000.000	77,534,100.000	
	メキシコ・ペソ 小計	176,000,000.000 (1,117,600,000)	195,743,180.000 (1,242,969,193)	
国債証券	合計	13,203,068,100 (13,203,068,100)	13,865,477,295 (13,865,477,295)	
合計		13,203,068,100 (13,203,068,100)	13,865,477,295 (13,865,477,295)	

- (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	13.87%	14.37%
イギリス・ポンド	国債証券 1銘柄	9.92%	10.27%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	8.61%	8.92%
カナダ・ドル	国債証券 2銘柄	9.85%	10.20%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	9.36%	9.69%
タイ・バーツ	国債証券 3銘柄	9.78%	10.13%
ニュージーランド・ドル	国債証券 1銘柄	7.29%	7.55%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	9.10%	9.42%
マレーシア・リンギット	国債証券 1銘柄	10.11%	10.48%
メキシコ・ペソ	国債証券 2銘柄	8.65%	8.96%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成28年2月29日現在

資産総額	570,624,038円
負債総額	422,556円
純資産総額（ - ）	570,201,482円
発行済数量	798,190,367口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7144円

(参考)

D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産総額	40,440,664,956円
負債総額	349,323,675円
純資産総額（ - ）	40,091,341,281円
発行済数量	14,972,531,207口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6777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28年2月29日現在

資産総額	61,333,749,276円
負債総額	2,000,000円
純資産総額（ - ）	61,331,749,276円
発行済数量	29,594,163,492口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0724円

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産総額	36,217,054,856円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	36,217,054,856円
発行済数量	17,112,612,104口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1164円

高金利ソブリン・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産総額	13,905,750,921円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	13,905,750,921円
発行済数量	10,943,853,409口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2706円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

<更新・訂正後>

(1) 資本金の額

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

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

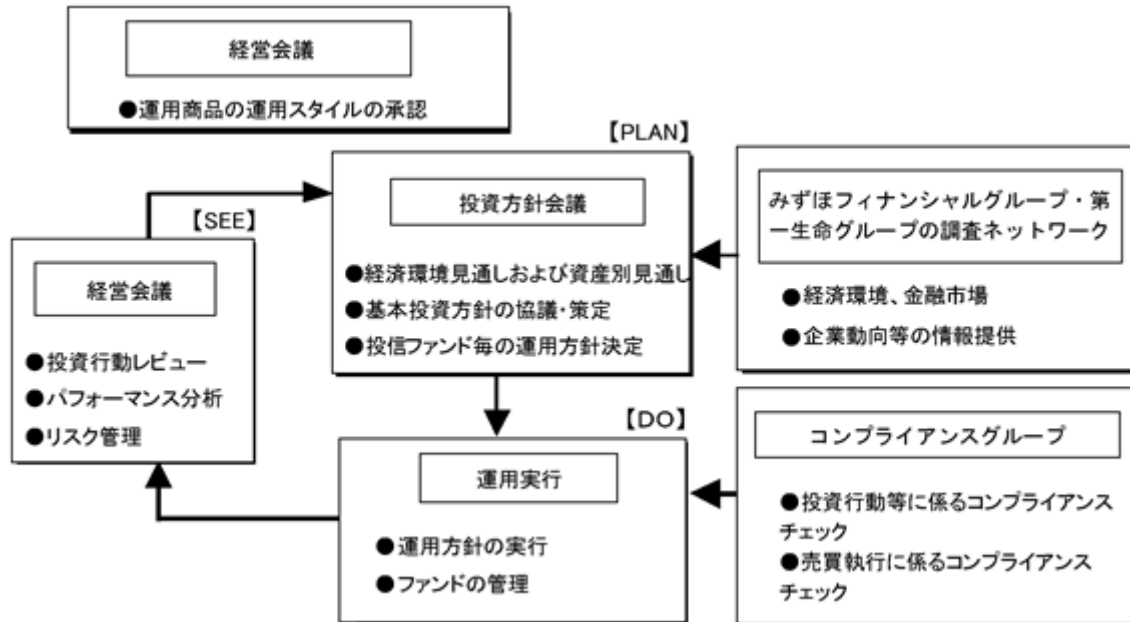
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

平成28年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は415本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	5	23,629,020,732
追加型株式投資信託	370	5,576,357,548,539
単位型公社債投資信託	40	294,039,557,704
追加型公社債投資信託	0	0
合計	415	5,894,026,126,975

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	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)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その 他 の 関 係 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行 (旧株式 会社みず ほコーポ レート銀 行)	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	1,629,874	未払 手数料	224,525
								預金の預入 (純額)	775,579	現金・ 預金	10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	432,201	-	-
							預金の引出 (純額)	203,876			
	みずほ第 一ファイ 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 一ファイ 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。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table border="0"> <tr> <td>有形固定資産</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">68,441千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: right;">...</td> <td style="text-align: right;">293,794千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	68,441千円	無形固定資産	...	293,794千円
有形固定資産	...	68,441千円					
無形固定資産	...	293,794千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

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

（有価証券関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）			
1．満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2．子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,316,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
3．その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	493,805	159,101	334,703
（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

（金銭の信託関係）

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

（セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

1．セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

第31期中間会計期間
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

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

1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(略)

(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。

<訂正後>

(略)

(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27年12月末日現在 671,821千米ドル

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27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12月末日現在 900万ポンド

c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

(6) 投資顧問会社

a. 名称

DIAM U.S.A., Inc.

b. 資本金の額

平成27年12月末日現在 400万米ドル

c. 事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

第3【その他】

< 訂正前 >

(略)

(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。

(略)

(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)

< 訂正後 >

(略)

(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。

(略)

(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28年3月23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8月11日から平成28年2月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）の平成28年2月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。