【表紙】

【提出書類】	**有価証券報告書**
【提出先】	**関東財務局長**
【提出日】	**平成24年5月8日**
【計算期間】	**第9特定期間（自 平成23年8月9日　至 平成24年2月8日）**
【ファンド名】	**ＤＩＡＭインカム３資産ファンド（毎月決算型） ただし、愛称として「インカム・パスポート」という名称を用いる場合があります。**
【発行者名】	**ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社**
【代表者の役職氏名】	**代表取締役社長　　中島 敬雄**
【本店の所在の場所】	**東京都千代田区丸の内三丁目３番１号**
【事務連絡者氏名】	**大楽 信雄**
【連絡場所】	**東京都千代田区丸の内三丁目３番１号**
【電話番号】	**03-3287-3110**
【縦覧に供する場所】	**該当事項はありません。**

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、各マザーファンド＊への投資を通じ、実質的に外国債券、外国株式、外国不動産投資信託証券の3資産へ分散投資を行い、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

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

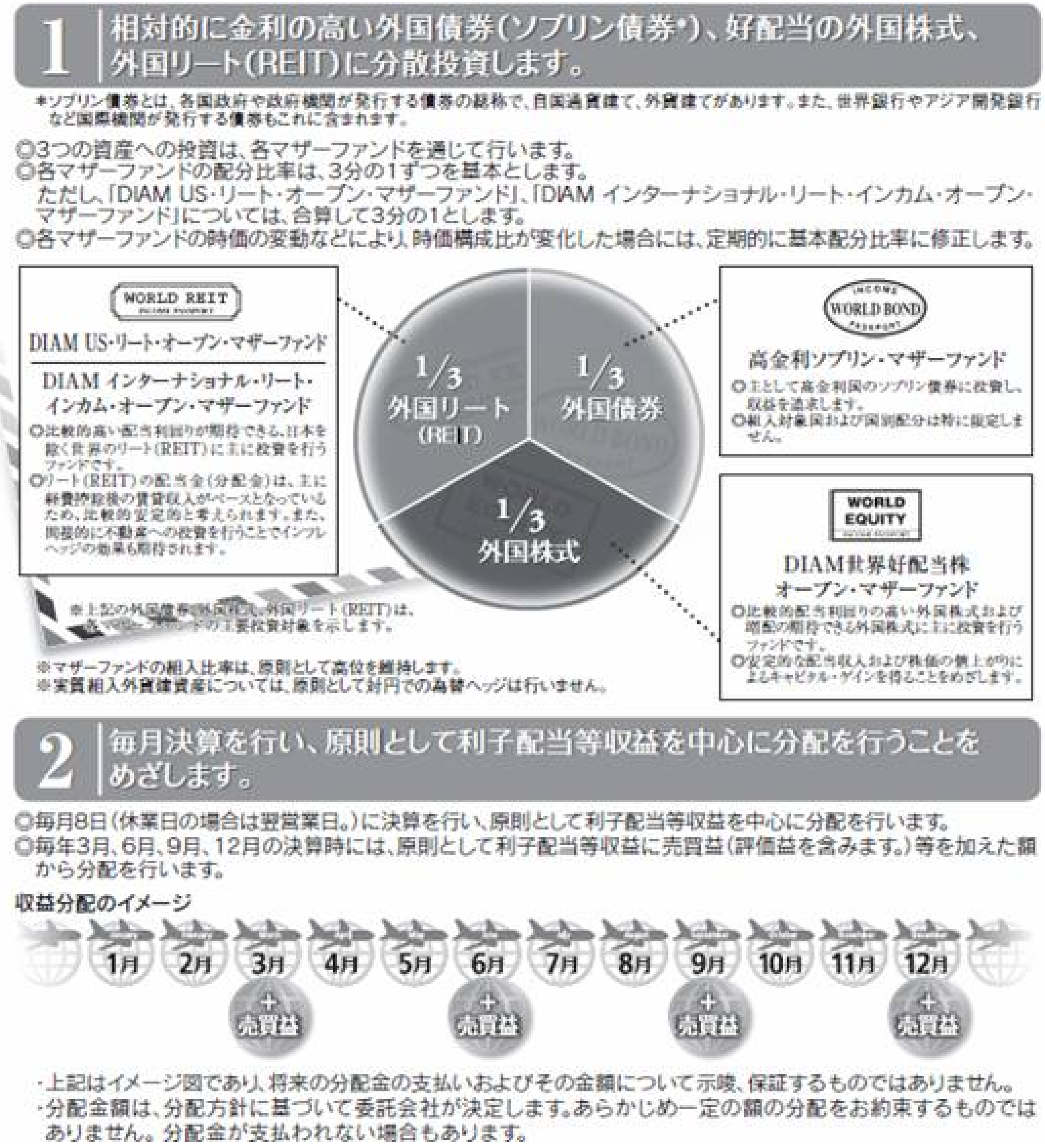
（注）「不動産投資信託証券」（以下「リート（REIT）」という場合があります。）とは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資者から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入等などが投資者に分配される商品をいいます。

②当ファンドは、契約型の追加型株式投資信託に属します。

③当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

④当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞



投資信託の収益分配金に関するご説明

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

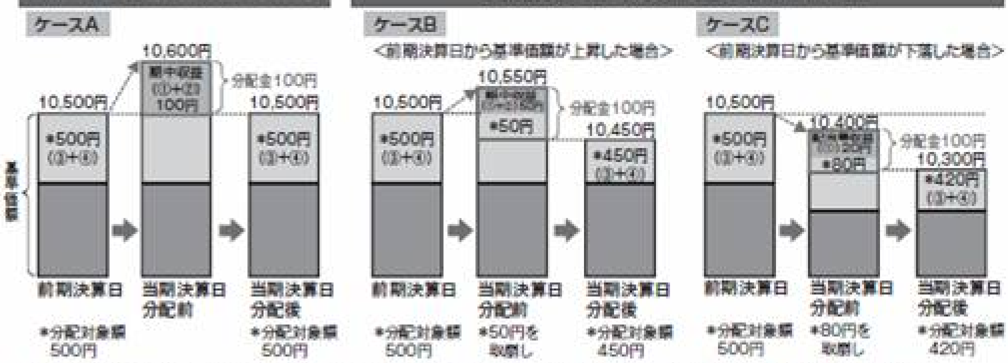
投資信託から分配金が支払われるイメージ

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

分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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



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

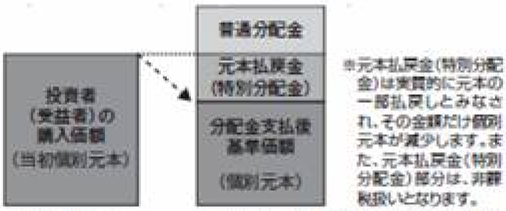
ケースA:分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
ケースB:分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
ケースC:分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

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

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は、非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合

普通分配金　　　　　　　:個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金）:個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

○商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

※単位型投信・追加型投信

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

※投資対象地域

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

※投資対象資産

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

○属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

※投資対象資産

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

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

※決算頻度

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

※投資対象地域

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

※投資形態

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

※為替ヘッジ

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

※上記の分類は、社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、以下の方法でご確認ください。

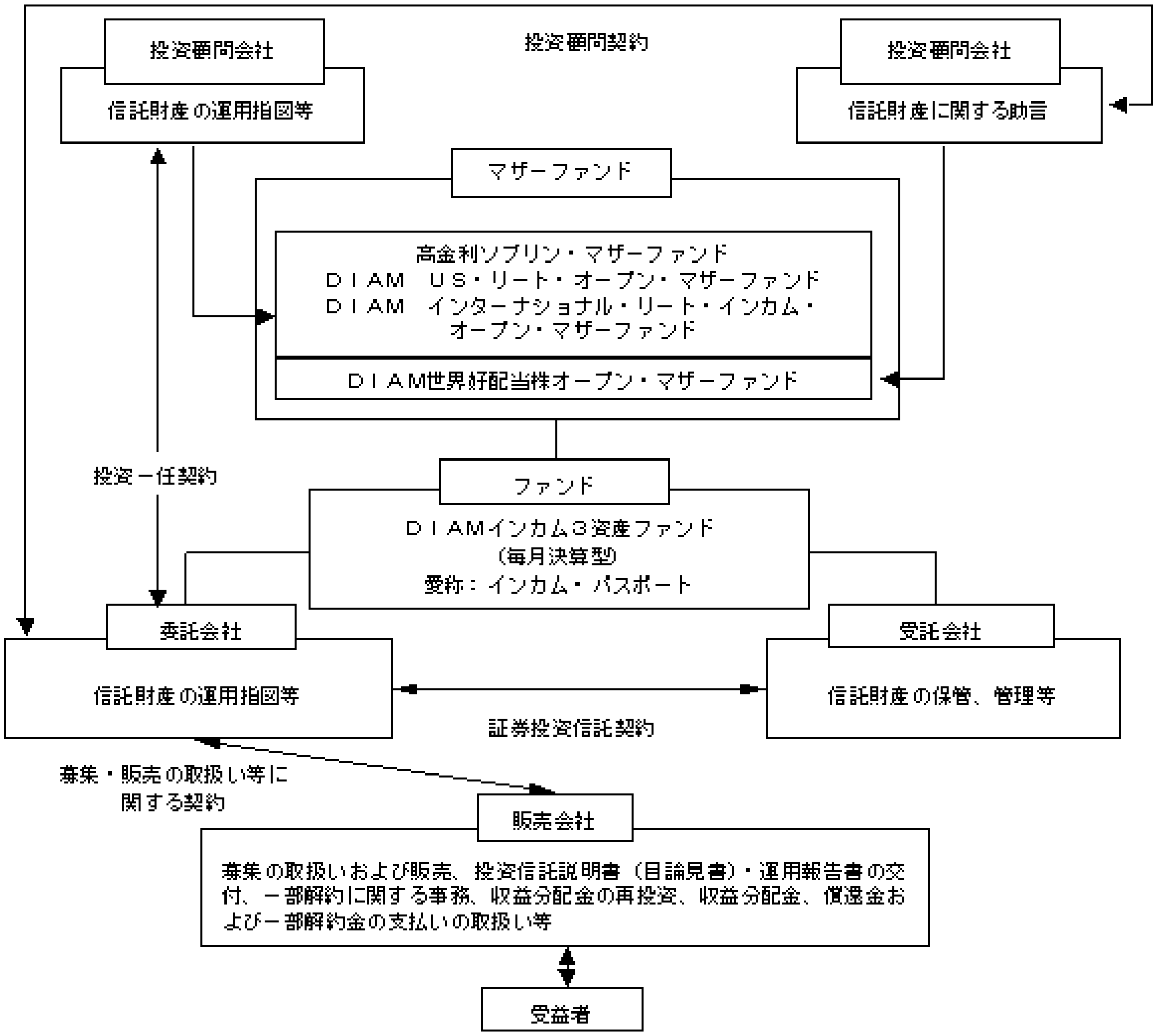
・投資信託協会への照会

ホームページ URL http://www.toushin.or.jp/

(2)【ファンドの沿革】

平成19年8月20日　　信託契約締結、当初設定日、ファンドの運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



①委託会社：ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。

②受託会社：みずほ信託銀行株式会社
当ファンドの信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

③販売会社
当ファンドの募集の取扱いおよび販売を行い、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

④投資顧問会社
デービス・セレクテド・アドバイザーズ
委託会社との投資一任契約に基づき、ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント
委託会社との投資一任契約に基づき、ＤＩＡＭ インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

DIAM International Ltd
委託会社との投資一任契約に基づき、高金利ソブリン・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。
委託会社との投資顧問契約に基づき、ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンドの信託財産の運用助言を行います。

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

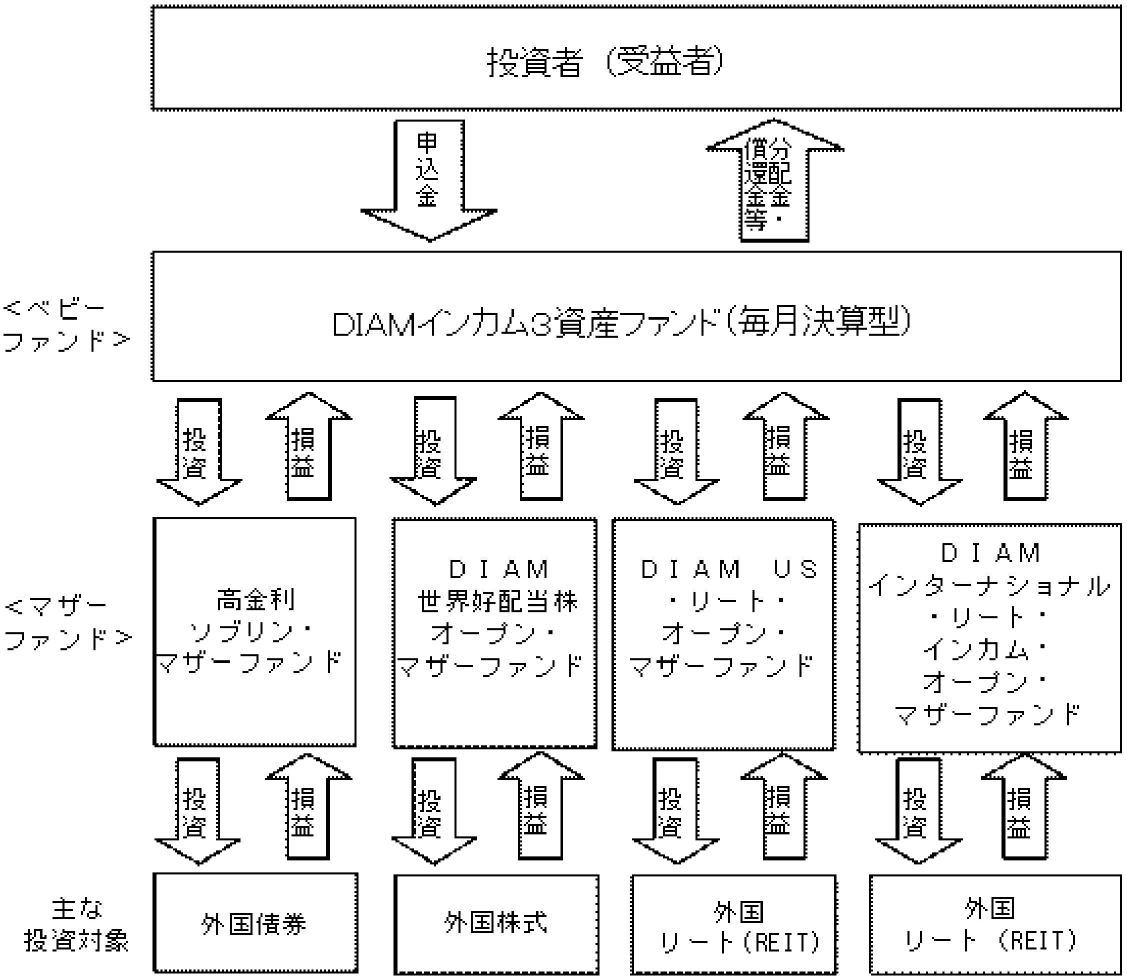
・「証券投資信託契約」の概要
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。
当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。
当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

・「投資一任契約」の概要
委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd、デービス・セレクテド・アドバイザーズ、コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント）との間においては、各々高金利ソブリン・マザーファンド、ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンドおよびＤＩＡＭ インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。
当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものであります。

・「投資顧問契約」の概要
委託会社と投資顧問会社（DIAM U.S.A.,Inc.およびDIAM International Ltd）との間においては、ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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



○委託会社の概況
名称：ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

(1)資本金の額
20億円（平成24年2月29日現在）

(2)委託会社の沿革

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

(3)大株主の状況

（平成24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	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

＜投資態度＞
①各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に外国債券、外国株式、外国不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。以下同じ。）および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の３資産へ分散投資を行います。
②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。
③各資産への投資は、原則として３分の１を基本資産配分比率とし、各マザーファンド受益証券を通じて行います。ただし、外国不動産投資信託証券への投資については、ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド受益証券およびＤＩＡＭ インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド受益証券の純資産総額を合算して資産配分を算出します。なお、時価変動等により各マザーファンド受益証券の時価構成比率が基本資産配分比率から乖離した場合は、原則として定期的に基本資産配分比率に近づけるものとします。
④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。
⑤ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）
1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）

イ.有価証券
ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。)
ハ.金銭債権
ニ.約束手形
2.次に掲げる特定資産以外の資産
イ.為替手形
②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）
委託会社は、信託金を、主としてＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された、高金利ソブリン・マザーファンド、ＤＩＡM世界好配当株オープン・マザーファンド、ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド、ＤＩＡＭ インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの各受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。
1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13.外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～12.の証券または証書の性質を有するもの
14.投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
15.投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
17.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
18.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
19.外国法人が発行する譲渡性預金証書
20.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23.外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの
なお、1.の証券または証書、13.ならびに18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。
③金融商品の指図範囲（約款第17条第2項）

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

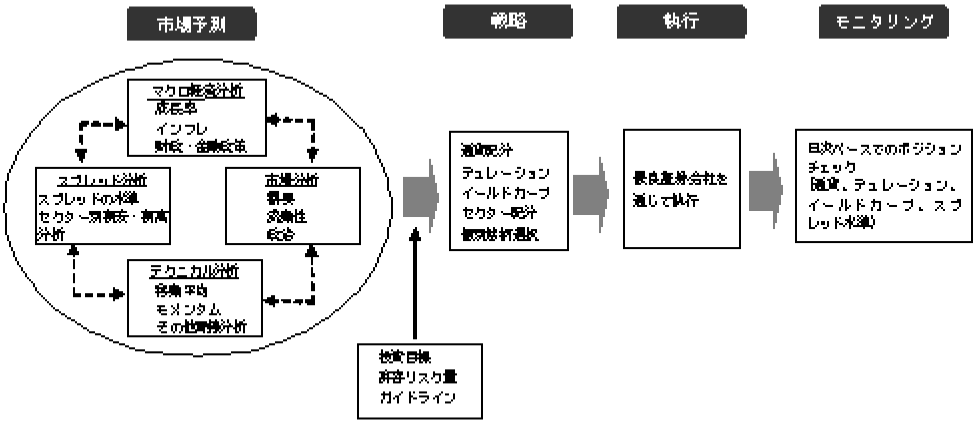
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

④金融商品の指図範囲（約款第17条第3項）

上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と定めるときは、委託会社は、信託金を、上記③1.から4.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	高金利ソブリン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。
主な投資対象	高金利国のソブリン債券を主要投資対象とします。
投資態度	■景気・金利・為替動向、財政・金融政策を中心としたファンダメンタルズ分析に基づき、投資対象銘柄の発行規模やポートフォリオの地域分散を考慮した上で、主として高金利国のソブリン債※1に投資し、収益を追及します。なお、組入対象国および国別配分は特に限定しません。 ※1 ソブリン債券とは、各国政府や政府機関が発行する債券の総称で、自国通貨建、外貨建があり、世界銀行、アジア開発銀行などの国際機関が発行する債券も含まれます。 ■当初債券組入れ時において、A-/A3格以上※2の債券に投資対象とします。 ※2 格付機関はＭｏｏｄｙ'ｓ社またはＳ＆Ｐ社とし、両社が格付けを付与している場合には、どちらか高い方の格付けとします。 ■運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。 ■外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

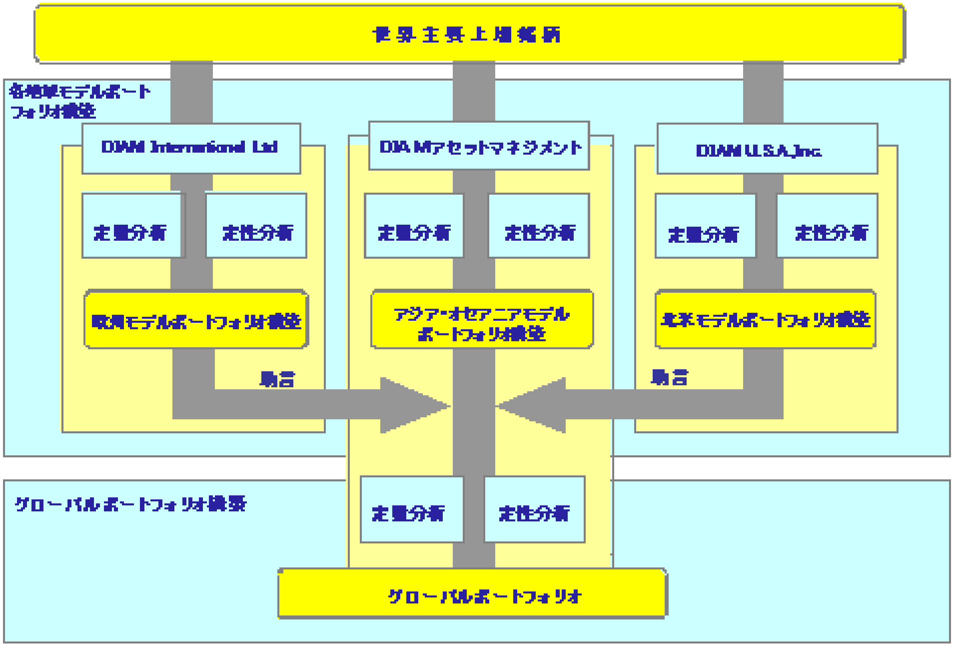
<table>
<tr><td>運用プロセス</td><td>①地域配分（通貨アロケーション）の決定
各国の金利はその国の名目経済成長率と密接な関係があるため、経済分析を中心に、名目経済成長率のサイクルとリスク・プレミアムがピークに近いと判断される国に注目します。これらの国の実体経済、財政政策、金融政策等のファンダメンタルズ分析をもとに、為替リスク、金利リスク、信用リスクを判断し、リスクの相対的に小さな国に重点投資します。
②投資銘柄の決定
当該国のイールドカーブの形状や銘柄毎の流動性を勘案した上で銘柄選定を行い、ポートフォリオを構築します。
③リスク管理とモニタリング
・日次で、保有債券のスプレッドや信用格付けをモニターすると同時に、保有国に関するニュースのフォロー、およびマクロ経済分析を実施いたします。（ファンドマネジャー）
・週次で、ポートフォリオのリスク量や寄与度分析等を中心に、パフォーマンス評価を実施します。（ミドル・オフィサー）
・月次で、コンプライアンス・オフィサーが運用ガイドライン等の契約項目をチェックします。

</td></tr>
<tr><td>主な投資制限</td><td>①株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。株式（株式投資信託証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
②投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
③同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤外貨建資産への投資には、制限を設けません。</td></tr>
</table>

ファンド名	ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

<table>
<tr>
<td>投資態度</td>
<td>
①主に日本を除く世界各国の好配当株式に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざします。
②組入銘柄の選定に当たっては、配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄を選定し、安定的な配当収入およびキャピタルゲインを享受することをめざします。
③北米地域の銘柄選定に当たってはDIAM U.S.A.,Inc.、欧州地域の銘柄選定に当たってはDIAM International Ltdの投資助言を受けます。
④株式の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向の急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、株式組入比率を引き下げる場合があります。
⑤外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。

■投資対象銘柄イメージ
世界の株式の中でも配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄に着目します。

</td>
</tr>
<tr>
<td>運用プロセス</td>
<td>
①組入れ銘柄選定にあたっては、世界を三極（北米、欧州、アジア・オセアニア）に区分し、DIAM International Ltdは欧州モデルポートフォリオを、DIAM U.S.A.,Inc.は北米モデルポートフォリオをそれぞれ構築し、委託会社に助言します。委託会社はアジア・オセアニアモデルポートフォリオを構築します。
②委託会社は、構築された各地域のモデルポートフォリオについて、平均配当利回り、地域配分、業種配分等を考慮し、最終的にグローバルポートフォリオとして集約・構築します。



</td>
</tr>
</table>

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20％以下とします。 ④投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。 ⑤同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20％以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。 ⑦同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。

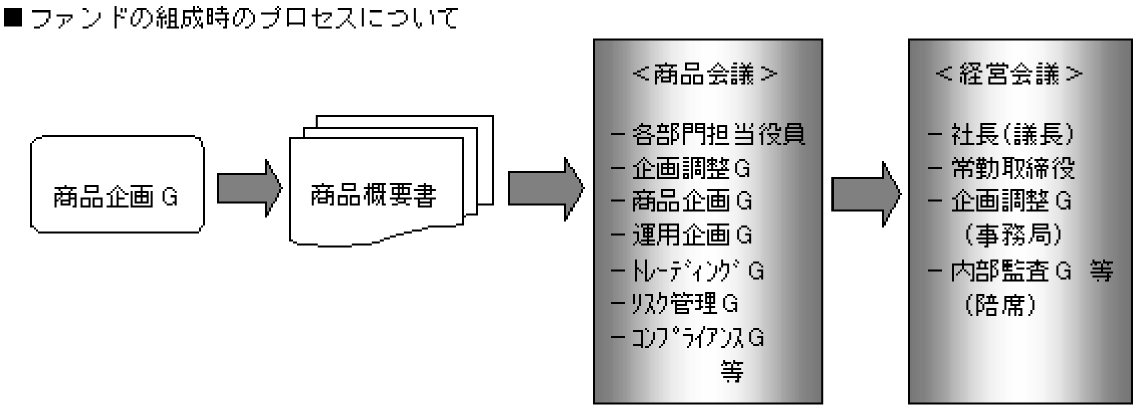
ファンド名	ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主な投資対象	米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託および不動産投資法人をいいます。以下同じ。）の投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	①運用指図に関する権限はデービス・セレクテド・アドバイザーズ（米国）に委託します。 デービス・セレクテド・アドバイザーズとは・・・ Davis Selected Advisers, LP ・1969年設立。創業者一族であるDavis家が約70％を出資する独立系運用会社。 ・運用受託資産は、約4兆2,983億円（約55,291百万米ドル、1米ドル=77.74円で換算）。そのうち、不動産関連証券投資は約1,207億円（2011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。 ②不動産投信等への投資は、原則として高位を維持することをめざします。 ③外貨建資産については、対円で為替ヘッジは行いません。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％を超えないものとします。 ③株式への投資は行いません。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ファンド名	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
基本方針	この投資信託は、信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主な投資対象	米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。

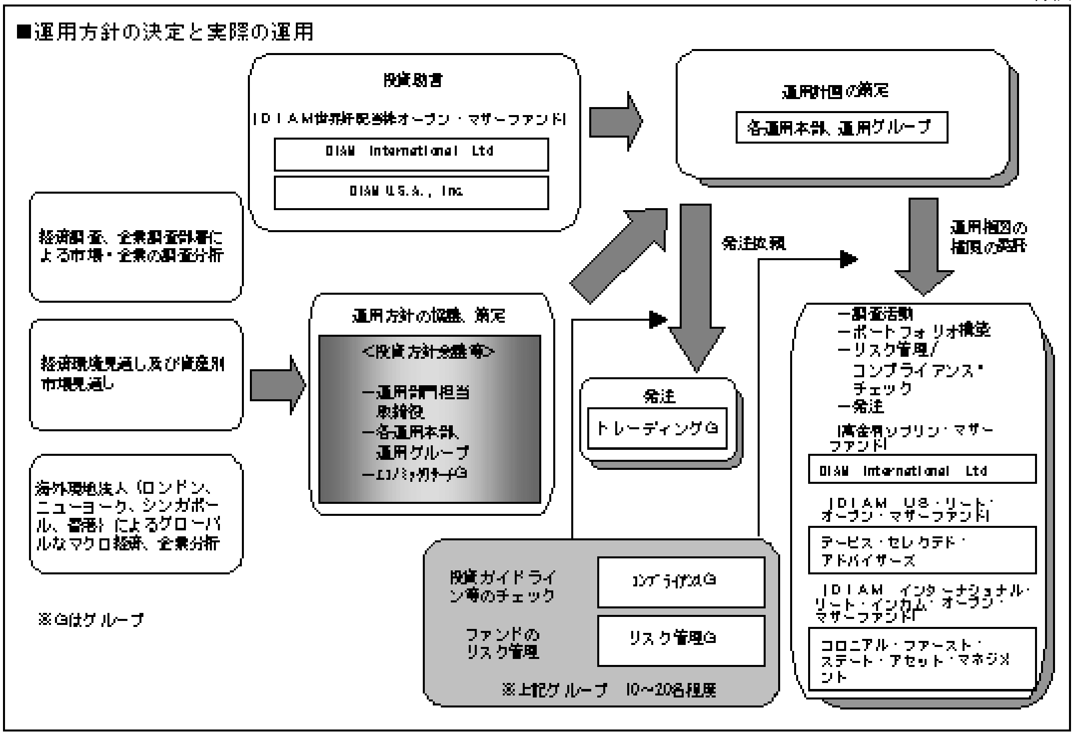
投資態度	①運用指図に関する権限はコロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント（豪州）に委託します。 コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントとは・・・ Colonial First State Asset Management (Australia) Limited ・オーストラリア・コモンウエルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。 ・運用受託資産は、約11兆2,294億円（約141,929百万豪ドル、1豪ドル=79.12円換算）と豪州を代表する資産運用会社の一つです。そのうち、不動産関連証券投資は約2,531億円（2011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。 ②不動産投信等への投資は、原則として高位を維持することをめざします。 ③外貨建資産について、対円で為替ヘッジは行いません。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。 ③株式への投資は行いません。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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】



※ Gはグループ
※商品会議は各部門の担当役員、グループリーダーや実務担当者等 20 名程度が参加、経営会議は常勤取締役 8名により構成。



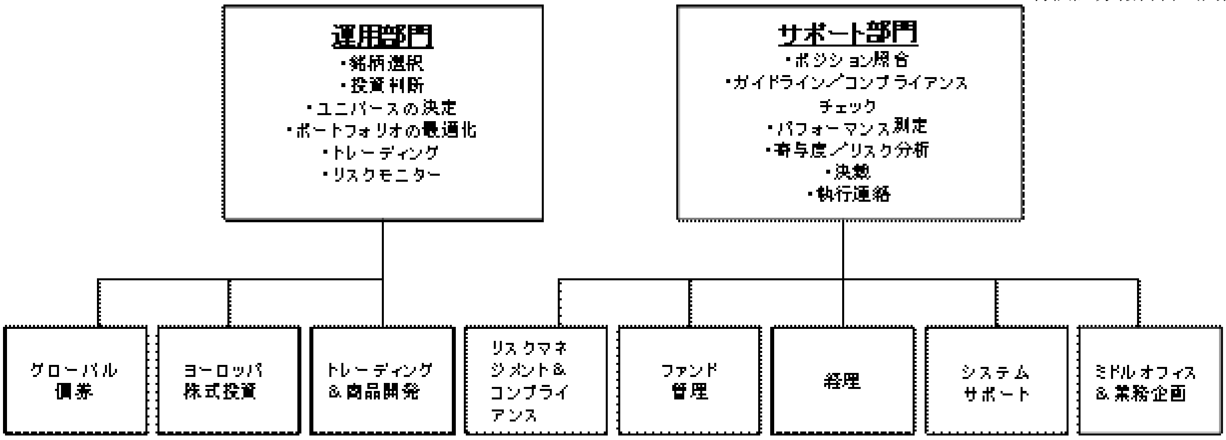
※運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

＜ファンドの組成時のプロセスについて＞
運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

＜運用方針の決定と実際の運用＞
経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部、運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。
「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。
個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。
なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

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

2）高金利ソブリン・マザーファンド
DIAM International Ltdの運用体制は、以下のとおりです。



3）ＤＩＡＭ　ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド

デービス・セレクテド・アドバイザーズの運用体制は、以下のとおりです。

ＤＩＡＭ　ＵＳ・リート・オープン・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をデービス・セレクテド・アドバイザーズに委託します。	
①調査活動	不動産担当ポートフォリオマネジャー（運用担当者、以下同じ）およびアナリストにより、綿密な個別銘柄調査が行われます。経済・政治・不動産市場などのマクロ分析結果は、上記個別銘柄調査を効率的に行うことを目的として、活用されます。
②ポートフォリオ構築	①の分析結果に基づき、個別銘柄の選択の結果としてポートフォリオが構築されます。付加価値の源泉を個別銘柄選択に求めているため、良い経営の成長している銘柄を、内在価値より割安な価格で購入することを主眼とします。組入銘柄は、地理的、不動産タイプ別に分散させながら、30～40銘柄でポートフォリオを組成します。ポートフォリオ構築の最終決定は、不動産担当ポートフォリオマネジャーが行います。
③リスク管理/コンプライアンス・チェック	不動産投信等への投資にかかるリスク管理は、個別銘柄のリスク管理に帰結するとの認識のもと、組入銘柄の継続的な調査を運用部門にて行います。また、業種分散、銘柄集中度を月次でモニタリングします。それら一連のリスク管理は、運用部門とは独立した組織により並行して行われます。また、ガイドラインの遵守状況などコンプライアンス・チェックも、運用部門とは完全に独立した部門により、定期的に行われます。
④運用評価	委託会社において、マザーファンドの運用実績を、原則として月1回開催される経営会議において、評価いたします。

4）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

コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメント（コロニアルグループ）の運用体制は、以下のとおりです。

ＤＩＡＭ インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をコロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントに委託します。

①調査活動	a)トップダウン・マクロ・スクリーニング 中長期的に良好な運用を行うため、経済・政治・税金・証券市場・通貨見通しに加え、不動産需給の基礎的要因や貸借レート成長率、土地価格の見積もりなどに基づき、専属ファンドマネジャー（運用担当者、以下同じ）およびアナリストが地域別に不動産物件セクターの見通しを策定します。 b)ボトムアップ調査 専属ファンドマネジャーおよびアナリストが、不動産関連証券発行会社のマネジメントとの面談、主要な不動産賃貸契約の個別契約条項や不動産入居テナント企業に対する分析に基づき、綿密な調査活動を行います。また、オーストラリア・コモンウエルス銀行の調査情報ネットワークも活用します。
②ポートフォリオ構築	①a)ならびにb)の分析結果に基づき、個別銘柄の選択の結果としてポートフォリオが構築されます。付加価値の源泉を個別銘柄選択に求めているため、グローバルな視点により銘柄の横比較を行い、優良な銘柄を選択することに主眼を置いています。ポートフォリオ構築に関する権限は、不動産関連証券チームの責任者に一任されています。
③リスク管理/コンプライアンス・チェック	運用部門でのモニタリングに加え、運用部門とは完全に独立した部門により、個別銘柄ベースのリスク評価、また主に社内管理システムを活用してポートフォリオのリスク管理が行われます。また、ガイドラインの遵守状況などコンプライアンス・チェックも、運用部門とは完全に独立した部門により、システィマティックに行われます。
④運用評価	委託会社において、マザーファンドの運用実績を、原則として月1回開催される経営会議において、評価いたします。

※各運用体制は、平成24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。

(4)【分配方針】

①収益分配方針

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

1)分配対象額の範囲

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

2)分配対象額についての分配方針

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

3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

1)信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

2)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

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

(5)【投資制限】

①マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

②株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70％未満とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

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

④新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

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

⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

⑦同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

⑧投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑨信用取引の指図および範囲（約款第23条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2.株式分割により取得する株券
3.有償増資により取得する株券
4.売出しにより取得する株券
5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に

限ります。）の行使により取得可能な株券

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

⑩先物取引等の運用指図（約款第24条）

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

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

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

⑪スワップ取引の運用指図（約款第25条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑫金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第26条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

4)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.～2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

2)上記1)1.～2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑭特別の場合の外貨建資産への投資制限（約款第28条）

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

⑮外貨為替予約の指図および範囲（約款第29条）

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

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

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

⑯資金の借入れ（約款第36条）

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

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

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

4）借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑰同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

⑱デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令 第130条第1項第8号）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動きのほか、為替変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

※基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

○資産配分リスク

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

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

○株価変動リスク

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

○金利リスク

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

○リート（REIT)の価格変動リスク

一般にリート(REIT)が投資対象とする不動産の価値および当該不動産から得る収入は、当該国または国際的な景気、経済、社会情勢等の変化等により変動し、リート(REIT)の価格および分配金はその影響を受けることになり、当ファンドの基準価額が下がる要因となる場合があります。

リート(REIT)は、実物資産である建物等を投資対象にしているため、火災、自然災害等に伴う損害を受けた場合は、当ファンドの基準価額が下がる要因となる場合があります。

リート(REIT)が投資対象とする建物の用途規制等、不動産等にかかる規制の強化や新たな規制がかかることにより、規制下となる不動産等の価値が低下する可能性があり、その結果、当ファンドの基準価額が下がる要因となる場合があります。

○為替リスク

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

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

○カントリーリスク

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

○信用リスク

債券、コマーシャルペーパーおよび短期金融商品の発行者が、経営不振、その他の理由により利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）またはそれが予想される場合には、当該債券等の価格は下落し（価格がゼロになることもあります。）、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

株式や短期金融商品等の発行者が、経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。また、こうした状況に陥ると予想された場合、当該株式等の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

リート(REIT)が、投資対象とする不動産の収益性悪化または資金繰りの悪化等により、清算される場合には、投資した資金が回収困難になる可能性があります。また、こうした状況に陥ると予想される場合、当該リート(REIT)の価格が下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

○流動性リスク

流動性リスクとは、市場における売買量の欠如等の理由により、当ファンドにとって最適な時期で株式等の売買ができず機会損失を被るリスクをいいます。

特にリート(REIT)は、市場規模や取引量が少ないため、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できない等のリスクがあります。また、金融商品取引所等が定める基準に抵触し、上場廃止等になった場合は、売買取引が困難になる可能性があります。

＜分配金に関する留意点＞

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

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

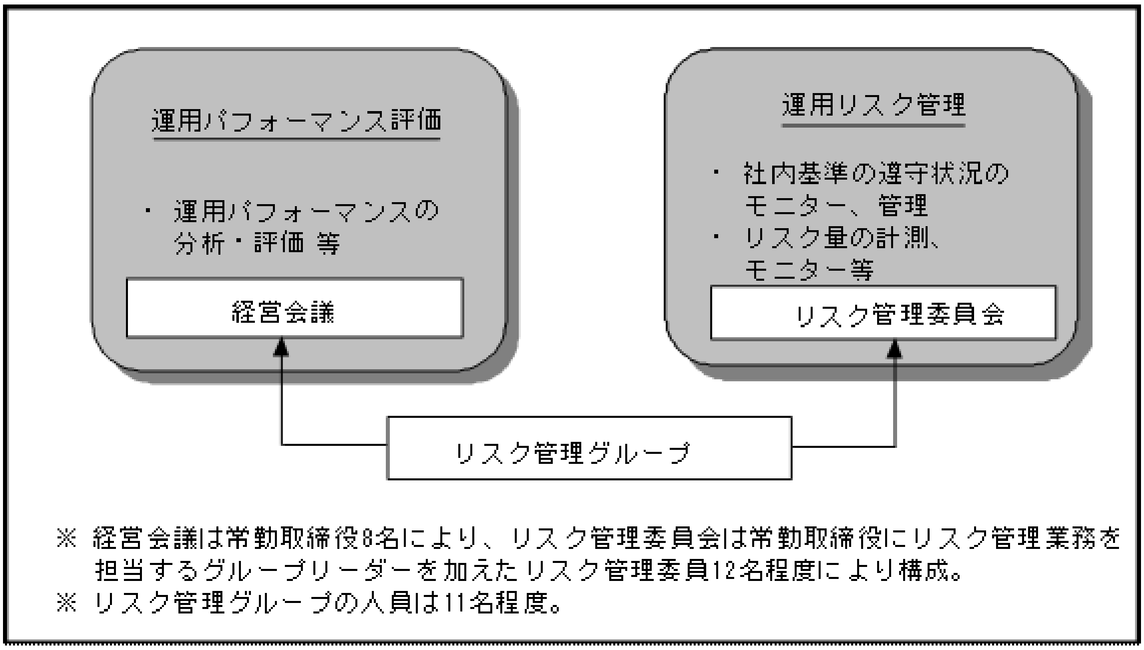
○分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

＜その他の留意点＞

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

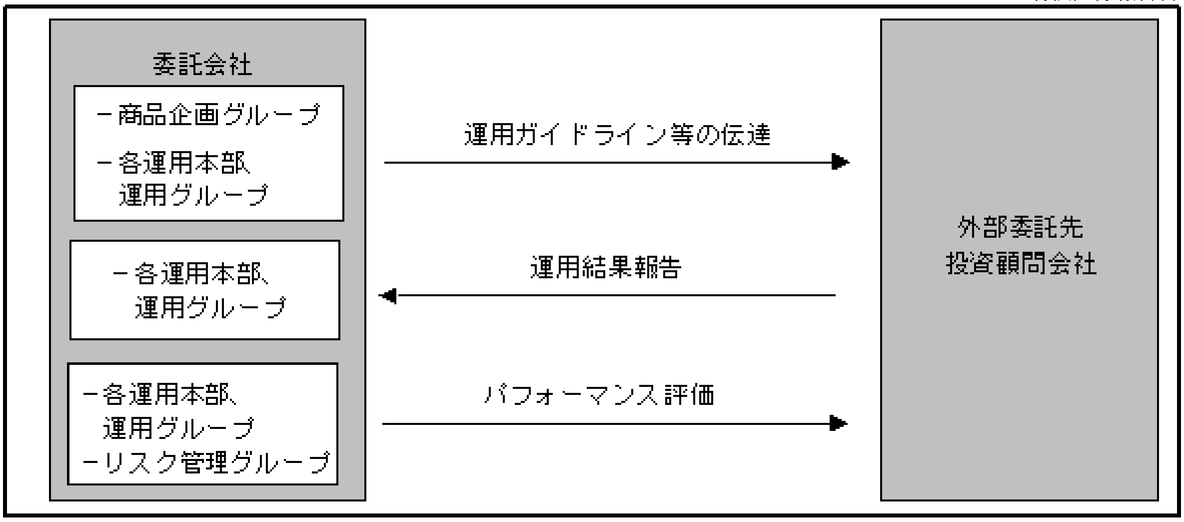
ません。
○当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
○資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。
○委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。
○委託会社は、当ファンドの純資産総額が10億円を下回った場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合等には、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。
○注意事項
・当ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

＜運用評価・運用リスク管理体制＞



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。
運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

＜外部委託先に関する管理体制＞



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

※上記体制は平成24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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

時期	項目	費用		
毎日	信託報酬	総額	信託財産の純資産総額に対して 年率1.26%（税抜1.20%）	
		配分	委託会社	年率0.609%（税抜 0.58%）
			販売会社	年率0.588%（税抜 0.56%）
			受託会社	年率0.063%（税抜0.06%）

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

・委託会社の信託報酬には、マザーファンドの投資顧問会社への報酬も含まれます。各投資顧問会社への報酬は以下の通りです。

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

ＤＩＡＭ　ＵＳ・リート・オープン・マザーファンドおよびＤＩＡＭ　インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、当ファンドの信託財産に属する当該マザーファンド受益証券の時価総額に対して、年率0.325%～0.50%とします。

ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、当ファンドまたはマザー

ファンドから直接的に支払われません。各社への投資顧問報酬は委託会社が受け取った報酬の中から支払うものとします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

イ.信託財産留保額

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

ロ.その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

・信託財産の財務諸表監査に要する費用は、毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用に係る消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

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

・マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

※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。

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

※実質的に投資対象とする不動産投信等には運用報酬等の費用がかかりますが、投資する不動産投信等の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限等を示すことはできません。

(5)【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

平成24年12月31日までの間は、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、原則として、10%（所得税7%および地方税3%）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。

上記10%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）となります。

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、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%）となる予定です。

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。

②換金（解約）時および償還時

平成24年12月31日までの間は、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、10%（所得税7%および地方税3%）の税率での申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%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。

上記10%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）となります。

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、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%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

○法人の受益者に対する課税

平成24年12月31日までの間は、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、7%（所得税7%）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。

上記7%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））となります。

また、上記7.147%の税率は平成26年1月1日からは、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

※上記は、平成24年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。

※税金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＞

①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。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③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、①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、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	788,482,191	99.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		7,691,080	0.97
合　　計　　（純資産総額）		796,173,271	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（参考）マザーファンドの投資状況

高金利ソブリン・マザーファンド

平成24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	米国	1,172,500,051	8.60
	カナダ	1,228,347,233	9.01
	スウェーデン	986,175,590	7.23
	ノルウェー	1,281,174,960	9.39
	ポーランド	1,500,216,170	11.00
	チェコ	1,198,815,108	8.79
	オーストラリア	525,956,243	3.86
	ニュージーランド	1,444,208,497	10.59
	メキシコ	1,480,886,757	10.86
	南アフリカ	1,581,358,733	11.60
	小計	12,399,639,343	90.92
特殊債券	オーストラリア	979,938,682	7.19
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		258,363,076	1.89
合　　計　　（純資産総額）		13,637,941,101	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンド

平成24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)

株式	米国	15,877,676,866	36.28
	英国	6,413,663,662	14.66
	カナダ	4,500,004,363	10.28
	スイス	2,006,446,168	4.59
	スウェーデン	987,188,788	2.26
	ノルウェー	624,462,256	1.43
	アイルランド	349,873,993	0.80
	オランダ	657,463,803	1.50
	フランス	1,822,302,020	4.16
	ドイツ	1,456,518,093	3.33
	スペイン	247,174,839	0.56
	イタリア	292,671,033	0.67
	フィンランド	268,708,241	0.61
	香港	882,752,208	2.02
	シンガポール	1,701,033,197	3.89
	オーストラリア	3,491,932,239	7.98
	バミューダ諸島	393,706,169	0.90
	小計	41,973,577,939	95.92
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,785,334,055	4.08
合　　計　（純資産総額）		43,758,911,994	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド

平成24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
投資証券	米国	71,454,659,495	96.74
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,409,606,407	3.26
合　　計　（純資産総額）		73,864,265,902	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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

平成24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
投資信託受益証券	シンガポール	14,399,564,451	12.62
	オーストラリア	43,594,338,446	38.19
	小計	57,993,902,898	50.81
投資証券	英国	7,557,853,557	6.62
	カナダ	16,432,916,924	14.40
	オランダ	7,299,594,530	6.39
	ベルギー	3,489,279,214	3.06
	フランス	11,048,808,380	9.68
	ドイツ	1,204,019,976	1.05
	香港	2,340,396,824	2.05
	ニュージーランド	2,465,585,321	2.16
	小計	51,838,454,727	45.41
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,313,095,032	3.78
合　　計　（純資産総額）		114,145,452,657	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	214,866,131	11,504.00	247,181,997	12,334.00	265,015,885	33.29
2	高金利ソブリン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	259,664,984	9,629.00	250,031,413	10,192.00	264,650,551	33.24
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	親投資信託受益証券	日本	133,041,857	11,338.00	150,842,857	11,867.00	157,880,771	19.83
4	ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	74,402,908	13,154.00	97,869,585	13,566.00	100,934,984	12.68

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。
(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。
(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.03
合計	99.03

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）マザーファンドの投資資産

高金利ソブリン・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は券面総額	帳簿価額		評価額		利率(%)	償還期限	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)			
1	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17	国債証券	ニュージーランド	1,285,947,000	106.52	1,369,765,025	112.31	1,444,208,497	6.00	2017/12/15	10.59

2	NORWAY 5.0 05/15/15	国債証券	ノルウェー	1,160,800,000	108.50	1,259,455,667	110.37	1,281,174,960	5.00	2015/5/15	9.39
3	CANADA 4.5 06/01/15	国債証券	カナダ	1,112,029,000	109.10	1,213,225,587	110.46	1,228,347,233	4.50	2015/6/1	9.01
4	CZECH REPUBLIC 6.95 01/26/16	国債証券	チェコ	1,013,840,000	117.57	1,191,981,826	118.25	1,198,815,108	6.95	2016/1/26	8.79
5	US T N/B 4.0 02/15/15	国債証券	米国	1,060,942,000	110.04	1,167,449,967	110.52	1,172,500,051	4.00	2015/2/15	8.60
6	SOUTH AFRICA 13.5 09/15/15	国債証券	南アフリカ	933,009,000	121.07	1,129,547,346	121.12	1,130,060,501	13.50	2015/9/15	8.29
7	SWEDEN 4.5 08/12/15	国債証券	スウェーデン	887,040,000	106.40	943,766,208	111.18	986,175,590	4.50	2015/8/12	7.23
8	NEW S WALES 5.5 08/01/14	特殊債券	オーストラリア	950,262,000	100.40	954,082,053	103.12	979,938,682	5.50	2014/8/1	7.19
9	MEXICAN BONDS 9.0 06/20/13	国債証券	メキシコ	894,600,000	106.86	955,933,776	105.36	942,577,398	9.00	2013/6/20	6.91
10	POLAND 5.0 10/24/13	国債証券	ポーランド	790,500,000	99.60	787,338,000	100.65	795,638,250	5.00	2013/10/24	5.83
11	POLAND 6.25 10/24/15	国債証券	ポーランド	674,560,000	102.81	693,481,408	104.45	704,577,920	6.25	2015/10/24	5.17
12	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	国債証券	オーストラリア	488,208,000	103.73	506,418,158	107.73	525,956,243	6.25	2015/4/15	3.86
13	SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	国債証券	南アフリカ	431,200,000	103.47	446,162,640	104.66	451,298,232	8.25	2017/9/15	3.31
14	MEXICAN BONDS 8.0 12/17/15	国債証券	メキシコ	384,300,000	106.33	408,637,719	109.71	421,611,687	8.00	2015/12/17	3.09
15	MEXICAN BONDS 6.0 06/18/15	国債証券	メキシコ	113,400,000	98.90	112,157,136	102.91	116,697,672	6.00	2015/6/18	0.86

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。
(注2) 投資有価証券は15銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	90.92
特殊債券	7.19
合計	98.11

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は券面総額	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	株式	米国	タバコ	140,765	5,606.45	789,192,385	6,765.82	952,391,328	2.18
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	292,184	2,727.42	796,907,930	3,017.12	881,553,591	2.01
3	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	株式	英国	タバコ	208,109	3,444.28	716,785,812	4,072.50	847,523,694	1.94
4	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	3,560,463	216.53	770,938,177	221.35	788,122,049	1.80
5	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	53,893	13,164.27	709,461,837	14,271.22	769,118,967	1.76
6	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	146,907	4,854.35	713,137,885	4,459.98	655,202,634	1.50
7	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	英国	医薬品	354,603	1,685.92	597,831,965	1,803.72	639,604,098	1.46
8	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	139,674	4,269.95	596,400,298	4,556.24	636,387,951	1.45
9	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	116,375	4,632.32	539,086,386	5,002.14	582,124,566	1.33
10	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	株式	英国	タバコ	142,117	2,780.09	395,098,164	3,223.31	458,087,474	1.05
11	BASF SE	株式	ドイツ	化学	62,552	6,646.12	415,728,130	7,227.40	452,088,200	1.03

12	TIME WARNER CABLE INC	株式	米国	メディア	64,584	6,140.55	396,581,591	6,413.25	414,193,545	0.95
13	ALLIANZ SE	株式	ドイツ	保険	41,337	10,313.06	426,310,879	9,949.08	411,265,141	0.94
14	SEADRILL LTD	株式	バミューダ諸島	エネルギー設備・サービス	118,760	2,826.22	335,641,935	3,315.14	393,706,169	0.90
15	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	株式	カナダ	商業銀行	61,549	6,854.81	421,906,485	6,259.02	385,236,342	0.88
16	REED ELSEVIER PLC	株式	英国	メディア	539,339	706.59	381,088,847	707.23	381,435,291	0.87
17	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	147,444	2,263.57	333,749,534	2,571.27	379,118,570	0.87
18	NATIONAL BANK OF CANADA	株式	カナダ	商業銀行	60,959	6,564.22	400,148,159	6,213.56	378,772,617	0.87
19	BANK OF NOVA SCOTIA	株式	カナダ	商業銀行	86,064	4,752.50	409,019,461	4,349.09	374,299,961	0.86
20	KEPPEL CORP LTD	株式	シンガポール	コングロマリット	524,000	680.40	356,530,550	709.84	371,958,308	0.85
21	CENTRICA PLC	株式	英国	総合公益事業	962,499	412.61	397,135,909	386.44	371,945,957	0.85
22	STATOIL ASA	株式	ノルウェー	石油・ガス・消耗燃料	154,900	2,080.71	322,302,720	2,328.86	360,739,640	0.82
23	ROYAL BANK OF CANADA	株式	カナダ	商業銀行	79,263	3,917.95	310,548,800	4,514.68	357,846,716	0.82
24	BAYTEX ENERGY CORP	株式	カナダ	石油・ガス・消耗燃料	76,481	4,476.71	342,383,310	4,676.20	357,640,735	0.82
25	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	株式	シンガポール	商業銀行	615,000	599.40	368,628,048	580.02	356,711,193	0.82
26	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	株式	カナダ	商業銀行	54,510	6,922.99	377,372,147	6,524.44	355,647,475	0.81
27	SANOFI	株式	フランス	医薬品	58,519	5,740.72	335,941,113	6,073.54	355,417,195	0.81
28	CRESCENT POINT ENERGY CORP	株式	カナダ	石油・ガス・消耗燃料	94,039	3,672.51	345,359,360	3,771.16	354,635,946	0.81
29	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	160,495	1,990.22	319,420,729	2,197.72	352,723,585	0.81
30	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	株式	米国	化学	84,571	4,122.14	348,613,747	4,146.15	350,643,646	0.80

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	石油・ガス・消耗燃料	12.03
	医薬品	10.52
	商業銀行	10.23
	タバコ	8.15
	化学	4.80
	保険	4.48
	各種電気通信サービス	3.71
	各種金融サービス	3.69
	総合公益事業	3.64
	食品	3.09
	コングロマリット	2.91
	メディア	2.51
	半導体・半導体製造装置	2.30
	機械	2.11
	無線通信サービス	1.80
	エネルギー設備・サービス	1.65
	飲料	1.49
	金属・鉱業	1.44
	食品・生活必需品小売り	1.44
	水道	1.35
	ソフトウェア	0.87
	コンピュータ・周辺機器	0.80
	建設・土木	0.77
	紙製品・林産品	0.76
	通信機器	0.76
	建設関連製品	0.75
	レジャー用品	0.73
	各種消費者サービス	0.72
	専門小売り	0.72
	ホテル・レストラン・レジャー	0.70
	航空宇宙・防衛	0.70
	ガス	0.70
	容器・包装	0.70
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.70
	電力	0.69
	自動車	0.60
	商業サービス・用品	0.54
	商社・流通業	0.38
合計		95.92

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額 単価(円)	帳簿価額 金額(円)	評価額 単価(円)	評価額 金額(円)	投資比率(%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	米国	397,283	9,802.62	3,894,414,281	10,996.68	4,368,795,610	5.91
2	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	投資証券	米国	9,133,684	380.00	3,470,825,494	458.26	4,185,623,951	5.67
3	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	投資証券	米国	650,174	5,374.09	3,494,096,712	5,776.69	3,755,852,344	5.08
4	THE MACERICH COMPANY	投資証券	米国	858,400	3,937.18	3,379,678,746	4,318.80	3,707,258,263	5.02
5	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	投資証券	米国	1,001,300	3,495.06	3,499,601,175	3,689.50	3,694,292,745	5.00
6	VENTAS INC	投資証券	米国	809,663	4,225.21	3,420,997,500	4,513.24	3,654,202,790	4.95
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	米国	607,540	5,191.76	3,154,200,655	5,721.83	3,476,237,925	4.71
8	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	投資証券	米国	997,894	3,149.75	3,143,113,832	3,305.46	3,298,498,302	4.47
9	CBL & ASSOCIATES	投資証券	米国	2,042,835	1,202.94	2,457,405,483	1,429.65	2,920,538,241	3.95
10	BRANDYWINE REALTY TRUST	投資証券	米国	3,278,200	683.36	2,240,189,441	880.22	2,885,533,270	3.91
11	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	投資証券	米国	1,462,320	1,859.75	2,719,553,864	1,958.10	2,863,374,056	3.88
12	LIBERTY PROPERTY TRUST	投資証券	米国	1,026,500	2,377.64	2,440,647,049	2,714.08	2,785,998,193	3.77
13	PLUM CREEK TIMBER CO	投資証券	米国	846,100	2,847.20	2,409,013,551	3,158.62	2,672,510,074	3.62
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC	投資証券	米国	237,786	10,665.90	2,536,200,746	11,183.05	2,659,173,869	3.60
15	KIMCO REALTY	投資証券	米国	1,667,200	1,296.60	2,161,694,255	1,486.93	2,479,013,697	3.36
16	HIGHWOODS PROPERTIES INC	投資証券	米国	942,376	2,287.28	2,155,475,893	2,598.70	2,448,955,150	3.32
17	REGENCY	投資証券	米国	666,367	2,926.26	1,949,965,496	3,433.74	2,288,131,556	3.10
18	LEXINGTON REALTY TRUST	投資証券	米国	2,958,800	581.70	1,721,142,245	709.98	2,100,700,659	2.84
19	SL GREEN REALTY PFD 7.625	投資証券	米国	1,007,340	2,021.03	2,035,868,390	2,054.11	2,069,189,988	2.80

20	EAST GROUP	投資証券	米国	527,100	3,299.81	1,739,330,905	3,895.23	2,053,175,944	2.78
21	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	米国	281,066	5,901.74	1,658,779,017	6,639.16	1,866,041,358	2.53
22	PROLOGIS INC	投資証券	米国	606,000	2,605.10	1,578,691,958	2,710.04	1,642,284,967	2.22
23	DIGITAL REALTY 7.0%	投資証券	米国	700,000	2,045.24	1,431,666,600	2,138.83	1,497,178,760	2.03
24	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	投資証券	米国	689,200	1,886.30	1,300,036,857	1,839.50	1,267,786,157	1.72
25	RAYONIER INC	投資証券	米国	316,000	3,722.63	1,176,351,610	3,596.71	1,136,561,750	1.54
26	CBL & ASSOCIATES PROP PFD 7.375	投資証券	米国	492,000	1,855.64	912,974,880	2,031.52	999,509,021	1.35
27	BIOMED REALTY TRUST INC	投資証券	米国	539,800	1,449.70	782,548,302	1,483.71	800,904,067	1.08
28	POST PROPERTIES, INC	投資証券	米国	226,000	3,464.52	782,981,570	3,542.66	800,640,889	1.08
29	DUPONT FABROS 7.625	投資証券	米国	285,000	1,982.31	564,957,666	2,046.04	583,122,768	0.79
30	VORNADO REALTY TRUST PFD 6.75	投資証券	米国	175,000	2,017.81	353,116,190	2,071.86	362,575,920	0.49

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	96.74
合計	96.74

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

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

① 投資有価証券の主要銘柄

平成24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額 単価（円）	帳簿価額 金額（円）	評価額 単価（円）	評価額 金額（円）	投資比率（%）
1	CFS RETAIL PROPERTY	投資信託受益証券	オーストラリア	54,226,470	165.64	8,982,180,944	155.18	8,414,885,305	7.37
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券	フランス	529,964	14,564.53	7,718,677,902	15,705.36	8,323,274,082	7.29

3	MIRVAC GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	70,288,580	113.62	7,986,404,509	102.00	7,169,477,333	6.28
4	INVESTA OFFICE FUND	投資信託受益証券	オーストラリア	99,175,352	53.62	5,317,355,920	54.05	5,360,586,456	4.70
5	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	投資信託受益証券	シンガポール	73,971,320	54.94	4,063,621,471	57.81	4,276,137,765	3.75
6	STOCKLAND	投資信託受益証券	オーストラリア	15,207,632	306.87	4,666,820,779	271.13	4,123,242,223	3.61
7	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	投資信託受益証券	シンガポール	30,053,000	123.98	3,726,058,393	131.12	3,940,480,238	3.45
8	CHARTER HALL RETAIL REIT	投資信託受益証券	オーストラリア	13,541,096	285.95	3,872,081,818	270.26	3,659,589,523	3.21
9	ALLIED PROPERTIES REIT	投資証券	カナダ	1,561,122	1,961.07	3,061,465,149	2,176.17	3,397,263,272	2.98
10	DEXUS PROPERTY GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	40,453,033	76.72	3,103,491,967	78.03	3,156,392,398	2.77
11	BRITISH LAND CO PLC	投資証券	英国	5,100,787	605.99	3,091,041,166	607.92	3,100,870,637	2.72
12	WERELDHAVE NV	投資証券	オランダ	475,901	5,446.62	2,592,054,046	6,067.02	2,887,298,981	2.53
13	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	投資証券	カナダ	1,173,305	2,067.40	2,425,690,640	2,193.21	2,573,308,248	2.25
14	GOODMAN PROPERTY TRUST	投資証券	ニュージーランド	35,973,675	66.50	2,392,350,114	68.54	2,465,585,321	2.16
15	PRIMARIS RETAIL REIT	投資証券	カナダ	1,392,011	1,687.52	2,349,052,388	1,761.39	2,451,872,863	2.15
16	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	投資証券	カナダ	1,824,205	1,124.51	2,051,345,672	1,289.79	2,352,843,738	2.06
17	LINK REIT/THE	投資証券	香港	7,868,467	291.76	2,295,710,930	297.44	2,340,396,824	2.05
18	EUROCOMMERCIAL	投資証券	オランダ	692,422	2,632.59	1,822,862,887	2,879.23	1,993,638,733	1.75
19	ASCOTT RESIDENCE TRUST	投資信託受益証券	シンガポール	27,492,000	63.67	1,750,429,697	68.14	1,873,372,235	1.64
20	GPT GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	6,729,225	282.46	1,900,758,427	270.26	1,818,626,890	1.59
21	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	投資信託受益証券	シンガポール	23,350,840	70.92	1,656,037,370	75.25	1,757,088,830	1.54
22	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	投資証券	カナダ	789,834	2,168.05	1,712,400,157	2,203.77	1,740,608,920	1.52

23	WESTFIELD RETAIL TRUST	投資信託受益証券	オーストラリア	7,983,214	231.03	1,844,337,981	217.95	1,739,941,491	1.52
24	HAMMERSON PLC	投資証券	英国	3,372,005	478.55	1,613,675,522	509.26	1,717,210,676	1.50
25	COFINIMMO SA	投資証券	ベルギー	165,635	9,346.07	1,548,036,801	9,727.43	1,611,203,613	1.41
26	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	投資証券	カナダ	578,957	2,507.34	1,451,642,797	2,739.49	1,586,045,465	1.39
27	CHARTER HALL GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	8,286,860	185.69	1,538,815,209	182.21	1,509,917,271	1.32
28	DUNDEE REAL ESTATE INV TRUST	投資証券	カナダ	491,275	2,658.32	1,305,964,930	2,789.00	1,370,166,565	1.20
29	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	5,704,030	235.39	1,342,648,806	231.90	1,322,757,712	1.16
30	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	投資信託受益証券	オーストラリア	15,418,342	83.26	1,283,683,358	85.00	1,310,566,779	1.15

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	50.81
投資証券	45.41
合計	96.22

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ 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】

①【純資産の推移】

直近日（平成24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（百万円）		１口当たり純資産額（円）	
		分配落	分配付	分配落	分配付
第1特定期間	第1期末（平成19年10月9日現在）	1,522	1,522	1.1278	1.1278
	第2期末（平成19年11月8日現在）	1,631	1,631	1.0780	1.0780
	第3期末（平成19年12月10日現在）	1,706	1,735	1.0336	1.0516
	第4期末（平成20年1月8日現在）	1,631	1,636	0.9526	0.9556
	第5期末（平成20年2月8日現在）	1,578	1,583	0.9077	0.9107
第2特定期間	第6期末（平成20年3月10日現在）	1,509	1,514	0.8604	0.8634
	第7期末（平成20年4月8日現在）	1,590	1,595	0.9047	0.9077
	第8期末（平成20年5月8日現在）	1,623	1,628	0.9241	0.9271
	第9期末（平成20年6月9日現在）	1,609	1,615	0.9175	0.9205
	第10期末（平成20年7月8日現在）	1,550	1,555	0.8798	0.8828
	第11期末（平成20年8月8日現在）	1,568	1,573	0.8930	0.8960
第3特定期間	第12期末（平成20年9月8日現在）	1,455	1,460	0.8362	0.8392
	第13期末（平成20年10月8日現在）	1,173	1,178	0.6814	0.6844
	第14期末（平成20年11月10日現在）	981	986	0.5820	0.5850
	第15期末（平成20年12月8日現在）	829	834	0.4934	0.4964
	第16期末（平成21年1月8日現在）	896	901	0.5350	0.5380
	第17期末（平成21年2月9日現在）	811	816	0.4861	0.4891
第4特定期間	第18期末（平成21年3月9日現在）	726	731	0.4373	0.4403
	第19期末（平成21年4月8日現在）	844	849	0.5079	0.5109
	第20期末（平成21年5月8日現在）	911	916	0.5471	0.5501
	第21期末（平成21年6月8日現在）	954	959	0.5717	0.5747
	第22期末（平成21年7月8日現在）	876	881	0.5272	0.5302
	第23期末（平成21年8月10日現在）	1,015	1,020	0.6107	0.6137
第5特定期間	第24期末（平成21年9月8日現在）	991	996	0.5969	0.5999
	第25期末（平成21年10月8日現在）	985	990	0.5927	0.5957
	第26期末（平成21年11月9日現在）	996	1,001	0.5997	0.6027
	第27期末（平成21年12月8日現在）	1,010	1,015	0.6083	0.6113
	第28期末（平成22年1月8日現在）	1,054	1,059	0.6385	0.6415
	第29期末（平成22年2月8日現在）	941	946	0.5723	0.5753
第6特定期間	第30期末（平成22年3月8日現在）	989	994	0.6065	0.6095
	第31期末（平成22年4月8日現在）	1,033	1,038	0.6365	0.6395
	第32期末（平成22年5月10日現在）	948	953	0.5885	0.5915
	第33期末（平成22年6月8日現在）	891	896	0.5541	0.5571
	第34期末（平成22年7月8日現在）	891	896	0.5570	0.5600
	第35期末（平成22年8月9日現在）	921	926	0.5760	0.5790

第7特定期間	第36期末（平成22年9月8日現在）	895	900	0.5619	0.5649
	第37期末（平成22年10月8日現在）	934	939	0.5881	0.5911
	第38期末（平成22年11月8日現在）	941	945	0.5970	0.6000
	第39期末（平成22年12月8日現在）	924	928	0.5874	0.5904
	第40期末（平成23年1月11日現在）	913	917	0.5835	0.5865
	第41期末（平成23年2月8日現在）	915	920	0.5958	0.5988
第8特定期間	第42期末（平成23年3月8日現在）	915	920	0.5998	0.6028
	第43期末（平成23年4月8日現在）	966	970	0.6327	0.6357
	第44期末（平成23年5月9日現在）	925	929	0.6078	0.6108
	第45期末（平成23年6月8日現在）	903	907	0.6033	0.6063
	第46期末（平成23年7月8日現在）	923	927	0.6175	0.6205
	第47期末（平成23年8月8日現在）	808	812	0.5483	0.5513
第9特定期間	第48期末（平成23年9月8日現在）	800	804	0.5493	0.5523
	第49期末（平成23年10月11日現在）	755	759	0.5209	0.5239
	第50期末（平成23年11月8日現在）	769	773	0.5436	0.5466
	第51期末（平成23年12月8日現在）	741	745	0.5351	0.5381
	第52期末（平成24年1月10日現在）	723	727	0.5230	0.5260
	第53期末（平成24年2月8日現在）	755	759	0.5519	0.5549
	平成23年2月末	909	－	0.5957	－
	3月末	939	－	0.6152	－
	4月末	963	－	0.6320	－
	5月末	926	－	0.6148	－
	6月末	906	－	0.6061	－
	7月末	871	－	0.5863	－
	8月末	806	－	0.5535	－
	9月末	745	－	0.5139	－
	10月末	790	－	0.5561	－
	11月末	729	－	0.5221	－
	12月末	736	－	0.5323	－
	平成24年1月末	742	－	0.5399	－
	2月末	796	－	0.5826	－

②【分配の推移】

		１口当たりの分配額（円）
第1特定期間	第1期	-
	第2期	-
	第3期	0.0180
	第4期	0.0030
	第5期	0.0030
第2特定期間	第6期	0.0030
	第7期	0.0030
	第8期	0.0030
	第9期	0.0030
	第10期	0.0030
	第11期	0.0030

第3特定期間	第12期	0.0030
	第13期	0.0030
	第14期	0.0030
	第15期	0.0030
	第16期	0.0030
	第17期	0.0030
第4特定期間	第18期	0.0030
	第19期	0.0030
	第20期	0.0030
	第21期	0.0030
	第22期	0.0030
	第23期	0.0030
第5特定期間	第24期	0.0030
	第25期	0.0030
	第26期	0.0030
	第27期	0.0030
	第28期	0.0030
	第29期	0.0030
第6特定期間	第30期	0.0030
	第31期	0.0030
	第32期	0.0030
	第33期	0.0030
	第34期	0.0030
	第35期	0.0030
第7特定期間	第36期	0.0030
	第37期	0.0030
	第38期	0.0030
	第39期	0.0030
	第40期	0.0030
	第41期	0.0030
第8特定期間	第42期	0.0030
	第43期	0.0030
	第44期	0.0030
	第45期	0.0030
	第46期	0.0030
	第47期	0.0030
第9特定期間	第48期	0.0030
	第49期	0.0030
	第50期	0.0030
	第51期	0.0030
	第52期	0.0030
	第53期	0.0030

③【収益率の推移】

		収益率（%）

第1特定期間	第1期	12.78
	第2期	△ 4.42
	第3期	△ 2.45
	第4期	△ 7.55
	第5期	△ 4.40
第2特定期間	第6期	△ 4.88
	第7期	5.50
	第8期	2.48
	第9期	△ 0.39
	第10期	△ 3.78
	第11期	1.84
第3特定期間	第12期	△ 6.02
	第13期	△ 18.15
	第14期	△ 14.15
	第15期	△ 14.71
	第16期	9.04
	第17期	△ 8.58
第4特定期間	第18期	△ 9.42
	第19期	16.83
	第20期	8.31
	第21期	5.04
	第22期	△ 7.26
	第23期	16.41
第5特定期間	第24期	△ 1.77
	第25期	△ 0.20
	第26期	1.69
	第27期	1.93
	第28期	5.46
	第29期	△ 9.90
第6特定期間	第30期	6.50
	第31期	5.44
	第32期	△ 7.07
	第33期	△ 5.34
	第34期	1.06
	第35期	3.95
第7特定期間	第36期	△ 1.93
	第37期	5.20
	第38期	2.02
	第39期	△ 1.11
	第40期	△ 0.15
	第41期	2.62
第8特定期間	第42期	1.17
	第43期	5.99
	第44期	△ 3.46
	第45期	△ 0.25
	第46期	2.85
	第47期	△ 10.72

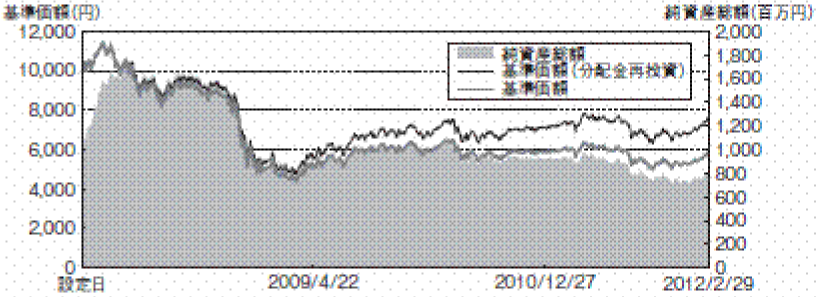
第9特定期間	第48期	0.73
	第49期	△ 4.62
	第50期	4.93
	第51期	△ 1.01
	第52期	△ 1.70
	第53期	6.10

(注) 収益率＝（当期分配付き基準価額－前期分配落ち基準価額）÷前期分配落ち基準価額×100

＜＜参考情報＞＞

データの基準日：2012年2月29日

基準価額・純資産の推移《設定日(2007年8月20日)～2012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して計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日2007年8月20日)
※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第49期(2011.10.11)	30円
第50期(2011.11.08)	30円
第51期(2011.12.08)	30円
第52期(2012.01.10)	30円
第53期(2012.02.08)	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	1,680円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	33.29
2	高金利ソブリン・マザーファンド	33.24
3	DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	19.83
4	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	12.68

■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。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	南アフリカ	11.60
	ポーランド	11.00
	メキシコ	10.86
	ニュージーランド	10.59
	ノルウェー	9.39
	その他	37.48
	小計	90.92
特殊債券	オーストラリア	7.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.89
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17	国債証券	ニュージーランド	6.00	2017/12/15	10.59
2	NORWAY 5.0 05/15/15	国債証券	ノルウェー	5.00	2015/5/15	9.39
3	CANADA 4.5 06/01/15	国債証券	カナダ	4.50	2015/6/1	9.01
4	CZECH REPUBLIC 6.95 01/26/16	国債証券	チェコ	6.95	2016/1/26	8.79
5	US T N/B 4.0 02/15/15	国債証券	米国	4.00	2015/2/15	8.60
6	SOUTH AFRICA 13.5 09/15/15	国債証券	南アフリカ	13.50	2015/9/15	8.29
7	SWEDEN 4.5 08/12/15	国債証券	スウェーデン	4.50	2015/8/12	7.23
8	NEW S WALES 5.5 08/01/14	特殊債券	オーストラリア	5.50	2014/8/1	7.19
9	MEXICAN BONDS 9.0 06/20/13	国債証券	メキシコ	9.00	2013/6/20	6.91
10	POLAND 5.0 10/24/13	国債証券	ポーランド	5.00	2013/10/24	5.83

■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。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	米国	36.28
	英国	14.66
	カナダ	10.28
	オーストラリア	7.98
	スイス	4.59
	その他	22.13
	小計	95.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.08
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	国名	業種	投資比率(%)
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	米国	タバコ	2.18
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	英国	石油・ガス・消耗燃料	2.01
3	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	英国	タバコ	1.94
4	VODAFONE GROUP PLC	英国	無線通信サービス	1.80
5	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	医薬品	1.76
6	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス	医薬品	1.50
7	GLAXOSMITHKLINE PLC	英国	医薬品	1.46
8	TOTAL SA	フランス	石油・ガス・消耗燃料	1.45
9	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品	1.33
10	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	英国	タバコ	1.05

組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	石油・ガス・消耗燃料	12.03
2	医薬品	10.52
3	商業銀行	10.23
4	タバコ	8.15
5	化学	4.80

○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：2012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。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資証券	米国	96.74
現金･預金･その他の資産(負債控除後)		3.26
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	5.91
2	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	米国	5.67
3	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	米国	5.08
4	THE MACERICH COMPANY	米国	5.02
5	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	米国	5.00
6	VENTAS INC	米国	4.95
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	米国	4.71
8	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	米国	4.47
9	CBL & ASSOCIATES	米国	3.95
10	BRANDYWINE REALTY TRUST	米国	3.91

■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。

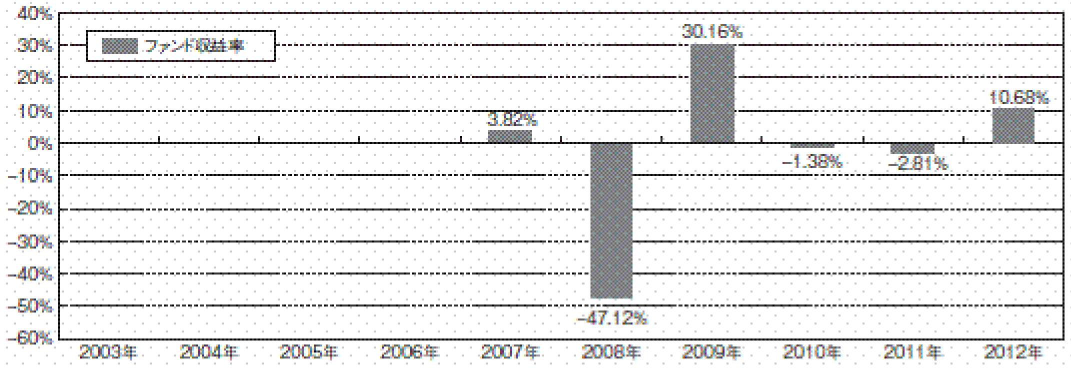
ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資信託受益証券	オーストラリア	38.19
	シンガポール	12.62
	小計	50.81
投資証券	カナダ	14.40
	フランス	9.68
	英国	6.62
	オランダ	6.39
	ベルギー	3.06
	その他	5.27
	小計	45.41
現金･預金･その他の資産(負債控除後)		3.78
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	CFS RETAIL PROPERTY	オーストラリア	7.37
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	7.29
3	MIRVAC GROUP	オーストラリア	6.28
4	INVESTA OFFICE FUND	オーストラリア	4.70
5	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	シンガポール	3.75
6	STOCKLAND	オーストラリア	3.61
7	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	シンガポール	3.45
8	CHARTER HALL RETAIL REIT	オーストラリア	3.21
9	ALLIED PROPERTIES REIT	カナダ	2.98
10	DEXUS PROPERTY GROUP	オーストラリア	2.77

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものとして算出しております。
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2007年は設定日から年末までの収益率、および2012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。

(4)【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

		設定口数	解約口数
第1特定期間	第1期	1,354,335,639	4,739,799
	第2期	166,860,369	3,311,288
	第3期	140,462,149	2,938,296
	第4期	62,678,664	293,332
	第5期	39,709,557	13,508,334
第2特定期間	第6期	17,471,891	2,346,378
	第7期	5,846,556	2,422,007
	第8期	4,939,912	6,461,617
	第9期	1,069,957	2,877,579
	第10期	10,908,115	3,057,864
	第11期	478,385	6,698,211
第3特定期間	第12期	193,805	15,419,077
	第13期	176	18,874,634
	第14期	976,882	36,838,384
	第15期	604,348	6,450,064
	第16期	355,752	5,561,132
	第17期	281	6,134,961
第4特定期間	第18期	469,253	8,511,372
	第19期	2,037,344	86,600
	第20期	3,852,844	19,337
	第21期	3,650,102	489,716
	第22期	536,958	7,177,491
	第23期	309,789	200,000
第5特定期間	第24期	278,283	2,400,000
	第25期	1,075,950	91,164
	第26期	1,869,460	1,958,864
	第27期	3,462,264	4,845,946
	第28期	452,778	9,798,067
	第29期	963,128	7,649,148
第6特定期間	第30期	937,216	14,608,912
	第31期	342,684	8,188,965
	第32期	252,100	11,566,596
	第33期	902,823	3,973,267
	第34期	529,529	9,099,542
	第35期	292,849	-
第7特定期間	第36期	357,626	6,545,358
	第37期	371,690	5,436,996
	第38期	3,550,872	16,230,264
	第39期	319,387	3,442,381
	第40期	283,685	8,573,358
	第41期	175,852	28,599,465

第8特定期間	第42期	410,215	10,304,818
	第43期	319,129	449,966
	第44期	170,769	4,817,592
	第45期	372,618	25,560,029
	第46期	364,478	1,948,607
	第47期	945,460	22,315,201
第9特定期間	第48期	767,012	18,084,686
	第49期	410,878	7,453,380
	第50期	360,812	33,825,764
	第51期	590,848	30,573,389
	第52期	758,996	2,906,839
	第53期	2,626,180	17,511,573

(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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL http://www.diam.co.jp/

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

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※当初元本は1口当たり1円です。

・お申込手数料

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

・解約のお申込み方法

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

※原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに解約の請求が行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の

所定の事務手続が完了したものを当日のお申込みとします。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

・解約価額

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

解約価額＝基準価額－信託財産留保額

※信託財産留保額は、解約に際して生じる売買手数料等の費用について、受益者間の公平性を確保するため解約者から一定の金額を徴収し、信託財産に繰り入れるものです。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL http://www.diam.co.jp/

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

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されております。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL http://www.diam.co.jp/
コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(2)【保管】

該当事項はありません。

※ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

(3)【信託期間】

信託期間は平成19年8月20日から無期限です。

※ただし、下記(5)イ.の場合には信託を終了する場合があります。

(4)【計算期間】

a.計算期間は原則として毎月9日から翌月8日までとします。

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

(5)【その他】

イ.償還規定

a.委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

b.委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

c.委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

d.委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

e.上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。

f.委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

g.上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

h.委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

i.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、そ

の投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

j.受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

k.上記d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

a.委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

b.委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

c.委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

d.上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。

e.委託会社は、上記d.の規定により、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

f.委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a.からe.の規定に従い信託約款を変更します。

g.上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。

h.上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ.関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則3ヵ月前までに当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。投資一任契約および投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、各マザーファンドの信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ.公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

ホ.運用報告書

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

運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL http://www.diam.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金受領権

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

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

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

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

(2)償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

（1）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第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、第9特定期間（平成23年8月9日から平成24年2月8日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ＤＩＡＭ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23年８月８日現在	当期 平成24年２月８日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,544,386	8,420,779
親投資信託受益証券	797,276,629	745,925,852
未収入金	5,000,000	10,000,000
流動資産合計	813,821,015	764,346,631
資産合計	813,821,015	764,346,631
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,421,782	4,107,260
未払解約金	282,664	3,840,733
未払受託者報酬	46,869	37,034
未払委託者報酬	890,671	703,797
その他未払費用	5,553	4,386
流動負債合計	5,647,539	8,693,210
負債合計	5,647,539	8,693,210
純資産の部		
元本等		
元本	1,473,927,594	1,369,086,689
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	＊3 △665,754,118	＊3 △613,433,268
（分配準備積立金）	84,363,804	68,153,344
元本等合計	808,173,476	755,653,421
純資産合計	808,173,476	755,653,421
負債純資産合計	813,821,015	764,346,631

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 平成23年２月９日 至 平成23年８月８日	当期 自 平成23年８月９日 至 平成24年２月８日
営業収益		
受取利息	4,180	3,268
有価証券売買等損益	△36,635,503	33,649,223
営業収益合計	△36,631,323	33,652,491
営業費用		
受託者報酬	284,964	238,859
委託者報酬	＊1 5,415,258	＊1 4,539,190
その他費用	33,756	28,287
営業費用合計	5,733,978	4,806,336
営業利益又は営業損失（△）	△42,365,301	28,846,155
経常利益又は経常損失（△）	△42,365,301	28,846,155
当期純利益又は当期純損失（△）	△42,365,301	28,846,155
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△530,985	△22,805
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△621,206,804	△665,754,118
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,448,604	51,394,107
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,448,604	51,394,107
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,036,392	2,557,844
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,036,392	2,557,844
分配金	＊2 27,125,210	＊2 25,384,373
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△665,754,118	△613,433,268

(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。

（追加情報）

当特定期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	前期 平成23年8月8日現在	当期 平成24年2月8日現在
*1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中解約元本額	1,536,741,138円 2,582,669円 65,396,213円	1,473,927,594円 5,514,726円 110,355,631円
*2 特定期間末日における受益権の総数	1,473,927,594口	1,369,086,689口
*3 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665,754,118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613,433,268円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	前期 自平成23年2月9日 至平成23年8月8日	当期 自平成23年8月9日 至平成24年2月8日
*1 当ファンドの主要投資対象である高金利ソブリン・マザーファンド、ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド及びＤＩＡＭ インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドにおいて、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	1,178,211円	982,237円
*2 分配金の計算過程	（平成23年2月9日から平成23年3月8日までの分配金計算期間）	（平成23年8月9日から平成23年9月8日までの分配金計算期間）

	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,648,484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（47,121,387円）及び分配準備積立金（92,632,746円）より分配対象収益は142,402,617円（1万口当たり932.66円）であり、うち4,580,539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。） （平成23年3月9日から平成23年4月8日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,115,278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（47,136,638円）及び分配準備積立金（90,673,966円）より分配対象収益は141,925,882円（1万口当たり929.62円）であり、うち4,580,147円（1万口当たり30円）を分配金額としております。 （平成23年4月9日から平成23年5月9日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,127,850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（47,003,438円）及び分配準備積立金（89,924,453円）より分配対象収益は142,055,741円（1万口当たり933.31円）であり、うち4,566,206円（1万口当たり30円）を分配金額としております。 （平成23年5月10日から平成23年6月8日までの分配金計算期間）	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,882,610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（45,124,896円）及び分配準備積立金（83,328,903円）より分配対象収益は131,336,409円（1万口当たり901.66円）であり、うち4,369,829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。） （平成23年9月9日から平成23年10月11日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,450,193円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（44,930,166円）及び分配準備積立金（81,422,940円）より分配対象収益は128,803,299円（1万口当たり888.56円）であり、うち4,348,702円（1万口当たり30円）を分配金額としております。 （平成23年10月12日から平成23年11月8日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,383,647円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（43,912,826円）及び分配準備積立金（77,668,859円）より分配対象収益は123,965,332円（1万口当たり875.40円）であり、うち4,248,307円（1万口当たり30円）を分配金額としております。 （平成23年11月9日から平成23年12月8日までの分配金計算期間）

	計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,260,189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（46,248,025円）及び分配準備積立金（88,966,724円）より分配対象収益は138,474,938円（1万口当たり925.09円）であり、うち4,490,644円（1万口当たり30円）を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,267,265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（43,014,850円）及び分配準備積立金（74,167,880円）より分配対象収益は119,449,995円（1万口当たり861.76円）であり、うち4,158,359円（1万口当たり30円）を分配金額としております。
	（平成23年6月9日から平成23年7月8日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,088,110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（46,220,754円）及び分配準備積立金（87,622,060円）より分配対象収益は138,930,924円（1万口当たり929.12円）であり、うち4,485,892円（1万口当たり30円）を分配金額としております。	（平成23年12月9日から平成24年1月10日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,426,229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（42,988,983円）及び分配準備積立金（72,125,246円）より分配対象収益は118,540,458円（1万口当たり856.52円）であり、うち4,151,916円（1万口当たり30円）を分配金額としております。
	（平成23年7月9日から平成23年8月8日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,877,624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（45,616,377円）及び分配準備積立金（86,907,962円）より分配対象収益は134,401,963円（1万口当たり911.86円）であり、うち4,421,782円（1万口当たり30円）を分配金額としております。	（平成24年1月11日から平成24年2月8日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,763,636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（42,662,328円）及び分配準備積立金（70,496,968円）より分配対象収益は114,922,932円（1万口当たり839.41円）であり、うち4,107,260円（1万口当たり30円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	前期 自平成23年2月9日 至平成23年8月8日	当期 自平成23年8月9日 至平成24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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 平成23年8月8日現在	当期 平成24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)親投資信託受益証券 「注記表（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。	(1)親投資信託受益証券 同左

	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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

	前期 平成23年8月8日現在	当期 平成24年2月8日現在
種 類	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	△ 96,759,810	44,017,901
合計	△ 96,759,810	44,017,901

（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23年8月8日現在	当期 平成24年2月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.5483円 (5,483円)	0.5519円 (5,519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24年2月8日現在

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド	74,402,908	97,869,585	
親投資信託受益証券	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	133,041,857	150,842,857	
親投資信託受益証券	ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンド	214,866,131	247,181,997	
親投資信託受益証券	高金利ソブリン・マザーファンド	259,664,984	250,031,413	
合 計		681,975,880	745,925,852	

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

「高金利ソブリン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記番号	平成23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		4,726,770	4,202
コール・ローン		169,964,096	30,133,172
国債証券		14,670,385,561	11,850,766,649
特殊債券		1,422,357,490	934,080,667

未収入金		―	111,220,687
未収利息		306,056,189	202,564,525
前払費用		22,131,010	6,805,601
流動資産合計		16,595,621,116	13,135,575,503
資産合計		16,595,621,116	13,135,575,503
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		―	420,781
未払解約金		78,500,000	54,000,000
流動負債合計		78,500,000	54,420,781
負債合計		78,500,000	54,420,781
純資産の部			
元本等			
元本		16,724,001,932	13,584,911,432
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）	*3	△ 206,880,816	△ 503,756,710
元本等合計		16,517,121,116	13,081,154,722
純資産合計		16,517,121,116	13,081,154,722
負債純資産合計		16,595,621,116	13,135,575,503

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)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。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年5月10日から平成24年5月8日までとなっております。

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
*1 本有価証券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	20,487,872,239円	16,724,001,932円
同期中追加設定元本額	－円	6,553,796円
同期中解約元本額	3,763,870,307円	3,145,644,296円
同期末における元本の内訳		
ＤＩＡＭ高金利ソブリン債券ファンド（毎月決算型）	6,950,285,591円	4,934,135,514円
世界６資産アクティブ・バランス・ファンド	1,017,310,834円	859,758,688円
ＤＩＡＭバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	994,384,628円	784,973,487円
ＤＩＡＭ世界６資産バランスファンド	992,437,981円	845,746,698円
ＤＩＡＭグローバル・アクティブ・バランスファンド	3,758,209,304円	3,183,855,710円
ＤＩＡＭ資産形成ファンド（隔月決算型）	30,135,765円	23,349,981円
ＤＩＡＭ資産形成ファンド（１年決算型）	7,173,934円	6,858,011円
ＤＩＡＭインカム３資産ファンド（毎月決算型）	278,486,526円	259,664,984円
ＤＩＡＭ高金利ソブリン私募ファンド（適格機関投資家向け）	2,695,577,369円	2,686,568,359円
（合　　計）	16,724,001,932円	13,584,911,432円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	16,724,001,932口	13,584,911,432口
*3 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206,880,816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503,756,710円であります。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成23年2月9日 至平成23年8月8日	自平成23年8月9日 至平成24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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年8月8日現在	平成24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)国債証券及び特殊債券 「注記表（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。 ――――――	(1)国債証券及び特殊債券 同左 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

	平成23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
種　類	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	261,737,417	266,617,850
特殊債券	48,445,796	25,853,211
合計	310,183,213	292,471,061

(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特定期間末日までの期間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）

（平成23年8月8日現在）
該当事項はありません。

平成24年2月8日現在					
区分	種　類	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 カナダドル	111,652,078	-	112,072,859	△ 420,781
合　計		111,652,078	-	112,072,859	△ 420,781

（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。

①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。

②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23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9876円 (9,876円)	0.9629円 (9,629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24年2月8日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 4.0 02/15/15	13,150,000.00	14,585,191.000	
米ドル小計	銘柄数 ： 1	13,150,000.00	14,585,191.000	
	組入時価比率 ： 8.58%		(1,121,747,040)	
	合計時価比率 ： 8.77%			
	CANADA 4.5 06/01/15	13,700,000.00	15,163,982.000	
カナダドル小計	銘柄数 ： 1	13,700,000.00	15,163,982.000	
	組入時価比率 ： 8.96%		(1,171,417,610)	
	合計時価比率 ： 9.16%			
	SWEDEN 4.5 08/12/15	72,000,000.00	80,044,560.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 ： 1	72,000,000.00	80,044,560.000	

	組入時価比率 ： 7.06%		(923,714,222)	
	合計時価比率 ： 7.23%			
	NORWAY 5.0 05/15/15	80,000,000.00	89,012,000.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 ： 1	80,000,000.00	89,012,000.000	
	組入時価比率 ： 9.06%		(1,185,639,840)	
	合計時価比率 ： 9.27%			
	POLAND 5.0 10/24/13	30,000,000.00	30,180,000.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	25,600,000.00	26,845,440.000	
ポーランドズロチ小計	銘柄数 ： 2	55,600,000.00	57,025,440.000	
	組入時価比率 ： 10.67%		(1,395,982,771)	
	合計時価比率 ： 10.92%			
	CZECH REPUBLIC 6.95 01/26/16	232,000,000.00	274,177,600.000	
チェコ コルナ小計	銘柄数 ： 1	232,000,000.00	274,177,600.000	
	組入時価比率 ： 8.64%		(1,129,611,712)	
	合計時価比率 ： 8.84%			
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	5,600,000.00	6,063,568.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 ： 1	5,600,000.00	6,063,568.000	
	組入時価比率 ： 3.85%		(503,215,508)	
	合計時価比率 ： 3.94%			
	NEW ZEALAND 6.0 12/15/17	20,350,000.00	23,234,002.000	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 ： 1	20,350,000.00	23,234,002.000	
	組入時価比率 ： 11.40%		(1,491,622,928)	
	合計時価比率 ： 11.67%			
	MEXICAN BONDS 9.0 06/20/13	142,000,000.00	150,207,600.000	
	MEXICAN BONDS 6.0 06/18/15	18,000,000.00	18,591,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/17/15	61,000,000.00	67,373,280.000	
メキシコ ペソ小計	銘柄数 ： 3	221,000,000.00	236,172,180.000	
	組入時価比率 ： 10.92%		(1,428,841,689)	
	合計時価比率 ： 11.18%			
	SOUTH AFRICA 13.5 09/15/15	86,550,000.00	105,582,345.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	40,000,000.00	41,954,400.000	
南アフリカ・ランド小計	銘柄数 ： 2	126,550,000.00	147,536,745.000	
	組入時価比率 ： 11.46%		(1,498,973,329)	
	合計時価比率 ： 11.72%			
国債証券計			11,850,766,649	
			(11,850,766,649)	
特殊債券	NEW S WALES 5.5 08/01/14	10,900,000.00	11,255,340.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 ： 1	10,900,000.00	11,255,340.000	
	組入時価比率 ： 7.14%		(934,080,667)	
	合計時価比率 ： 7.31%			
特殊債券計			934,080,667	
			(934,080,667)	
合計			12,784,847,316	
			(12,784,847,316)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券	1銘柄	8.58%	8.77%
カナダドル	国債証券	1銘柄	8.96%	9.16%
スウェーデンクローネ	国債証券	1銘柄	7.06%	7.23%
ノルウェークローネ	国債証券	1銘柄	9.06%	9.27%
ポーランドズロチ	国債証券	2銘柄	10.67%	10.92%
チェコ コルナ	国債証券	1銘柄	8.64%	8.84%
オーストラリアドル	国債証券	1銘柄	3.85%	3.94%
オーストラリアドル	特殊債券	1銘柄	7.14%	7.31%
ニュージーランドドル	国債証券	1銘柄	11.40%	11.67%
メキシコ ペソ	国債証券	3銘柄	10.92%	11.18%
南アフリカ・ランド	国債証券	2銘柄	11.46%	11.72%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額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
「注記表（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。

「ＤＩＡＭ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

科目	注記番号	平成23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		202,868,202	356,104,823
コール・ローン		1,124,710,544	487,193,684
株式		43,799,199,054	40,707,152,261
派生商品評価勘定		－	58,000
未収入金		－	1,089,582,644
未収配当金		216,344,524	49,969,475
流動資産合計		45,343,122,324	42,690,060,887
資産合計		45,343,122,324	42,690,060,887
負債の部			
流動負債			
未払金		－	947,952,057
流動負債合計		－	947,952,057
負債合計		－	947,952,057

純資産の部			
元本等			
元本		42,407,711,294	36,285,673,705
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		2,935,411,030	5,456,435,125
元本等合計		45,343,122,324	41,742,108,830
純資産合計		45,343,122,324	41,742,108,830
負債純資産合計		45,343,122,324	42,690,060,887

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)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。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年5月27日から平成24年5月28日までとなっております。

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年8月8日現在	平成24年2月8日現在

*1 本有価証券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 同期中追加設定元本額 同期中解約元本額	 49,554,189,004円 321,597,992円 7,468,075,702円	 42,407,711,294円 185,846,588円 6,307,884,177円
同期末における元本の内訳		
ＤＩＡＭ世界好配当株オープン（毎月決算コース）	31,845,701,169円	27,065,630,216円
ＤＩＡＭ世界好配当株式ファンド（毎月決算型）	528,521,118円	696,456,501円
世界６資産アクティブ・バランス・ファンド	243,764,193円	201,290,650円
ＤＩＡＭ世界６資産バランスファンド	863,673,151円	714,625,195円
ＤＩＡＭグローバル・アクティブ・バランスファンド	1,365,013,585円	1,104,886,999円
ＤＩＡＭ資産形成ファンド（隔月決算型）	77,852,142円	60,263,150円
ＤＩＡＭ資産形成ファンド（１年決算型）	18,826,132円	18,013,943円
ＤＩＡＭ世界インカム・オープン（毎月決算コース）	3,603,246,601円	2,820,735,079円
ＤＩＡＭ世界３資産オープン（毎月決算型）	1,935,328,520円	1,714,095,432円
ＤＩＡＭインカム３資産ファンド（毎月決算型）	250,974,274円	214,866,131円
ＤＩＡＭ世界好配当株私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,674,810,409円	1,674,810,409円
（合　　計）	42,407,711,294円	36,285,673,705円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	42,407,711,294口	36,285,673,705口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成23年2月9日 至平成23年8月8日	自平成23年8月9日 至平成24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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年8月8日現在	平成24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)株式 「注記表（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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)株式 同左 (2)派生商品評価勘定 「注記表（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。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成23年8月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額(円)	平成24年2月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△ 3,842,451,729	1,432,623,951
合計	△ 3,842,451,729	1,432,623,951

(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特定期間末日までの期間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）

（平成23年8月8日現在）

該当事項はありません。

平成24年2月8日現在

区分	種 類	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				
	ユーロ	295,568,000	-	295,510,000	58,000
	英ポンド	91,687,500	-	91,687,500	-
合 計		387,255,500	-	387,197,500	58,000

（注）時価の算定方法

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

①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。

②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23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0692円 (10,692円)	1.1504円 (11,504円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

①株 式

平成24年2月8日現在

通 貨	銘 柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	SEADRILL LTD	118,760	38.370	4,556,821.200	
	SEAGATE TECHNOLOGY	192,456	26.670	5,132,801.520	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	111,568	44.870	5,006,056.160	
	ABBOTT LABORATORIES	67,783	55.710	3,776,190.930	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	84,571	51.610	4,364,709.310	
	AGL RESOURCES INC	92,871	41.650	3,868,077.150	
	VERIZON COMM INC	95,833	37.920	3,633,987.360	
	FIRSTENERGY CORP	98,915	43.240	4,277,084.600	
	H&R BLOCK INC	236,903	17.140	4,060,517.420	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	126,717	32.150	4,073,951.550	
	ONEOK INC	46,332	82.560	3,825,169.920	
	CENTURYLINK INC	101,175	37.490	3,793,050.750	
	CONAGRA FOODS INC	137,902	26.610	3,669,572.220	
	CONSOLIDATED EDISON INC	63,493	59.130	3,754,341.090	
	SARA LEE CORP	194,281	19.810	3,848,706.610	
	CMS ENERGY CORP	175,670	21.910	3,848,929.700	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	59,233	62.870	3,723,978.710	
	DOW CHEMICAL	114,583	33.860	3,879,780.380	
	DTE ENERGY CO	70,956	54.380	3,858,587.280	
	EATON CORP	76,408	51.290	3,918,966.320	
	FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	109,128	45.750	4,992,606.000	
	GENERAL ELECTRIC CO	226,804	19.180	4,350,100.720	
	REYNOLDS AMERICAN INC	90,774	40.110	3,640,945.140	
	INTEL CORP	160,495	26.640	4,275,586.800	

	JOHNSON & JOHNSON	57,400	65.260	3,745,924.000	
	VECTOR GROUP LTD	227,183	17.790	4,041,585.570	
	ELI LILLY & CO	103,478	39.500	4,087,381.000	
	LIMITED BRANDS	101,395	44.820	4,544,523.900	
	LINEAR TECH CORP	111,291	34.080	3,792,797.280	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	59,931	77.290	4,632,066.990	
	LOCKHEED MARTIN CORP	50,322	86.630	4,359,394.860	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	73,041	50.420	3,682,727.220	
	MCDONALD'S CORPORATION	38,266	100.910	3,861,422.060	
	MATTEL INC	120,679	32.000	3,861,728.000	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	152,566	27.220	4,152,846.520	
	MERCK & CO.INC.	97,510	38.630	3,766,811.300	
	MICROSOFT CORP	147,444	30.350	4,474,925.400	
	PFIZER INC	253,656	21.050	5,339,458.800	
	CONOCOPHILLIPS	61,138	71.920	4,397,044.960	
	ALTRIA GROUP INC	133,918	28.820	3,859,516.760	
	QUALCOMM INC	65,443	61.550	4,028,016.650	
	KRAFT FOODS INC-A	96,588	38.510	3,719,603.880	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	67,182	59.740	4,013,452.680	
	SOUTHERN CO	84,517	44.490	3,760,161.330	
	AT&T INC	141,277	30.040	4,243,961.080	
	CHEVRON CORP	41,313	106.830	4,413,467.790	
	PEPCO HOLDINGS INC	187,353	19.900	3,728,324.700	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	71,116	53.400	3,797,594.400	
	B&G FOODS INC	82,199	22.500	1,849,477.500	
	SPECTRA ENERGY CORP	138,767	31.320	4,346,182.440	
	TIME WARNER CABLE INC	64,584	75.220	4,858,008.480	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	140,765	77.600	10,923,364.000	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	120,327	34.290	4,126,012.830	
	LORILLARD INC	33,099	113.010	3,740,517.990	
米ドル小計	銘柄数 ： 54	5,977,359		226,278,819.210	
	組入時価比率 ： 41.69%			(17,403,103,985)	
	合計時価比率 ： 42.75%				
英ポンド	SEVERN TRENT PLC	139,253	15.220	2,119,430.660	
	DIAGEO PLC	169,829	14.740	2,503,279.460	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	208,109	30.925	6,435,770.820	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	142,117	24.280	3,450,600.760	
	CENTRICA PLC	962,499	3.027	2,913,484.470	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	400,740	6.060	2,428,484.400	
	PRUDENTIAL PLC	337,012	7.285	2,455,132.420	
	VODAFONE GROUP PLC	3,560,463	1.749	6,227,249.780	
	REED ELSEVIER PLC	539,339	5.310	2,863,890.090	
	BP PLC	429,758	4.865	2,090,772.670	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	354,603	14.060	4,985,718.180	
	ASTRAZENECA PLC	82,707	30.000	2,481,210.000	
	G4S PLC	643,597	2.777	1,787,268.860	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	292,184	23.180	6,772,825.120	
英ポンド小計	銘柄数 ： 14	8,262,210		49,515,117.690	

	組入時価比率 ： 14.50%			(6,053,718,289)	
	合計時価比率 ： 14.87%				
カナダドル	TMX GROUP INC	99,090	41.900	4,151,871.000	
	BANK OF MONTREAL	69,397	58.120	4,033,353.640	
	BANK OF NOVA SCOTIA	86,064	51.980	4,473,606.720	
	NATIONAL BANK OF CANADA	60,959	75.790	4,620,082.610	
	BCE INC	100,363	40.600	4,074,737.800	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	61,549	76.340	4,698,650.660	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	116,722	46.100	5,380,884.200	
	POWER CORP OF CANADA	157,712	25.060	3,952,262.720	
	ROYAL BANK OF CANADA	79,263	53.580	4,246,911.540	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	61,489	78.830	4,847,177.870	
	BAYTEX ENERGY CORP	91,904	55.890	5,136,514.560	
カナダドル小計	銘柄数 ： 11	984,512		49,616,053.320	
	組入時価比率 ： 9.18%			(3,832,840,119)	
	合計時価比率 ： 9.42%				
スイスフラン	NESTLE SA-REGISTERED	116,375	53.550	6,231,881.250	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	53,893	161.000	8,676,773.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	158,260	51.650	8,174,129.000	
スイスフラン小計	銘柄数 ： 3	328,528		23,082,783.250	
	組入時価比率 ： 4.66%			(1,946,109,456)	
	合計時価比率 ： 4.78%				
スウェーデンクローネ	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	229,128	113.600	26,028,940.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	122,462	213.100	26,096,652.200	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 ： 2	351,590		52,125,593.000	
	組入時価比率 ： 1.44%			(601,529,343)	
	合計時価比率 ： 1.48%				
ユーロ	BASF SE	62,552	60.870	3,807,540.240	
	ALLIANZ SE	41,337	88.920	3,675,686.040	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	27,634	107.600	2,973,418.400	
	REPSOL YPF SA	110,650	20.580	2,277,177.000	
	TELEFONICA S.A	182,876	13.370	2,445,052.120	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	84,736	35.570	3,014,059.520	
	VINCI S.A.	80,204	36.830	2,953,913.320	
	VIVENDI SA	200,932	16.190	3,253,089.080	
	TOTAL SA	139,674	40.935	5,717,555.190	
	FRANCE TELECOM SA	221,381	11.645	2,577,981.740	
	SANOFI	58,519	56.530	3,308,079.070	
	GDF SUEZ	168,804	21.350	3,603,965.400	
	ENI SPA	155,078	17.190	2,665,790.820	
	SNAM SPA	614,373	3.528	2,167,507.940	
	KONINKLIJKE DSM NV	68,244	40.930	2,793,226.920	
ユーロ小計	銘柄数 ： 15	2,216,994		47,234,042.800	
	組入時価比率 ： 11.53%			(4,813,621,302)	
	合計時価比率 ： 11.83%				
ノルウェークローネ	ORKLA ASA	519,436	48.060	24,964,094.160	

	STATOIL ASA	154,900	150.000	23,235,000.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 ： 2	674,336		48,199,094.160	
	組入時価比率 ： 1.54%			(642,011,934)	
	合計時価比率 ： 1.58%				
香港ドル	CNOOC LTD	1,859,000	16.780	31,194,020.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,638,500	20.900	34,244,650.000	
香港ドル小計	銘柄数 ： 2	3,497,500		65,438,670.000	
	組入時価比率 ： 1.56%			(649,151,606)	
	合計時価比率 ： 1.59%				
シンガポール・ドル	SEMBCORP INDUSTRIES	992,000	4.890	4,850,880.000	
	SEMBCORP MARINE	958,000	5.020	4,809,160.000	
	KEPPEL CORP LTD	524,000	10.700	5,606,800.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	615,000	8.660	5,325,900.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 ： 4	3,089,000		20,592,740.000	
	組入時価比率 ： 3.05%			(1,272,219,477)	
	合計時価比率 ： 3.13%				
オーストラリアドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	177,158	21.360	3,784,094.880	
	AMCOR LTD	566,468	6.990	3,959,611.320	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	174,637	20.920	3,653,406.040	
	TELSTRA CORP LTD	1,205,795	3.430	4,135,876.850	
	BHP BILLITON LTD	97,819	37.900	3,707,340.100	
	COCA-COLA AMATIL LTD	312,232	11.570	3,612,524.240	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	78,714	50.510	3,975,844.140	
	ORICA LTD	168,277	25.300	4,257,408.100	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	150,756	23.210	3,499,046.760	
	WOOLWORTHS LTD	140,890	24.280	3,420,809.200	
	METCASH LTD	1,012,804	4.030	4,081,600.120	
オーストラリアドル小計	銘柄数 ： 11	4,085,550		42,087,561.750	
	組入時価比率 ： 8.37%			(3,492,846,750)	
	合計時価比率 ： 8.58%				
合計				40,707,152,261	
				(40,707,152,261)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

②株式以外の有価証券

該当事項はありません。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式	54銘柄	41.69%	42.75%

英ポンド	株式	14銘柄	14.50%	14.87%
カナダドル	株式	11銘柄	9.18%	9.42%
スイスフラン	株式	3銘柄	4.66%	4.78%
スウェーデンクローネ	株式	2銘柄	1.44%	1.48%
ユーロ	株式	15銘柄	11.53%	11.83%
ノルウェークローネ	株式	2銘柄	1.54%	1.58%
香港ドル	株式	2銘柄	1.56%	1.59%
シンガポール・ドル	株式	4銘柄	3.05%	3.13%
オーストラリアドル	株式	11銘柄	8.37%	8.58%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額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
「注記表（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。

次へ

「ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記番号	平成23年8月8日現在 金額 （円）	平成24年2月8日現在 金額 （円）
資産の部			
流動資産			
預金		1,880,014,412	3,685,518,553
コール・ローン		1,154,735,828	1,014,709,983
投資証券		75,551,245,967	69,929,933,397
派生商品評価勘定		11,960,000	－
未収入金		3,247,771,529	－
未収配当金		－	13,424,024
流動資産合計		81,845,727,736	74,643,585,957
資産合計		81,845,727,736	74,643,585,957
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	6,400,000
未払金		284,161,056	580,343,633
未払解約金		2,000,000,000	1,035,000,000
流動負債合計		2,284,161,056	1,621,743,633
負債合計		2,284,161,056	1,621,743,633
純資産の部			
元本等			
元本		71,098,477,510	55,513,751,360
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		8,463,089,170	17,508,090,964
元本等合計		79,561,566,680	73,021,842,324
純資産合計		79,561,566,680	73,021,842,324
負債純資産合計		81,845,727,736	74,643,585,957

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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)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。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年12月10日から平成23年12月9日まで及び平成23年12月10日から平成24年12月10日までとなっております。

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号　平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号　平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
*1 本有価証券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	80,873,181,191円	71,098,477,510円
同期中追加設定元本額	11,569,116円	21,238,673円
同期中解約元本額	9,786,272,797円	15,605,964,823円
同期末における元本の内訳		
世界６資産アクティブ・バランス・ファンド	85,354,453円	70,108,151円
ＤＩＡＭ世界６資産バランスファンド	310,384,131円	247,256,619円
ＤＩＡＭグローバル・アクティブ・バランスファンド	432,876,639円	344,955,371円
ＤＩＡＭ資産形成ファンド（隔月決算型）	8,890,705円	6,529,503円
ＤＩＡＭ資産形成ファンド（１年決算型）	2,219,762円	2,219,762円
ＤＩＡＭ ワールド・リート・インカム・オープン（毎月決算コース）	66,682,216,251円	51,962,260,981円
ＤＩＡＭ世界インカム・オープン（毎月決算コース）	1,271,260,191円	976,145,388円
ＤＩＡＭ ワールド・リート・オープン（ラップ向け）	14,022,339円	7,364,581円

ＤＩＡＭ ワールドＲＥＩＴアクティブファンド（毎月決算型）	1,473,696,394円	1,208,273,862円
ＤＩＡＭ世界３資産オープン（毎月決算型）	713,139,215円	596,659,768円
ＤＩＡＭインカム３資産ファンド（毎月決算型）	89,883,032円	74,402,908円
ＤＩＡＭ ワールドＲＥＩＴアクティブファンド＜ＤＣ年金＞	14,534,398円	17,574,466円
（合　　計）	71,098,477,510円	55,513,751,360円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	71,098,477,510口	55,513,751,360口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成23年2月9日 至平成23年8月8日	自平成23年8月9日 至平成24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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年8月8日現在	平成24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)投資証券 「注記表（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)派生商品評価勘定 「注記表（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。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)投資証券 同左 (2)派生商品評価勘定 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成23年8月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額(円)	平成24年2月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△ 2,869,351,818	7,940,157,198
合計	△ 2,869,351,818	7,940,157,198

(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特定期間末日までの期間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）

平成23年8月8日現在

区分	種　類	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 米ドル	2,042,560,000	-	2,030,600,000	11,960,000
合　計		2,042,560,000	-	2,030,600,000	11,960,000

平成24年2月8日現在

区分	種　類	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 米ドル	1,531,600,000	-	1,538,000,000	△ 6,400,000
合　計		1,531,600,000	-	1,538,000,000	△ 6,400,000

（注）時価の算定方法

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

①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。

②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23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1190円 (11,190円)	1.3154円 (13,154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24年2月8日現在

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資証券	CBL & ASSOCIATES PROP PFD 7.375	492,000.00	12,172,080.000	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	650,174.00	47,898,318.580	
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	1,001,300.00	44,587,889.000	
	PROLOGIS INC	606,000.00	20,173,740.000	
	LEXINGTON REALTY TRUST	2,958,800.00	25,652,796.000	
	CBL & ASSOCIATES	2,042,835.00	37,690,305.750	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	237,786.00	34,778,580.360	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	942,376.00	31,334,002.000	
	EAST GROUP	527,100.00	25,917,507.000	
	RAYONIER INC	316,000.00	14,248,440.000	
	KIMCO REALTY	1,667,200.00	31,009,920.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,026,500.00	34,326,160.000	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	4,039,200.00	45,521,784.000	
	DIGITAL REALTY 7.0%	700,000.00	18,095,000.000	
	THE MACERICH COMPANY	858,400.00	47,641,200.000	
	DUPONT FABROS 7.625	285,000.00	7,139,250.000	
	PLUM CREEK TIMBER CO	846,100.00	33,429,411.000	
	POST PROPERTIES, INC	226,000.00	10,276,220.000	
	REGENCY	666,367.00	28,647,117.330	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,383,120.00	34,287,544.800	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	397,283.00	54,618,466.840	
	VENTAS INC	809,663.00	47,664,860.810	
	VORNADO REALTY TRUST	281,066.00	24,107,030.820	
	SL GREEN REALTY PFD 7.625	1,007,340.00	25,737,537.000	
	VORNADO REALTY TRUST PFD 6.75	175,000.00	4,439,750.000	
	BIOMED REALTY TRUST INC	539,800.00	10,418,140.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	997,894.00	43,937,272.820	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	607,540.00	43,007,756.600	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	9,133,684.00	51,331,304.080	
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	689,200.00	17,574,600.000	

	CORESITE REALTY CORP	74,480.00	1,579,720.800	
米ドル小計	銘柄数 ： 31	36,185,208.00	909,243,705.590	
	組入時価比率 ： 95.77%		(69,929,933,397)	
	合計時価比率 :100.00%			
合計			69,929,933,397	
			(69,929,933,397)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券	31銘柄	95.77%	100.00%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額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
「注記表（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。

「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」の状況
貸借対照表

科目	注記番号	平成23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		3,180,080,429	2,859,406,520
コール・ローン		1,706,537,167	991,201,420
投資信託受益証券		59,987,799,563	56,432,354,960
投資証券		61,572,002,340	50,248,504,758
派生商品評価勘定		10,344,000	－
未収入金		80,843,269	515,232,988
未収配当金		1,463,710,709	1,316,564,261
流動資産合計		128,001,317,477	112,363,264,907
資産合計		128,001,317,477	112,363,264,907
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,215,000	15,042,500
未払金		－	75,770,995
未払解約金		2,500,000,000	1,031,000,000
流動負債合計		2,507,215,000	1,121,813,495
負債合計		2,507,215,000	1,121,813,495
純資産の部			

元本等			
元本		115,593,214,200	98,117,412,233
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		9,900,888,277	13,124,039,179
元本等合計		125,494,102,477	111,241,451,412
純資産合計		125,494,102,477	111,241,451,412
負債純資産合計		128,001,317,477	112,363,264,907

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	投資信託受益証券及び投資証券 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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)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。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年12月10日から平成23年12月9日まで及び平成23年12月10日から平成24年12月10日までとなっております。

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
*1 本有価証券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	132,553,915,885円	115,593,214,200円
同期中追加設定元本額	14,898,018円	84,698,351円
同期中解約元本額	16,975,599,703円	17,560,500,318円
同期末における元本の内訳		
世界６資産アクティブ・バランス・ファンド	141,543,849円	122,656,720円
ＤＩＡＭ世界６資産バランスファンド	495,518,221円	432,402,642円
ＤＩＡＭグローバル・アクティブ・バランスファンド	732,627,249円	641,390,800円
ＤＩＡＭ資産形成ファンド（隔月決算型）	14,128,121円	11,645,644円
ＤＩＡＭ資産形成ファンド（１年決算型）	3,514,431円	3,514,431円
ＤＩＡＭ ワールド・リート・インカム・オープン（毎月決算コース）	108,511,724,876円	91,817,343,990円
ＤＩＡＭ世界インカム・オープン（毎月決算コース）	2,064,450,768円	1,717,136,901円
ＤＩＡＭ ワールド・リート・オープン（ラップ向け）	22,136,099円	13,031,826円
ＤＩＡＭ ワールドＲＥＩＴアクティブファンド（毎月決算型）	2,346,918,176円	2,155,287,461円
ＤＩＡＭ世界３資産オープン（毎月決算型）	1,096,083,259円	1,038,786,020円
ＤＩＡＭインカム３資産ファンド（毎月決算型）	141,219,979円	133,041,857円
ＤＩＡＭ ワールドＲＥＩＴアクティブファンド＜ＤＣ年金＞	23,349,172円	31,173,941円
（合　　計）	115,593,214,200円	98,117,412,233円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	115,593,214,200口	98,117,412,233口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成23年2月9日 至平成23年8月8日	自平成23年8月9日 至平成24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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年8月8日現在	平成24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)投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（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)派生商品評価勘定 「注記表（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。	(1)投資信託受益証券及び投資証券 同左 (2)派生商品評価勘定 同左

	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成23年8月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額(円)	平成24年2月8日現在 当期の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	△ 4,728,742,185	△ 1,184,234,990
投資証券	△ 4,194,256,648	3,557,391,555
合計	△ 8,922,998,833	2,373,156,565

(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特定期間末日までの期間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）

平成23年8月8日現在

区分	種 類	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				
	オーストラリアドル	501,481,000	-	496,540,000	4,941,000
	カナダドル	602,175,000	-	597,000,000	5,175,000
	ニュージーランドドル	49,970,000	-	49,742,000	228,000
	ユーロ	608,960,000	-	615,175,000	△ 6,215,000
	英ポンド	255,480,000	-	256,480,000	△ 1,000,000

合　計	2,018,066,000	-	2,014,937,000	3,129,000

平成24年2月8日現在					
区分	種　類	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				
	オーストラリアドル	603,435,000	-	609,829,500	△ 6,394,500
	カナダドル	153,740,000	-	154,480,000	△ 740,000
	シンガポール・ドル	251,453,000	-	253,257,000	△ 1,804,000
	ニュージーランドドル	102,240,000	-	102,704,000	△ 464,000
	ユーロ	401,960,000	-	407,600,000	△ 5,640,000
合　計		1,512,828,000	-	1,527,870,500	△ 15,042,500

（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。
①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。
②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23年8月8日現在	平成24年2月8日現在
1口当たり純資産額	1.0857円	1.1338円
（1万口当たり純資産額）	(10,857円)	(11,338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24年2月8日現在

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	31,291,000.00	61,017,450.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	74,648,320.00	66,437,004.800	

	ASCOTT RESIDENCE TRUST	27,492,000.00	27,492,000.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	10,172,000.00	14,647,680.000	
	PARKWAY LIFE REIT	6,095,000.00	10,666,250.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	23,696,840.00	26,303,492.400	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	6,704,000.00	5,798,960.000	
	CACHE LOGISTICS TRUST	8,017,000.00	7,976,915.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 ： 8	188,116,160.00	220,339,752.200	
	組入時価比率 ： 12.24%		(13,612,589,891)	
	合計時価比率 ： 12.76%			
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	5,704,030.00	15,001,598.900	
	BWP TRUST	6,282,307.00	10,962,625.710	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	16,447,149.00	16,118,206.020	
	MIRVAC GROUP	62,994,939.00	78,113,724.360	
	INVESTA OFFICE FUND	99,175,352.00	62,976,348.520	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	9,963,747.00	7,024,441.630	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	13,541,096.00	44,143,972.960	
	CFS RETAIL PROPERTY	57,169,560.00	98,331,643.200	
	GPT GROUP	6,971,433.00	21,332,584.980	
	ALE PROPERTY GROUP	3,301,606.00	6,471,147.760	
	STOCKLAND	15,207,632.00	49,881,032.960	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,342,667.00	913,013.560	
	WESTFIELD GROUP	1,580,347.00	13,575,180.730	
	DEXUS PROPERTY GROUP	48,965,534.00	43,824,152.930	
	GOODMAN GROUP	11,156,284.00	7,530,491.700	
	CHARTER HALL GROUP	8,561,921.00	18,236,891.730	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	8,576,052.00	21,525,890.520	
オーストラリアドル小計	銘柄数 ： 17	376,941,656.00	515,962,948.170	
	組入時価比率 ： 38.49%		(42,819,765,069)	
	合計時価比率 ： 40.14%			
投資信託受益証券計			56,432,354,960	
			(56,432,354,960)	
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	5,140,787.00	25,960,974.350	
	HAMMERSON PLC	3,397,005.00	12,874,648.950	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,381,449.00	9,393,853.200	
	SEGRO PLC	3,405,164.00	7,688,860.310	
	LOCAL SHOPPING REIT PLC	1,797,071.00	857,202.860	
	METRIC PROPERTY INVESTMENTS PLC	3,791,952.00	3,355,877.520	
英ポンド小計	銘柄数 ： 6	18,913,428.00	60,131,417.190	
	組入時価比率 ： 6.61%		(7,351,667,066)	
	合計時価比率 ： 6.89%			
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	826,622.00	22,442,787.300	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1,248,948.00	33,034,674.600	
	ALLIED PROPERTIES REIT	1,561,122.00	40,995,063.720	
	DUNDEE REAL ESTATE INV TRUST	491,275.00	16,831,081.500	

	PRIMARIS RETAIL REIT	1,405,611.00	31,401,349.740	
	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	578,957.00	18,723,469.380	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,824,205.00	28,512,324.150	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	860,661.00	12,307,452.300	
カナダドル小計	銘柄数 ： 8	8,797,401.00	204,248,202.690	
	組入時価比率 ： 14.18%		(15,778,173,658)	
	合計時価比率 ： 14.79%			
	BEFIMMO	167,458.00	8,980,772.540	
	COFINIMMO SA	167,335.00	15,230,831.700	
	WAREHOUSES DE PAUW	273,252.00	10,580,317.440	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,207,549.00	10,747,186.100	
	GECINA SA	60,612.00	4,578,024.360	
	ICADE EMGP	45,244.00	2,852,181.760	
	SOCIETE TOUR EIFFEL	126,344.00	5,055,023.440	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	535,964.00	77,661,183.600	
	KLEPIERRE	375,900.00	8,600,592.000	
	SILIC	58,261.00	4,613,688.590	
	EUROCOMMERCIAL	699,422.00	19,450,925.820	
	VASTNED RETAIL	287,692.00	10,470,550.340	
	CORIO NV	271,693.00	10,128,715.040	
	WERELDHAVE NV	482,901.00	28,665,003.360	
	NIEUWE STEEN INVS	368,699.00	3,515,176.260	
ユーロ小計	銘柄数 ： 15	5,128,326.00	221,130,172.350	
	組入時価比率 ： 20.26%		(22,535,375,864)	
	合計時価比率 ： 21.12%			
	LINK REIT/THE	7,742,967.00	217,577,372.700	
香港ドル小計	銘柄数 ： 1	7,742,967.00	217,577,372.700	
	組入時価比率 ： 1.94%		(2,158,367,537)	
	合計時価比率 ： 2.02%			
	GOODMAN PROPERTY TRUST	36,850,097.00	37,771,349.420	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 ： 1	36,850,097.00	37,771,349.420	
	組入時価比率 ： 2.18%		(2,424,920,633)	
	合計時価比率 ： 2.27%			
投資証券計			50,248,504,758	
			(50,248,504,758)	
合計			106,680,859,718	
			(106,680,859,718)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率

英ポンド	投資証券	6銘柄	6.61%	6.89%
カナダドル	投資証券	8銘柄	14.18%	14.79%
ユーロ	投資証券	15銘柄	20.26%	21.12%
香港ドル	投資証券	1銘柄	1.94%	2.02%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	8銘柄	12.24%	12.76%
オーストラリアドル	投資信託受益証券	17銘柄	38.49%	40.14%
ニュージーランドドル	投資証券	1銘柄	2.18%	2.27%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額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

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成24年2月29日現在

項　目	金額又は口数
Ⅰ 資産総額	797,305,547円
Ⅱ 負債総額	1,132,276円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	796,173,271円
Ⅳ 発行済数量	1,366,510,369口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.5826円

（参考）マザーファンドの現況

高金利ソブリン・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項　目	金額又は口数
Ⅰ 資産総額	13,657,941,101円
Ⅱ 負債総額	20,000,000円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,637,941,101円
Ⅳ 発行済数量	13,381,281,448口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0192円

ＤＩＡＭ世界好配当株オープン・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項　目	金額又は口数
Ⅰ 資産総額	44,448,939,322円
Ⅱ 負債総額	690,027,328円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	43,758,911,994円
Ⅳ 発行済数量	35,479,533,608口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2334円

ＤＩＡＭ ＵＳ・リート・オープン・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項　目	金額又は口数
Ⅰ 資産総額	74,376,265,902円
Ⅱ 負債総額	512,000,000円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	73,864,265,902円
Ⅳ 発行済数量	54,446,219,463口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3566円

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

平成24年2月29日現在

項　目	金額又は口数
Ⅰ 資産総額	114,706,452,657円
Ⅱ 負債総額	561,000,000円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	114,145,452,657円
Ⅳ 発行済数量	96,189,166,591口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1867円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4)受益権の譲渡の対抗要件

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

(5)受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

本書提出日現在の資本金の額　　　20億円

発行する株式総数　　80,000株

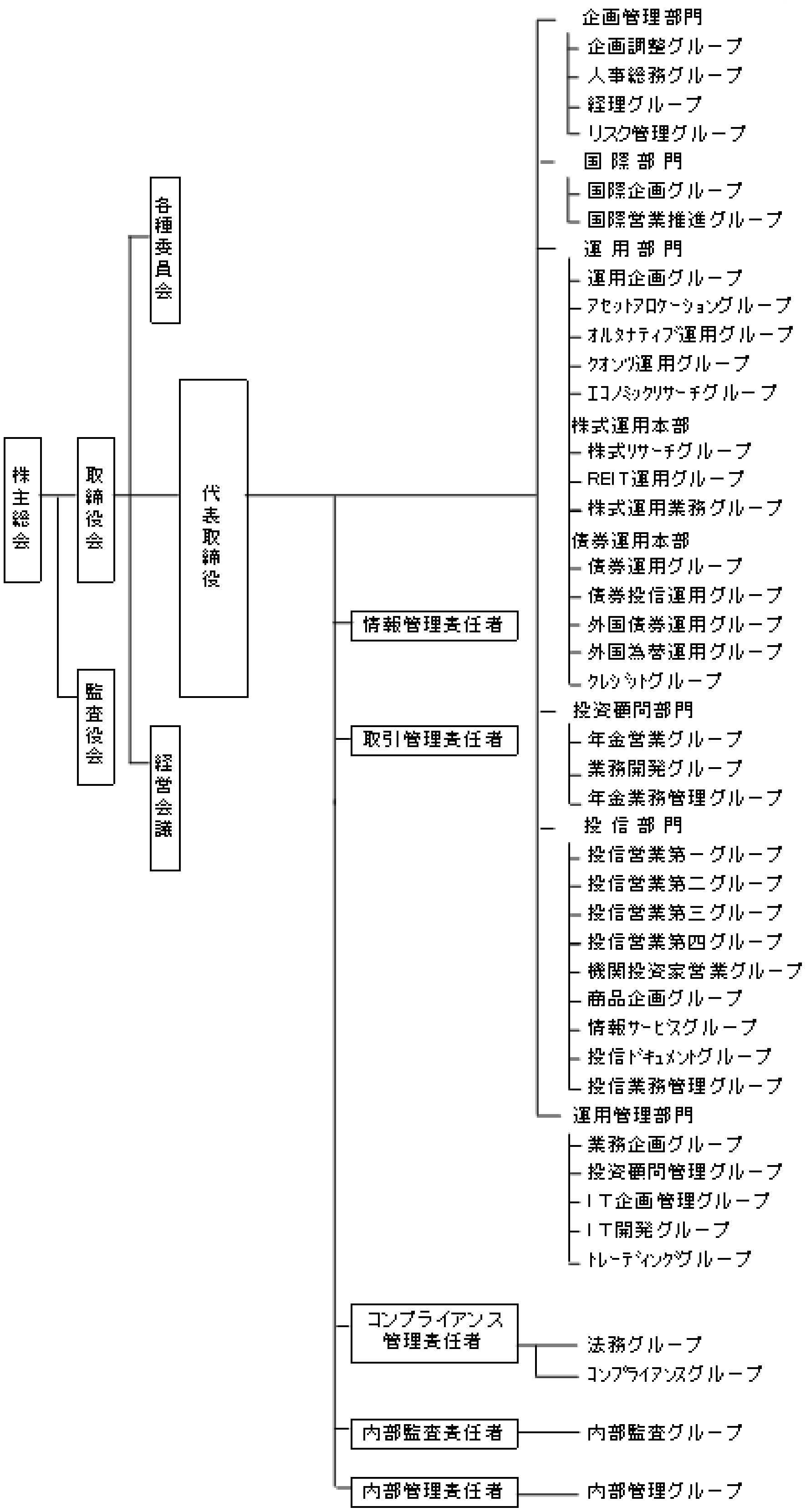
発行済株式総数　　24,000株

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

（2）会社の機構

①会社の組織図



※上記組織は、平成24年4月1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 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。

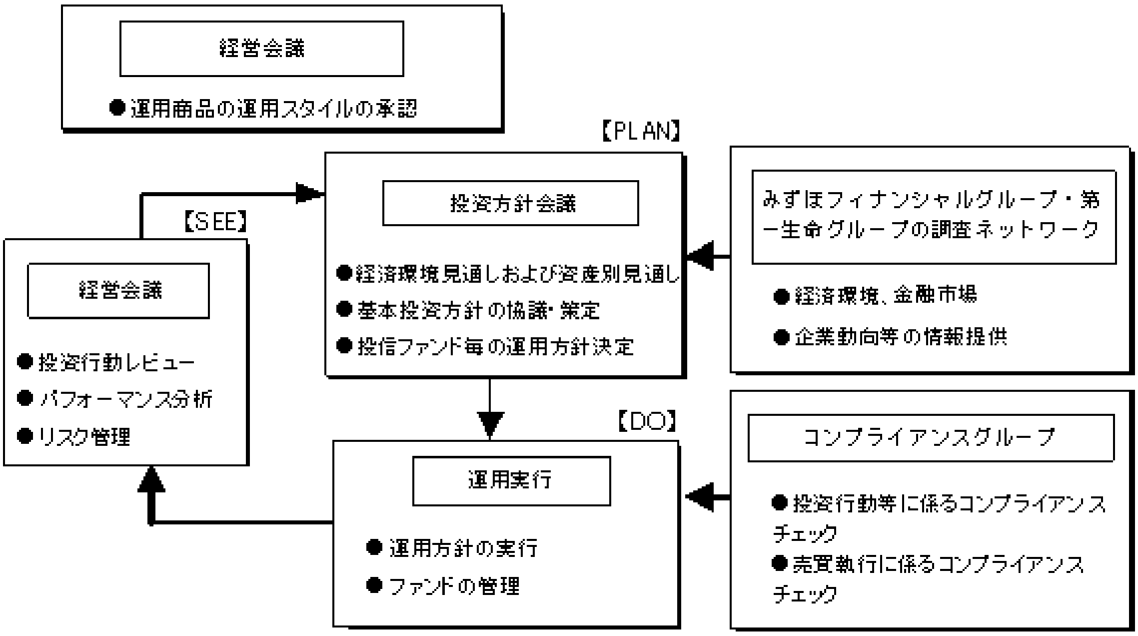
③ 投資運用の意思決定機構

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24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】

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」に定める投資助言業務を行っています。

平成24年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は275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	13	25,098,443,613
追加型株式投資信託	252	4,185,613,693,844
単位型公社債投資信託	9	75,758,017,008
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	407,439,406
合計	275	4,286,877,593,871

3【委託会社等の経理状況】

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

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。以下「中間財務諸表等規則」という。）、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。

なお、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。

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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23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27期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23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25期 （平成22年3月31日現在）		第26期 （平成23年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		13,820,588		12,220,759
金銭の信託		399,833		5,967,344
前払費用		33,221		27,593
未収委託者報酬		3,169,323		2,942,180
未収運用受託報酬		1,000,785		1,061,935
未収投資助言報酬	※2	271,577	※2	267,240
未収収益		247,552		186,483
繰延税金資産		383,608		403,201
その他		21,009		102,404
流動資産計		19,347,501		23,179,143
固定資産				
有形固定資産		599,421		400,967
建物	※1	237,642	※1	183,704
器具備品	※1	351,237	※1	206,306
建設仮勘定		10,541		10,956
無形固定資産		964,184		1,267,273
商標権	※1	804	※1	510
ソフトウエア	※1	557,870	※1	780,190
ソフトウエア仮勘定		397,829		478,971
電話加入権		7,148		7,148
電話施設利用権	※1	531	※1	451
投資その他の資産		5,247,891		4,252,397
投資有価証券		1,194,081		604,498
関係会社株式		2,161,144		2,457,319
繰延税金資産		403,908		402,191
長期差入保証金		1,187,070		702,696
その他		328,612		85,690
貸倒引当金		△26,925		－
固定資産計		6,811,497		5,920,638
資産合計		26,158,999		29,099,782

（単位：千円）

	第25期 （平成22年3月31日現在）		第26期 （平成23年3月31日現在）	
（負債の部）				
流動負債				
預り金		119,466		120,910
未払金		1,526,031		1,479,756
未払収益分配金		7,837		3,223
未払償還金		96,340		98,362
未払手数料		1,206,815		1,134,992
その他未払金		215,038		243,178
未払費用	※2	1,522,325	※2	1,226,658
未払法人税等		1,283,275		1,706,391
未払消費税等		113,923		143,728
賞与引当金		572,614		575,326
その他		38,231		10,000
流動負債計		5,175,867		5,262,771
固定負債				
退職給付引当金		488,790		579,063
役員退職慰労引当金		96,342		100,260
固定負債計		585,133		679,324
負債合計		5,761,000		5,942,095
（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		15,737,995		18,512,674
利益準備金		123,293		123,293
その他利益剰余金				
別途積立金		11,650,000		13,430,000
研究開発積立金		300,000		300,000
運用責任準備積立金		200,000		200,000
繰越利益剰余金		3,464,702		4,459,380
株主資本計		20,166,473		22,941,152
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		231,525		216,534
評価・換算差額等計		231,525		216,534
純資産合計		20,397,999		23,157,686
負債・純資産合計		26,158,999		29,099,782

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

	第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）		第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	26,734,588		24,367,005	
運用受託報酬	4,297,349		4,458,894	
投資助言報酬	1,027,153		1,019,727	
その他営業収益	723,055		789,867	
営業収益計		32,782,146		30,635,495
営業費用				
支払手数料	13,000,141		10,405,593	
広告宣伝費	218,782		272,928	
公告費	1,767		2,297	
調査費	5,056,427		4,755,890	
調査費	2,555,070		2,611,173	
委託調査費	2,501,356		2,144,716	
委託計算費	351,370		338,206	
営業雑経費	679,608		671,721	
通信費	32,088		30,286	
印刷費	613,198		585,041	
協会費	21,225		23,561	
諸会費	41		38	
支払販売手数料	13,054		32,794	
営業費用計		19,308,097		16,446,637
一般管理費				
給料	4,678,614		4,576,265	
役員報酬	※1 244,725		※1 235,289	
給料・手当	3,840,052		3,768,114	
賞与	593,836		572,860	
交際費	45,342		38,997	
寄付金	3,450		13,335	
旅費交通費	269,516		255,190	
租税公課	85,030		89,571	
不動産賃借料	791,980		718,929	
退職給付費用	132,513		139,773	
固定資産減価償却費	397,252		486,987	
福利厚生費	22,233		20,476	
修繕費	5,615		20,842	
賞与引当金繰入	572,614		575,326	
役員退職慰労引当金繰入	45,086		42,036	
役員退職金	18,129		13,140	
機器リース料	2,191		1,951	
事務委託費	285,449		331,935	
消耗品費	78,753		70,952	
器具備品費	2,046		575	
諸経費	88,728		124,218	
一般管理費計		7,524,549		7,520,506
営業利益		5,949,500		6,668,351

（単位：千円）

	第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）		第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	5,287		※4 341,775	
受取利息	18,745		9,168	
時効成立分配金	157		2,574	
投資信託解約益	559,971		157,213	
先物利益	―		9,816	
金銭の信託運用益	―		69,014	
雑収入	3,431		8,602	
営業外収益計		587,592		598,165
営業外費用				
為替差損	17,771		755	
時効成立後支払分配金	444		―	
先物損失	719,577		―	
金銭の信託運用損	1,116		―	
雑損失	―		6,089	
営業外費用計		738,911		6,844
経常利益		5,798,181		7,259,672
特別利益				
貸倒引当金戻入益	―		4,288	
過年度損益修正益	―		※3,※4 105,241	
特別利益計		―		109,530
特別損失				
固定資産除却損	※2 21,626		※2 31,419	
固定資産売却損	2,464		1,440	
関係会社株式評価損	―		3,825	
特別損失計		24,090		36,684
税引前当期純利益		5,774,091		7,332,518
法人税、住民税及び事業税		2,508,095		2,885,426
法人税等調整額		△135,267		△7,586
法人税等合計		2,372,828		2,877,839
当期純利益		3,401,263		4,454,678

(3)【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	10,040,000	11,650,000
当期変動額	1,610,000	1,780,000
当期末残高	11,650,000	13,430,000
研究開発積立金		
前期末残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
前期末残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	3,299,438	3,464,702
当期変動額		
剰余金の配当	△1,626,000	△1,680,000
別途積立金の積立	△1,610,000	△1,780,000
当期純利益	3,401,263	4,454,678
当期末残高	3,464,702	4,459,380
利益剰余金合計		
前期末残高	13,962,732	15,737,995
当期変動額	1,775,263	2,774,678
当期末残高	15,737,995	18,512,674
株主資本合計		
前期末残高	18,391,210	20,166,473
当期変動額	1,775,263	2,774,678
当期末残高	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	△1,547	231,525
当期変動額（純額）	233,073	△14,991
当期末残高	231,525	216,534
純資産合計		
前期末残高	18,389,662	20,397,999
当期変動額	2,008,336	2,759,687
当期末残高	20,397,999	23,157,686

次へ

重要な会計方針

第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
1.有価証券の評価基準及び評価方法 （1）子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法 （2）その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの: 移動平均法による原価法	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 同左 （2）その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左
2.金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法	2.金銭の信託の評価基準及び評価方法 同左
3.デリバティブ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 同左
4.固定資産の減価償却の方法 （1）有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。 （2）無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウエアについては、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。 （3）リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法	4.固定資産の減価償却の方法 （1）有形固定資産（リース資産を除く） 同左 （2）無形固定資産（リース資産を除く） 同左 （3）リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） 同左
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。	5.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左
6.引当金の計上基準 （1）貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 （2）賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。	6.引当金の計上基準 （1）同左 （2）同左

（3）退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。 （会計方針の変更） 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正（その3）」（企業会計基準委員会 平成20年7月31日 企業会計基準第19号）を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。	（3）退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。 ――――――
（4）役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。	（4）同左
7.リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。	7.リース取引の処理方法 同左
8.消費税等の処理方法 税抜方式によっております。	8.消費税等の処理方法 同左

追加情報

第25期　（平成22年3月31日現在）	第26期　（平成23年3月31日現在）
当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	――――――

注記事項

（貸借対照表関係）

第25期　（平成22年3月31日現在）	第26期　（平成23年3月31日現在）
※1. 固定資産の減価償却累計額 建物　471,484千円 器具備品　356,326千円 商標権　6,882千円 ソフトウエア　684,370千円 電話施設利用権　1,065千円 ※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。 流動資産　未収投資助言報酬　270,492千円 流動負債　未払費用　400,075千円	※1. 固定資産の減価償却累計額 建物　484,832千円 器具備品　499,620千円 商標権　2,428千円 ソフトウエア　809,403千円 電話施設利用権　1,145千円 ※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。 流動資産　未収投資助言報酬　266,194千円 流動負債　未払費用　291,628千円

（損益計算書関係）

第25期 （自　平成21年4月　1日 至　平成22年3月31日）	第26期 （自　平成22年4月　1日 至　平成23年3月31日）
※1. 役員報酬の限度額 取締役　年額250,000千円 監査役　年額 50,000千円 ※2. 固定資産除却損の内訳 建物　1,199千円 器具備品　15,159千円 ソフトウェア　5,267千円	※1. 役員報酬の限度額 同左 ※2. 固定資産除却損の内訳 建物　15,317千円 器具備品　3,597千円 ソフトウェア　12,503千円 ※3. 過年度損益修正益の内訳 特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。 ※4. 関係会社項目 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　331,240千円 過年度損益修正益　105,241千円

（株主資本等変動計算書関係）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22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	前事業年度末株式数（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21年6月29日定時株主総会	普通株式	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30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22年6月30日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

第26期（自平成22年4月1日 至平成23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	前事業年度末株式数（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22年6月30日定時株主総会	普通株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22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23年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成23年6月28日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

（リース取引関係）

第25期（自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期（自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引	1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引
①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額	①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

第25期

	器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	－	90,601千円
減価償却累計額相当額	75,063千円	－	75,063千円
期末残高相当額	15,538千円	－	15,538千円

第26期

	器具備品	その他	合計
取得価額相当額	46,681千円	－	46,681千円
減価償却累計額相当額	46,138千円	－	46,138千円
期末残高相当額	543千円	－	543千円

②未経過リース料期末残高相当額

	第25期 1年以内	第25期 1年超	第25期 合計	第26期 1年以内	第26期 1年超	第26期 合計
未経過リース料期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円	586千円	－	586千円

③当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

	第25期	第26期
支払リース料	24,096千円	15,998千円
減価償却費相当額	22,727千円	14,995千円
支払利息相当額	845千円	234千円

第25期	第26期
④減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	④減価償却費相当額の算定方法 同左
⑤利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。	⑤利息相当額の算定方法 同左
2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額	2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額

	1年以内	1年超	合計
第25期	1,609千円	1,475千円	3,084千円
第26期	1,475千円	－	1,475千円

（金融商品関係）

第25期　（平成22年3月31日現在）

1.　金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日　至平成22年3月31日）
(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 投資有価証券及び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であり、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・保証金であります。 デリバティブ取引は、投資有価証券及び金銭の信託に係る為替及び市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引及び株価指数先物取引等であります。 (3)金融商品に係るリスク管理体制 ①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。 ②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。 ③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。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金・預金	13,820,588	13,820,588	－
(2) 金銭の信託	399,833	399,833	－
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	1,111,335	1,111,335	－
(4) 長期差入保証金	61,485	61,485	－
資産計	15,393,243	15,393,243	－
(1) 未払法人税等	1,283,275	1,283,275	－
負債計	1,283,275	1,283,275	－
デリバティブ取引 (*)	(38,094)	(38,094)	－

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については（）で示しております。

（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。

(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。

(4) 長期差入保証金
長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、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。

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（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

①非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）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。

②関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）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。

③長期差入保証金のうち、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・保証金等（貸借対照表計上額1,125,584千円）につきましては、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ため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

（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

	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	13,819,459	―	―	―
(2) 投資有価証券 その他有価証券のうち 満期があるもの	―	―	―	―
(3) 長期差入保証金（*）	61,485	―	―	―
合計	13,880,945	―	―	―

（*）長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である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・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

（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。

第26期　（平成23年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
(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。 デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。 取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。 (2)金融商品の内容及びそのリスク 投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。 金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。 長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金であります。 金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。 (3)金融商品に係るリスク管理体制 ①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。 ②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。 ③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

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金・預金	12,220,759	12,220,759	—
(2) 金銭の信託	5,967,344	5,967,344	—
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	524,252	524,252	—
資産計	18,712,356	18,712,356	—
(1) 未払法人税等	1,706,391	1,706,391	—
負債計	1,706,391	1,706,391	—

（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

①非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）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。

②関係会社株式（貸借対照表計上額2,457,319千円）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。

③長期差入保証金のうち、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（貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、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

	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	12,220,413	－	－	－
合計	12,220,413	－	－	－

（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）

第25期　（平成22年3月31日現在）

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（貸借対照表計上額2,161,144千円）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

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの ①株式 ②債券 ③その他（投資信託）	 368,968 ― 716,414	 146,101 ― 544,802	 222,866 ― 171,611
小計	1,085,382	690,904	394,477
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの ①株式 ②債券 ③その他（投資信託）	 ― ― 25,953	 ― ― 30,000	 ― ― △4,047
小計	25,953	30,000	△4,047
合計	1,111,335	720,904	390,430

（注）非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）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

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
2,070,000	563,988	4,017

第26期　（平成23年3月31日現在）

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（貸借対照表計上額2,457,319千円）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

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの ①株式 ②債券 ③その他（投資信託）	 513,129 ― 3,400	 146,101 ― 3,000	 367,027 ― 400
小計	516,529	149,101	367,427
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの ①株式 ②債券 ③その他（投資信託）	 ― ― 7,723	 ― ― 10,000	 ― ― △2,277
小計	7,723	10,000	△2,277
合計	524,252	159,101	365,150

（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

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
719,016	162,043	4,830

（金銭の信託関係）

第25期 （平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	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	399,833	△838

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。

第26期　（平成23年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	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	5,967,344	119,701

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）

第25期　（平成22年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
（1）通貨関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 （千円）	契約額のうち 1年超（千円）	時価 （千円）	評価損益 （千円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	22,960	－	△743	△743
	香港ドル	27,416	－	△264	△264
	豪ドル	101,481	－	△1,076	△1,076
	シンガポールドル	14,547	－	△154	△154
合計		166,405	－	△2,238	△2,238

（注1）時価の算定方法
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。

（2）株式関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 （千円）	契約額のうち 1年超（千円）	時価 （千円）	評価損益 （千円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	561,971	－	△29,413	△29,413
合計		561,971	－	△29,413	△29,413

（注2）時価の算定方法
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）不動産投資信託関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等（千円）	契約額のうち1年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引	REIT指数先物取引 売建	104,418	－	△6,442	△6,442
合計		104,418	－	△6,442	△6,442

（注3）時価の算定方法

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。

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。

第26期　(平成23年3月31日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第25期　（平成22年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

		第25期 （平成22年3月31日現在）	（千円）
（1）	退職給付債務	530,305	
（2）	未認識数理計算上の差異	△41,515	
	退職給付引当金	488,790	

3. 退職給付費用に関する事項

		第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	（千円）
（1）	勤務費用	82,653	
（2）	利息費用	6,471	
（3）	数理計算上の差異の費用処理額	5,402	
（4）	確定拠出年金 拠出額	37,987	
	退職給付費用	132,513	

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

		第25期 （平成22年3月31日）
（1）	割引率（％）	1.5
（2）	退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
（3）	数理計算上の差異の処理年数（年）	5

第26期　（平成23年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

		第26期 （平成23年3月31日現在）　（千円）
(1)	退職給付債務	636,624
(2)	未認識数理計算上の差異	△57,560
	退職給付引当金	579,063

3. 退職給付費用に関する事項

		第26期 （自　平成22年4月　1日 至　平成23年3月31日）　（千円）
(1)	勤務費用	85,216
(2)	利息費用	7,954
(3)	数理計算上の差異の費用処理額	9,383
(4)	確定拠出年金　拠出額	37,218
	退職給付費用	139,773

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第26期 （平成23年3月31日）
(1)　割引率（%）	1.5
(2)　退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3)　数理計算上の差異の処理年数（年）	5

（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25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
未払事業税	108,541	128,299
未払事業所税	6,290	6,141
賞与引当金	233,054	234,157
未払法定福利費	26,912	28,823
未払確定拠出年金掛金	2,712	2,739
減価償却超過額	17,598	36,256
減価償却超過額（一括償却資産）	6,098	3,039
繰延資産償却超過額（税法上）	89,657	139,027
退職給付引当金	198,937	235,678
役員退職慰労引当金	39,211	40,806
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	66,421	763
関係会社株式評価損	－	1,556
貸倒引当金繰入額	14,840	－
繰延税金資産合計	815,851	862,867
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	28,334	57,474
繰延税金負債合計	28,334	57,474
差引繰延税金資産の純額	787,517	805,393

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

第25期については、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。

第26期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（セグメント情報等）

１．セグメント情報

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

２．関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23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	24,367,005	5,478,622	789,867	30,635,495

（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

①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。

②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。

（追加情報）

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

（関連当事者との取引）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主等

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	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円(基金償却積立金)	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名,出向3名,転籍2名	資産の運用及び助言、当社設定投信の販売	資産運用の助言の顧問料の受入 販売手数料の支払 保険料の支払	711,279 13,054 6,572	未収投資助言報酬	190,025

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）支払販売手数料は、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3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

（注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

（注5）平成22年4月1日付にて、第一生命保険相互会社は、相互会社から株式会社へ組織変更しております。
新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

(2)子会社等

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	785,924	未払費用	296,169
子会社	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	244,629	未払費用	98,673

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	7,000億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	1,434,905	未払手数料	122,995
								預金の預入（純額）	90,148	現金・預金	412,513
								受取利息	199	未収収益	-
	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	613,204	未払手数料	104,436
								預金の預入（純額）	1,133,958	現金・預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収収益	1,071
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	―	―	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	247,604	未払費用	113,245
								業務委託料の支払	48,770	未払費用	36,277
	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）	401,000	金銭の信託	399,833
								信託報酬の支払	130		

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3）業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
（注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主等

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	710,392	未収投資助言報酬	190,149

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

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	646,432	未払費用	172,736
子会社	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	224,694	未払費用	88,837
子会社	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000千円	資産の運用	(所有)直接100%	－	なし	増資の引受	300,000	－	－

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

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	7,000億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	1,538,792	未払手数料	108,444
								預金の預入（純額）	112,401	現金・預金	524,914
								受取利息	156	未収収益	-
	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	536,163	未払手数料	89,649
								預金の引出（純額）	1,524,876	現金・預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収収益	-
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	－	－	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	198,967	未払費用	94,085
								業務委託料の支払	17,740	未払費用	21,598
	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）	5,500,000	金銭の信託	5,967,344
								信託報酬の支払	3,163		

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3）業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
（注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税が含まれております。
（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

第25期 （自　平成21年4月　1日 至　平成22年3月31日）	第26期 （自　平成22年4月　1日 至　平成23年3月31日）
1株当たり純資産額　　849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額　141,719円30銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。	1株当たり純資産額　　964,903円60銭 1株当たり当期純利益金額　185,611円60銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注）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25期 （自　平成21年4月　1日 至　平成22年3月31日）	第26期 （自　平成22年4月　1日 至　平成23年3月31日）
当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

第25期 （自　平成21年4月　1日 至　平成22年3月31日）	第26期 （自　平成22年4月　1日 至　平成23年3月31日）
――――――	――――――

次へ

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第27期中間会計期間末 （平成23年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		11,268,020
金銭の信託		5,629,150
前払費用		59,568
未収委託者報酬		2,810,956
未収運用受託報酬		1,659,443
未収投資助言報酬		313,603
未収収益		243,409
繰延税金資産		375,975
その他		20,513
流動資産計		22,380,642
固定資産		
有形固定資産		381,897
建物	※1	168,959
器具備品	※1	173,255
建設仮勘定		39,682
無形固定資産		1,279,779
商標権	※1	430
ソフトウエア	※1	1,082,772
ソフトウエア仮勘定		189,016
電話加入権		7,148
電話施設利用権	※1	411
投資その他の資産		4,173,376
投資有価証券		388,843
関係会社株式		2,457,319
繰延税金資産		542,108
長期差入保証金		702,696
その他		82,408
固定資産計		5,835,053
資産合計		28,215,695

（単位：千円）

	第27期中間会計期間末 （平成23年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	45,556
未払金	1,335,271
未払収益分配金	3,223
未払償還金	95,222
未払手数料	1,089,997
その他未払金	146,827
未払費用	1,253,226
未払法人税等	1,383,356
未払消費税等	121,733
前受収益	4,659
賞与引当金	566,648
流動負債計	4,710,452
固定負債	
退職給付引当金	616,545
役員退職慰労引当金	118,905
固定負債計	735,451
負債合計	5,445,903
（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	18,252,663
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	15,630,000
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	1,999,370
株主資本計	22,681,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	88,650
評価・換算差額等計	88,650
純資産合計	22,769,792
負債・純資産合計	28,215,695

（2）中間損益計算書

（単位：千円）

	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日至平成23年9月30日）	
営業収益		
委託者報酬	12,186,600	
運用受託報酬	2,427,618	
投資助言報酬	487,590	
その他営業収益	367,965	
営業収益計		15,469,773
営業費用		
支払手数料	5,317,217	
広告宣伝費	77,160	
調査費	2,399,769	
調査費	1,478,893	
委託調査費	920,876	
委託計算費	170,060	
営業雑経費	274,550	
通信費	13,894	
印刷費	212,477	
協会費	12,507	
諸会費	19	
支払販売手数料	35,652	
営業費用計		8,238,758
一般管理費		
給料	2,023,999	
役員報酬	123,681	
給料・手当	1,900,318	
交際費	15,479	
寄付金	3,156	
旅費交通費	98,767	
租税公課	46,092	
不動産賃借料	322,850	
退職給付費用	73,794	
固定資産減価償却費	※1 228,152	
福利厚生費	15,312	
修繕費	3,575	
賞与引当金繰入	566,648	
役員退職慰労引当金繰入	26,763	
役員退職金	528	
機器リース料	828	
事務委託費	174,574	
消耗品費	28,721	
器具備品費	671	
諸経費	52,322	
一般管理費計		3,682,240
営業利益		3,548,774

（単位：千円）

	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日至平成23年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	57,123	
受取利息	2,091	
雑収入	3,855	
営業外収益計		63,070
営業外費用		
為替差損	1,209	
時効成立後支払分配金	36	
金銭の信託運用損	337,781	
雑損失	997	
営業外費用計		340,025
経常利益		3,271,819
特別利益		
ゴルフ会員権売却益	1,959	
特別利益計		1,959
特別損失		
固定資産除却損	5,729	
固定資産売却損	381	
特別損失計		6,111
税引前中間純利益		3,267,666
法人税、住民税及び事業税		1,344,597
法人税等調整額		△24,919
法人税等合計		1,319,677
中間純利益		1,947,989

(3) 中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

		第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日至平成23年9月30日）
株主資本		
	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	当期首残高	13,430,000
	当中間期変動額	2,200,000
	当中間期末残高	15,630,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	4,459,380
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	△2,208,000
	別途積立金の積立	△2,200,000
	中間純利益	1,947,989
	当中間期末残高	1,999,370
	利益剰余金合計	
	当期首残高	18,512,674
	当中間期変動額	△260,010
	当中間期末残高	18,252,663
	株主資本合計	
	当期首残高	22,941,152
	当中間期変動額	△260,010
	当中間期末残高	22,681,141
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	216,534
	当中間期変動額（純額）	△127,883
	当中間期末残高	88,650
純資産合計		

	当期首残高	23,157,686
	当中間期変動額	△387,894
	当中間期末残高	22,769,792

前へ　次へ

重要な会計方針

項目	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日 至平成23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（リース資産を除く）：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 器具備品　…　2～20年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウエアについては、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。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
5．引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異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 (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．外貨建て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．リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
８．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27期中間会計期間 （自平成23年4月1日　至平成23年9月30日）
当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号　平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計適用指針第24号　平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第27期中間会計期間末 （平成23年9月30日現在）
※１．固定資産の減価償却累計額	建物 … 499,974千円 器具備品 … 531,842千円 商標権 … 2,508千円 ソフトウエア … 798,730千円 電話施設利用権 … 1,185千円

（中間損益計算書関係）

項目	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
※１．減価償却実施額	有形固定資産 … 64,964千円 無形固定資産 … 163,188千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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23年6月28日定時株主総会	普通株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

（リース取引関係）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
１．ファイナンス・リース取引 (1)所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの） ①リース資産の内容 該当事項はありません。 ②リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「４．固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。 (2)所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの） ①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額 該当事項はありません。 ②未経過リース料中間期末残高相当額 該当事項はありません。 ③当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 支払リース料　588千円 減価償却費相当額　543千円 支払利息相当額　1千円 ④減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。 ⑤利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。 ２．オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料中間期末残高相当額 1年以内　670千円　／　1 年 超　－　／　合　計　670千円

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成23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	11,268,020	11,268,020	－
(2) 金銭の信託	5,629,150	5,629,150	－
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	308,597	308,597	－
資産計	17,205,769	17,205,769	－
(1) 未払法人税等	1,383,356	1,383,356	－
負債計	1,383,356	1,383,356	－

（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

①非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）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。

②関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,457,319千円）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。

③長期差入保証金のうち、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（中間貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、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ため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成23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2,457,319千円）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			
①株式	298,359	146,101	152,257
②債券	－	－	－
③その他（投資信託）	3,118	3,000	118
小計	301,478	149,101	152,376
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	－	－	－
②債券	－	－	－
③その他（投資信託）	7,119	10,000	△2,881
小計	7,119	10,000	△2,881
合計	308,597	159,101	149,495

（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27期中間会計期間末（平成23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 該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日　至平成23年9月30日）

１．セグメント情報

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

２．関連情報

（１）サービスごとの情報

	投資信託（千円）	投資顧問（千円）	その他（千円）	合計（千円）
営業収益	12,186,600	2,915,208	367,965	15,469,773

（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

①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。

②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。

（持分法損益等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日　至平成23年9月30日）
該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日　至平成23年9月30日）
1株当たり純資産額　948,741円　34銭 1株当たり中間純利益金額　81,166円　22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27期中間会計期間 （自平成23年4月1日　至平成23年9月30日）
中間純利益	1,947,989千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,947,989千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日　至平成23年9月30日）
該当事項はありません。

前へ

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

(2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

(3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記(3) (4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。

・株券不発行に伴う対応および役付取締役（取締役会長職）追加に伴う変更

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

みずほ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

平成23年3月末日現在　247,303百万円

ｃ．事業の内容

日本において信託銀行業務を営んでいます。

（２）販売会社

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

（平成23年3月末日現在）

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社七十七銀行(※1)	24,658	日本において銀行業務を営んでおります。

株式会社ＳＢＩ証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

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

（３）投資顧問会社
ａ．名称
デービス・セレクテド・アドバイザーズ
ｂ．資本金の額
2011年12月末日現在　520,471,836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
2011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
2011年12月末日現在　400万ポンド
ｃ．事業の内容
イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

（６）投資顧問会社
ａ．名称
DIAM U.S.A.,Inc.
ｂ．資本金の額
2011年12月末日現在　400万米ドル
ｃ．事業の内容
米国において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。
(1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
(2) 信託財産の計算
(3) 信託財産に関する報告書の作成
(4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。
(1) 募集の取扱いおよび販売

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

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

その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【参考情報】

当ファンドについては、当特定期間の間に、次の書類を提出いたしました。

書類名	提出年月日
臨時報告書	平成23年9月15日、平成23年12月15日
有価証券届出書の訂正届出書	平成24年1月27日
有価証券報告書	平成23年11月8日
有価証券届出書	平成23年11月8日

独立監査人の監査報告書

平成２４年３月２１日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取 締 役 会　御 中

あらた監査法人

指 定 社 員 業務執行社員	公認会計士	柴　毅　印
指 定 社 員 業務執行社員	公認会計士	和 田　涉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭインカム３資産ファンド（毎月決算型）の平成２３年８月９日から平成２４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、ＤＩＡＭインカム３資産ファンド（毎月決算型）の平成２４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
ＤＩＡＭ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。

※ 財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

委託会社の監査報告書(当期)へ

独立監査人の監査報告書

平成２３年６月１０日

ＤＩＡＭ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	浅野　功	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘	印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２２年４月１日から平成２３年３月３１日までの第２６期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２３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。

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

委託会社の監査報告書(中間)へ

独立監査人の中間監査報告書

平成２３年１２月９日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	浅野　功 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘 印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２３年４月１日から平成２４年３月３１日までの第２７期事業年度の中間会計期間（平成２３年４月１日から平成２３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、ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２３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２３年４月１日から平成２３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）上記は、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

委託会社の監査報告書(当期)へ

独立監査人の監査報告書

平成２２年6月３０日

ＤＩＡＭ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	浅野　功	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘	印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２１年４月１日から平成２２年３月３１日までの第２５期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２２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。

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