

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成28年7月11日
<b>【発行者名】</b>	D I A Mアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 西 惠正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	上野 圭子
<b>【電話番号】</b>	03-3287-3110
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】</b>	D I A M高金利通貨ファンド
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】</b>	1,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

有価証券報告書の提出に伴い、平成28年1月13日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

## 2【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第一部【証券情報】

## (4)【発行(売出)価格】

<訂正前>

(略)

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

<訂正後>

(略)

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。  
(当ファンドの略称：通貨セレクシ)

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成27年10月30日現在）

(略)

大株主の状況

(平成27年10月30日現在)

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

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成28年4月28日現在）

(略)

大株主の状況

(平成28年4月28日現在)

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

## 2【投資方針】

### (2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

ファンド名	D I A Mマルチカレンシーファンド ( J P Y )クラスF
(略)	
投資態度	(略) 平成27年11月末時点の投資対象国通貨は下記の通りです。当ファンドが今後も下記の通貨に投資するとは限りません。 (略)
(略)	

(略)

<訂正後>

(略)

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

ファンド名	D I A Mマルチカレンシーファンド ( J P Y )クラスF
(略)	
投資態度	(略) 平成28年4月末時点の投資対象国通貨は下記の通りです。当ファンドが今後も下記の通貨に投資するとは限りません。 (略)
(略)	

(略)

**( 3 ) 【運用体制】**

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

上記体制は平成27年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

&lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

上記体制は平成28年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

**3 【投資リスク】**

&lt; 運用評価・運用リスク管理体制 &gt;

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

上記体制は平成27年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

&lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

上記体制は平成28年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

&lt; 更新・訂正後 &gt;

## （参考情報）

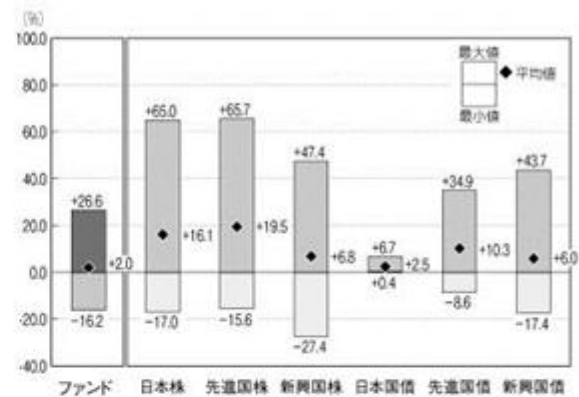
### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



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

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

### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



2011年5月～2016年4月

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

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

#### \*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (4)【その他の手数料等】

<訂正前>

(略)

##### 2. その他の費用

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

(略)

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。

<訂正後>

(略)

##### 2. その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

(略)

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。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

##### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

(略)

<訂正後>

(略)

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

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

(略)



## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	647,052,126	96.57
内 ルクセンブルグ	647,052,126	96.57
親投資信託受益証券	12,535,794	1.87
内 日本	12,535,794	1.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,461,302	1.56
純資産総額	670,049,222	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	332,391,057,900	82.62
内 日本	332,391,057,900	82.62
地方債証券	25,375,874,270	6.31
内 日本	25,375,874,270	6.31
特殊債券	22,149,993,139	5.51
内 日本	22,149,993,139	5.51
社債券	19,901,514,800	4.95
内 日本	19,601,163,800	4.87
内 オランダ	200,838,000	0.05
内 イギリス	99,513,000	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,475,654,026	0.62
純資産総額	402,294,094,135	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	D I A Mマルチカレンシー ファンド( J P Y )クラスF ルクセンブルグ	投資信託受益 証券	177,226	3,494.22 619,267,510	3,651.00 647,052,126	- -	96.57%
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	9,608,918	1.3029 12,520,420	1.3046 12,535,794	- -	1.87%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	96.57%
親投資信託受益証券	1.87%
合計	98.44%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	1 2 4 回 利付国庫債券( 5 年) 日本	国債証券	5,000,000,000	101.02 5,051,250,000	101.28 5,064,450,000	0.100000 2020/6/20	1.26%
2	1 2 2 回 利付国庫債券( 5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	101.18 4,553,415,000	0.100000 2019/12/20	1.13%
3	1 0 6 回 利付国庫債券( 5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.54 4,524,705,000	100.62 4,528,215,000	0.200000 2017/9/20	1.13%
4	1 0 5 回 利付国庫債券( 5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.46 4,520,790,000	100.50 4,522,770,000	0.200000 2017/6/20	1.12%
5	1 1 6 回 利付国庫債券( 5 年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	101.17 4,249,350,000	0.200000 2018/12/20	1.06%
6	3 4 0 回 利付国庫債券( 1 0年) 日本	国債証券	4,000,000,000	103.35 4,134,275,000	104.78 4,191,240,000	0.400000 2025/9/20	1.04%

7	341回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	4,000,000,000	103.40 4,136,380,000	103.83 4,153,440,000	0.300000 2025/12/20	1.03%
8	125回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	4,000,000,000	101.06 4,042,440,000	101.34 4,053,840,000	0.100000 2020/9/20	1.01%
9	117回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	4,000,000,000	101.10 4,044,000,000	101.27 4,050,880,000	0.200000 2019/3/20	1.01%
10	339回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,500,000,000	103.50 3,622,835,000	104.74 3,666,180,000	0.400000 2025/6/20	0.91%
11	118回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,650,000	101.36 3,547,880,000	0.200000 2019/6/20	0.88%
12	114回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	101.31 3,545,990,000	0.300000 2018/9/20	0.88%
13	123回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,500,000,000	101.00 3,535,210,000	101.22 3,543,015,000	0.100000 2020/3/20	0.88%
14	107回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,300,000,000	100.64 3,321,285,000	100.74 3,324,486,000	0.200000 2017/12/20	0.83%
15	289回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,200,000,000	103.03 3,297,024,000	102.86 3,291,616,000	1.500000 2017/12/20	0.82%
16	126回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,200,000,000	101.37 3,244,044,000	101.42 3,245,568,000	0.100000 2020/12/20	0.81%
17	313回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	107.37 3,221,340,000	1.300000 2021/3/20	0.80%
18	325回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,000,000,000	106.20 3,186,010,000	106.42 3,192,690,000	0.800000 2022/9/20	0.79%
19	296回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,000,000,000	104.30 3,129,060,000	104.16 3,125,070,000	1.500000 2018/9/20	0.78%
20	301回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	105.44 3,057,818,000	1.500000 2019/6/20	0.76%
21	355回 利付国庫債券(2年)	日本	国債証券	3,000,000,000	100.36 3,010,950,000	100.46 3,014,010,000	0.100000 2017/8/15	0.75%
22	334回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,800,000,000	105.26 2,947,420,000	106.21 2,973,908,000	0.600000 2024/6/20	0.74%
23	310回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	105.32 2,948,960,000	1.000000 2020/9/20	0.73%

24	330回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.81 2,670,325,000	107.32 2,683,125,000	0.800000 2023/9/20	0.67%
25	321回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.86 2,671,625,000	107.16 2,679,025,000	1.000000 2022/3/20	0.67%
26	286回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,600,000,000	102.59 2,667,548,000	102.32 2,660,320,000	1.800000 2017/6/20	0.66%
27	306回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.34 2,658,700,000	106.30 2,657,600,000	1.400000 2020/3/20	0.66%
28	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	105.55 2,638,825,000	1.300000 2019/12/20	0.66%
29	143回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	2,100,000,000	116.03 2,436,735,000	123.85 2,601,039,000	1.600000 2033/3/20	0.65%
30	149回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	2,100,000,000	113.46 2,382,670,000	122.84 2,579,703,000	1.500000 2034/6/20	0.64%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
国債証券	82.62%
地方債証券	6.31%
特殊債券	5.51%
社債券	4.95%
合計	99.38%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（平成28年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成20年4月11日)	2,272	2,289	0.8908	0.8973
第2特定期間末 (平成20年10月14日)	7,314	7,391	0.6719	0.6789
第3特定期間末 (平成21年4月13日)	10,112	10,221	0.6509	0.6579
第4特定期間末 (平成21年10月13日)	9,607	9,682	0.6435	0.6485
第5特定期間末 (平成22年4月12日)	7,776	7,836	0.6506	0.6556
第6特定期間末 (平成22年10月12日)	5,408	5,456	0.5713	0.5763
第7特定期間末 (平成23年4月11日)	4,501	4,539	0.5893	0.5943
第8特定期間末 (平成23年10月11日)	2,692	2,721	0.4531	0.4581
第9特定期間末 (平成24年4月11日)	2,324	2,349	0.4665	0.4715
第10特定期間末 (平成24年10月11日)	1,908	1,926	0.4171	0.4211
第11特定期間末 (平成25年4月11日)	1,598	1,607	0.5137	0.5167
第12特定期間末 (平成25年10月11日)	1,273	1,282	0.4505	0.4535
第13特定期間末 (平成26年4月11日)	1,114	1,121	0.4564	0.4594
第14特定期間末 (平成26年10月14日)	993	999	0.4435	0.4465
第15特定期間末 (平成27年4月13日)	906	912	0.4297	0.4327
第16特定期間末 (平成27年10月13日)	777	783	0.3897	0.3927
第17特定期間末 (平成28年4月11日)	643	645	0.3409	0.3424
平成27年4月末日	901	-	0.4319	-
5月末日	908	-	0.4383	-
6月末日	886	-	0.4309	-
7月末日	851	-	0.4184	-
8月末日	785	-	0.3933	-
9月末日	754	-	0.3763	-
10月末日	762	-	0.3838	-

11月末日	762	-	0.3882	-
12月末日	722	-	0.3767	-
平成28年1月末日	687	-	0.3596	-
2月末日	656	-	0.3454	-
3月末日	673	-	0.3569	-
4月末日	670	-	0.3555	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0065
第2特定期間	0.0400
第3特定期間	0.0420
第4特定期間	0.0340
第5特定期間	0.0300
第6特定期間	0.0300
第7特定期間	0.0300
第8特定期間	0.0300
第9特定期間	0.0300
第10特定期間	0.0250
第11特定期間	0.0190
第12特定期間	0.0180
第13特定期間	0.0180
第14特定期間	0.0180
第15特定期間	0.0180
第16特定期間	0.0180
第17特定期間	0.0090

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	10.3
第2特定期間	20.1
第3特定期間	3.1
第4特定期間	4.1
第5特定期間	5.8
第6特定期間	7.6
第7特定期間	8.4
第8特定期間	18.0
第9特定期間	9.6
第10特定期間	5.2
第11特定期間	27.7
第12特定期間	8.8
第13特定期間	5.3
第14特定期間	1.1
第15特定期間	0.9
第16特定期間	5.1
第17特定期間	10.2

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	2,629,095,816	77,789,024
第2特定期間	8,761,546,516	425,819,093
第3特定期間	5,135,772,292	487,302,676
第4特定期間	2,011,880,844	2,615,718,875
第5特定期間	488,429,094	3,466,642,018
第6特定期間	260,391,356	2,745,913,430
第7特定期間	175,633,748	2,004,268,227
第8特定期間	205,094,655	1,902,609,557
第9特定期間	138,510,945	1,096,271,038
第10特定期間	163,594,414	572,568,481
第11特定期間	116,557,648	1,579,935,616
第12特定期間	84,670,838	368,107,788
第13特定期間	68,672,226	456,022,333
第14特定期間	61,234,079	262,586,711
第15特定期間	83,807,714	214,168,692
第16特定期間	52,824,821	166,808,238
第17特定期間	37,624,559	146,088,606

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

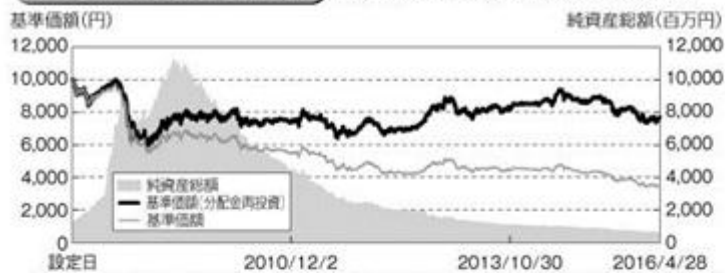
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。



## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2016年4月28日

## 基準価額・純資産の推移 (設定日(2007年12月27日)～2016年4月28日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日：2007年12月27日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第96期	(2015.12.11)	15円
第97期	(2016.01.12)	15円
第98期	(2016.02.12)	15円
第99期	(2016.03.11)	15円
第100期	(2016.04.11)	15円
直近1年間累計		270円
設定来累計		4,155円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 (注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	投資比率
1	DIAMマルチカレンシーファンド(JPY)クラスF	投資信託受益証券	ルクセンブルグ	96.57%
2	国内債券バッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1.87%

■DIAMマルチカレンシーファンド(JPY)の内容 ※DIAM International Ltdの現地月末データを基に作成しています。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	通貨	クーポン(%)	償還日	投資比率(%)
1	地方公共団体金融機構	日本円	2.000%	2016/5/9	27.41%
2	オーストラリア国債	オーストラリアドル	4.750%	2016/6/15	11.93%
3	国際復興開発銀行	米ドル	1.000%	2016/9/15	8.55%
4	オランダ自治体金融公庫	日本円	1.850%	2016/11/7	8.13%
5	フランス相互信用連合銀行	英ポンド	0.630%	2016/8/5	7.47%
6	欧州投資銀行	米ドル	2.125%	2016/7/15	6.88%
7	アジア開発銀行	米ドル	0.500%	2016/6/20	6.83%

※投資比率はDIAMマルチカレンシーファンド(JPY)の純資産総額に対する割合です。

## 投資対象通貨別配分

ルーマニア・レイ	3.1%
英ポンド	7.5%
トルコ・リラ	10.7%
南アフリカ・ランド	10.3%
ブラジル・リアル	11.3%
メキシコ・ペソ	8.9%
インド・ルピー	10.1%
オーストラリア・ドル	11.9%
米ドル	22.3%
日本円	4.0%

※比率はDIAMマルチカレンシーファンド(JPY)の純資産総額に対する割合です。

※通貨別配分は為替予約取引等を含めた実質的な比率です。

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	82.62
内 日本	82.62
地方債証券	6.31
内 日本	6.31
特殊債券	5.51
内 日本	5.51
社債券	4.95
内 日本	4.87
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.62
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.26%
2	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.13%
3	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.13%
4	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.12%
5	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.06%
6	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	1.04%
7	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	1.03%
8	125回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/20	1.01%
9	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.01%
10	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/6/20	0.91%

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2007年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年10月14日から平成28年4月11日まで）の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## D I A M高金利通貨ファンド

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成27年10月13日現在	当 期 平成28年4月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	16,786,498
コール・ローン	22,430,451	-
投資信託受益証券	750,165,668	617,267,510
親投資信託受益証券	11,892,957	12,520,420
流動資産合計	784,489,076	646,574,428
資産合計	784,489,076	646,574,428
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	5,985,555	2,830,081
未払解約金	434,389	99,999
未払受託者報酬	28,955	24,432
未払委託者報酬	550,292	464,309
その他未払費用	3,423	2,831
流動負債合計	7,002,614	3,421,652
負債合計	7,002,614	3,421,652
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,995,185,209	1,886,721,162
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 1,217,698,747	2 1,243,568,386
(分配準備積立金)	-	1,596,161
元本等合計	777,486,462	643,152,776
純資産合計	777,486,462	643,152,776
負債純資産合計	784,489,076	646,574,428

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	前 期 自 平成27年4月14日 至 平成27年10月13日	当 期 自 平成27年10月14日 至 平成28年4月11日
営業収益		
受取配当金	34,596,120	21,718,020
受取利息	4,175	2,814
有価証券売買等損益	74,959,244	95,156,795
営業収益合計	40,358,949	73,435,961
営業費用		
受託者報酬	184,268	152,261
委託者報酬	3,501,842	2,893,554
その他費用	21,806	17,942
営業費用合計	3,707,916	3,063,757
営業利益又は営業損失（ ）	44,066,865	76,499,718
経常利益又は経常損失（ ）	44,066,865	76,499,718
当期純利益又は当期純損失（ ）	44,066,865	76,499,718
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	325,450	425,777
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,202,916,694	1,217,698,747
剰余金増加額又は欠損金減少額	96,507,815	91,187,995
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	96,507,815	91,187,995
剰余金減少額又は欠損金増加額	30,839,985	23,663,824
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	30,839,985	23,663,824
分配金	1 36,708,468	1 17,319,869
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,217,698,747	1,243,568,386

## ( 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	<p>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、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。</p> <p>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。</p>
2 . 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日の取扱い</p> <p>当ファンドは、原則として毎年4月11日及び10月11日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を平成27年10月13日としております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	前 期 平成27年10月13日現在	当 期 平成28年4月11日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2,109,168,626円 52,824,821円 166,808,238円	1,995,185,209円 37,624,559円 146,088,606円
2 . 受益権の総数	1,995,185,209口	1,886,721,162口
3 . 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,217,698,747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1,243,568,386円であります。

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	前 期 自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日	当 期 自 平成27年10月14日 至 平成28年 4月11日

<p>1 . 1 分配金の計算過程</p> <p>（自平成27年4月14日 至平成27年5月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,342,145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（39,077,092円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は44,419,237円（1万口当たり212.81円）であり、うち6,261,743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。）</p> <p>（自平成27年5月12日 至平成27年6月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,531,140円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（37,765,022円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は43,296,162円（1万口当たり209.60円）であり、うち6,197,001円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成27年6月12日 至平成27年7月13日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,168,783円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（36,938,235円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は42,107,018円（1万口当たり204.74円）であり、うち6,169,950円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成27年10月14日 至平成27年11月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,220,209円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（32,284,188円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は35,504,397円（1万口当たり178.86円）であり、うち2,977,502円（1万口当たり15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。）</p> <p>（自平成27年11月12日 至平成27年12月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,122,328円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（31,789,764円）及び分配準備積立金（238,386円）より分配対象収益は35,150,478円（1万口当たり179.84円）であり、うち2,931,791円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成27年12月12日 至平成28年1月12日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,034,137円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（31,116,667円）及び分配準備積立金（418,707円）より分配対象収益は34,569,511円（1万口当たり180.71円）であり、うち2,869,547円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成27年10月14日 至平成27年11月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,220,209円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（32,284,188円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は35,504,397円（1万口当たり178.86円）であり、うち2,977,502円（1万口当たり15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。）</p> <p>（自平成27年11月12日 至平成27年12月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,122,328円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（31,789,764円）及び分配準備積立金（238,386円）より分配対象収益は35,150,478円（1万口当たり179.84円）であり、うち2,931,791円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成27年12月12日 至平成28年1月12日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,034,137円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（31,116,667円）及び分配準備積立金（418,707円）より分配対象収益は34,569,511円（1万口当たり180.71円）であり、うち2,869,547円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>
--	---	---

<p>（自平成27年7月14日 至平成27年8月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,126,752円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（35,522,506円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は40,649,258円（1万口当たり199.96円）であり、うち6,098,583円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成28年1月13日 至平成28年2月12日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,089,682円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（31,083,339円）及び分配準備積立金（580,093円）より分配対象収益は34,753,114円（1万口当たり181.88円）であり、うち2,866,112円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成27年8月12日 至平成27年9月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,067,091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（33,972,822円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は39,039,913円（1万口当たり195.34円）であり、うち5,995,636円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成28年2月13日 至平成28年3月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,405,914円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（30,855,437円）及び分配準備積立金（795,554円）より分配対象収益は35,056,905円（1万口当たり184.84円）であり、うち2,844,836円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成27年9月12日 至平成27年10月13日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,444,268円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（32,989,967円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は38,434,235円（1万口当たり192.63円）であり、うち5,985,555円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成28年3月12日 至平成28年4月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,080,632円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（30,699,938円）及び分配準備積立金（1,345,610円）より分配対象収益は35,126,180円（1万口当たり186.18円）であり、うち2,830,081円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	前 期 自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日	当 期 自 平成27年10月14日 至 平成28年 4月11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投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成27年10月13日現在	当 期 平成28年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前 期 平成27年10月13日現在	当 期 平成28年4月11日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	11,363,324	26,481,128
親投資信託受益証券	44,201	200,827
合計	11,407,525	26,280,301

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前 期 平成27年10月13日現在	当 期 平成28年4月11日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.3897円 (3,897円)

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

## ( 1 ) 株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

平成28年4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	D I A Mマルチカレンシーファンド( J P Y )クラスF	176,665	617,267,510	
投資信託受益証券	合計	176,665	617,267,510	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,608,918	12,520,420	
親投資信託受益証券	合計	9,608,918	12,520,420	
合計		9,785,583	629,787,930	

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

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「D I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスF」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」及び「投資信託受益証券」は、すべてこれらの受益証券であります。

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		-	3,756,083,368
コール・ローン		2,224,478,564	-
国債証券		317,928,930,800	329,136,399,100
地方債証券		26,783,612,286	25,587,051,778
特殊債券		23,721,372,706	22,513,454,636
社債券		20,909,216,540	20,225,236,220
未収利息		794,409,192	719,893,333
前払費用		9,719,715	15,431,464
流動資産合計		392,371,739,803	401,953,549,899
資産合計		392,371,739,803	401,953,549,899
負債の部			
流動負債			
未払解約金		210,279,000	309,803,000
流動負債合計		210,279,000	309,803,000
負債合計		210,279,000	309,803,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	316,855,478,878	308,243,052,850
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		75,305,981,925	93,400,694,049
元本等合計		392,161,460,803	401,643,746,899
純資産合計		392,161,460,803	401,643,746,899
負債純資産合計		392,371,739,803	401,953,549,899

## 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、地方債証券、特殊債券及び社債券 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。
--------------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	351,120,330,661円	316,855,478,878円
同期中追加設定元本額	29,558,579,774円	53,785,582,072円
同期中一部解約元本額	63,823,431,557円	62,398,008,100円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	10,610,110,772円	10,189,723,711円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	177,424,282円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	129,810,216円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	52,465,611円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	407,909,092円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	107,590,970円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	19,551,322円
たわらノーロード 国内債券	- 円	499,029,979円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	11,183,879,620円	11,809,576,538円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	4,560,763,857円	4,411,073,872円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	6,939,063,876円	6,480,491,204円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,800,386,834円	2,615,279,280円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,703,049,604円	1,653,291,162円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,857,722,753円	1,806,678,912円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	285,255,001円	268,626,805円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	122,199,952円	107,576,268円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,386,777,943円	2,209,086,423円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,346,875円	5,452,881円

D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	226,593,600円	231,432,354円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	159,689,036円	174,623,598円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	43,621,584円	44,208,206円
投資のソムリエ	7,603,993,960円	6,344,706,145円
クルーズコントロール	395,203,752円	604,204,415円
投資のソムリエ<DC年金>	125,186,249円	125,649,262円
D I A M 8資産バランスファンドN< DC年金>	583,823,917円	767,551,057円
D I A M D C バランス・F(成長 型)	27,996,987円	56,353,219円
クルーズコントロール<DC年金>	126,052円	151,948円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実 型)	5,523,880円	1,989,847円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極 型)	13,004,249円	3,480,335円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制 型	- 円	20,893,399円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	1,931,127円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券パッシブファンド(適 格機関投資家向け)	12,016,292,940円	31,096,487,907円
D I A Mアクティブアロケーション私募 ファンド(適格機関投資家限定)	1,279,005,279円	1,137,777,976円
D I A Mワールドバランス25VA(適 格機関投資家限定)	642,627,808円	594,706,063円
D I A Mグローバル・バランスファンド 25VA(適格機関投資家限定)	1,837,672,697円	586,764,909円
D I A Mグローバル・バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	333,370,299円	293,906,868円
D I A M国際分散バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	177,639,936円	145,321,307円
D I A M国際分散バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	467,309,828円	361,970,931円
D I A M国内重視バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	194,420,100円	148,960,776円
D I A M国内重視バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	151,181,830円	120,207,345円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	16,332,125,844円	10,701,542,796円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	6,187,740,575円	4,159,400,477円
D I A Mバランスファンド25VA(適 格機関投資家限定)	10,375,754,139円	8,198,032,403円

D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	4,155,493,213円	3,748,904,424円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,170,742,145円	6,487,138,553円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	840,840,673円	777,766,005円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	3,756,926,921円	3,349,309,389円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,189,873,187円	4,700,107,293円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	7,219,477,959円	6,328,177,230円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	884,082,241円	839,267,900円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	7,050,158,468円	6,492,607,467円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	7,564,188,784円	6,792,117,861円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	18,960,024円	- 円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	95,547,128,459円	89,389,465,051円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,399,541,344円	1,263,312,175円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	8,283,528,234円	7,678,814,912円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	30,413,681,432円	28,270,093,182円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	486,613円	479,010円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	69,332,819円	64,892,567円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	10,688,870円	9,650,616円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	34,126,849,735円	31,761,944,157円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	645,177,103円	582,247,446円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	166,391,543円	156,781,930円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	427,964,083円	451,004,519円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	248,307,734円	195,890,787円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	334,827円	326,339円
計	316,855,478,878円	308,243,052,850円

2 . 受益権の総数	316,855,478,878口	308,243,052,850口
------------	------------------	------------------



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年 4月11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、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	4,129,823,600	11,866,127,200
地方債証券	19,735,673	16,907,361
特殊債証券	48,505,831	430,784
社債証券	88,889,040	35,623,290
合計	3,972,693,056	11,918,227,067

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年2月17日から平成27年10月13日まで及び平成28年2月16日から平成28年4月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年10月13日現在	平成28年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.2377円	1.3030円
（1万口当たり純資産額）	（12,377円）	（13,030円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成28年4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 5 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,007,860,000	
	3 5 4 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,506,315,000	
	3 5 5 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,013,500,000	
	3 5 6 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,009,720,000	
	3 5 8 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,508,145,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,523,265,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,528,575,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	3,300,000,000	3,324,882,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,013,600,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,021,380,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,521,420,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,024,180,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,547,215,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,251,702,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,053,800,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,550,015,000	
	1 2 0 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,522,875,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,517,670,000	
	1 2 2 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,556,925,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,546,550,000	
	1 2 4 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,069,700,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,059,160,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,250,016,000	
	1 2 7 回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,016,460,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	925,050,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	1,087,842,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,254,832,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,209,752,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	1,041,236,000	
	7 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,140,656,000	
	8 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,327,930,000	
	2 8 6 回 利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,662,920,000	
	2 8 8 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,542,000,000	
	2 8 9 回 利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,294,624,000	
	2 9 0 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,031,960,000	
	2 9 3 回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,298,890,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,129,540,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,402,672,000	
	2 9 9 回 利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,673,296,000	
	3 0 1 回 利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,062,487,000	

303回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,373,905,000	
305回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,643,225,000	
306回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,662,300,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,384,071,000	
309回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,056,210,000	
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,954,420,000	
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,348,522,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,227,460,000	
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,612,155,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,072,950,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,814,648,000	
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,614,495,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,070,570,000	
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,684,175,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,128,600,000	
325回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,667,400,000	
326回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,806,148,000	
328回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,114,720,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,072,910,000	
330回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,687,750,000	
332回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,122,420,000	
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,124,700,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,978,976,000	
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,112,900,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,585,815,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,351,493,000	
338回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,622,125,000	
339回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,670,730,000	
340回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,196,560,000	
341回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,678,335,000	
342回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,019,040,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	137,166,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	132,614,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,196,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	282,034,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,068,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	270,474,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	402,987,000	
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	380,223,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	502,192,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	397,722,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	393,255,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	691,640,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	280,720,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	563,096,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	278,260,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,127,975,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	275,566,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	425,127,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	691,035,000	

22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	668,889,900
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	855,312,000
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	428,751,000
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	835,368,000
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	990,521,000
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,298,826,000
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,161,008,000
29回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,582,306,000
30回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,424,570,000
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,268,901,000
32回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	2,016,252,000
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,790,958,000
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,716,984,000
35回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	2,085,420,000
36回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,956,192,000
37回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,932,126,000
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,360,240,000
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,110,576,000
40回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,364,700,000
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,072,608,000
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,341,810,000
43回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,344,620,000
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,077,936,000
45回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,037,136,000
46回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,815,842,000
47回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,856,036,000
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,398,914,000
49回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,273,810,000
50回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	442,772,000
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	628,878,000
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	422,116,000
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	764,848,800
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	867,136,000
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	953,284,200
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	993,573,000
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	550,955,000
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,053,103,500
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	564,450,000
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	862,360,200
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	670,092,000
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	620,438,500
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	797,566,000
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	918,167,400
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,279,838,000
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	682,848,000
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,098,484,200
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	868,112,000
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,394,783,000
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	694,614,000
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,278,354,000

67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,217,205,000
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,516,062,500
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,491,000,000
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,414,576,800
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,682,198,000
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,722,063,500
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,681,722,000
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,701,294,000
85回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,706,474,000
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,492,536,000
90回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,734,166,000
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,602,900,000
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	858,711,000
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	990,184,000
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,517,220,000
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,760,346,000
99回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,500,660,000
100回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,899,495,000
102回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,201,211,000
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,640,587,000
107回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,771,882,000
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,990,624,000
111回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,058,720,000
113回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,170,985,000
114回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,178,210,000
116回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,338,758,000
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,274,680,000
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,121,859,000
121回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,400,422,000
123回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,460,728,000
125回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,363,148,000
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	889,812,000
129回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,130,562,000
130回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,139,382,000
132回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,992,320,000
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,136,403,000
135回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,247,030,000
137回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,123,096,000
140回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,376,254,000
141回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,379,446,000
143回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,598,582,000
145回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,010,448,000
146回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,012,880,000
147回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,360,465,000
148回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,082,619,000
149回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,574,537,000
150回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,416,040,000
151回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,343,400,000
152回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,757,610,000
153回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,499,105,000

	154回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,109,168,000	
	155回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,266,560,000	
	156回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	507,970,000	
国債証券 合計		288,320,000,000	329,136,399,100	
地方債証券	659回 東京都公募公債	203,500,000	210,657,095	
	667回 東京都公募公債	300,000,000	313,755,000	
	680回 東京都公募公債	200,000,000	210,778,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	523,120,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	208,112,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	528,095,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	736,463,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	526,895,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	317,628,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	420,684,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	248,204,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	210,250,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	211,268,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	313,671,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	314,835,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	312,003,000	
	307回 大阪府公募公債	100,000,000	102,688,000	
	310回 大阪府公募公債	240,000,000	246,573,600	
	319回 大阪府公募公債	200,000,000	208,204,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	210,706,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	315,783,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	210,904,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	313,290,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	318,555,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	362,271,000	
	19年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,746,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	206,530,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	325,215,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	206,107,310	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	208,850,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	211,160,000	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	103,893,000	
	22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	209,728,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	530,700,000	
	25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	317,100,000	
	22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	211,088,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	460,504,000	
	23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	211,752,000	
	26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	418,036,000	
	21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	210,366,000	
	25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	210,026,000	
	21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	209,496,000	
	24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	313,932,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	211,528,000		
55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,566,000		
57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,474,000		



65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,790,000		
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	738,269,000		
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	528,565,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	741,090,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,029,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	530,320,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	737,037,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	525,865,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,160,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	838,413,973		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,265,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,893,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,305,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	520,805,000		
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,470,000		
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	414,440,000		
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	417,376,000		
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	522,280,000		
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	138,291,300		
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	470,767,500		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	209,994,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	211,318,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	474,687,000		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	423,624,000		
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	308,343,000		
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	210,598,000		
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	106,640,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	209,880,000		
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	213,346,000		
地方債証券 合計		24,359,400,000	25,587,051,778		
特殊債券	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,540,000	
	25回	高速道路機構債	300,000,000	307,821,000	
	48回	高速道路機構債	700,000,000	734,972,000	
	96回	高速道路機構債	700,000,000	734,237,000	
	116回	高速道路機構債	100,000,000	104,828,000	
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,362,000	
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	335,007,000	
	36回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	351,770,960	
	40回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	339,725,160	
	47回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,102,000	
	54回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,540,000	
	56回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,628,000	

6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	735,046,690	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	167,951,880	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	417,292,630	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	622,566,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	729,694,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,787,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,431,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	421,836,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,047,550,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	518,065,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	530,685,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	351,189,300	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	519,025,000	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	513,305,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	681,232,440	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,037,880	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	524,280,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,613,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,275,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,594,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,049,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,096,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,990,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	421,900,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	531,900,000	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,110,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	207,896,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,586,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	314,193,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	63,798,000	68,843,783	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	44,652,000	48,108,064	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	65,883,000	71,045,591	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	71,268,000	77,347,160	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	31,093,000	32,686,516	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	159,390,000	166,417,505	

	4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,243,000	43,635,329	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,675,000	30,132,540	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	103,032,000	112,058,633	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,259,000	87,074,594	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,315,000	146,267,358	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,990,000	256,835,542	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	463,440,000	497,104,281	
	7 5 5 号 利付商工債	260,000,000	261,541,800	
	い第 7 6 9 号 利付商工債	200,000,000	201,410,000	
	い第 7 7 9 号 利付商工債	200,000,000	201,412,000	
	7 5 3 号 利附農林債	300,000,000	301,269,000	
	7 6 0 号 利附農林債	300,000,000	302,841,000	
	7 6 4 号 利附農林債	500,000,000	504,530,000	
	2 7 5 回 利附信金中金債	400,000,000	401,780,000	
	2 8 2 回 利附信金中金債	300,000,000	301,845,000	
	2 9 3 回 利附信金中金債	400,000,000	402,732,000	
	3 0 2 回 利附信金中金債	300,000,000	301,818,000	
	1 8 6 号 利附商工債(3年)	200,000,000	200,688,000	
	2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	310,695,000	
	5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	209,066,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	527,560,000	
特殊債券 合計		21,613,038,000	22,513,454,636	
社債券	1 回 スタンダード・チャータード円貨社債	100,000,000	99,545,000	
	2 7 回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,086,000	
	2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	313,305,000	
	7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,463,000	
	9 回 日本たばこ産業社債	200,000,000	201,034,000	
	3 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	104,190,000	
	4 1 回 住友化学社債	100,000,000	105,354,000	
	3 7 回 三菱化学社債	100,000,000	104,642,000	
	8 回 プリヂストン社債	200,000,000	201,216,000	
	6 4 回 新日本製鐵社債	100,000,000	105,488,000	
	1 回 日本電産社債	100,000,000	100,442,000	
	1 1 回 パナソニック社債	100,000,000	101,893,000	
	1 2 回 パナソニック社債	200,000,000	202,022,000	
	5 6 回 日産自動車社債	100,000,000	101,865,000	
	1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	211,528,000	
	1 6 回 トヨタ自動車社債	100,000,000	103,760,000	
	4 9 回 伊藤忠商事社債	100,000,000	104,889,000	
	6 6 回 伊藤忠商事社債	200,000,000	200,886,000	
	9 1 回 丸紅社債	100,000,000	100,566,000	
	9 4 回 丸紅社債	100,000,000	105,268,000	
	4 5 回 住友商事社債	100,000,000	104,759,000	
	4 7 回 住友商事社債	100,000,000	103,640,000	
	6 9 回 三菱商事社債	300,000,000	312,297,000	
	4 8 回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,964,000	
	3 1 回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,320,000	

3 2 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,828,000	
7 回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	107,248,000	
1 4 0 回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,176,000	
7 回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	214,594,000	
1 2 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,304,000	
2 5 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,334,000	
2 8 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,124,000	
3 2 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	322,422,000	
4 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,164,000	
6 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,184,000	
7 回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,652,000	
9 回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,406,000	
7 回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	101,873,000	
1 2 回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,220,000	
1 0 回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	207,050,000	
1 0 回	セブン銀行社債	100,000,000	104,508,000	
1 1 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,862,000	
2 0 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,624,000	
2 2 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,044,000	
2 3 回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	426,512,000	
1 0 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,329,000	
1 4 回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	213,396,000	
2 3 回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,465,000	
1 5 回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	215,092,000	
4 7 回	日立キャピタル社債	200,000,000	209,058,000	
1 4 4 回	オリックス社債	100,000,000	102,341,000	
1 6 4 回	オリックス社債	100,000,000	103,301,000	
1 6 7 回	オリックス社債	200,000,000	201,386,000	
5 回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,876,000	
3 9 回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,221,000	
4 6 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,642,000	
8 回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,708,000	
3 8 回	三井不動産社債	200,000,000	210,718,000	
7 2 回	三菱地所社債	100,000,000	116,817,000	
9 0 回	三菱地所社債	100,000,000	103,259,000	
9 6 回	三菱地所社債	200,000,000	210,184,000	
8 4 回	住友不動産社債	100,000,000	100,574,000	
8 7 回	住友不動産社債	100,000,000	102,769,000	
8 回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	103,771,000	
7 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,510,000	
1 5 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	333,813,000	
1 9 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,502,000	
3 9 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	351,519,000	
5 2 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,558,000	
5 6 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,440,000	
9 回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	226,410,000	
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	343,128,000	
5 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,651,000	
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,614,000	
1 0 回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	193,855,100	

1 1 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,197,000	
1 4 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	116,536,000	
1 5 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	212,626,000	
2 3 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,277,000	
5 4 回	日本電信電話社債	200,000,000	206,880,000	
6 0 回	日本電信電話社債	300,000,000	317,379,000	
1 5 回	NTTドコモ社債	200,000,000	208,512,000	
4 5 5 回	東京電力社債	200,000,000	208,770,000	
5 4 2 回	東京電力社債	500,000,000	512,670,000	
4 7 6 回	中部電力社債	100,000,000	104,572,000	
4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	522,815,000	
4 1 0 回	関西電力社債	300,000,000	314,463,000	
4 8 6 回	関西電力社債	154,000,000	155,407,560	
4 9 2 回	関西電力社債	200,000,000	202,686,000	
4 9 3 回	関西電力社債	200,000,000	202,472,000	
3 1 0 回	中国電力社債	200,000,000	208,144,000	
3 7 7 回	中国電力社債	200,000,000	212,610,000	
2 6 0 回	北陸電力社債	100,000,000	108,972,000	
2 8 1 回	北陸電力社債	200,000,000	207,820,000	
4 7 1 回	東北電力社債	200,000,000	212,916,000	
4 7 3 回	東北電力社債	300,000,000	305,553,000	
2 3 7 回	四国電力社債	100,000,000	105,198,000	
2 5 3 回	四国電力社債	200,000,000	210,682,000	
4 2 3 回	九州電力社債	200,000,000	205,388,000	
4 2 4 回	九州電力社債	200,000,000	212,400,000	
4 2 6 回	九州電力社債	400,000,000	420,104,000	
3 2 0 回	北海道電力社債	200,000,000	203,652,000	
3 2 1 回	北海道電力社債	161,000,000	168,077,560	
3 8 回	電源開発社債	300,000,000	315,135,000	
1 7 回	東京ガス社債	100,000,000	105,575,000	
9 回	大阪ガス社債	100,000,000	105,131,000	
1 8 回	大阪ガス社債	100,000,000	109,219,000	
2 7 回	NTTデータ社債	100,000,000	105,939,000	
社債券 合計		19,305,000,000	20,225,236,220	
合計		353,597,438,000	397,462,141,734	

## 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）

「D I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスF」は、「D I A M高金利通貨ファンド」が投資対象とする外国投資信託受益証券です。

D I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスFはルクセンブルグ籍外国投資信託受益証券です。2014年12月31日に会計期間が終了し、現地の公認会計士による財務諸表監査を受けて完了しています。以下の「純資産計算書」、「財務諸表に対する注記」及び「組み入れ投資有価証券明細」は、2014年12月31日現在の財務諸表の原文の一部を抜粋・翻訳したものです。

### 純資産計算書

2014年12月31日現在

（日本円で表示）

	注記	D I A Mマルチカレンシーファンド ( J P Y )	日本円
<b>資産</b>			
投資有価証券、時価	2.3		685,302,329
投資有価証券、原価			686,666,264
銀行預金			258,817,270
未収債券利息			2,153,154
<b>資産合計</b>			<b>946,272,753</b>
<b>負債</b>			
未払投資運用報酬、運用会社報酬およびAIFM報酬			1,402,404
為替先渡契約に係る未実現損失	2.6,12		11,228,655
未払管理手数料			368,237
未払専門家報酬			318,545
未払保管手数料			153,690
未払取引手数料			6,000
未払年次税（“Taxe d'abonnement”）			23,317
その他の未払金			102,703
<b>負債合計</b>			<b>13,603,551</b>
<b>純資産</b>			<b>932,669,202</b>
発行済ユニット数			
クラスF			196,082
1ユニット当たり純資産価値			
クラスF	日本円		4,757

**財務諸表に対する注記**

2014年12月31日現在

\*訳者注 財務諸表に対する注記は原文の一部を抜粋・翻訳したものです。

**注記2 - 重要な会計方針****2.1 財務諸表の表示**

当財務諸表は、共同投資のための事業体に関するルクセンブルグの規制に準拠して表示されている。

**2.2 勘定**

財務諸表は日本円で表示されている。日本円以外で作成された財務諸表は期末の為替レートで換算されている。

**2.3 投資有価証券**

証券取引所に上場している有価証券またはその他の規制市場で取引されている有価証券は、かかる証券取引所または市場での直近の終値で評価されている。有価証券が複数の証券取引所または市場に上場している場合は、かかる有価証券の主要な市場を構成する証券取引所または市場での直近の終値で決定される。

証券取引所に上場していない有価証券またはその他の規制市場で取引されていない有価証券は、直近の入手可能な市場価格で評価される。

上述の価格が公正な市場価値を表さない有価証券は、合理的に予想可能な売却価格に基づき、慎重かつ誠実に評価される。

残存期間が12か月未満の短期金融市場有価証券の価値は、その市場価値であるものとみなされる。ただし、かかる市場価値が入手不可能であるか、または市場価値を表しておらず、当該有価証券が市場価値に近似する償却原価法で評価されている場合を除く。

ポートフォリオがその総資産のほとんどすべてを投資することを容認されている共同投資ファンドの株式またはユニットを含む、オープンエンド型投資ファンドの株式またはユニットは、直近で入手可能な算出された純資産価値で評価される。

**2.4 外貨換算**

ポートフォリオの通貨以外の通貨建ての資産および負債は、期末の為替レートでポートフォリオの通貨に換算される。

ポートフォリオの通貨以外の通貨建ての利益および費用は、取引日の為替レートでポートフォリオの通貨に換算される。

日本円以外の通貨建ての有価証券の取得原価は、購入日の為替レートで換算される。

為替取引による損益は、当期の成績を決定する損益計算書および純資産変動計算書に計上される。

**2.5 設定費**

設定費は5年間で償却される。

**2.6 為替先渡契約**

為替先渡契約は、満期までの残存期間に応じて、期末現在で適用される先物レートで評価される。

為替先渡契約から生じる損益は、損益計算書および純資産変動計算書に計上される。

**2.8 収入の認識**

分配金は分配原資から源泉徴収税を控除した純額で表示され、分配落ち日に収入として計上される。受取利息は発生主義に基づいて計上されている。

**注記3 - 2014年12月31日現在の為替レート**

2014年12月31日現在の為替レートは以下の通りである。

オーストラリア・ドル/日本円	=	98.1161	メキシコ・ペソ/日本円	=	8.1341
ブラジル・レアル/日本円	=	45.1038	ルーマニア・レイ/日本円	=	32.3573
ユーロ/日本円	=	145.0789	シンガポール・ドル/日本円	=	90.4800
イギリス・ポンド/日本円	=	186.9463	トルコ・リラ/日本円	=	51.2865
ハンガリー・フォリント/日本円	=	0.4595	アメリカ・ドル/日本円	=	119.8950

インド・ルピー/日本円	=	1.8994	南アフリカ・ランド/日本円	=	10.3637
アラブ首長国連邦・ディルハム/アメリカ・ドル	=	0.2723	日本円/アメリカ・ドル	=	0.0083
オーストラリア・ドル/アメリカ・ドル	=	0.8184	韓国・ウォン/アメリカ・ドル	=	0.0009
ブラジル・レアル/アメリカ・ドル	=	0.3762	メキシコ・ペソ/アメリカ・ドル	=	0.0678
カナダ・ドル/アメリカ・ドル	=	0.8634	マレーシア・リンギット/アメリカ・ドル	=	0.2860
スイス・フラン/アメリカ・ドル	=	1.0064	ノルウェー・クローネ/アメリカ・ドル	=	0.1334
チェコ・コルナ/アメリカ・ドル	=	0.0437	フィリピン・ペソ/アメリカ・ドル	=	0.0224
デンマーク・クローネ/アメリカ・ドル	=	0.1625	ポーランド・ズロチ/アメリカ・ドル	=	0.2815
ユーロ/アメリカ・ドル	=	1.2101	カタール・リアル/アメリカ・ドル	=	0.2746
イギリス・ポンド/アメリカ・ドル	=	1.5593	スウェーデン・クローナ/アメリカ・ドル	=	0.1277
香港・ドル/アメリカ・ドル	=	0.1290	シンガポール・ドル/アメリカ・ドル	=	0.7547
インドネシア・ルピア/アメリカ・ドル	=	0.0001	タイ・バーツ/アメリカ・ドル	=	0.0304
インド・ルピー/アメリカ・ドル	=	0.0158	台湾・ドル/アメリカ・ドル	=	0.0316
イスラエル・シェケル/アメリカ・ドル	=	0.2570	南アフリカ・ランド/アメリカ・ドル	=	0.0864

**注記12 - 為替先渡契約**

2014年12月31日現在、D I A Mマルチカレンシーファンド(J P Y)において、為替先渡契約に係る未実現損失は11,228,655円である。

2014年12月31日現在、U B S A G ロンドンとの為替先渡契約の残高は以下の通りである。

通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現利益/(損失) (日本円)
南アフリカ・ランド	11,200,000	日本円	115,718,400	2015/1/21	(46,994)
トルコ・リラ	2,250,000	日本円	117,675,000	2015/1/21	(2,909,861)
インド・ルピー	65,000,000	日本円	124,475,000	2015/1/21	(1,632,521)

2014年12月31日現在、ロイヤル・バンク・オブ・スコットランド・ロンドンとの為替先渡契約の残高は以下の通りである。

通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現利益/(損失) (日本円)
ルーマニア・レイ	550,000	日本円	18,262,200	2015/1/21	(473,480)
イギリス・ポンド	200,000	日本円	37,351,560	2015/1/21	25,821
ブラジル・レアル	2,750,000	日本円	127,861,250	2015/1/21	(4,544,808)
メキシコ・ペソ	13,500,000	日本円	111,277,800	2015/1/21	(1,630,242)
日本円	24,278,722	イギリス・ポンド	130,000	2015/1/21	(16,570)



## 組み入れ投資有価証券明細

2014年12月31日現在

(日本円で表示)

額面	銘柄	通貨	取得原価	評価額	純資産価値に 対する比率
			日本円	日本円	%
公認の証券取引所に上場されている、もしくはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券					
<b>債券</b>					
<b>オーストラリア</b>					
1,000,000	AUSTRALIA(GOVERNMENT OF) 6.250% 15/04/15	オーストラ リア・ドル	<u>95,708,161</u>	<u>99,126,668</u>	<u>10.63</u>
	オーストラリア小計		<u>95,708,161</u>	<u>99,126,668</u>	<u>10.63</u>
<b>フランス</b>					
90,000,000	AGENCE FRANCAISE DEVELOPEMENT 1.800% 19/06/15	日本円	<u>91,575,000</u>	<u>90,630,000</u>	<u>9.72</u>
	フランス小計		<u>91,575,000</u>	<u>90,630,000</u>	<u>9.72</u>
	債券合計		<u>187,283,161</u>	<u>189,756,668</u>	<u>20.35</u>
<b>コマーシャルペーパー</b>					
<b>フランス</b>					
1,000,000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL ECP (AUD) 24/02/15	オーストラ リア・ドル	<u>100,951,245</u>	<u>97,705,248</u>	<u>10.48</u>
100,000,000	CREDIT AGRICOLE CD (JPY) 20/03/15	日本円	<u>100,000,000</u>	<u>100,000,000</u>	<u>10.72</u>
1,000,000	NATIXIS (PARIS) CP (AUD) 06/02/15	オーストラ リア・ドル	<u>98,436,525</u>	<u>97,843,677</u>	<u>10.49</u>
	フランス小計		<u>299,387,770</u>	<u>295,548,925</u>	<u>31.69</u>
<b>イギリス</b>					
100,000,000	KOREA DEVELOPMENT BANK (LONDON)(JPY) CD 20/04/2015	日本円	<u>99,996,611</u>	<u>99,996,944</u>	<u>10.72</u>
100,000,000	MITSUBISHI UFJ TRUST AND BANKING CO (JPY) CD 15/01/15	日本円	<u>99,998,722</u>	<u>99,999,792</u>	<u>10.72</u>
	イギリス小計		<u>199,995,333</u>	<u>199,996,736</u>	<u>21.44</u>
	コマーシャルペーパー合計		<u>499,383,103</u>	<u>495,545,661</u>	<u>53.13</u>

投資有価証券合計

686,666,264685,302,32973.48

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成28年4月28日現在

資産総額	670,937,966円
負債総額	888,744円
純資産総額（ - ）	670,049,222円
発行済数量	1,885,020,924口
1口当たり純資産額（ / ）	0.3555円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産総額	404,374,771,751円
負債総額	2,080,677,616円
純資産総額（ - ）	402,294,094,135円
発行済数量	308,374,295,443口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3046円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

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

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

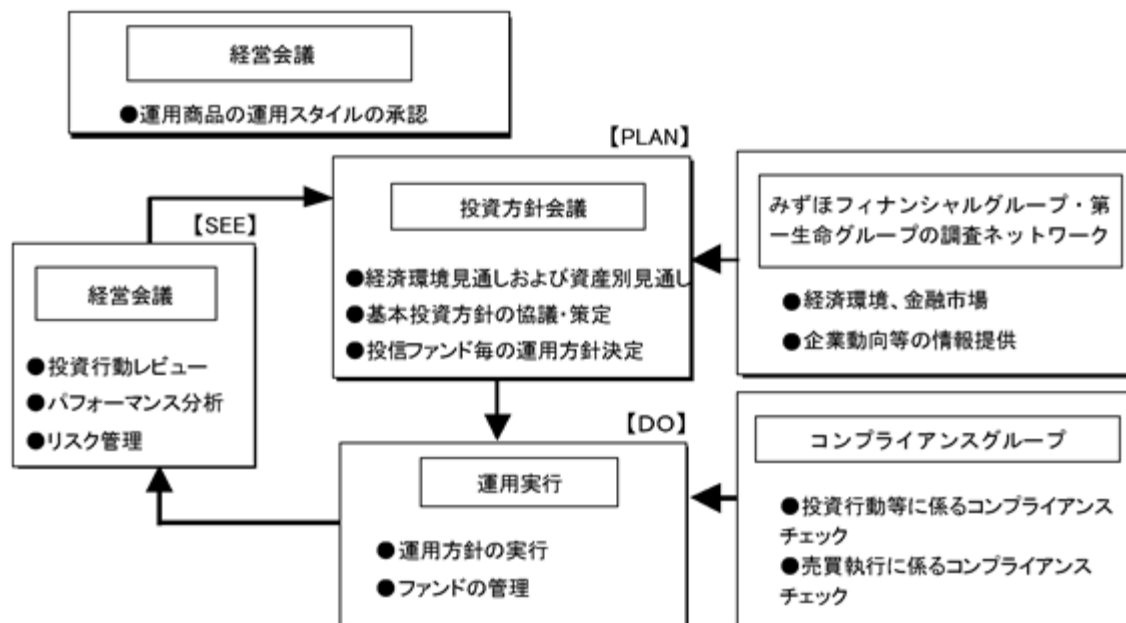
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成28年4月28日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

平成28年4月28日現在、委託会社の運用する投資信託は421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	6	74,284,971,539
追加型株式投資信託	372	5,825,192,212,947
単位型公社債投資信託	43	314,580,388,571
追加型公社債投資信託	0	0
合計	421	6,214,057,573,057

### 3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,051,921	12,951,736
金銭の信託	14,169,657	13,094,914
前払費用	57,309	44,951
未収委託者報酬	4,622,292	4,460,404
未収運用受託報酬	1,737,052	1,859,778
未収投資助言報酬	2 312,206	2 277,603
未収収益	260,845	205,097
繰延税金資産	411,797	341,078
その他	46,782	40,689
流動資産計	33,669,865	33,276,255
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 138,967	1 29,219
車両運搬具	1 941	1 549
器具備品	1 243,908	1 184,683
建設仮勘定	49,116	444,155
無形固定資産	1,912,472	1,706,201
商標権	1 101	1 7
ソフトウェア	1 1,702,633	1 1,645,861
ソフトウェア仮勘定	202,399	53,036
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 188	1 146
投資その他の資産	4,343,365	6,497,772
投資有価証券	613,137	458,701
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
繰延税金資産	582,861	679,092
差入保証金	733,907	2,040,945
その他	96,862	89,835
固定資産計	6,688,771	8,862,580
資産合計	40,358,637	42,138,836

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,605,579	966,681
未払金	2,515,377	2,055,332
未払償還金	49,873	49,873
未払手数料	1,836,651	1,744,274
その他未払金	628,852	261,185
未払費用	2 2,196,267	2 3,076,566
未払法人税等	1,539,263	1,223,957
未払消費税等	671,243	352,820
賞与引当金	722,343	728,769
その他	30,000	-
流動負債計	9,280,074	8,404,128
固定負債		
退職給付引当金	868,928	997,396
役員退職慰労引当金	110,465	154,535
固定負債計	979,394	1,151,932
負債合計	10,259,468	9,556,060
（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	25,417,784	28,000,340
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	19,480,000	22,030,000
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	5,314,491	5,347,047
株主資本計	29,846,262	32,428,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	252,905	153,956
評価・換算差額等計	252,905	153,956
純資産合計	30,099,168	32,582,775
負債・純資産合計	40,358,637	42,138,836



## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

	第30期 ( 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日 )		第31期 ( 自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日 )	
	営業収益			
委託者報酬	28,170,831		30,188,445	
運用受託報酬	7,064,021		7,595,678	
投資助言報酬	1,032,659		993,027	
その他営業収益	828,240		724,211	
営業収益計		37,095,752		39,501,363
営業費用				
支払手数料	12,416,659		12,946,176	
広告宣伝費	527,620		468,931	
公告費	288		258	
調査費	6,317,052		7,616,390	
調査費	4,129,778		4,969,812	
委託調査費	2,187,273		2,646,578	
委託計算費	385,121		412,257	
営業雑経費	488,963		548,183	
通信費	34,089		34,855	
印刷費	414,215		436,756	
協会費	24,177		23,698	
諸会費	37		40	
支払販売手数料	16,443		52,833	
営業費用計		20,135,705		21,992,198
一般管理費				
給料	5,260,910		5,382,757	
役員報酬	242,666		242,446	
給料・手当	4,378,307		4,431,015	
賞与	639,936		709,295	
交際費	37,625		43,975	
寄付金	2,697		2,628	
旅費交通費	242,164		254,276	
租税公課	127,947		180,892	
不動産賃借料	686,770		1,128,367	
退職給付費用	218,863		226,460	
固定資産減価償却費	628,056		902,248	
福利厚生費	33,310		36,173	
修繕費	13,807		31,617	
賞与引当金繰入額	722,343		728,769	
役員退職慰労引当金繰入額	50,327		49,320	
役員退職慰労金	25,501		5,250	
機器リース料	87		140	
事務委託費	231,303		251,913	
事務用消耗品費	67,208		70,839	
器具備品費	5,869		14,182	
諸経費	135,032		214,532	
一般管理費計		8,489,827		9,524,346
営業利益		8,470,220		7,984,819

（単位：千円）

	第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）		第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		17,346		25,274
受取利息		2,404		2,079
時効成立分配金・償還金		974		-
為替差益		652		3,996
雑収入		1,822		6,693
営業外収益計		23,200		38,044
営業外費用				
金銭の信託運用損		163,033		305,368
時効成立後支払分配金・償還金		65		-
外国税支払損失		47,515		-
営業外費用計		210,614		305,368
経常利益		8,282,806		7,717,494
特別利益				
投資有価証券売却益		-		3,377
特別利益計		-		3,377
特別損失				
固定資産除却損	1	12,988	1	624
固定資産売却損	2	-	2	2,653
ゴルフ会員権売却損		1,080		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,307
関係会社株式評価損		202,477		-
特別損失計		216,547		9,584
税引前当期純利益		8,066,259		7,711,286
法人税、住民税及び事業税		2,969,684		2,557,305
法人税等調整額		29,428		27,424
法人税等合計		2,940,256		2,584,730
当期純利益		5,126,003		5,126,556

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
会計方針の変更による累積的影響額									
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の積立				2,550,000			2,550,000	-	-
当期純利益							5,126,556	5,126,556	5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556	2,582,556	2,582,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	252,905	30,099,168
会計方針の変更による累積的影響額		
会計方針の変更を反映した当期首残高	252,905	30,099,168
当期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の積立		-
当期純利益		5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	98,949	98,949
当期変動額合計	98,949	2,483,607
当期末残高	153,956	32,582,775

## 重要な会計方針

項目	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 : 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの: 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの: 移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異: 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用: 発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

**未適用の会計基準等**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

**（1）概要**

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

**（2）適用予定日**

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

**（3）当該会計基準等の適用による影響**

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

**会計上の見積りの変更**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

**追加情報**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne 株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 D I A Mアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 8 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 固定資産の減価償却累計額

(千円)

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
建物	582,075	767,802
車両運搬具	3,981	4,374
器具備品	735,461	562,853
商標権	836	930
ソフトウェア	2,015,473	2,613,791
電信電話専用施設利用権	1,408	1,451

## 2. 関係会社項目

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

(千円)

		第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	311,994	276,211
流動負債	未払費用	492,035	622,004

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	0	182
ソフトウェア	12,988	442

## 2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	-	2,653

## (株主資本等変動計算書関係)

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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



## (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28年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

## 第30期（平成27年3月31日現在）

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

## 第31期（平成28年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	26,427,656	26,427,656	-
(1) 未払法人税等	1,223,957	1,223,957	-
負債計	1,223,957	1,223,957	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
非上場株式	80,246	77,696
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
差入保証金	733,907	2,040,945

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期(平成27年3月31日現在)

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

第31期(平成28年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,951,736	-	-	-
合計	12,951,736	-	-	-

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円、第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	365,683	146,101	219,581
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

（注）非上場株式（貸借対照表計上額77,696千円）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  
第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）  
該当事項はありません。

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他有価証券	5,927	3,377	-

7. 減損処理を行った有価証券  
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	13,094,914	825,986

2. 満期保有目的の金銭の信託  
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託  
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引  
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引  
該当事項はありません。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035
会計方針の変更による累積的影響額	203,600	-
会計方針の変更を反映した期首残高	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	49,633	51,531
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

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

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	973,035	1,086,550
未積立退職給付債務	973,035	1,086,550
未認識数理計算上の差異	89,550	79,449
未認識過去勤務費用	14,556	9,704
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396
退職給付引当金	868,928	997,396
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	174,402	179,999

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
割引率	0.89%	0.89%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第30期事業年度43,461千円、第31期事業年度44,193千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	118,238	79,702
未払事業所税	5,527	5,581
賞与引当金	239,095	224,898
未払法定福利費	30,557	28,395
未払確定拠出年金掛金	2,650	2,500
外国税支払損失	15,727	-
資産除去債務	-	13,244
減価償却超過額（一括償却資産）	2,158	3,389
減価償却超過額	130,844	136,503
繰延資産償却超過額（税法上）	2,710	1,339
退職給付引当金	281,232	305,591
役員退職慰労引当金	35,724	47,318
ゴルフ会員権評価損	1,940	3,768
関係会社株式評価損	176,106	166,740
その他有価証券評価差額金	-	1,196
繰延税金資産合計	1,042,515	1,020,171
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	47,855	-
繰延税金負債合計	47,855	-
差引繰延税金資産の純額	994,659	1,020,171

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

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

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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

#### （資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

#### （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30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

#### （1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

#### （2）地域ごとの情報

##### 営業収益

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

##### 有形固定資産

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

#### （3）主要な顧客ごとの情報

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



## 第31期（自平成27年4月1日 至平成28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	30,188,445	8,588,706	724,211	39,501,363

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （２）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （３）主要な顧客ごとの情報

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

## （関連当事者との取引）

## (1)親会社及び法人主要株主等

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

## 第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

## 第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	9,000千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	800,617	未払費用	308,974
								増資の引受	912,600	-	-
	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	473,948	未払費用	157,130

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	71
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	407,531	未払 費用	240,725
	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)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

## 第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料  預金の預入 (純額)  受取利息	3,023,040  879,733  1,787	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	372,837  12,155,931  123
	みずほ第 一ファイ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払  業務委託料 の支払	557,013  8,540	未払 費用  未払金	292,861  7,581
	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 払戻 (純額)  信託報酬の 支払	700,000  8,336	金銭の 信託	13,094,914

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (1株当たり情報)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,254,132円02銭	1,357,615円66銭
1株当たり当期純利益金額	213,583円46銭	213,606円51銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

<更新・訂正後>

## (1)受託会社

## a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

## b. 資本金の額

平成28年3月末日現在 247,369百万円

## c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託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。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社ジャパンネット銀行	37,250	日本において銀行業務を営んでおります。
ソニー銀行株式会社	31,000	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。
立花証券株式会社	6,695	「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。
東洋証券株式会社	13,494	「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。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社証券ジャパン	3,000	「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。
ばんせい証券株式会社	1,558	「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。
フィデリティ証券株式会社	7,657	「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。
リテラ・クレア証券株式会社	3,794	「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。

水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
----------	--------	----------------------------------

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

### 第3【その他】

< 訂正前 >

(略)

(5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。

基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

(委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：通貨セレクシ)

< 訂正後 >

(略)

(5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。

基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

(当ファンドの略称：通貨セレクシ)



## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月1日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印  
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M高金利通貨ファンドの平成27年10月14日から平成28年4月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M高金利通貨ファンドの平成28年4月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

---

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成28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。

### 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。