

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成27年5月22日

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 西 恵正

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 上野 圭子

【電話番号】 03-3287-3110

**【届出の対象とした募集内国
投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** U Sストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型

**【届出の対象とした募集内国
投資信託受益証券の金額】** 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書の提出に伴い、平成26年11月25日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

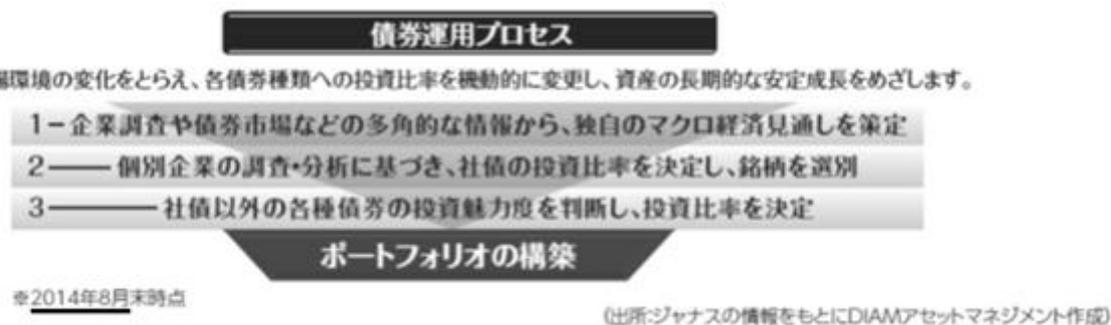
(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

<ファンドの特色>

(略)



(略)

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーについて

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーは、ジャナス・キャピタル・グループの一員です。同グループは、米国コロラド州デンバーを本拠地とし、ニューヨーク証券取引所に上場する米国の独立系資産運用グループです。創設以来、一貫して資産運用に専念。揺るぎない投資哲学と豊富な専門知識、グローバルに広がるネットワークを基盤に、「投資の世界において、付加価値を追求する方法は一つではない」という理念のもと、様々な資産運用戦略の提供に取り組み、確かな実績を築いています。

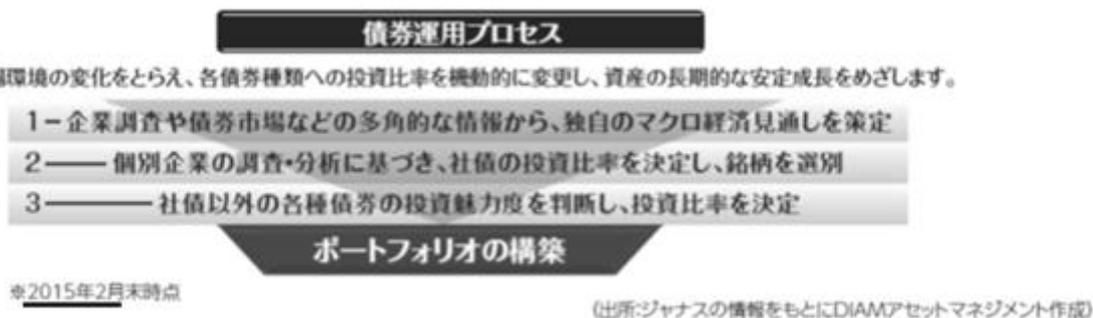
(略)

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

(略)



(略)

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーについて

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーは、ジャナス・キャピタル・グループの一員です。同グループは、ニューヨーク証券取引所に上場している米国有数の資産運用会社です。創設以来、一貫して資産運用に専念。揺るぎない投資哲学と豊富な専門知識、グローバルに広がるネットワークを基盤に、「投資の世界において、付加価値を追求する方法は一つではない」という理念のもと、様々な資産運用戦略の提供に取り組み、確かな実績を築いています。

(略)

(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26年8月29日現在）

(略)

大株主の状況

(平成26年8月29日現在)

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

< 訂正後 >

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成27年2月27日現在）

(略)

大株主の状況

(平成27年2月27日現在)

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

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

< 訂正前 >

(略)

(参考) 当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

ファンド名	D I A Mケイマン・ファンド - Janus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス
(略)	
信託報酬	(略)
(略)	

(略)

< 訂正後 >

(略)

（参考）当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

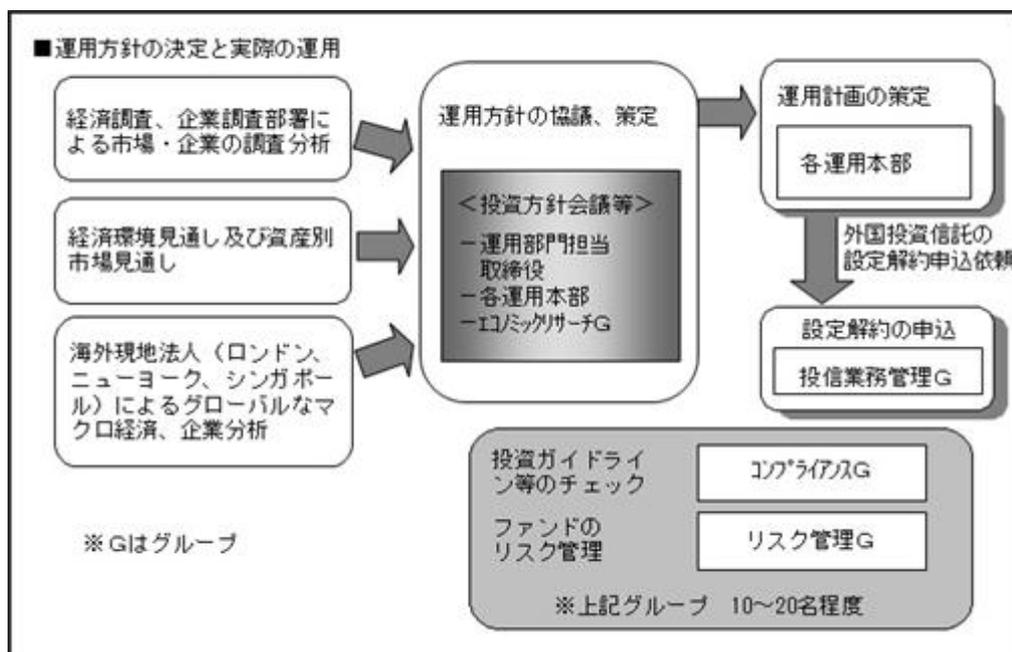
ファンド名	D I A Mケイマン・ファンド - Janus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス
（略）	
信託報酬等	（略）
（略）	

（略）

（3）【運用体制】

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

<更新・訂正後>



経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部の運用担当者、エコミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

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

外国投資信託の設定解約の申込については、投信業務管理グループで行われます。なお、国内債券の発注は、債券運用本部で執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

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

3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

< 運用評価・運用リスク管理体制 >

(略)

上記体制は平成26年8月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

(略)

< 運用評価・運用リスク管理体制 >

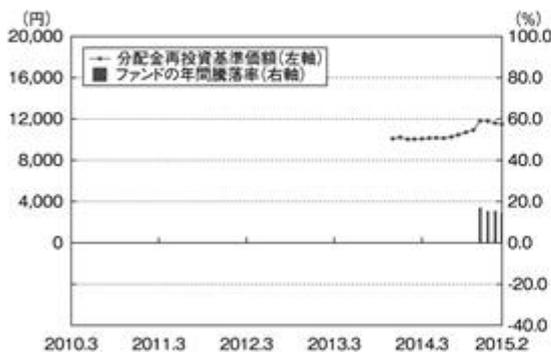
(略)

上記体制は平成27年2月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

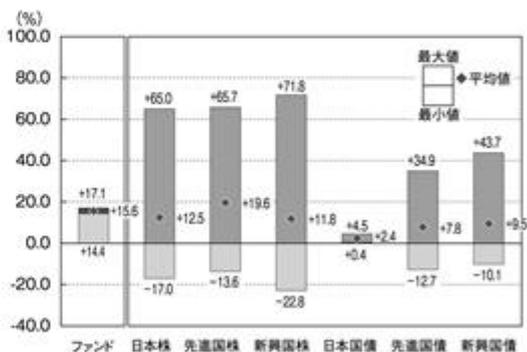
投資リスクの末尾に以下の内容が追加されます。

(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



ファンド:2014年11月~2015年2月
代表的な資産クラス:2010年3月~2015年2月

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

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

* 各資産クラスの指数

- 日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 - 先進国株……MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 日本国債……NOMURA-BPI国債
 - 先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 - 新興国債……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】

(1)【申込手数料】

<訂正前>

(略)

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<訂正後>

(略)

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(3)【信託報酬等】

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

<更新・訂正後>

ファンド	ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.972%（税抜0.90%） 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。 信託報酬の配分は、各販売会社の取扱純資産額 ^(注) に応じて、以下の通りとします。 (注) 各販売会社の取扱純資産額の算出に当たっては、「USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」の取扱純資産額を合算します。また、複数の系列販売会社の取扱純資産額を合算する場合があります。			
	信託報酬の配分（税抜）			
	各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社
	300億円以下の部分	年率0.35%	年率0.51%	年率0.04%
	300億円超800億円以下の部分	年率0.30%	年率0.56%	
800億円超の部分	年率0.25%	年率0.61%		
主な役務	委託した資金の運用の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価	

投資対象とする 外国投資信託	外国投資信託の純資産総額に対して年率0.49%程度 ただし、当該外国投資信託の信託報酬には、年間最低報酬額が定められている場合があり、純資産総額等によっては年率換算で上記の信託報酬率を上回る場合があります。
実質的な負担	ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.462%（税抜1.39%）（概算） 上記はファンドが投資対象とする外国投資信託を高位に組入れた状態を想定しています。

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】

<訂正前>

(略)

その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

(略)

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

(略)

<訂正後>

(略)

その他の費用

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

(略)

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

(略)

(5) 【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は、平成26年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

(略)

<訂正後>

(略)

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

(略)

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	1,361,135,109	97.48
内 ケイマン諸島	1,361,135,109	97.48
親投資信託受益証券	2,403,518	0.17
内 日本	2,403,518	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	32,847,820	2.35
純資産総額	1,396,386,447	100.00

その他資産の投資状況

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	1,192,600	0.09
-	1,192,600	0.09
為替予約取引（売建）	57,244,800	4.10
-	57,244,800	4.10

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（参考）

D I A Mマネーマーケットマザーファンド

平成27年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	3,535,055	19.19
内 日本	3,535,055	19.19
地方債証券	300,375	1.63
内 日本	300,375	1.63
特殊債券	10,079,370	54.71
内 日本	10,079,370	54.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,508,405	24.47
純資産総額	18,423,205	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	D I A Mケイマン・ファン ド - Janus USコア プラス・ボンド・ファン ド 米ドル建てアルファ年 1回決算クラス ケイマン諸島	投資信託受益 証券	107,855	12,459.81 1,343,863,152	12,619.95 1,361,135,109	- -	97.48%
2	D I A Mマネーマーケットマ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,398,003	1.0017 2,402,319	1.0023 2,403,518	- -	0.17%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	97.48%
親投資信託受益証券	0.17%
合計	97.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

D I A Mマネーマーケットマザーファンド

平成27年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	146回 政保阪神高速道路 債 日本	特殊債券	4,000,000	101.18 4,047,380	100.31 4,012,680	1.300000 2015/5/29	21.78%
2	855回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	2,000,000	101.20 2,024,160	100.68 2,013,780	1.300000 2015/9/18	10.93%
3	269回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	1,500,000	101.24 1,518,735	100.06 1,500,900	1.300000 2015/3/20	8.15%
4	13回 政保日本政策投資銀 行債券 日本	特殊債券	1,000,000	104.18 1,041,850	102.91 1,029,170	2.000000 2016/8/25	5.59%
5	858回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	1,000,000	101.51 1,015,110	101.19 1,011,980	1.500000 2015/12/25	5.49%
6	200回 政保首都高速道路 債券 日本	特殊債券	1,000,000	101.50 1,015,030	100.71 1,007,160	1.300000 2015/9/25	5.47%
7	101回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	1,000,000	100.81 1,008,120	100.70 1,007,010	0.400000 2016/12/20	5.47%
8	853回 政保公営企業債券 日本	特殊債券	1,000,000	101.16 1,011,650	100.46 1,004,600	1.200000 2015/7/24	5.45%
9	288回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	500,000	105.48 527,445	104.30 521,545	1.700000 2017/9/20	2.83%
10	275回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	500,000	102.32 511,610	101.12 505,600	1.400000 2015/12/20	2.74%
11	22年度2回 大阪市みおつ くし債 日本	地方債証 券	300,000	100.28 300,840	100.12 300,375	0.520000 2015/12/24	1.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年2月27日現在

種類	投資比率
国債証券	19.19%
地方債証券	1.63%
特殊債券	54.71%
合計	75.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

【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】

平成27年2月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2015年03月	買建	10,000	1,186,970	1,192,600	0.09%
		アメリカ・ドル売/円 買2015年03月	売建	480,000	57,095,424	57,244,800	4.10%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(参考)

D I A Mマネーマーケットマザーファンド
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成26年8月25日)	1,260	1,260	1.0475	1.0475
平成26年2月末日	1,098	-	1.0044	-
3月末日	1,211	-	1.0079	-
4月末日	1,212	-	1.0136	-
5月末日	1,229	-	1.0162	-
6月末日	1,231	-	1.0135	-
7月末日	1,248	-	1.0250	-
8月末日	1,255	-	1.0460	-
9月末日	1,177	-	1.0697	-
10月末日	1,185	-	1.0908	-
11月末日	1,229	-	1.1806	-
12月末日	1,333	-	1.1787	-
平成27年1月末日	1,394	-	1.1584	-
2月末日	1,396	-	1.1490	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成26年8月26日～ 平成27年2月25日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.8
平成26年8月26日～ 平成27年2月25日	9.4

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（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計算期間については、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計算期間	1,340,794,784	136,982,938
平成26年8月26日～ 平成27年2月25日	355,639,484	298,725,245

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

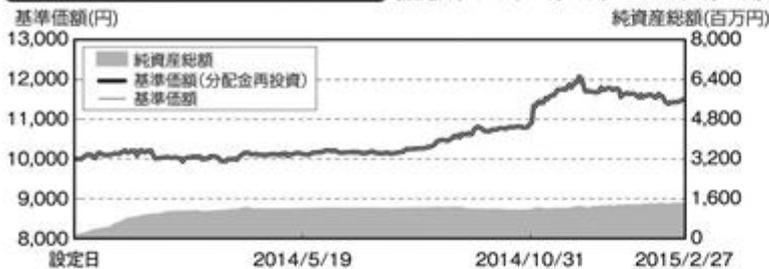
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2015年2月27日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2013年11月25日)~2015年2月27日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2013年11月25日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

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	種類	発行体の国/地域	投資比率
1	DIAMケイマン・ファンド-Janus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス	投資信託受益証券	ケイマン諸島	97.48%
2	DIAMマネーマーケットマザーファンド	親投資信託受益証券	日本	0.17%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.09
為替予約取引(売建)	△4.10

■DIAMケイマン・ファンド-Janus USコアプラス・ボンド・ファンドの組入上位10銘柄

※ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーの現地月末データを基に作成しています。
 ※投資比率はDIAMケイマン・ファンド-Janus USコアプラス・ボンド・ファンドの純資産総額に対する割合です。

順位	銘柄名	種別	クーポン	償還日	投資比率
1	US TREASURY	国債	0.625%	2016/12/31	6.2%
2	US TREASURY	国債	2.250%	2024/11/15	5.3%
3	US TREASURY	国債	0.500%	2016/11/30	3.7%
4	US TREASURY	国債	0.500%	2017/1/31	3.0%
5	US TREASURY	国債	1.500%	2019/11/30	2.9%
6	US TREASURY	国債	1.500%	2018/8/31	2.4%
7	US TREASURY	国債	0.500%	2016/8/31	1.9%
8	US TREASURY	国債	0.875%	2017/1/31	1.7%
9	US TREASURY	国債	1.000%	2017/12/15	1.7%
10	Fannie Mae	モーゲージ債	3.500%	2044/1/1	1.6%

■DIAMマネーマーケットマザーファンドの主要な資産の状況

(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。

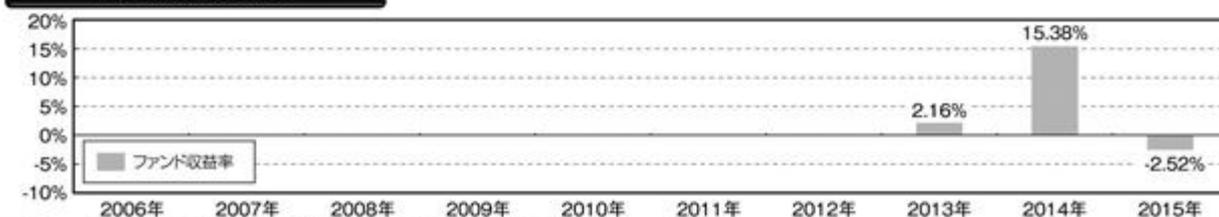
ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	19.19
内 日本	19.19
地方債証券	1.63
内 日本	1.63
特殊債券	54.71
内 日本	54.71
コールローン、その他の資産(負債控除後)	24.47
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	146回 政保阪神高速道路債	特殊債券	日本	1.300000	2015/5/29	21.78%
2	855回 政保公営企業債券	特殊債券	日本	1.300000	2015/9/18	10.93%
3	269回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.300000	2015/3/20	8.15%
4	13回 政保日本政策投資銀行債券	特殊債券	日本	2.000000	2016/8/25	5.59%
5	858回 政保公営企業債券	特殊債券	日本	1.500000	2015/12/25	5.49%
6	200回 政保首都高速道路債券	特殊債券	日本	1.300000	2015/9/25	5.47%
7	101回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.400000	2016/12/20	5.47%
8	853回 政保公営企業債券	特殊債券	日本	1.200000	2015/7/24	5.45%
9	288回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.700000	2017/9/20	2.83%
10	275回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.400000	2015/12/20	2.74%

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、2013年は設定日から年末までの収益率、および2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

イ.償還規定

(略)

e.上記c.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

(略)

j.信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、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取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記c.に規定する書面に付記します。

ロ.信託約款の変更等

(略)

b.委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(略)

d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

(略)

i.重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、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取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

(略)

ホ.運用報告書

委託会社は、原則として毎年8月23日（休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書（交付運用報告書を作成している場合は、交付運用報告書）を作成し、当該信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

<訂正後>

イ.償還規定

(略)

e.上記c.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

（略）

j. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ．信託約款の変更等

（略）

b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

（略）

d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

（略）

i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

（略）

ホ．運用報告書

・ 委託会社は、毎年8月23日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

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 1 財務諸表」につきましては、以下の内容が追加されます。

<追 加>

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成26年8月26日から平成27年2月25日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

U S ストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成26年8月25日現在	第2期中間計算期間末 平成27年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	42,073,446	88,064,307
投資信託受益証券	1,219,122,211	1,412,853,499
親投資信託受益証券	2,402,319	2,403,518
未収入金	25,546,977	1,081,546
流動資産合計	1,289,144,953	1,504,402,870
資産合計	1,289,144,953	1,504,402,870
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	28,224	27,080
未払金	14,987,947	45,964,018
未払解約金	10,122,152	7,669,370
未払受託者報酬	133,440	277,920
未払委託者報酬	2,869,363	5,976,113
その他未払費用	15,801	32,913
流動負債合計	28,156,927	59,947,414
負債合計	28,156,927	59,947,414
純資産の部		
元本等		
元本	1,203,811,846	1,260,726,085
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	57,176,180	183,729,371
(分配準備積立金)	46,615,787	35,649,077
元本等合計	1,260,988,026	1,444,455,456
純資産合計	1,260,988,026	1,444,455,456
負債純資産合計	1,289,144,953	1,504,402,870

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 平成25年11月25日 至 平成26年5月24日	第2期中間計算期間 自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日
営業収益		
受取利息	19,144	14,986
有価証券売買等損益	35,011,786	19,812,958
為替差損益	23,517,450	90,646,960
その他収益	-	72,240
営業収益合計	11,513,480	110,547,144
営業費用		
受託者報酬	203,886	277,920
委託者報酬	4,384,328	5,976,113
その他費用	131,593	225,212
営業費用合計	4,719,807	6,479,245
営業利益又は営業損失（ ）	6,793,673	104,067,899
経常利益又は経常損失（ ）	6,793,673	104,067,899
中間純利益又は中間純損失（ ）	6,793,673	104,067,899
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	20,544	17,622,903
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	57,176,180
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,216,457	55,631,766
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,216,457	55,631,766
剰余金減少額又は欠損金増加額	901,989	15,523,571
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	901,989	15,523,571
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	17,128,685	183,729,371

(3) 【中間注記表】

(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 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成26年8月25日現在	第2期中間計算期間末 平成27年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	197,481,436円	1,203,811,846円
期中追加設定元本額	1,143,313,348円	355,639,484円
期中一部解約元本額	136,982,938円	298,725,245円
2 . 受益権の総数	1,203,811,846口	1,260,726,085口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成26年8月25日現在	第2期中間計算期間末 平成27年2月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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 「（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)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。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）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 平成26年8月25日現在				第2期中間計算期間末 平成27年2月25日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	6,222,576	-	6,250,800	28,224	-	-	-	-
アメリカ・ドル	6,222,576	-	6,250,800	28,224	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	14,278,280	-	14,251,200	27,080
アメリカ・ドル	-	-	-	-	14,278,280	-	14,251,200	27,080
合計	6,222,576	-	6,250,800	28,224	14,278,280	-	14,251,200	27,080

（注）時価の算定方法

1. 中間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。
 中間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。
 中間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。
 - ・ 中間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。
 - ・ 中間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. 中間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、中間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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 平成26年8月25日現在	第2期中間計算期間末 平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0475円 (10,475円)	1.1457円 (11,457円)

（参考）

当ファンドは、「D I A Mマネーマーケットマザーファンド」受益証券及び「D I A Mケイマン・ファンド - J a n u s U S コアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス」投資信託証券を主要投資対象としており、中間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。

「D I A Mマネーマーケットマザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成26年8月25日現在	平成27年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,667,810	4,453,207
国債証券		10,209,618	3,535,160
地方債証券		1,372,844	300,372
特殊債券		7,099,090	10,080,040
未収利息		59,391	51,452
前払費用		11,103	2,671
流動資産合計		21,419,856	18,422,902
資産合計		21,419,856	18,422,902
負債の部			
流動負債			
流動負債合計		-	-
負債合計		-	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	21,381,025	18,381,025
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		38,831	41,877
元本等合計		21,419,856	18,422,902
純資産合計		21,419,856	18,422,902
負債純資産合計		21,419,856	18,422,902

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。
--------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年8月25日現在	平成27年2月25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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	3,000,000円 18,381,025円 - 円	21,381,025円 - 円 3,000,000円
元本の内訳 ファンド名		
りそな 新興国ハイ・イールド債券ファンド（弾力為替ヘッジ）毎月決算型	2,500,000円	- 円
りそな 新興国ハイ・イールド債券ファンド（弾力為替ヘッジ）年2回決算型	500,000円	- 円
U Sストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型	5,995,005円	5,995,005円
U Sストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型	2,398,003円	2,398,003円
D I A M欧州ハイブリッド証券ファンド為替ヘッジなし（毎月決算型）	998,802円	998,802円
D I A M欧州ハイブリッド証券ファンド為替ヘッジなし（年1回決算型）	299,641円	299,641円
D I A M欧州ハイブリッド証券ファンド為替プレミアム（毎月決算型）	6,991,611円	6,991,611円
D I A M欧州ハイブリッド証券ファンド為替プレミアム（年1回決算型）	1,697,963円	1,697,963円
計	21,381,025円	18,381,025円
2. 受益権の総数	21,381,025口	18,381,025口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年8月25日現在	平成27年2月25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）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年8月25日現在	平成27年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.0018円	1.0023円
（1万口当たり純資産額）	（10,018円）	（10,023円）

（参考）

「D I A Mケイマン・ファンド - Janus USコアプラス・ボンド・ファンド」は、「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」が投資対象とする外国投資信託です。

D I A Mケイマン・ファンド - Janus USコアプラス・ボンド・ファンドはケイマン籍外国投資信託です。2013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」、「投資有価証券明細書」及び「財務諸表に関する注記」は、2013年12月31日現在の財務諸表の原文の翻訳を抜粋したものです。

純資産計算書
2013年12月31日現在
(日本円建て)

	単位：日本円
資産の部	
投資有価証券の公正価値（取得原価：55,223,555,112円）（注2）	59,337,147,644
現金および現金等価物	609,908,202
受益権口発行未収金	401,132,698
未収利息	458,641,008
為替先渡契約による未実現利益	88,772,660
前払費用	3,706,183
その他未収金	1,415,269
資産合計	60,900,723,664
負債の部	
投資有価証券購入未払金	66,256,025
未払償還金	261,601,600
為替先渡契約による未実損失	390,558,208
未払監査報酬	3,568,986
未払管理事務報酬	10,913,584
未払保管報酬	2,046,350
未払投資運用報酬	53,569,801
未払受託報酬	1,364,203
その他未払費用	115,762
負債合計	789,994,519
2013年12月31日現在純資産合計	60,110,729,145
純資産内訳	
払込資本	55,633,454,421
デリバティブおよび有価証券による実現純利益	1,568,210,364
デリバティブおよび有価証券による未実現増加分	3,831,819,551
純投資収益を超える分配金累計	(922,755,191)
2013年12月31日現在純資産合計	60,110,729,145
発行済受益権口数	
クラス SUNHJJPY	2,572,897
クラス MJPHJJPY	759,051
クラス MUNHJJPY	1,886,786
クラス AUNHDUSD	74,953
クラス MUNHDUSD	169,790
クラス YJPHJJPY	950
クラス YUNHJJPY	1,298

純資産計算書（続き）
2013年12月31日現在
（日本円建て）

一口当たり純資産価額（日本円）

クラス SUNHDJPY	11,694
クラス MJPHDJPY	9,800
クラス MUNHDJPY	10,597
クラス AUNHDUSD	10,499
クラス MUNHDUSD	10,488
クラス YJPHDJPY	10,009
クラス YUNHDJPY	10,085

投資有価証券明細書

2013年12月31日現在

(日本円建て)

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
社債						
オーストラリア						
各種鉱物						
		8.25% 11/01/19				
	2,994,000	FMG RESOURCES AUG 06 144A	USD	333,356,369	354,413,280	0.59%
		7% 11/01/15				
	764,000	FMG RESOURCES AUG'06 144A	USD	81,695,102	83,462,043	0.14%
				<u>415,051,471</u>	<u>437,875,323</u>	<u>0.73%</u>
リート(不動産投資法人) - (総合型)						
		6.375% 04/15/21				
	3,200,000	GOODMAN FUNDING 144A	USD	344,802,000	373,843,527	0.62%
	750,000	GOODMAN FUNDING6.38% 11/12/20 144A	USD	83,174,745	87,427,865	0.15%
				<u>427,976,745</u>	<u>461,271,392</u>	<u>0.77%</u>
オーストラリア合計						
				<u>843,028,216</u>	<u>899,146,715</u>	<u>1.50%</u>
バミューダ						
総合型製造業						
		4.25% 06/15/23				
	1,944,000	INGERSOLL-RND G 144A	USD	189,793,662	199,949,341	0.33%
バミューダ合計						
				<u>189,793,662</u>	<u>199,949,341</u>	<u>0.33%</u>
英領バージン諸島						
ハードウエア						
	4,608,000	TSMC GLOBAL LTD 1.63% 04/03/18	USD	442,187,874	465,016,766	0.77%
英領バージン諸島合計						
				<u>442,187,874</u>	<u>465,016,766</u>	<u>0.77%</u>
カナダ						
医薬品						
	1,881,000	VPII ESCROW COR 6.75% 08/15/18 144A	USD	188,429,737	218,214,145	0.36%
パイプライン						
	1,200,000	KINDER MORGAN 5.70% 01/05/16	USD	122,378,221	136,106,606	0.23%
カナダ合計						
				<u>310,807,958</u>	<u>354,320,751</u>	<u>0.59%</u>
アイルランド						
特別目的会社						
	1,765,000	PERRIGO CO LTD 2.30% 11/08/18 144A	USD	179,597,195	183,312,589	0.30%
	950,000	PERRIGO CO LTD 4.00% 11/15/23 144A	USD	93,227,367	98,159,695	0.17%
アイルランド合計						
				<u>272,824,562</u>	<u>281,472,284</u>	<u>0.47%</u>
ジャージー管区						
出版						
		UNITED BUSINESS				
	1,705,000	5.750% 11/03/20 144A	USD	169,299,815	186,565,552	0.31%
ジャージー管区合計						
				<u>169,299,815</u>	<u>186,565,552</u>	<u>0.31%</u>

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%	
社債(続き)							
ルクセンブルグ							
鉄鋼 - 生産	1,284,000	ARCELORMITTAL	4.50% 02/25/17	USD	127,528,471	145,413,822	0.24%
ルクセンブルグ合計					127,528,471	145,413,822	0.24%
オランダ							
化学	5,919,000	LYONDELLBASELL	5.000% 04/15/19	USD	618,554,121	691,745,034	1.15%
金融 - リース会社	3,970,000	LEASEPLAN CORP	2.50% 05/16/18 144A	USD	392,179,389	406,082,856	0.68%
オランダ合計					1,010,733,510	1,097,827,890	1.83%
韓国							
石油 - 油田サービス	500,000	KOREA NATL OIL	4.00% 10/27/16 144A	USD	49,976,449	56,042,513	0.09%
韓国合計					49,976,449	56,042,513	0.09%
英国							
自動車/小型トラック	938,000	JAGUAR LAND ROV	5.625% 02/01/23 144A	USD	93,307,843	99,081,435	0.16%
建材 - セメント	600,000	HANSON LTD	6.13% 08/15/16	USD	62,413,376	69,526,959	0.12%
商業銀行(米国外)	2,741,000	SANTANDER UK PL	5.00% 11/07/23 144A	USD	276,509,894	289,722,553	0.48%
総合型銀行	1,276,000	ROYAL BK SCOTLN	6.00% 12/19/23	USD	130,255,169	135,236,517	0.22%
	2,991,000	ROYAL BK SCOTLN	6.10% 06/10/23	USD	301,084,871	317,478,173	0.53%
					431,340,040	452,714,690	0.75%
電力 - 総合	898,000	PPL WEM HLDG	3.900% 05/01/16 144A	USD	82,501,193	98,687,367	0.16%
	700,000	PPL WEM HLDG	5.375% 05/01/21 144A	USD	69,805,122	78,348,863	0.13%
					152,306,315	177,036,230	0.29%
金融 - 住宅ローン	2,150,000	NORTHERN ROCK	5.625% 06/22/17 144A	USD	229,607,427	256,367,235	0.44%
英国合計					1,245,484,895	1,344,449,102	2.24%
米国							
航空宇宙産業・防衛 - 機器	900,000	EXELIS INC	4.25% 10/01/16	USD	85,585,989	99,963,592	0.17%
	1,350,000	TRANSDIGM INC	7.75% 12/15/18	USD	144,646,650	152,888,364	0.25%
					230,232,639	252,851,956	0.42%

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%	
社債(続き)							
米国(続き)							
航空会社	500,000	SOUTHWEST AIR	5.125% 03/01/17	USD	47,920,433	57,117,527	0.10%
自動車 - 小型トラック	2,409,000	GENERAL MOTORS	3.50% 10/02/18 144A	USD	241,781,364	260,160,895	0.43%
	7,362,000	GENERAL MOTORS	4.88% 10/02/23 144A	USD	735,342,283	787,324,232	1.31%
	1,735,000	GENERAL MOTORS	6.25% 10/02/43 144A	USD	171,201,128	190,335,306	0.32%
					<u>1,148,324,775</u>	<u>1,237,820,433</u>	<u>2.06%</u>
自動車ABS(資産担保証券)他	3,715,000	AMERICREDIT AUTOMOBIL	3.38%, 03/08/16	USD	382,345,929	404,678,013	0.67%
	1,951,000	AMERICREDIT AUTOMOBIL	MBS 10/09/18	USD	184,267,890	206,964,866	0.34%
	400,000	SANTANDER DRIVE AUTO	2.70% 08/15/2018	USD	38,924,534	43,208,793	0.08%
					<u>605,538,353</u>	<u>654,851,672</u>	<u>1.09%</u>
飲料 - ワイン・蒸留酒	168,000	CONSTELLATION B	3.75% 05/01/21	USD	16,364,881	16,642,326	0.03%
建築 - 住宅・商業施設	910,000	D.R. HORTON INC	4.75% 5/15/17	USD	94,463,343	101,623,399	0.17%
	473,000	TOLL BR FIN COR	4.00% 12/31/18	USD	47,087,165	50,708,960	0.08%
	1,145,000	TOLL BR FIN COR	4.38% 04/15/23	USD	120,662,444	112,221,925	0.19%
					<u>262,212,952</u>	<u>264,554,284</u>	<u>0.44%</u>
醸造業	1,505,000	SABMILLER HLD I	2.20% 08/01/18 144A	USD	146,532,704	158,105,835	0.26%
カジノ・ホテル	3,675,000	MGM MIRAGE	7.500% 06/01/16	USD	383,103,668	434,543,495	0.72%
	355,000	MGM RESORTS INTL	6.625% 07/15/15	USD	36,025,092	40,203,977	0.07%
	1,264,000	WYNN LAS VEGAS	4.25% 05/30/23 144A	USD	124,852,695	124,715,494	0.21%
					<u>543,981,455</u>	<u>599,462,966</u>	<u>1.00%</u>
携帯電話通信	2,335,000	SPRINT NEXTEL	7.000% 08/15/20	USD	241,106,241	266,894,447	0.44%
化学 - 特殊化学品	1,102,000	ASHLAND INC	3.88% 04/15/18	USD	105,727,328	117,852,663	0.20%
	2,160,000	ASHLAND INC	4.75% 08/15/22	USD	206,542,910	216,810,599	0.36%
	1,290,000	ASHLAND INC	6.875% 05/15/43	USD	122,219,778	128,806,181	0.21%
					<u>434,490,016</u>	<u>463,469,443</u>	<u>0.77%</u>

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
社債(続き)						
米国(続き)						
CMBS(商業用不動産担保証券)他						
	227,000	COMM 2007-C9 AJ	5.65% 7/10/17	USD	25,323,272	24,960,493 0.04%
	198,000	COMM 2013-WWP A2	VAR 3/10/23	USD	19,114,258	19,869,851 0.03%
	5,821,000	GCCFC 2007-GG11 AM	VAR 8/10/17	USD	619,164,271	671,955,307 1.12%
	292,000	GS MORTGAGE SEC.	MBS 4/10/2022	USD	27,671,627	30,284,378 0.05%
		GS MORTGAGE SEC.	3.206%			
	910,000	MBS	12/10/2027	USD	80,697,856	83,853,030 0.14%
		GSMS 2013-KYO D				
	3,466,000	CMON	2.95% 11/08/29	USD	324,983,818	363,371,182 0.60%
		GSMS 2013-KYO E				
	217,000	CMON	3.95% 11/08/29	USD	20,266,716	22,834,676 0.04%
			FLOAT 04/15/30			
	862,000	JPMCC 2013-JWRZ D	144A	USD	84,330,288	90,201,236 0.15%
		JPMCC 2013-JWRZ E				
	305,000	CM	3.939% 4/15/2030	USD	31,314,788	31,999,227 0.05%
	2,058,000	WBCMT 2007 - C30AM	VAR 12/15/43	USD	220,013,751	233,219,501 0.39%
	530,000	WBCMT 2007 - C31	VAR 4/15/47	USD	55,754,920	60,774,420 0.11%
					<u>1,508,635,565</u>	<u>1,633,323,301</u> 2.72%
商業銀行						
			6.625% 4/01/18			
	1,282,000	CIT GROUP INC	144A	USD	142,822,327	152,092,982 0.25%
商業銀行 - 米国西部						
	1,450,000	SVB FINANCIAL G	5.38% 09/15/20	USD	170,859,678	168,315,945 0.28%
商業銀行 - 米国東部						
	4,230,000	CIT GROUP INC	4.250% 08/15/17	USD	413,289,263	464,600,898 0.77%
	1,102,000	CIT GROUP INC	5.00% 08/01/23	USD	107,700,628	112,061,377 0.19%
			5.500% 02/15/19			
	2,683,000	CIT GROUP INC	144A	USD	270,110,435	303,851,468 0.51%
	1,300,000	HSBC BANK USA N	4.875% 08/24/20	USD	138,164,045	147,672,497 0.24%
					<u>929,264,371</u>	<u>1,028,186,240</u> 1.71%
CAD						
	600,000	AUTODESK INC	1.95% 12/15/17	USD	56,946,332	62,443,092 0.10%
	1,236,000	AUTODESK INC	3.600% 12/15/22	USD	115,357,568	120,186,555 0.20%
					<u>172,303,900</u>	<u>182,629,647</u> 0.30%
コンサルティングサービス						
	2,313,000	VERISK ANALYTIC	4.125% 09/12/22	USD	219,364,452	235,732,221 0.39%
	1,496,000	VERISK ANALYTIC	5.80% 05/01/21	USD	150,587,125	170,061,655 0.29%
					<u>369,951,577</u>	<u>405,793,876</u> 0.68%
透析センター						
			5.88% 01/31/22			
	2,065,000	FRESENIUS MED	144A	USD	228,977,196	230,064,340 0.38%
総合型銀行						
	702,000	BANK OF AMER CR	1.500% 10/09/15	USD	62,339,990	74,559,105 0.12%
	3,350,000	BANK OF AMER CR	3.63% 03/17/16	USD	346,080,883	370,631,466 0.62%
	3,845,000	BANK OF AMER CR	3.750% 07/12/16	USD	390,447,416	429,896,387 0.72%
	459,000	BANK OF AMER CR	FXtoFL PERP	USD	44,815,562	53,705,387 0.09%

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
社債（続き）						
米国（続き）						
総合型銀行（続き）						
	4,100,000	CITIGROUP INC		5% 09/15/2014	USD	418,020,286 443,282,703 0.74%
	3,473,000	GOLDMAN SACHS G		2.38% 01/22/18	USD	340,157,981 366,769,405 0.61%
	400,000	GOLDMAN SACHS G		5.625% 01/15/17	USD	38,415,783 46,360,261 0.08%
	5,110,000	MORGAN STANLEY		3.450% 11/02/15	USD	505,147,347 559,305,834 0.93%
	1,100,000	MORGAN STANLEY		4.000% 07/24/15	USD	100,324,332 120,764,902 0.20%
	900,000	MORGAN STANLEY		4.75% 03/22/17	USD	92,334,591 103,310,345 0.17%
	5,840,000	MORGAN STANLEY		5.00% 11/24/25	USD	588,800,656 617,019,161 1.02%
						<u>2,926,884,827 3,185,604,956 5.30%</u>
総合型金融サービス						
	1,374,000	CARLYLE HLDGS F 3.88%		02/01/23 144A	USD	130,777,323 138,204,171 0.23%
		GENERAL ELEC CAP		VAR 11/15/67		
	2,300,000	COR		144A	USD	246,769,472 263,196,064 0.44%
						<u>377,546,795 401,400,235 0.67%</u>
総合型製造業						
	3,800,000	GE CAPITAL TRUST I		VAR 11/15/2067	USD	371,501,582 432,349,428 0.72%
電力- 総合						
	665,000	CMS ENERGY		4.25% 09/30/15	USD	66,957,457 73,670,615 0.12%
電子部品 - 半導体						
	4,400,000	SAMSUNG ELEC AM		1.750% 04/10/17 144A	USD	423,538,574 459,863,437 0.77%
電子コネクタ						
	1,100,000	AMPHENOL CORP		4.75% 11/15/14	USD	101,900,457 119,490,588 0.20%
エンジニアリング						
	1,225,000	URS CORP 3.850%		04/01/17 144A	USD	117,806,328 131,264,066 0.22%
	700,000	URS CORP 5.000%		04/01/22 144A	USD	66,479,962 72,587,470 0.12%
						<u>184,286,290 203,851,536 0.34%</u>
金融 - 自動車ローン						
	1,200,000	FORD MOTOR CRED		3.00% 06/12/17	USD	117,617,359 131,192,232 0.22%
	3,100,000	FORD MOTOR CRED		3.875% 01/15/15	USD	298,042,491 336,290,046 0.56%
	2,167,000	FORD MOTOR CRED		4.25% 09/20/22	USD	215,900,796 229,223,182 0.38%
	4,490,000	FORD MOTOR CRED		5.875% 08/02/21	USD	521,113,164 535,852,662 0.89%
	1,400,000	FORD MOTOR CRED		6.625% 08/15/17	USD	141,070,341 170,599,440 0.28%
	1,300,000	FORD MOTOR CREDIT		5.00% 5/15/18	USD	134,045,438 152,351,204 0.25%
	504,000	GEN MOTORS FIN		3.25% 05/15/18 144A	USD	50,523,747 53,105,354 0.09%
	1,376,000	GEN MOTORS FIN		4.25% 05/15/23 144A	USD	134,430,319 137,935,601 0.24%
						<u>1,612,743,655 1,746,549,721 2.91%</u>

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
社債(続き)						
米国(続き)						
金融 - 消費者ローン						
	800,000	AMER EXPRESS CR		1.750% 06/12/15	USD 71,634,874	85,471,304 0.14%
	2,050,000	AMERICAN EXPRES		FXtoFL 09/01/66	USD 209,826,642	230,386,224 0.39%
					<u>281,461,516</u>	<u>315,857,528</u> 0.53%
金融 - 投資銀行						
	1,100,000	E*TRADE FINL		6.00% 11/15/17	USD 117,133,625	123,419,549 0.21%
	100,000	LAZARD GROUP		6.85% 6/15/17	USD 10,813,499	11,859,859 0.02%
	2,267,000	LAZARD GROUP LL		4.25% 11/14/20	USD 224,294,971	238,106,964 0.40%
	563,000	RAYMOND JAMES		5.63% 04/01/24	USD 59,974,876	62,199,097 0.10%
	1,750,000	TD AMERITRADE		4.150% 12/01/14	USD 173,506,835	189,947,101 0.32%
	500,000	TD AMERITRADE		5.600% 12/01/19	USD 52,051,807	60,739,813 0.09%
					<u>637,775,613</u>	<u>686,272,383</u> 1.14%
金融サービス						
	1,454,000	05357HANO		3.74267% 12/5/20	USD 136,124,339	139,355,787 0.23%
				3.3675 % 10/13/		
	517,000	12628QAJ8		16	USD 51,666,396	54,609,298 0.09%
				3.9166%		
	646,822	46638DAG9		11/15/2014	USD 67,334,851	68,750,002 0.12%
					<u>255,125,586</u>	<u>262,715,087</u> 0.44%
食品 - 製菓						
	3,672,000	WM WRIGLEY JR C		2.40%		
				10/21/18 144A	USD 364,933,660	384,010,824 0.64%
	2,519,000	WM WRIGLEY JR C		3.38%		
				10/21/20 144A	USD 250,582,794	262,113,495 0.43%
					<u>615,516,454</u>	<u>646,124,319</u> 1.07%
食品 - 食肉						
	362,000	SUN MERGER SUB		5.25%		
				08/01/18 144A	USD 36,342,992	39,950,411 0.07%
				6.6% DUE		
	2,800,000	TYSON FOODS INC		4/1/2016	USD 288,160,933	328,681,673 0.54%
					<u>324,503,925</u>	<u>368,632,084</u> 0.61%
食品 - 小売						
	239,000	SAFEWAY INC		3.95% 08/15/20	USD 23,989,424	25,147,150 0.04%
	2,796,000	SAFEWAY INC		4.75% 12/01/21	USD 294,754,096	295,580,699 0.49%
					<u>318,743,520</u>	<u>320,727,849</u> 0.53%
ハードウェア						
	1,920,000	FLIR SYSTEMS		3.75% 09/01/16	USD 199,803,266	210,587,441 0.35%
装置						
	407,000	THERMO FISHER		2.40% 02/01/19	USD 41,695,356	42,429,867 0.07%
				3.150%		
	300,000	THERMO FISHER		01/15/23	USD 27,676,490	29,400,350 0.05%
	260,000	THERMO FISHER		3.60% 08/15/21	USD 25,473,181	27,127,265 0.05%
	867,000	THERMO FISHER		4.15% 02/01/24	USD 88,761,586	90,444,414 0.15%
	245,000	THERMO FISHER		5.30% 02/01/44	USD 25,132,368	26,136,703 0.04%
					<u>208,738,981</u>	<u>215,538,599</u> 0.36%

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
社債(続き)						
米国(続き)						
投資運用・投資顧問サービス						
	1,440,000	AMERIPRISE FINL	FXtoFL 06/01/66	USD 142,391,631	168,756,592	0.28%
			5.625%			
	2,546,000	NEUBERGER BERMAN	03/15/20 144A	USD 254,611,364	282,315,190	0.47%
			5.875%			
	2,774,000	NEUBERGER BERMAN	03/15/22 144A	USD 279,594,830	301,765,922	0.50%
				<u>676,597,825</u>	<u>752,837,704</u>	<u>1.25%</u>
生命保険・健康保険						
	3,763,000	PRIMERICA INC	4.75% 07/15/22	USD 385,249,097	408,083,391	0.68%
リネンサプライ						
	358,000	CINTAS CORP NO.	2.85% 06/01/16	USD 35,900,702	38,835,286	0.06%
	500,000	CINTAS CORP NO.	4.30% 06/01/21	USD 49,913,461	54,645,089	0.10%
				<u>85,814,163</u>	<u>93,480,375</u>	<u>0.16%</u>
機械 - 農業						
	1,230,000	CNH CAPITAL LLC	3.63% 04/15/18	USD 119,401,052	131,703,137	0.22%
医療 - ジェネリック薬品						
	1,597,000	ACTAVIS INC	1.88% 10/01/17	USD 157,993,944	166,251,542	0.28%
医薬品						
	1,590,000	ABBVIE INC	1.75% 11/06/17	USD 154,898,915	166,985,099	0.28%
医療 - バイオ・遺伝子						
	1,167,000	LIFE TECH CORP	5.00% 01/15/21	USD 124,856,405	132,998,304	0.22%
	2,566,000	LIFE TECH CORP	6.00% 03/01/20	USD 295,007,166	310,295,674	0.52%
				<u>419,863,571</u>	<u>443,293,978</u>	<u>0.74%</u>
抵当銀行						
	928,000	LBUBS 2007-C2 AM	5.493% 02/15/40	USD 94,407,251	103,225,728	0.17%
複合種目保険						
	900,000	AMER INTL GROUP	4.250% 09/15/14	USD 81,279,677	96,992,662	0.16%
	4,535,000	AMER INTL GROUP	VAR 05/15/58	USD 558,238,615	579,131,192	0.96%
	1,450,000	AMERICAN INTL GROUP	6.25% 03/15/37	USD 140,758,807	153,164,265	0.25%
	1,425,000	ING US INC	FXtoFL 05/15/53	USD 141,953,178	145,693,270	0.25%
				<u>922,230,277</u>	<u>974,981,389</u>	<u>1.62%</u>
石油 およびガス採掘						
	1,341,000	NABORS INDS INC	4.63% 09/15/21	USD 129,533,823	141,337,779	0.24%
	2,235,000	NABORS INDS INC	5.000% 09/15/20	USD 226,412,940	244,785,284	0.41%
				<u>355,946,763</u>	<u>386,123,063</u>	<u>0.64%</u>
石油- 探査および生産						
	5,090,000	CHESAPEAKE ENRG	5.38% 06/15/21	USD 498,418,268	556,383,841	0.93%
	2,000,000	CHESAPEAKE ENRG	6.13% 02/15/21	USD 215,861,201	226,501,280	0.38%
	1,700,000	CIMAREX ENERGY	5.875% 05/01/22	USD 177,237,755	189,845,911	0.32%
	5,722,000	CONTINENTAL RES	5.000% 09/15/22	USD 577,274,365	625,467,257	1.04%

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%	
社債（続き）							
米国（続き）							
石油-探査および生産（続き）							
	1,368,000	DEVON ENERGY	2.25% 12/15/18	USD	139,929,623	142,442,861	0.24%
	600,000	PETROHAWK ENERGY	6.25% 06/01/19	USD	59,523,106	69,653,085	0.12%
	1,130,000	PLAINS EXPLORAT	6.50% 11/15/20	USD	123,350,290	131,223,684	0.22%
	3,228,000	PLAINS EXPLORAT	6.88% 02/15/23	USD	343,465,924	379,992,422	0.63%
	231,000	PLAINS EXPLORATION &	6.625% 05/01/21	USD	23,593,308	26,637,742	0.04%
	1,941,000	PLAINS EXPLORATION &	6.75% 2/01/22	USD	216,355,989	224,877,279	0.37%
	2,574,000	WHITING PETRO	5.00% 03/15/19	USD	258,990,092	277,980,134	0.46%
	500,000	WHITING PETROLEUM	6.5% 10/01/18	USD	47,422,052	56,099,795	0.09%
					<u>2,681,421,973</u>	<u>2,907,105,291</u>	<u>4.84%</u>
石油精製および販売							
	500,000	MOTIVA ENTERPR	5.75% 01/15/20 144A	USD	53,828,795	59,756,556	0.10%
パイプライン							
	3,748,000	DCP MIDSTREAM OPER	3.25% 10/01/15	USD	369,138,048	407,143,717	0.68%
	3,589,000	DCP MIDSTREAM OPER	4.950% 04/01/22	USD	353,771,207	383,559,558	0.64%
	78,000	EL PASO CORP	6.50% 09/15/20	USD	8,070,049	8,832,091	0.01%
	600,000	EL PASO PIPELIN	5.000% 10/01/21	USD	59,113,585	66,362,016	0.11%
	500,000	EL PASO PIPELIN	6.500% 04/01/20	USD	52,549,392	60,615,053	0.10%
	748,000	ENERGY TRAN PTN	4.15% 10/01/20	USD	76,033,712	79,879,033	0.13%
	2,698,000	ENTERPRISE PROD	3.35% 03/15/23	USD	247,920,258	269,895,422	0.45%
	540,000	KINDER MORGAN 5.00%	02/15/21 144A	USD	52,979,405	56,188,340	0.09%
	2,483,000	KINDER MORGAN 5.63%	11/15/23 144A	USD	248,407,872	253,991,228	0.42%
	711,000	KINDER MORGAN 6.000%	01/15/18 144A	USD	68,418,584	82,261,136	0.14%
	500,000	PLAINS ALL AMER	3.950% 09/15/15	USD	46,398,319	55,287,701	0.09%
	289,000	SPECTRA PARTNER	2.95% 09/25/18	USD	28,501,489	30,822,471	0.05%
	1,506,000	SPECTRA PARTNER	4.75% 03/15/24	USD	148,428,113	161,677,874	0.27%
	3,851,000	WESTERN GAS	5.375% 06/01/21	USD	410,418,600	434,264,703	0.72%
	1,500,000	WILLIAMS COS IN	3.700% 01/15/23	USD	137,221,264	137,861,239	0.23%
					<u>2,307,369,897</u>	<u>2,488,641,582</u>	<u>4.13%</u>
不動産管理・サービス							
	500,000	CB RICHARD ELLI	6.625% 10/15/20	USD	47,504,617	56,493,939	0.09%
	1,522,000	JONES LANG LASA	4.400% 11/15/22	USD	144,458,414	153,922,155	0.26%
					<u>191,963,031</u>	<u>210,416,094</u>	<u>0.35%</u>
リート（不動産投資法人） - オフィス							
	2,750,000	ALEXANDRIA REAL	4.600% 04/01/22	USD	269,602,948	291,327,655	0.48%
	719,000	RECKSON OPER	6.00% 03/31/16	USD	76,131,101	81,930,359	0.14%
	500,000	SL GREEN REALTY	5.000% 08/15/18	USD	47,642,355	56,085,028	0.09%
	1,985,000	SL GREEN REALTY	7.750% 03/15/20	USD	225,844,134	245,427,396	0.41%
					<u>619,220,538</u>	<u>674,770,438</u>	<u>1.12%</u>

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
社債(続き)						
米国(続き)						
リート(不動産投資法人)-総合型						
	2,931,000	AMERICAN TOWER 1.55%	03/15/18 144A	USD	283,184,483	301,100,236 0.50%
	689,000	AMERICAN TOWER 3.07%	03/15/23 144A	USD	65,616,307	68,014,300 0.11%
					<u>348,800,790</u>	<u>369,114,536</u> 0.61%
リート(不動産投資法人)-医療関連						
	800,000	SENIOR HOUSING	6.75%	12/15/21	USD	88,954,778 92,970,756 0.15%
小売 - ドラッグストア						
	1,385,000	CVS CAREMARK	2.25%	12/05/18	USD	142,473,062 145,696,638 0.24%
	1,731,000	CVS CAREMARK	4.00%	12/05/23	USD	177,482,678 181,920,749 0.30%
					<u>319,955,740</u>	<u>327,617,387</u> 0.54%
小売 - 地域デパート						
	500,000	MACYS RETAIL HL	5.75%	07/15/14	USD	46,517,876 53,965,848 0.09%
小売 - レストラン						
	2,448,000	BRINKER INTL	3.88%	05/15/23	USD	244,013,192 232,066,241 0.39%
ゴム-タイヤ						
	950,000	CONTL RUBBER 4.500%	09/15/19 144A	USD	101,187,030	106,204,191 0.18%
警備サービス						
	2,114,000	ADT CORP	4.13%	06/15/23	USD	203,391,092 197,572,660 0.33%
ソフトウェアおよびサービス						
	860,000	FISERV INC	3.125%	10/01/15	USD	85,527,861 93,624,919 0.16%
鉄鋼 - 生産						
	417,000	RELIANCE ST&AL	4.50%	04/15/23	USD	41,113,752 43,073,134 0.07%
通信サービス						
	1,500,000	SBA TOWER TRUST	2.933%	12/15/42 144A	USD	139,364,673 160,784,640 0.27%
電話 - 総合						
	1,702,000	SPRINT CAP CORP	6.90%	05/01/19	USD	173,522,858 196,330,364 0.33%
	1,176,000	VERIZON COMM IN	2.50%	09/15/16	USD	118,014,847 127,894,007 0.21%
	2,449,000	VERIZON COMM IN	3.65%	09/14/18	USD	250,370,224 272,771,119 0.45%
	6,749,000	VERIZON COMM IN	5.15%	09/15/23	USD	685,305,070 763,090,039 1.27%
	3,144,000	VERIZON COMM IN	6.40%	09/15/33	USD	326,095,721 381,175,544 0.63%
	1,230,000	VERIZON COMM IN	6.55%	09/15/43	USD	126,015,217 151,789,369 0.25%
					<u>1,679,323,937</u>	<u>1,893,050,442</u> 3.14%
運輸 - トラック						
	1,200,000	JB HUNT TRANSPR	3.38%	09/15/15	USD	124,189,921 130,707,908 0.22%
旅行および宿泊施設						
	1,100,000	STARWOOD HOTELS	7.15%	12/01/19	USD	130,304,043 138,233,132 0.23%

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
社債(続き)						
米国(続き)						
トラック - リース						
	1,200,000	PENSKE TRUCK LE 2.50%	03/15/16 144A	USD	118,930,890	129,287,477 0.22%
		PENSKE TRUCK LE				
	2,300,000	3.375%	03/15/18 144A	USD	219,643,818	248,065,464 0.41%
	1,477,000	PENSKE TRUCK LE 4.25%	01/17/23 144A	USD	154,593,251	151,471,791 0.25%
	178,000	PENSKE TRUCK LE 4.88%	07/11/22	USD	18,675,420	19,226,210 0.03%
					511,843,379	548,050,942 0.91%
その他						
	347,000	RETAIL OPPORTUN	5.00% 12/15/23	USD	35,026,412	36,382,774 0.06%
米国合計						
社債合計						
34,093,934,541 36,842,692,639 61.29%						
ソブリン債(国債・政府機関発行証券)						
米国						
自動車ABS(資産担保証券)他						
	406,000	AMCAR 2013-4 D	3.31% 10/08/19	USD	39,207,924	43,311,056 0.07%
CMBS(商業用不動産担保証券)他						
	286,000	GSMS 2013-NYCS	3.77%, 1/10/18	USD	27,482,350	29,687,737 0.05%
FGLMC 個人向け住宅ローン						
	1,963,222	FG A97626	5% 3/1/41	USD	212,168,161	223,372,658 0.37%
	191,771	FG G11714	5% 6/1/20	USD	19,159,642	21,431,991 0.04%
					231,327,803	244,804,649 0.41%
FNMA個人向け住宅ローン30年						
			5.00%,			
	14,335,240	FANNIE MAE AL2719	07/01/41	USD	1,399,939,185	1,656,044,094 2.75%
	1,457,583	FG G07300	6%, 4/1/40	USD	157,258,855	172,408,471 0.29%
	2,479,829	FG G07428	5.5%, 09/01/41	USD	276,451,901	285,245,028 0.47%
	11,450,763	FN 890527	4.5%, 09/01/42	USD	1,211,291,048	1,277,180,207 2.12%
	454,012	FN 994545	6.00% 10/01/38	USD	48,151,627	54,733,765 0.09%
	5,061,303	FN AD7849	5.00% 06/01/40	USD	553,990,562	579,808,692 0.96%
	1,041,144	FN AD9150	5% 08/01/40	USD	111,886,421	119,242,628 0.20%
	1,792,723	FN AE0972	5% 02/01/41	USD	197,082,317	206,015,818 0.34%
	208,407	FN AH9735	4.50% 04/01/41	USD	21,242,857	23,377,563 0.04%
	590,648	FN AI0611	4.5% 04/01/41	USD	66,697,757	66,041,779 0.11%
	336,994	FN AI2430	4.50% 05/01/41	USD	34,204,094	37,814,231 0.06%
	604,610	FN AI2469	5.00% 05/01/41	USD	65,070,296	69,547,129 0.12%
	2,078,059	FN AI9852	5.00% 09/01/41	USD	219,001,792	238,546,511 0.40%
	4,938,787	FN AL0543	5% 07/01/41	USD	530,197,397	566,413,150 0.94%
	788,848	FN AL1705	4.5% 08/01/41	USD	88,931,641	88,225,853 0.15%

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
ソブリン債(続き)						
米国(続き)						
	818,627	FN AL3453		6% 05/01/37	USD 87,983,187	92,886,253 0.15%
	1,137,797	FN AL3642		4.5% 05/01/41	USD 128,453,504	127,248,537 0.21%
	1,538,479	FN AL3646		5.00% 05/01/41	USD 177,318,767	181,969,651 0.30%
	5,148,869	FN AL3754		5.00% 05/01/41	USD 580,957,241	592,279,641 0.99%
	4,322,243	FN AL3761		4.5% 06/01/41	USD 474,311,104	485,057,519 0.81%
	322,753	FN AL37933		7% 5/1/37	USD 34,267,323	36,374,424 0.06%
	4,792,447	FN AL4045		4.5% 07/01/41	USD 495,411,120	534,981,454 0.89%
	8,020,160	FN AL4469		5.5% 05/01/41	USD 893,120,724	931,999,013 1.56%
	3,191,398	FNCL AL3884		4.50% 01/01/20	USD 341,246,388	356,110,655 0.60%
					<u>8,194,467,108</u>	<u>8,779,552,066</u> 14.61%
FNMA個人向け住宅ローン20年						
	442,449	FN 310119		5% 9/1/29	USD 44,643,709	50,707,125 0.08%
	1,710,076	FN AL2193		5.50% 07/01/25	USD 179,234,577	197,377,121 0.33%
	175,589	FN MA0295		5.00% 01/01/30	USD 17,776,541	20,252,597 0.04%
					<u>241,654,827</u>	<u>268,336,843</u> 0.45%
GNMA個人向け住宅ローン30年						
	2,668,306	GN 782865		5.5%, 06/15/39	USD 286,980,789	317,417,912 0.53%
	989,823	GN 782892		5.5%, 08/15/39	USD 114,419,451	118,343,161 0.20%
	663,606	GN 783758		5.50%, 5/15/39	USD 79,522,886	81,625,623 0.14%
	746,565	GN 783763		5.10%, 12/15/29	USD 82,716,815	87,868,663 0.15%
	917,188	GN 783784		4.90% 12/15/32	USD 99,774,086	105,296,203 0.18%
	6,286,471	GNMA 783411		5.00%, 09/15/41	USD 637,150,353	723,137,811 1.19%
					<u>1,300,564,380</u>	<u>1,433,689,373</u> 2.39%
GNMA2個人向け住宅ローン30年						
	3,546,273	G2 MA0223		5.00%, 7/20/42	USD 375,416,139	405,375,604 0.67%
	167,177	G2 MA0323		6.00% 08/20/42	USD 17,628,128	19,796,908 0.03%
	105,661	G2 MA0397		6.00% 09/20/42	USD 11,166,405	12,500,184 0.02%
	166,251	G2 MA0539		6.00% 11/20/42	USD 17,550,125	19,618,119 0.03%
	5,156,720	G2 MA0788		6.00%, 02/20/43	USD 583,151,855	610,598,754 1.02%
	2,704,671	GINNIE MAE MA0225		6.00% 07/20/42	USD 272,327,285	320,212,391 0.53%
	439,645	GINNIE MAE MA0322		5.50% 07/20/42	USD 48,118,426	51,079,659 0.09%
	3,922,362	GNMA 688021		6.00%, 10/15/38	USD 446,946,435	459,173,404 0.77%
					<u>1,772,304,798</u>	<u>1,898,355,023</u> 3.16%
政府機関						
	2,402,000	US TREASURY N/B		3.625% 08/15/43	USD 233,817,738	238,478,081 0.40%
住宅ローン						
	1,112,597	KSCT 2010		2% 01/25/2020	USD 94,127,433	100,101,653 0.17%

種類	口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%	
ソブリン債（続き）							
米国（続き）							
ソブリン債							
		FLOAT 08/15/26					
	690,000	BHP 2013-BOCA D 144A	USD	68,637,751	72,732,839	0.12%	
	5,053,000	US TREASURY N/B 0.25% 10/31/15	USD	502,344,045	530,379,661	0.88%	
	19,169,000	US TREASURY N/B 0.25% 11/30/15	USD	1,999,161,745	2,010,861,252	3.35%	
	632,000	US TREASURY N/B 0.25% 12/31/15	USD	66,255,107	66,249,933	0.11%	
	1,610,000	US TREASURY N/B 0.75% 06/30/17	USD	147,308,924	167,454,099	0.28%	
	792,000	US TREASURY N/B 0.750% 03/31/17	USD	77,820,106	80,888,962	0.13%	
	549,000	US TREASURY N/B 0.750% 10/31/17	USD	50,195,924	56,665,788	0.09%	
	660,000	US TREASURY N/B 0.750% 12/31/17	USD	60,137,227	67,841,027	0.11%	
	8,302,000	US TREASURY N/B 0.875% 01/31/17	USD	778,625,936	873,536,335	1.45%	
	1,074,000	US TREASURY N/B 0.875% 01/31/18	USD	101,194,849	110,748,611	0.18%	
	68,000	US TREASURY N/B 0.875% 11/30/16	USD	6,282,835	7,170,869	0.01%	
		0.8750%					
	1,021,000	US TREASURY N/B 02/28/17	USD	94,006,712	107,312,208	0.18%	
	622,000	US TREASURY N/B 1.00% 09/30/19	USD	56,175,412	61,731,161	0.10%	
	647,000	US TREASURY N/B 1.000% 09/30/16	USD	59,766,896	68,595,310	0.11%	
	484,000	US TREASURY N/B 1.000% 10/31/16	USD	44,679,816	51,262,272	0.09%	
	6,080,000	US TREASURY N/B 1.25% 10/31/18	USD	604,562,861	626,582,279	1.04%	
	4,883,000	US TREASURY N/B 1.375% 07/31/18	USD	471,351,730	508,676,937	0.85%	
	6,488,000	US TREASURY N/B 1.38% 09/30/18	USD	641,472,302	673,637,277	1.12%	
	29,443,000	US TREASURY N/B 1.500% 08/31/18	USD	2,946,058,360	3,079,133,556	5.12%	
	230,000	US TREASURY N/B 1.750% 10/31/18	USD	21,842,954	24,283,684	0.04%	
	988,000	US TREASURY N/B 2.375% 05/31/18	USD	96,052,225	107,814,935	0.18%	
				8,893,933,717	9,353,558,995	15.54%	
その他							
		HILT 2013-HLT D					
	990,000	4.41%	11/05/30 144A	USD	100,732,493	104,579,529	0.17%
米国合計					21,129,620,571	22,494,455,005	37.42%
ソブリン債（国債・政府機関発行証券）合計					21,129,620,571	22,494,455,005	37.42%
投資有価証券合計					55,223,555,112	59,337,147,644	98.71%

口数	銘柄	通貨	取得原価	時価	対純資産%
為替先渡契約による未実現利益					
71,657,884	USD FW MJPHDJPY	USD	-	79,482,514	0.13%
2,665,885	USD FW MJPHDJPY	USD	-	5,192,590	0.01%
820,141	USD FW MJPHDJPY	USD	-	1,662,577	0.01%
459,609	USD FW MJPHDJPY	USD	-	1,215,339	0.00%
238,470	USD FW MJPHDJPY	USD	-	629,320	0.00%
125,690	USD FW MJPHDJPY	USD	-	342,063	0.00%
666,921	USD SP FUNDLVL	USD	-	96,705	0.00%
19,222	USD FW MJPHDJPY	USD	-	47,565	0.00%
19,051	USD FW MJPHDJPY	USD	-	42,732	0.00%
252,477	USD SP FUNDLVL	USD	-	36,609	0.00%
9,508	USD FW MJPHDJPY	USD	-	23,228	0.00%
33,308	USD SP FUNDLVL	USD	-	833	0.00%
27,970	USD FW MJPHDJPY	USD	-	585	0.00%
為替先渡契約による未実現利益合計			-	88,772,660	0.15%
為替先渡契約による未実現損失					
(27,950)	USD SP FUNDLVL	USD	-	(1,257)	(0.00%)
(744,508)	USD SP FUNDLVL	USD	-	(33,501)	(0.00%)
(105,480)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(39,811)	(0.00%)
(253,104)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(41,111)	(0.00%)
(91,263)	USD FW YJPHDJPY	USD	-	(71,726)	(0.00%)
(48,707)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(149,008)	(0.00%)
(59,172)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(182,336)	(0.00%)
(107,459)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(236,784)	(0.00%)
(135,738)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(286,080)	(0.00%)
(204,948)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(444,468)	(0.00%)
(227,836)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(468,201)	(0.00%)
(191,083)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(489,933)	(0.00%)
(142,576)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(515,069)	(0.00%)
(74,178,464)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(83,201,051)	(0.14%)
(76,977,190)	USD FW MJPHDJPY	USD	-	(304,397,872)	(0.51%)
為替先渡契約による未実現損失合計			-	(390,558,208)	(0.65%)
為替先渡契約による未実現損失の純額			-	(301,785,548)	(0.50%)

財務諸表に関する注記（2013年12月31日現在）

*** 訳者注** 財務諸表に関する注記は原文の翻訳を抜粋したものです。

注2 重要な会計方針

当ファンドは米国における一般会計原則(「U.S. GAAP」)を適用しており、重要な会計方針の概要は下記の通りです。

予測

財務諸表は米国における一般会計原則に準拠して作成されますが、経営者はその作成にあたり、財務諸表の作成日付時点での資産と負債の金額、および報告期間中の収益と費用の金額に影響をおよぼす予測と仮定を策定することが要求されます。実際の結果が予測と異なる場合があります。

機能通貨

当ファンドによる実績の報告、発行および償還は日本円建てにて行います。

現金および現金等価物

現金および現金等価物には要求に応じて銀行から支払われる満期支払高、外貨、および3ヶ月以内満期の有利子預金を含みます。2013年12月31日現在、当ファンドの所有する現金等価物は609,817,811円（取得原価：607,468,016円）です。

有価証券取引および投資収益

有価証券取引は取引日ベースで記録することとします。取引による実現損益は先入先出(「FIFO」)ベースで記録されます。配当収入は配当落ち期日で計上されますが、必要な場合には配当に関わる源泉徴収税も含めます。受取利息には投資ディスカウントやプレミアムの増加を含みますが、実効金利法を用いて計上します。

投資の評価

投資有価証券の評価は、その証券の主たる市場となっている証券取引所もしくは市場における入手可能な直近の終値、あるいは当該国の証券市場における直近の取引値の平均を用いることとします。当該有価証券の取引値が入手不可能、あるいは有価証券に市場性がない場合、受託会社の採用する手順に従い投資顧問の助言を取り入れ、誠意を持って公正価値で評価されます。債券価格は外部の価格サービス機関からの取引値情報に基づき算定します。外部の価格サービス機関からの取引値は、取引相場価格に基づくか、取引相場価格がない場合はディーラー相場価格あるいはマトリックス価格に基づいて算定されます。上記はすべて入手可能な市場ベースの観察可能なインプットによるものです。

外貨換算

外貨建ての資産および負債は財務諸表作成日における優勢な為替レートを元に換算します。外貨建ての取引は、取引日における優勢な為替レートを元に換算されます。

当ファンドは為替の変動による投資の損益を時価の変動によるものから分けていません。このような変動は投資による実現および未実現損益の純額の一部として計上しています。

一部の契約に関する金額の相殺

当ファンドは、同じマスター・ネットリング契約の下、同じ取引相手先との間で、受入および差入現金担保の公正価値とデリバティブのポジションの公正価値の金額を相殺しないことを選択しました。

分配金

当ファンドによる分配金支払は、米ドル建て為替ヘッジなし・毎月決算クラスおよび米ドル建て為替ヘッジなし・年1回決算クラスについては米ドルで、日本円建て為替ヘッジなし・毎月決算クラス、日本円建て為替ヘッジなし・年1回決算クラス、日本円建て日本円ヘッジあり・毎月決算クラス、日本円建て日本円ヘッジあり・年1回決算クラス、および日本円建て年2回決算クラスについては日本円で行います。受託会社により承認された分配金は、純投資収益があればその総額、実現キャピタルゲインがあればその純額、および各クラスの未実現キャピタルゲインがあればその増額分の総計を原資として当ファンドが月次で支払いますが、その対象となる期間は、米ドル建て為替ヘッジなし・年1回決算クラス、日本円建て為替ヘッジなし・年1回決算クラスおよび日本円建て日本円ヘッジあり・年1回決算クラスについては、前年度の前の12ヶ月の最終営業日の翌日から前年度の最終営業日までの期間、米ドル建て為替ヘッジなし・毎月決算クラス、日本円建て日本円ヘッジあり・毎月決算クラスおよび日本円建て為替ヘッジなし・毎月決算クラスについては前々月の最終営業日の翌日から前月の最終営業日までの期間、日本円建て為替ヘッジなし・年2回決算クラスについては、直前6ヶ月間の前の6ヶ月の最終営業日の翌日から直前6ヶ月の最終営業日までの期間とします。受託会社が妥当な分配金を維持するのに必要と判断した場合、追加の分配金を申告することができます。2012年12月28日から2013年12月31日の期間中の分配金として、1,604,886,543円が受益者に支払われました。

償還金

U.S. GAAPによると払戻通知で要求された金額が確定した時点で償還金は負債として計上されます。通常、このような計上は要求の内容によって、払戻通知の受領時あるいは会計年度の最終日に行われます。2013年12月31日現在、未払償還金は261,601,600円でした。

2【ファンドの現況】

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 2ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

平成27年2月27日現在

資産総額	1,458,769,201円
負債総額	62,382,754円
純資産総額（ - ）	1,396,386,447円
発行済数量	1,215,257,539口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1490円

（参考）

D I A Mマネーマーケットマザーファンド

平成27年2月27日現在

資産総額	18,423,205円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	18,423,205円
発行済数量	18,381,025口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0023円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

(1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

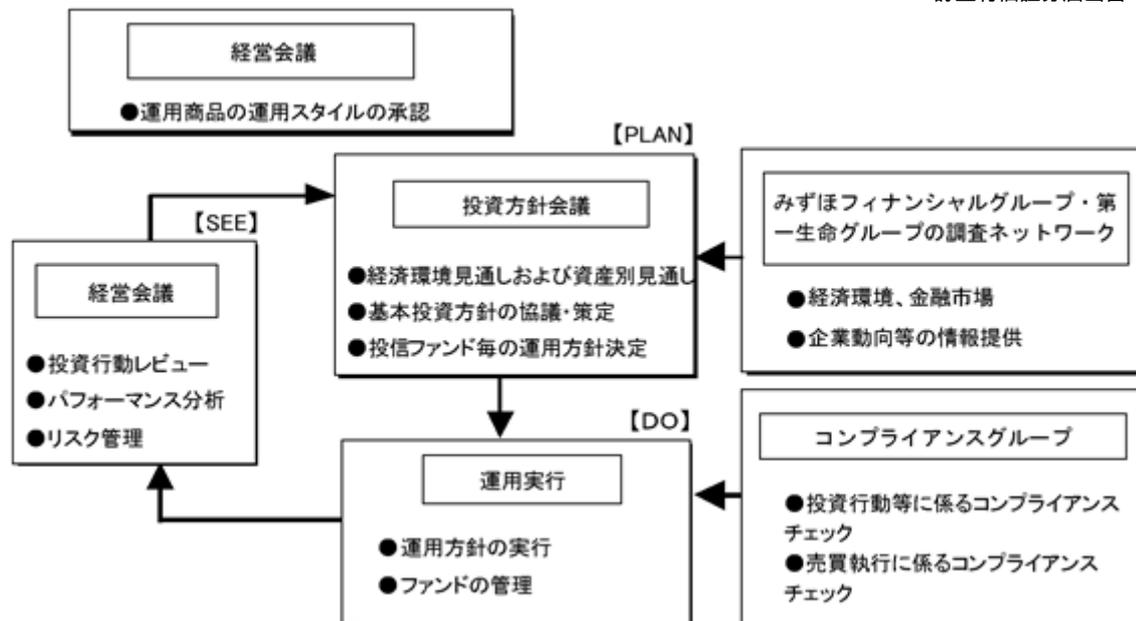
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成27年2月27日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

平成27年2月27日現在、委託会社の運用する投資信託は353本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	7	20,669,998,430
追加型株式投資信託	323	5,754,565,009,705
単位型公社債投資信託	23	201,073,975,137
追加型公社債投資信託	0	0
合計	353	5,976,308,983,272

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

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

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

3．委託会社は、第29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	10,806,745	11,487,360
金銭の信託	10,214,440	10,952,459
前払費用	69,143	64,554
未収委託者報酬	3,073,481	3,854,410
未収運用受託報酬	1,173,744	1,415,502
未収投資助言報酬	2 245,819	2 255,218
未収収益	244,974	275,082
繰延税金資産	426,229	401,327
その他	25,354	23,246
流動資産計	26,279,933	28,729,163
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 142,820	1 122,181
車両運搬具	1 2,770	1 1,615
器具備品	1 231,732	1 140,023
建設仮勘定	1,207	29,509
無形固定資産		
商標権	1 289	1 195
ソフトウェア	1 1,261,335	1 1,188,444
ソフトウェア仮勘定	68,920	642,834
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 292	1 231
投資その他の資産		
投資有価証券	4,002,042	4,178,284
関係会社株式	400,579	617,159
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	661,777	622,698
差入保証金	731,564	731,197
その他	89,047	88,154
固定資産計	5,718,557	6,310,469
資産合計	31,998,491	35,039,633

（単位：千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	571,153	760,493
未払金	1,547,527	1,972,562
未払収益分配金	48	-
未払償還金	84,932	51,109
未払手数料	1,195,452	1,554,065
その他未払金	267,093	367,387
未払費用	2 1,306,837	2 1,466,924
未払法人税等	1,299,068	1,721,861
未払消費税等	116,872	195,272
賞与引当金	724,974	668,366
その他	100,000	10,000
流動負債計	5,666,434	6,795,481
固定負債		
退職給付引当金	802,603	947,759
役員退職慰労引当金	98,510	136,010
固定負債計	901,113	1,083,769
負債合計	6,567,548	7,879,251
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	20,898,697	22,488,744
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	16,330,000	17,130,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,945,403	4,735,451
株主資本計	25,327,175	26,917,222
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	103,768	243,159
評価・換算差額等計	103,768	243,159
純資産合計	25,430,943	27,160,381
負債・純資産合計	31,998,491	35,039,633

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第28期 （ 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日 ）		第29期 （ 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日 ）	
	営業収益			
委託者報酬	23,374,427		25,437,511	
運用受託報酬	5,374,163		6,328,414	
投資助言報酬	885,923		926,837	
その他営業収益	715,164		835,020	
営業収益計		30,349,678		33,527,783
営業費用				
支払手数料	10,846,568		11,284,530	
広告宣伝費	177,553		316,226	
公告費	3,769		319	
調査費	4,546,312		5,226,606	
調査費	3,001,788		3,635,440	
委託調査費	1,544,523		1,591,166	
委託計算費	341,978		356,496	
営業雑経費	456,677		540,260	
通信費	25,513		32,834	
印刷費	374,775		466,075	
協会費	25,492		25,048	
諸会費	42		38	
支払販売手数料	30,854		16,264	
営業費用計		16,372,860		17,724,440
一般管理費				
給料	4,870,759		5,009,676	
役員報酬	242,014		255,603	
給料・手当	4,035,751		4,171,884	
賞与	592,994		582,188	
交際費	36,212		34,917	
寄付金	2,693		2,515	
旅費交通費	187,653		232,436	
租税公課	95,064		103,775	
不動産賃借料	675,811		683,633	
退職給付費用	173,065		221,376	
固定資産減価償却費	524,750		561,503	
福利厚生費	26,642		32,812	
修繕費	6,018		9,184	
賞与引当金繰入額	724,974		668,366	
役員退職慰労引当金繰入額	47,820		47,298	
役員退職慰労金	7,200		6,528	
機器リース料	35		35	
事務委託費	224,066		215,100	
事務用消耗品費	60,044		67,394	
器具備品費	2,065		3,191	
諸経費	159,247		118,672	

一般管理費計		7,824,126		8,018,417
営業利益		6,152,691		7,784,925

（単位：千円）

	第28期		第29期	
	（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）		（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	10,223		15,024	
受取利息	3,554		2,318	
時効成立分配金・償還金	2,080		33,872	
金銭の信託運用益	168,444		-	
雑収入	4,957		4,746	
営業外収益計		189,260		55,962
営業外費用				
為替差損	6,549		7,364	
金銭の信託運用損	-		213,744	
雑損失	-		10,952	
営業外費用計		6,549		232,061
経常利益		6,335,402		7,608,826
特別損失				
固定資産除却損	1	1,752	1	22
固定資産売却損	2	115	2	1,448
特別損失計		1,868		1,470
税引前当期純利益		6,333,533		7,607,355
法人税、住民税及び事業税		2,573,893		2,934,516
法人税等調整額		134,463		13,207
法人税等合計		2,439,430		2,921,308
当期純利益		3,894,102		4,686,047

(3) 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	15,630,000	300,000	200,000	3,463,300	19,716,594	24,145,072
当期変動額									
剰余金の 配当							2,712,000	2,712,000	2,712,000
別途積立金 の積立				700,000			700,000	-	-
当期純利益							3,894,102	3,894,102	3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	700,000	-	-	482,102	1,182,102	1,182,102
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	136,143	24,281,215
当期変動額		
剰余金の 配当		2,712,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	32,375	32,375
当期変動額 合計	32,375	1,149,727
当期末残高	103,768	25,430,943

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の 配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金 の積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の 配当		3,096,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	139,391	139,391
当期変動額 合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

重要な会計方針

項目	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

（1）概要

財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。

（2）適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正により財務諸表に与える影響額については、現在評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
建物	539,393	562,127
車両運搬具	2,152	3,308
器具備品	565,794	664,016
商標権	649	742
ソフトウェア	1,071,133	1,502,289
電信電話専用施設利用権	1,304	1,365

2. 関係会社項目

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

(千円)

		第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	241,190	255,084
流動負債	未払費用	334,888	392,646

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	-	22
ソフトウェア	1,752	0

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	115	1,448

(株主資本等変動計算書関係)

第28期(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成26年6月30日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,806,745	10,806,745	-
(2) 金銭の信託	10,214,440	10,214,440	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	320,332	320,332	-
資産計	21,341,518	21,341,518	-
(1) 未払法人税等	1,299,068	1,299,068	-
負債計	1,299,068	1,299,068	-

第29期（平成26年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
差入保証金	731,564	731,197

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第28期(平成25年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	10,806,412	-	-	-
合計	10,806,412	-	-	-

第29期(平成26年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第28期及び第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

4. その他有価証券

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	307,639	146,101	161,537
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	8,688	10,000	1,312
小計	8,688	10,000	1,312
合計	320,332	159,101	161,231

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

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,214,440	946,377

第29期（平成26年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（千円）

（1）退職給付債務	936,125
（2）未認識数理計算上の差異	133,522
退職給付引当金	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

(1) 勤務費用	102,125
(2) 利息費用	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	41,923
(5) その他	314
退職給付費用	173,065

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

1.5%

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

5年（各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理する方法）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

退職給付債務の期首残高	936,125
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の発生額	14,996
退職給付の支払額	34,684
過去勤務費用の発生額	24,260
退職給付債務の期末残高	1,079,828

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828
未積立退職給付債務	1,079,828
未認識数理計算上の差異	112,660
未認識過去勤務費用	19,408
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759
退職給付引当金	947,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の費用処理額	35,858
過去勤務費用の費用処理額	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第28期	第29期
	(平成25年3月31日現在)	(平成26年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	107,022	123,518
未払事業所税	5,986	5,841
賞与引当金	275,562	238,205
未払法定福利費	34,566	31,036
未払確定拠出年金掛金	3,091	2,724
減価償却超過額（一括償却資産）	5,192	3,183
減価償却超過額	159,737	152,470
繰延資産償却超過額（税法上）	27,873	10,908
退職給付引当金	286,796	337,781
役員退職慰労引当金	35,109	48,474
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	22,907	-
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	109	-
繰延税金資産合計	1,088,007	1,078,198
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	54,172
繰延税金負債合計	-	54,172
差引繰延税金資産の純額	1,088,007	1,024,025

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の関係会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務 1名, 出向 2名, 転籍 3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,289	未収投資 助言報酬	203,114

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	520,967	未払 費用	175,664
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	214,290	未払 費用	89,815

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	1,661,638 191,782 106	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	142,323 625,561 -
	株式会社 みずほ コーポ レート銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の引出 (純額) 受取利息	460,605 1,912,442 3,210	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	100,875 9,527,582 61
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	259,435 11,140	未払 費用 未払 費用	132,250 5,848
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額) 信託報酬の 支払	3,500,000 5,908	金銭の 信託	10,214,440

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(注7) 株式会社みずほ銀行は平成25年7月1日付で株式会社みずほコーポレート銀行(株式会社みずほ銀行に商号変更)に吸収合併されており、合併後の取引については吸収合併後の株式会社みずほ銀行(旧株式会社みずほコーポレート銀行)に引き継いでおります。

(1株当たり情報)

	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	1,059,622円64銭	1,131,682円58銭
1株当たり当期純利益金額	162,254円29銭	195,251円97銭

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

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

	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計方針の変更

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
1. 固定資産の減価償却累計額	建物	571,893千円
	車両運搬具	3,645千円
	器具備品	690,539千円
	商標権	789千円
	ソフトウェア	1,737,240千円
	電信電話専用施設利用権	1,386千円

(中間損益計算書関係)

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
1. 減価償却実施額	有形固定資産	36,625千円
	無形固定資産	235,019千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

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

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

（有価証券関係）

第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

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

3. その他有価証券

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

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

（金銭の信託関係）

第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

1. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第30期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第30期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,143,981円	89銭
1株当たり中間純利益金額	105,117円	43銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

（注1）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

（重要な後発事象）

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

独立監査人の中間監査報告書

平成27年4月15日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているUSストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型の平成26年8月26日から平成27年2月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型の平成27年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年8月26日から平成27年2月25日まで）の損益の状況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

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、公認会計士の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成26年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。