

# DIAM高格付インカム・オープンSRI (毎月決算コース) 〈愛称:ハッピークローバーSRI〉

追加型投信／内外／資産複合

## DIAMアセットマネジメント

本書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。

〈委託会社〉[ファンドの運用の指図を行う者]  
DIAMアセットマネジメント株式会社  
金融商品取引業者登録番号/関東財務局長(金商)第324号

〈受託会社〉[ファンドの財産の保管および管理を行う者]  
みずほ信託銀行株式会社

ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)を含む詳細な情報は下記委託会社への照会先までお問い合わせください。投資信託説明書(請求目論見書)は、委託会社のホームページで閲覧できる他、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。また、本書には約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は投資信託説明書(請求目論見書)に添付されております。

委託会社への照会先

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

【ホームページ】 <http://www.diam.co.jp/>

| 商品分類    |        |               | 属性区分                                  |              |                  |           |       |
|---------|--------|---------------|---------------------------------------|--------------|------------------|-----------|-------|
| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産(収益の源泉) | 投資対象資産                                | 決算頻度         | 投資対象地域           | 投資形態      | 為替ヘッジ |
| 追加型     | 内外     | 資産複合          | その他資産<br>(投資信託証券(資産複合(株式、債券)資産配分固定型)) | 年12回<br>(毎月) | グローバル<br>(日本を含む) | ファミリーファンド | なし    |

※上記の分類は、社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。  
商品分類および属性区分の定義については、投資信託協会ホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)にてご確認ください。

#### <委託会社の情報>

委託会社名 DIAMアセットマネジメント株式会社

設立年月日 1985年7月1日

資本金 20億円

運用する投資信託財産の  
合計純資産総額 4兆109億円

(2011年12月30日現在)

- 「DIAM高格付インカム・オープンSRI(毎月決算コース)<愛称:ハッピークローバーSRI>」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2012年3月5日に関東財務局長に提出しており、2012年3月6日にその効力が発生しております。
- 当ファンドは、商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- 当ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法に基づき受託会社の固有財産等との分別管理等がされています。
- 販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- ファンドの販売会社、ファンドの基準価額等については、前記の委託会社への照会先までお問い合わせください。
- ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

# 1. ファンドの目的・特色

## ファンドの目的

安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

## ファンドの特色

実質的に、比較的高金利の期待できる高格付資源国※1の公社債および積極的にCSR(企業の社会責任)※2へ取り組むわが国の上場企業の株式へ投資を行い、安定的な収益の確保ならびに信託財産の着実な成長をめざします。

高格付資源国の公社債への投資はDIAM高格付インカム・オープン・マザーファンドを通じて行います。  
また、わが国の上場株式への投資はDIAM SRI・マザーファンドを通じて行います。

※1 当ファンドにおいて「資源国」とは、「石油、鉱物資源、ガス、石炭等の資源を産出する国で、その資源がその国の経済もしくは世界経済に影響を与えると考えられる国」と定義します。

※2 「CSR」とは、Corporate Social Responsibilityの略です。また、CSR(企業の社会責任)を重視して投資することをSRI(Socially Responsible Investment 社会責任投資)といいます。



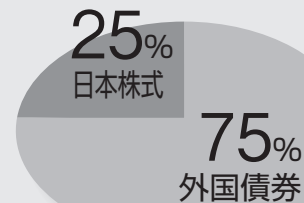
### 分散効果が期待できます。

資産分散効果と通貨分散効果が期待できます。

各マザーファンドの基本配分は、原則として下記の組入比率とします。

外国債券…純資産総額の75%  
(DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド)

日本株式…純資産総額の25%  
(DIAM SRI・マザーファンド)



※時価の変動などにより各マザーファンドの時価構成比が基本配分から乖離した場合には、定期的に基本配分に修正します。  
※上記の基本配分は、市場動向等を勘案し、変更する場合があります。



### 健全性を重視します。

- 外国債券については、国債を中心とした信用度の高いAA格以上(海外格付機関S&P社又はMoody's社のどちらか高い方の格付を採用。)の格付を取得している、流動性の高い公社債に実質的に投資します。
- 日本株式については、企業のCSR(企業の社会責任)評価で国内の先駆的存在である株式会社インテグレックス(以下インテグレックス社という場合があります。)によるスクリーニングを通して、「社会と共生」しながら「持続的成長」をするための「競争力」を持つ企業へ実質的に投資します。



毎月5日(休業日の場合は翌営業日。)に決算を行い、原則として利子・配当等収益の範囲内で分配を行います。また、売買益(評価益を含みます。)等については、毎年6月、12月の決算時に原則として分配を行います。

[収益分配のイメージ]



- ・上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

※「分配金自動いぞく投資コース」の場合、収益分配金は、税引後、自動的に無手数料で全額再投資されます。ただし、別途「定期引出契約」のお申込みをしていただくことにより、分配金を再投資せずに受取ることができる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

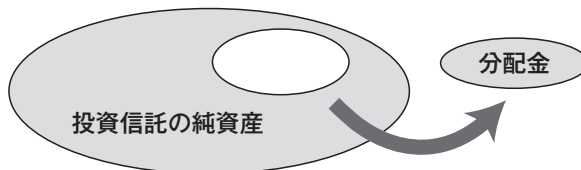
資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

# 1. ファンドの目的・特色

## 投資信託の収益分配金に関するご説明

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

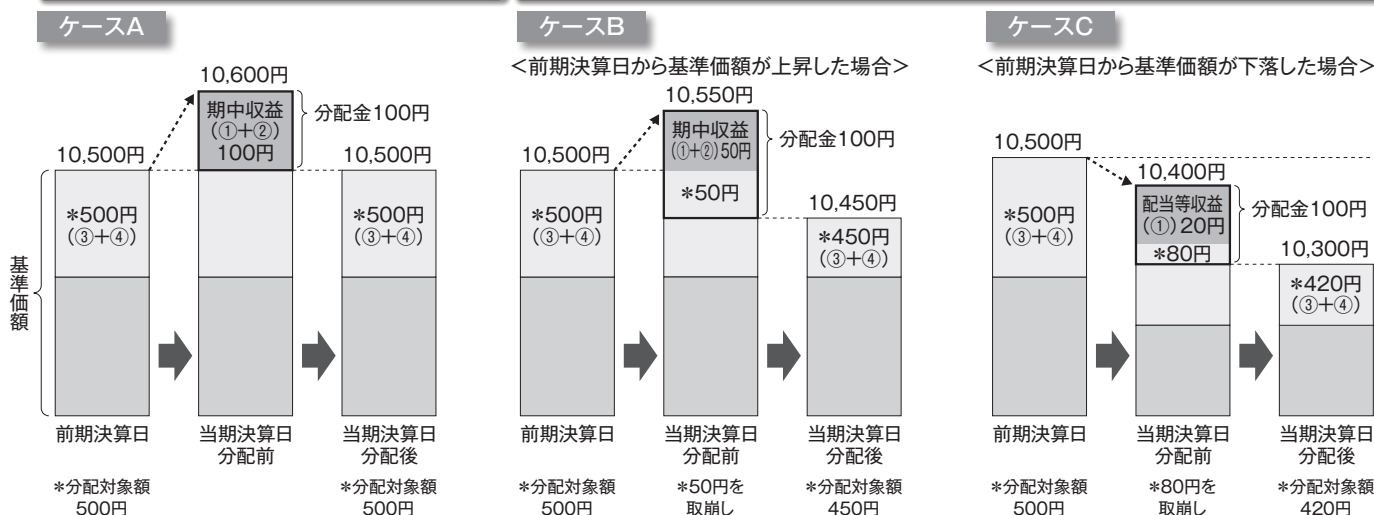
### 分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

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

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

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

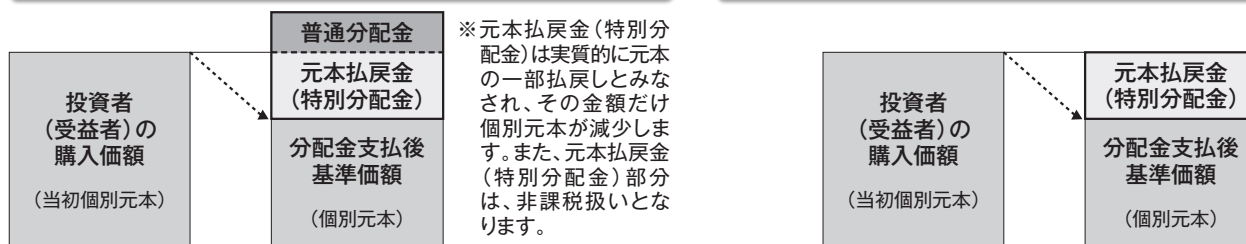
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

（注）普通分配金に対する課税については、後掲「手続・手数料等」の「ファンドの費用・税金」をご参照ください。

# 1. ファンドの目的・特色



実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

## DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンドについて

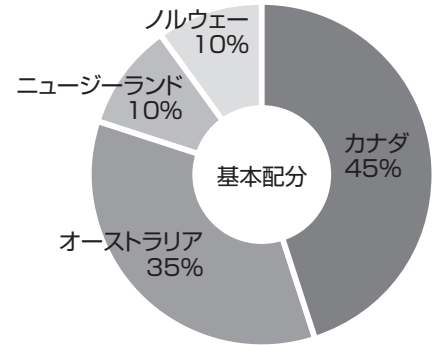
※DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンドを通じて外国の債券への投資を行います。

比較的高金利の期待できる資源国に投資します。

主な投資対象国は、カナダ、オーストラリア、ニュージーランド、ノルウェーです。  
 ※投資対象国は、信用力、金利・為替の見直し等により変更となる場合があります。

- 国別資産配分比率は、市場規模、経済規模、市場動向等を勘案し、右グラフの資産配分比率を基本とします。
- 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

国別資産配分比率



※2011年12月末現在  
 ※上記比率は、今後の市場規模、経済規模、市場動向等の変化などにより変更となる場合があります。

## 信用力重視

国債を中心とした信用度の高いAA格以上(海外格付機関S&P社又はMoody's社のどちらか高い方の格付を採用。)の格付を取得している、流動性の高い公社債に投資します。

## DIAM SRI・マザーファンドについて

※DIAM SRI・マザーファンドを通じてわが国の株式への投資を行います。

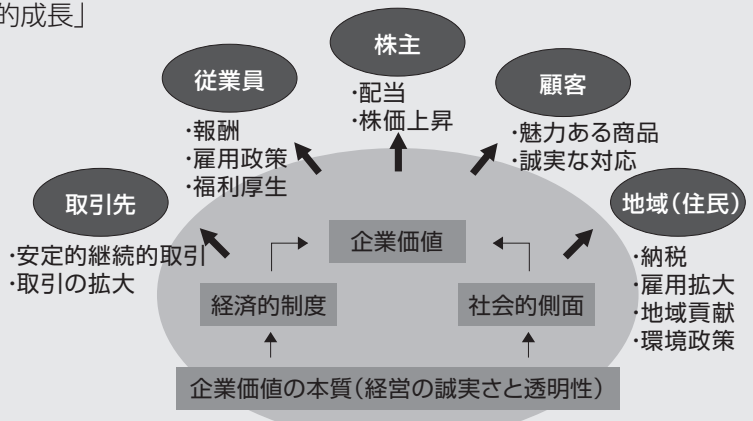
わが国の株式の中でも、積極的にCSR(企業の社会責任)へ取り組み、持続的な成長が期待できる上場企業の株式へ投資します。

インテグレックス社の考えるCSR(企業の社会責任)とは  
 ~3つのキーワード「社会との共生」「競争力」「持続的成長」

- 1 社会との共生**  
 投資家、消費者、従業員など企業にかかわるさまざまな利害関係者(ステークホルダー)と共に生き、
- 2 競争力**  
 社会から信頼を得ること
- 3 持続的成長**  
 企業も社会も持続的に成長するための…

### 企業理念の実現化

(そのための経営・組織の誠実さと透明性)であると考えます。



企業理念とは、通常、企業が社会の中でめざしていることが明文化されたものです。社会を無視したり否定したりした理念を掲げている企業はなく、「企業理念の実現化=社会との共生」につながると考えられます。

### インテグレックス社について

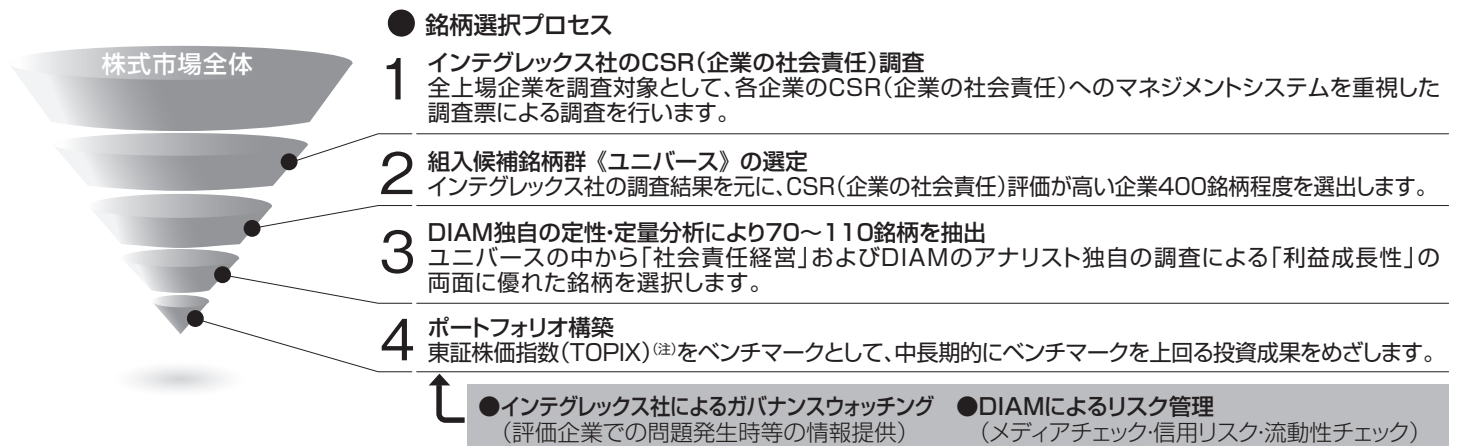
- 社名:株式会社インテグレックス
  - 代表取締役社長:秋山 をね
  - 設立:2001年6月
  - 資本金:6,000万円
  - 事業内容:社会責任投資(SRI)のための調査、企業社会責任(CSR)の推進支援
  - 金融機関、事業会社と資本関係を持たない中立的な調査会社。
- (2012年1月16日時点)

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

# 1. ファンドの目的・特色

投資銘柄の選定にあたっては、株式会社インテグレックスの投資助言を受けます。

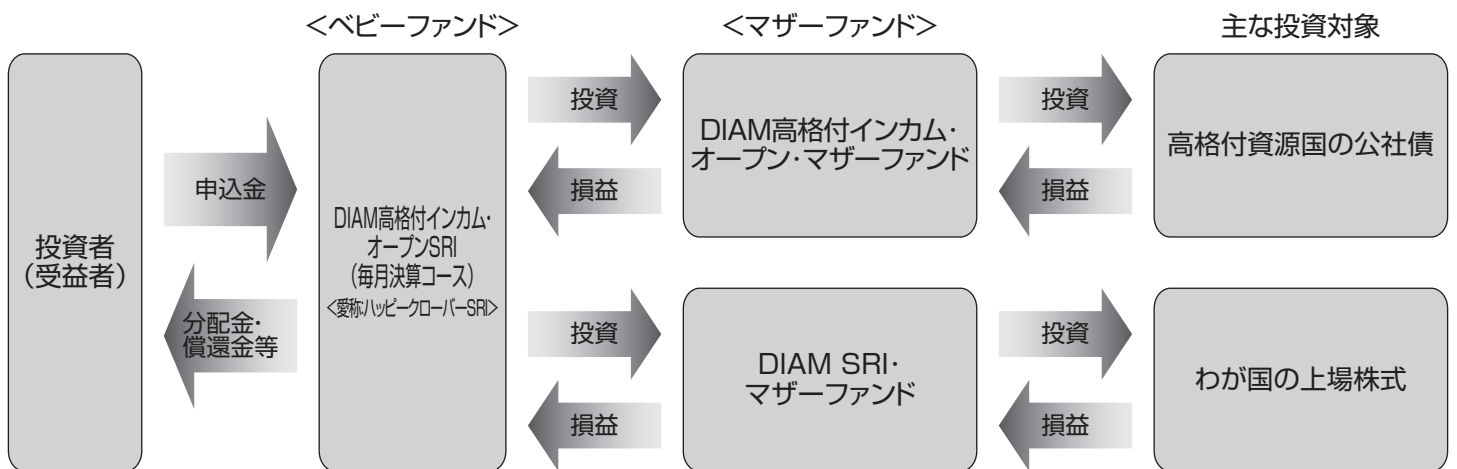
ポートフォリオ構築は、CSR(企業の社会責任)評価と個別銘柄の投資価値を勘案し、以下のプロセスによって行います。



(注)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。

## ファンドの仕組み

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



## 主な投資制限

- ①マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- ③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ④新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ⑤マザーファンド以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

# 1. ファンドの目的・特色

## マザーファンドの概要

| DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド   |
|--|
| 主要投資対象   |
| 高格付資源国 <sup>※1</sup> の公社債  |
| 投資態度   |
| <ul style="list-style-type: none"><li>・主に高格付資源国の公社債<sup>*</sup>に投資し、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。<br/>*これらの公社債には、同国通貨建ての国際機関債を含みます。</li><li>・投資対象となる国は、委託会社が定義した「資源国」の中から、信用力・金利・為替見通し等を判断材料とし、選定します。</li><li>・投資対象となる公社債は、国債を中心にAA格以上<sup>※2</sup>の格付を取得しているとともに、流動性の高い銘柄とします。</li><li>・国別の投資配分比率は、各国の市場規模・経済規模等を勘案し、決定します。</li><li>・外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li></ul> |
| <p>※1:当マザーファンドにおいて「資源国」とは、「石油、鉱物資源、ガス、石炭等の資源を産出する国で、その資源がその国の経済もしくは世界経済に影響を与えると考えられる国」と定義します。</p> <p>※2:格付機関はMoody's社またはS&amp;P社とし、両社が格付を付与している場合には、どちらか高い方の格付とします。</p>  |

| DIAM SRI・マザーファンド  |
|---|
| 主要投資対象  |
| わが国の上場株式  |
| 投資態度  |
| <ul style="list-style-type: none"><li>・TOPIX(東証株価指数)をベンチマークとして中長期的に同指数を上回る投資成果をめざします。</li><li>・組入れ銘柄選定に当たっては、CSR(企業の社会責任)への取組みに着目して、持続的な成長が期待できる銘柄に投資します。</li><li>・当ファンドでは、株式会社インテグレックスからの投資助言に基づき、CSR評価の高い企業を選出し、投資ユニバースとします。</li><li>・アナリストによる定性・定量分析情報を活用し、当該投資ユニバースから「社会的責任経営」および「利益成長性」の両面に優れた企業を選択し、ポートフォリオを構築します。</li><li>・株式の組入比率は原則として高位を保ちます。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等、やむを得ない事情が発生した場合には組入比率を引き下げる場合があります。</li></ul> |

○各マザーファンドの主な投資制限については、請求目論見書または約款に記載しております。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## 2.投資リスク

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

**基準価額の変動要因** ※基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

### 債券投資リスク

当ファンドでは実質的に公社債に投資します。公社債では、一般的に次に掲げるリスクがあります。

#### 1)金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に、金利が上昇すると債券の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

#### 2)信用リスク

信用リスクとは、公社債の発行者が経営不振、その他の理由により利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる(債務不履行)リスクをいいます。一般的に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合等には、当該公社債の価格は下落し(価格がゼロになることもあります。)、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

### 株式投資リスク

当ファンドでは実質的に株式に投資します。株式には一般的に次に掲げるリスクがあります。

#### 1)株価変動リスク

株式の価格は、一般に大きく変動します。株式市場の変動により、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### 2)個別銘柄選択リスク

当ファンドは、実質的に個別銘柄の選択による投資を行いますので、株式市場全体の動向から乖離する場合があります。個別銘柄選択リスクとは、投資した株式の価格変動によっては収益の源泉となる場合もありますが、株式市場全体の動向にかかわらず基準価額が下がる要因となる可能性があるリスクをいいます。

#### 3)信用リスク

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

### 為替リスク

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。

一般に外国為替相場が対円で下落(円高)になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがって、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落(円高)度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に大きく影響します。

### 流動性リスク

当ファンドは、実質的に市場規模が小さい債券や株式等に投資する場合があります。そのような市場では、資産規模や取引量が少ないため売却時に市場実勢から期待される価格で売却できなかつたり、売買取引が困難となることから、価格の値動きが大きくなる場合があります。基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

## 2.投資リスク

### 分配金に関する留意点

- 収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。
- 分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

### その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- 当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。
- 投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合または新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落する要因となる場合があります。

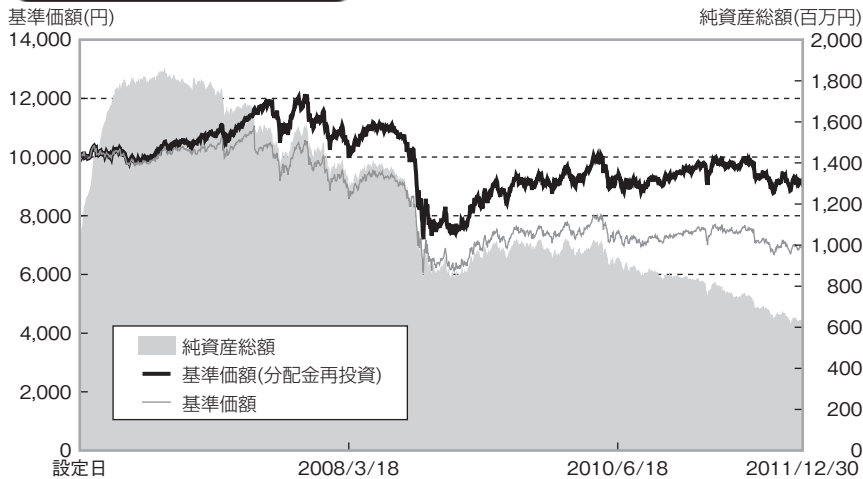
### リスクの管理体制

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

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

## 基準価額・純資産の推移

(設定日(2005年12月22日)~2011年12月30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:2005年12月22日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

|                   |        |
|-------------------|--------|
| 第66期 (2011.08.05) | 20円    |
| 第67期 (2011.09.05) | 20円    |
| 第68期 (2011.10.05) | 20円    |
| 第69期 (2011.11.07) | 20円    |
| 第70期 (2011.12.05) | 20円    |
| 直近1年間累計           | 240円   |
| 設定来累計             | 2,545円 |

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

### 組入銘柄一覧

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名                      | 投資比率(%) |
|----|--------------------------|---------|
| 1  | DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド | 74.74   |
| 2  | DIAM SRI・マザーファンド         | 24.13   |

### DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### ポートフォリオの状況

| 資産の種類               | 国名       | 投資比率(%) |
|---------------------|----------|---------|
| 国債証券                | カナダ      | 10.96   |
|                     | ノルウェー    | 5.63    |
|                     | ニュージーランド | 4.82    |
|                     | オーストラリア  | 3.01    |
|                     | 小計       | 24.43   |
| 地方債証券               | カナダ      | 17.63   |
|                     | 国際機関     | 23.25   |
| 特殊債券                | オーストラリア  | 10.69   |
|                     | ノルウェー    | 3.92    |
|                     | カナダ      | 0.14    |
|                     | 小計       | 38.00   |
| 社債券                 | カナダ      | 9.27    |
|                     | オーストラリア  | 8.36    |
|                     | 小計       | 17.63   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |          | 2.32    |
| 合計(純資産総額)           |          | 100.00  |

#### 組入上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名                           | 種類    | 国名       | 利率(%) | 償還期限       | 投資比率(%) |
|----|-------------------------------|-------|----------|-------|------------|---------|
| 1  | ONTARIO PROVINCE 4.2 06/02/20 | 地方債証券 | カナダ      | 4.20  | 2020/6/2   | 3.25    |
| 2  | CANHOU 4.55 12/15/12          | 社債券   | カナダ      | 4.55  | 2012/12/15 | 3.21    |
| 3  | ONTARIO PROVINCE 4.4 06/02/19 | 地方債証券 | カナダ      | 4.40  | 2019/6/2   | 3.01    |
| 4  | NEW S WALES 6.0 04/01/19      | 特殊債券  | オーストラリア  | 6.00  | 2019/4/1   | 2.58    |
| 5  | ONTARIO PROVINCE 4.3 03/08/17 | 地方債証券 | カナダ      | 4.30  | 2017/3/8   | 2.35    |
| 6  | CANADA 8.0 06/01/27           | 国債証券  | カナダ      | 8.00  | 2027/6/1   | 2.25    |
| 7  | NEW ZEALAND 6.0 12/15/17      | 国債証券  | ニュージーランド | 6.00  | 2017/12/15 | 2.02    |
| 8  | CANHOU 4.8 06/15/12           | 社債券   | カナダ      | 4.80  | 2012/6/15  | 1.81    |
| 9  | QUEENSLAND 6.0 09/14/17       | 特殊債券  | オーストラリア  | 6.00  | 2017/9/14  | 1.79    |
| 10 | CANADA 5.75 06/01/33          | 国債証券  | カナダ      | 5.75  | 2033/6/1   | 1.76    |

○掲載データ等はい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。

## 主要な資産の状況

### ■DIAM SRI・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### ポートフォリオの状況

| 資産の種類               | 国名 | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------|
| 株式                  | 日本 | 93.77   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |    | 6.23    |
| 合計(純資産総額)           |    | 100.00  |

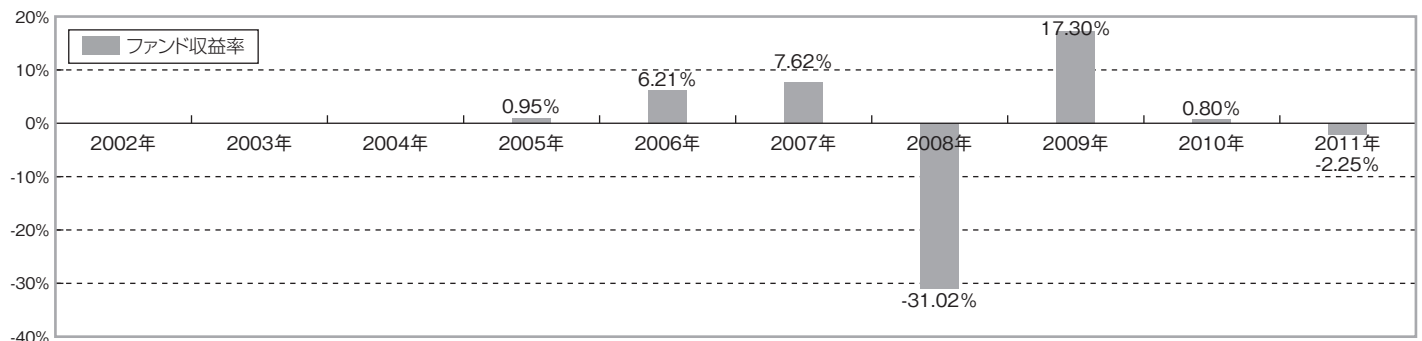
#### 組入上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名           | 業種      | 投資比率(%) |
|----|---------------|---------|---------|
| 1  | 三菱UFJフィナンシャルG | 銀行業     | 3.51    |
| 2  | トヨタ自動車        | 輸送用機器   | 3.31    |
| 3  | エヌ・ティ・ティ・ドコモ  | 情報・通信業  | 2.71    |
| 4  | 東レ            | 繊維製品    | 2.47    |
| 5  | 三菱地所          | 不動産業    | 2.32    |
| 6  | 出光興産          | 石油・石炭製品 | 2.06    |
| 7  | ユニ・チャーム       | 化学      | 2.05    |
| 8  | 三井物産          | 卸売業     | 1.99    |
| 9  | 東日本旅客鉄道       | 陸運業     | 1.98    |
| 10 | 日本電産          | 電気機器    | 1.84    |

#### 組入上位5業種(株式)

| 順位 | 業種     | 投資比率(%) |
|----|--------|---------|
| 1  | 電気機器   | 12.56   |
| 2  | 情報・通信業 | 9.12    |
| 3  | 銀行業    | 8.70    |
| 4  | 化学     | 7.71    |
| 5  | 輸送用機器  | 7.21    |

## 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、2005年は設定日から年末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。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 4. 手続・手数料等

### お申込みメモ

|                    |   |
|--------------------|---|
| 購入単位               | 各販売会社が定める単位(当初元本:1口=1円)   |
| 購入価額               | お申込日の翌営業日の基準価額とします。   |
| 購入代金               | お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに購入代金を販売会社に支払うものとします。   |
| 換金単位               | 各販売会社が定める単位   |
| 換金価額               | 換金のお申込日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額とします。  |
| 換金代金               | 原則として換金のお申込日より起算して5営業日目から支払います。   |
| 申込締切時間             | 原則として販売会社の毎営業日の午後3時までとします。  |
| 購入の申込期間            | 2012年3月6日～2013年3月5日<br>※カナダの銀行の休業日に該当する日(以下「海外休業日」といいます。)には、お申込みの受付を行いません。<br>※上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。   |
| 換金制限               | 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。<br>海外休業日には、換金のお申込みの受付を行いません。   |
| 購入・換金申込受付の中止および取消し | 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。  |
| 信託期間               | 無期限です。(設定日:2005年12月22日)   |
| 繰上償還               | 次のいずれかに該当する場合等には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了する場合があります。<br>① 受益権口数が10億口を下回るようになった場合。<br>② 受益者のために有利であると認めるとき。<br>③ やむを得ない事情が発生したとき。                               |
| 決算日                | 原則として毎月5日(休業日の場合は翌営業日)  |
| 収益分配               | 年12回、毎決算日に収益分配方針に基づき、収益分配を行います。<br>※「分配金受取コース」の場合、決算日から起算して原則として5営業日までにお支払いを開始します。<br>※「分配金自動けいぞく投資コース」の場合、税引後、無手数料で自動的に全額が再投資されます。                             |
| 信託金の限度額            | 3,000億円とします。  |
| 公告                 | 日本経済新聞に掲載します。   |
| 運用報告書              | 毎年6月、12月のファンドの決算時および償還時に運用報告書を作成し、あらかじめ届出を受けた住所に販売会社よりお届けいたします。<br>※委託会社のホームページにおいても開示しております。(URL <a href="http://www.diam.co.jp/">http://www.diam.co.jp/</a> ) |
| 課税関係               | 課税上は、株式投資信託として取り扱われます。<br>※益金不算入制度、配当控除の適用はありません。   |
| 基準価額の照会方法          | 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いただくか、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。<br>(委託会社の略称:DIAM、当ファンドの略称:ハビクSRI)  |

### ファンドの費用・税金

#### ファンドの費用

| <b>投資者が直接的に負担する費用</b>      |  |    |      |                                  |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
|----------------------------|--|----|------|----------------------------------|--------------------|----|--|----|------|----|----|----------------------------------|--|--|------|-----------------|--|------|--------------------|--|--|--|------|-------------------|
| 購入時手数料                     | 購入価額に、 <b>2.1%(税抜2.0%)を上限として</b> 各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額をご購入時にご負担いただきます。<br>※詳しくは販売会社にお問い合わせください。   |    |      |                                  |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
| 信託財産留保額                    | 換金のお申込日の翌営業日の基準価額に <b>0.3%</b> の率を乗じて得た額を、ご換金時にご負担いただきます。  |    |      |                                  |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
| <b>投資者が信託財産で間接的に負担する費用</b> |  |    |      |                                  |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
| 運用管理費用(信託報酬)               | ファンドの日々の純資産総額に対して <b>年1.2915%(税抜1.23%)</b> の率を乗じて得た額とします。また、運用管理費用(信託報酬)の配分は下記の通りとします。ファンドの運用管理費用(信託報酬)は、日々の基準価額に反映され、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。   |    |      |                                  |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
|                            | <table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="2">時期</th> <th colspan="2">項目</th> <th colspan="2">費用</th> </tr> <tr> <th rowspan="3">毎日</th> <th rowspan="3">信託報酬</th> <th rowspan="3">配分</th> <th>総額</th> <th colspan="2">信託財産の純資産総額に対して年率1.2915%(税抜1.23%)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>委託会社</td> <td>年率0.63%(税抜0.6%)</td> </tr> <tr> <td></td> <td>販売会社</td> <td>年率0.5985%(税抜0.57%)</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>受託会社</td> <td>年率0.063%(税抜0.06%)</td> </tr> </tbody> </table> | 時期 |      | 項目                               |                    | 費用 |  | 毎日 | 信託報酬 | 配分 | 総額 | 信託財産の純資産総額に対して年率1.2915%(税抜1.23%) |  |  | 委託会社 | 年率0.63%(税抜0.6%) |  | 販売会社 | 年率0.5985%(税抜0.57%) |  |  |  | 受託会社 | 年率0.063%(税抜0.06%) |
| 時期                         |  | 項目 |      | 費用                               |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
| 毎日                         | 信託報酬   | 配分 | 総額   | 信託財産の純資産総額に対して年率1.2915%(税抜1.23%) |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
|                            |  |    |      | 委託会社                             | 年率0.63%(税抜0.6%)    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
|                            |  |    |      | 販売会社                             | 年率0.5985%(税抜0.57%) |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
|                            |  |    | 受託会社 | 年率0.063%(税抜0.06%)                |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |
| その他費用・手数料                  | 組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、監査費用、外国での資産の保管等に要する諸費用等がお客様の保有期間中、その都度がかかります。<br>※これらの費用は運用状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を示すことができません。   |    |      |                                  |                    |    |  |    |      |    |    |                                  |  |  |      |                 |  |      |                    |  |  |  |      |                   |

※当該費用の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の保有期間等により異なるため、事前に記載することができません。

#### 税金

| 時期            | 項目        | 税金  |
|---------------|-----------|---|
| 分配時           | 所得税および地方税 | 配当所得として課税<br>普通分配金に対して10%                 |
| 換金(解約)時および償還時 | 所得税および地方税 | 譲渡所得として課税<br>換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して10% |

※税金は表に記載の時期に適用されます。

※上記の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

※上記は、2011年12月末現在のもので、2013年1月1日から2013年12月31日までは10.147%の税率となります。また、2014年1月1日以降は20.315%の税率となる予定です。

なお、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

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