

【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23年5月25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 中島 敬雄

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 大楽 信雄

【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】 バランス物語30（安定型）
バランス物語50（安定・成長型）
バランス物語70（成長型）

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 バランス物語30（安定型） 5,000億円を上限とします。
バランス物語50（安定・成長型）5,000億円を上限とします。
バランス物語70（成長型） 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書の提出に伴い、平成22年11月25日付をもって提出した有価証券届出書（平成23年4月1日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書で訂正済、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】

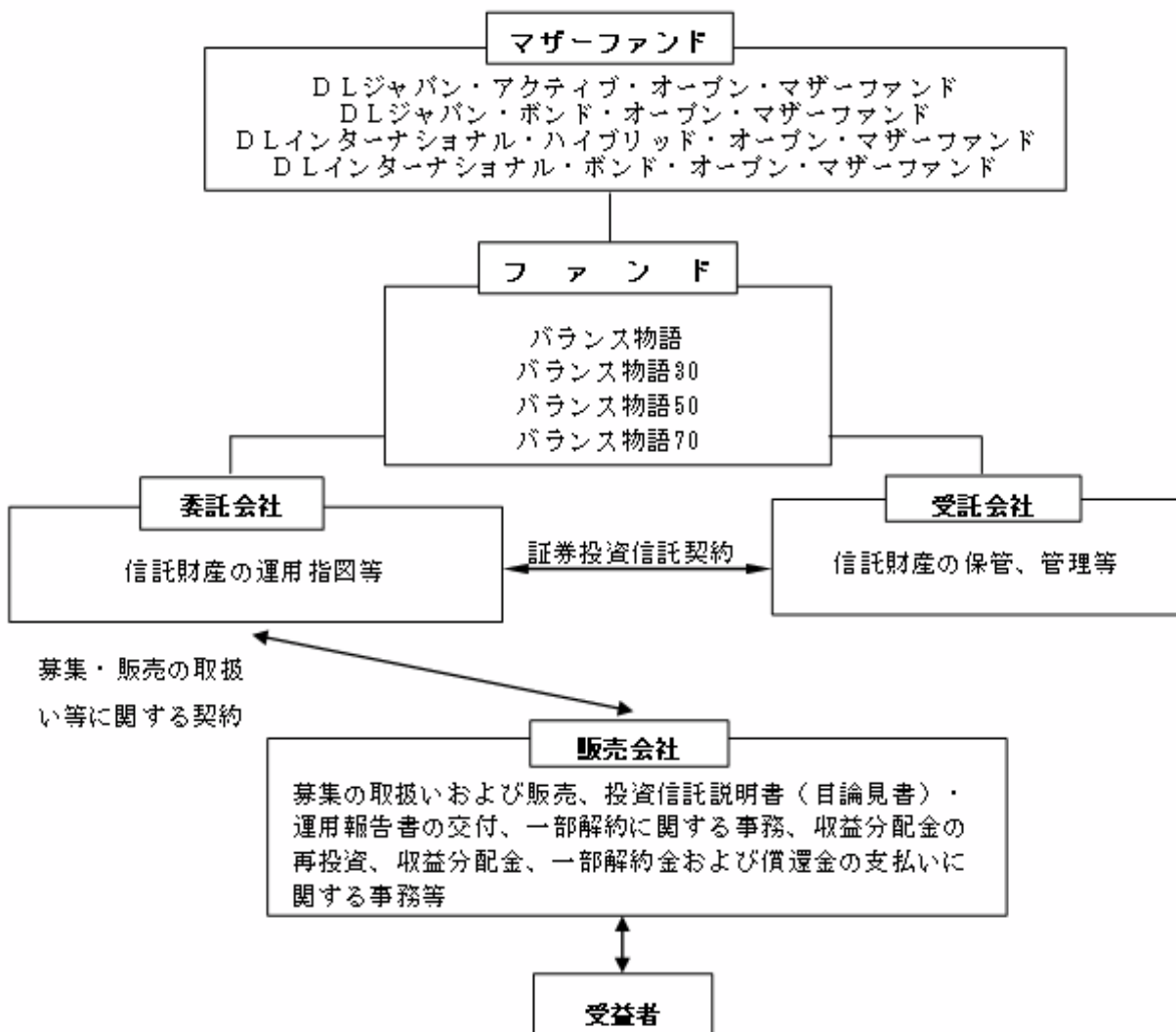
第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格 (3) ファンドの仕組み」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：D I A Mアセットマネジメント株式会社

当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。また、販売会社として募集等の業務を行います。

受託会社：三菱UFJ信託銀行株式会社

当ファンドの信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することができます。

販売会社

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

・「証券投資信託契約」の概要

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成23年2月28日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

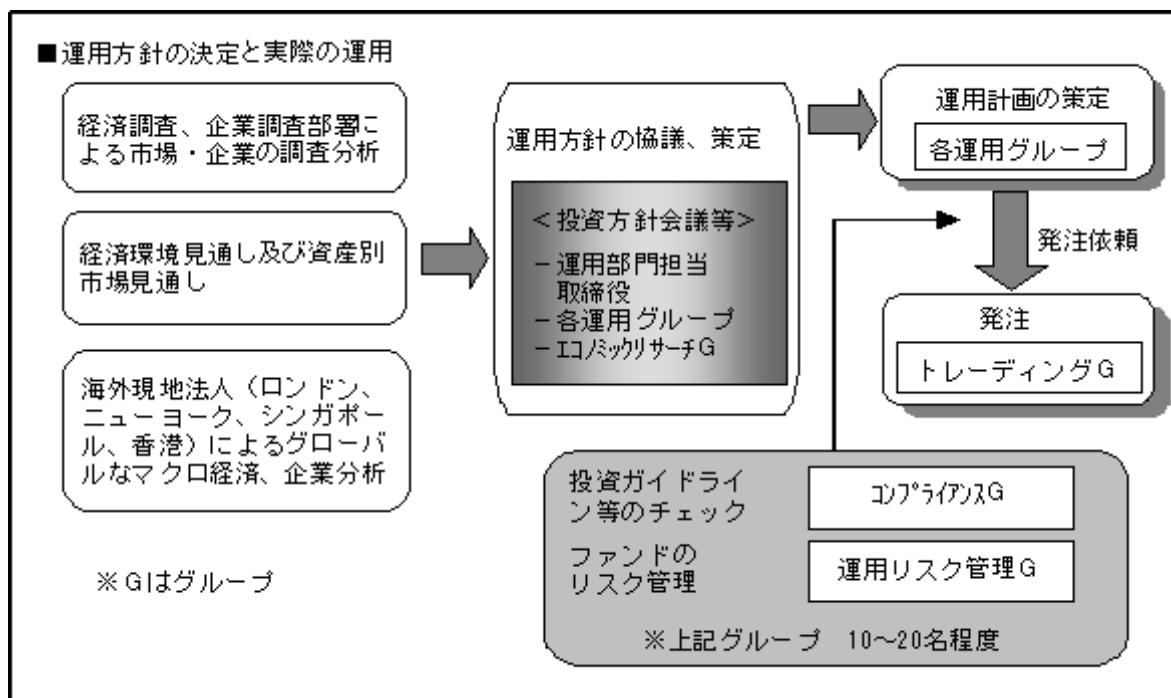
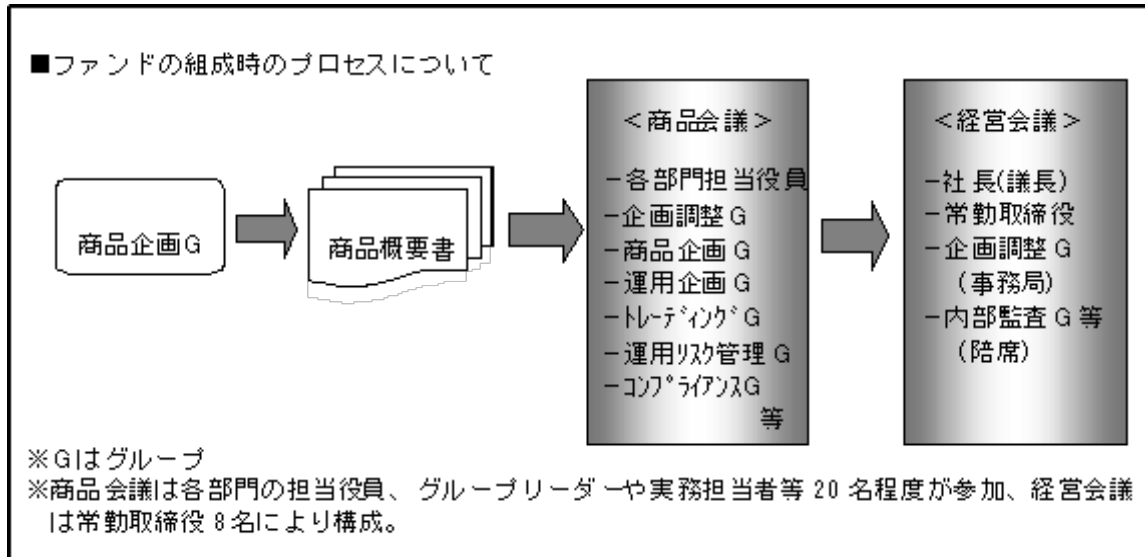
（平成23年2月28日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<訂正前>



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

<ファンドの組成時のプロセスについて>

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基

本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

< 運用方針の決定と実際の運用 >

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

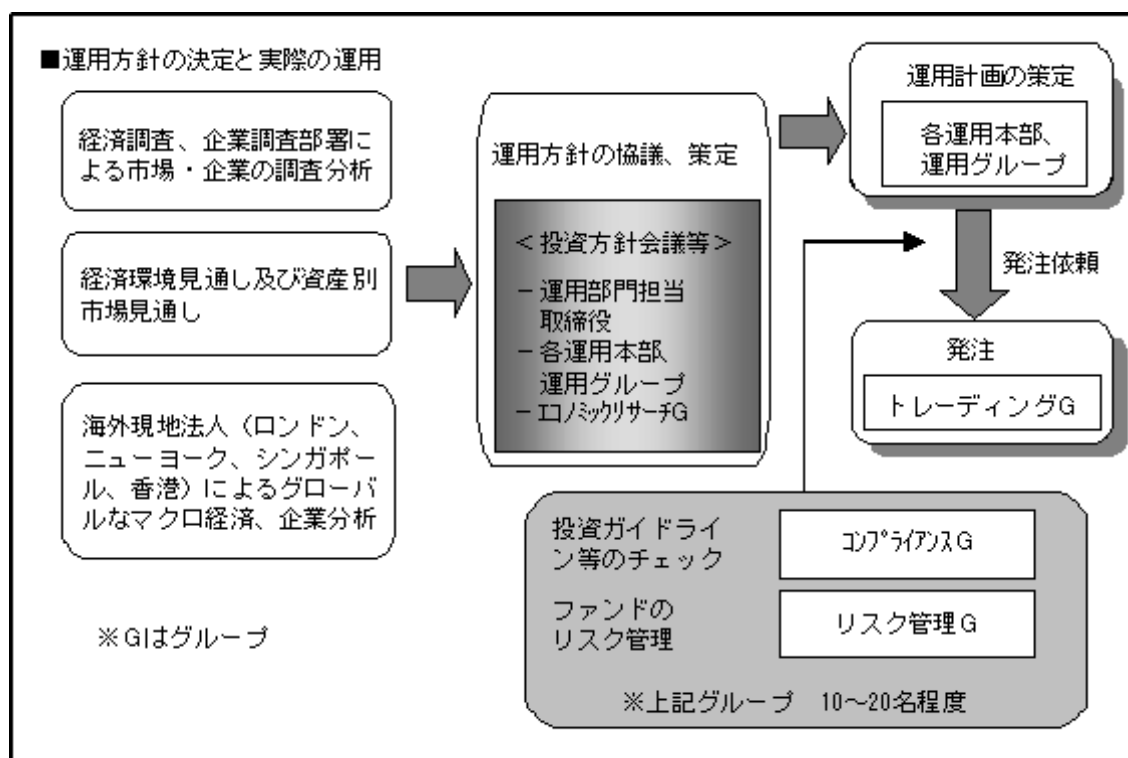
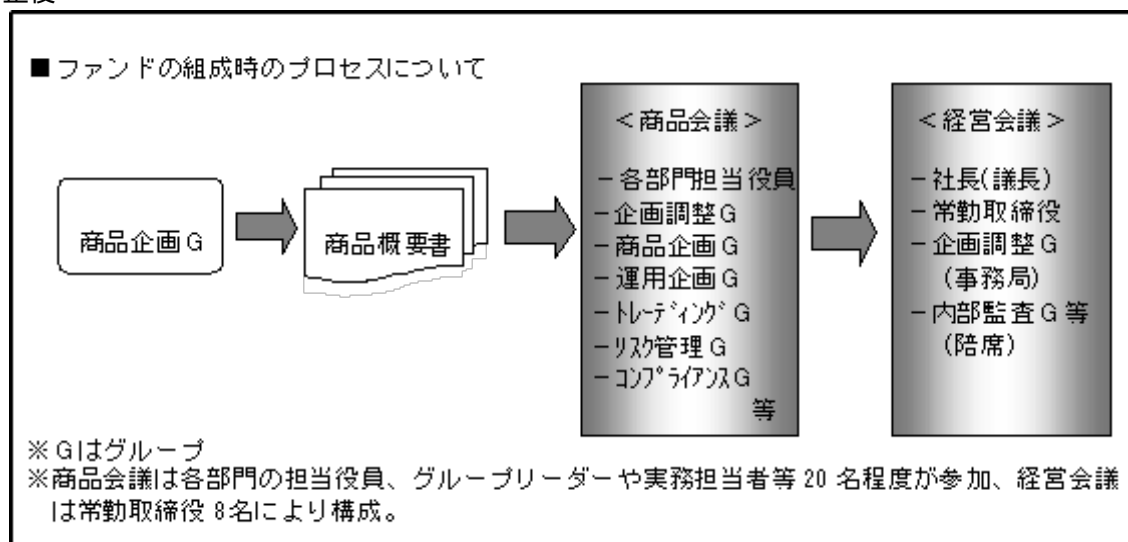
「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等によって得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

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、運用リスク管理グループにて行われます。

上記体制は平成22年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

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

< 運用方針の決定と実際の運用 >

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

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

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

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。

上記体制は平成23年4月1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 >

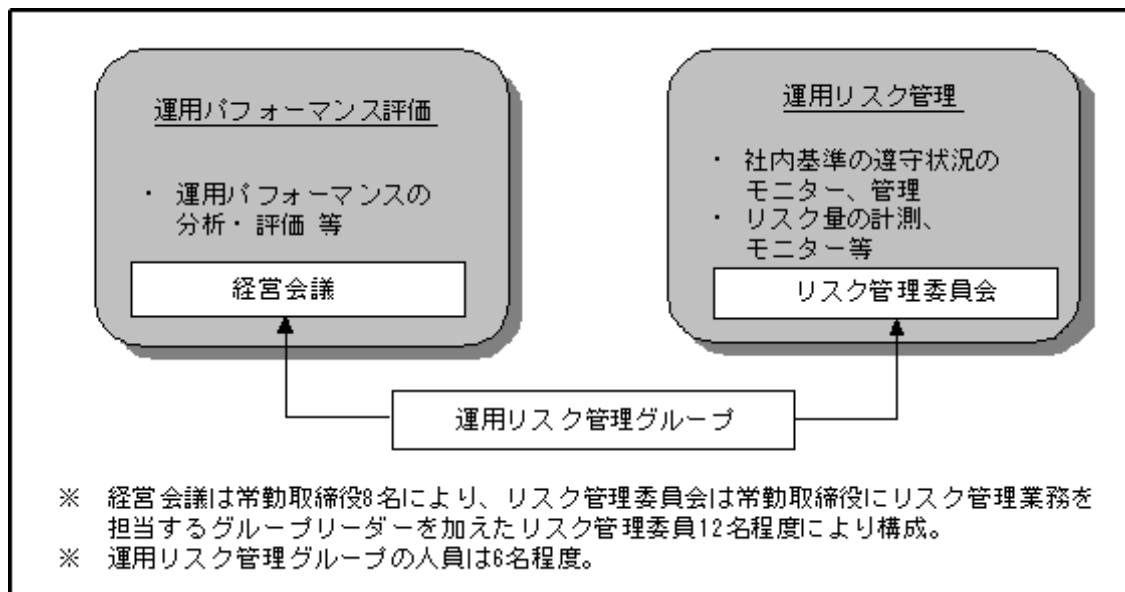
(1) 基準価額の主な変動要因

(略)

(2) その他の留意点

(略)

< 運用評価・運用リスク管理体制 >



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立した運用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、運用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。

上記体制は平成22年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1)基準価額の主な変動要因

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。

(略)

(2)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、収益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。

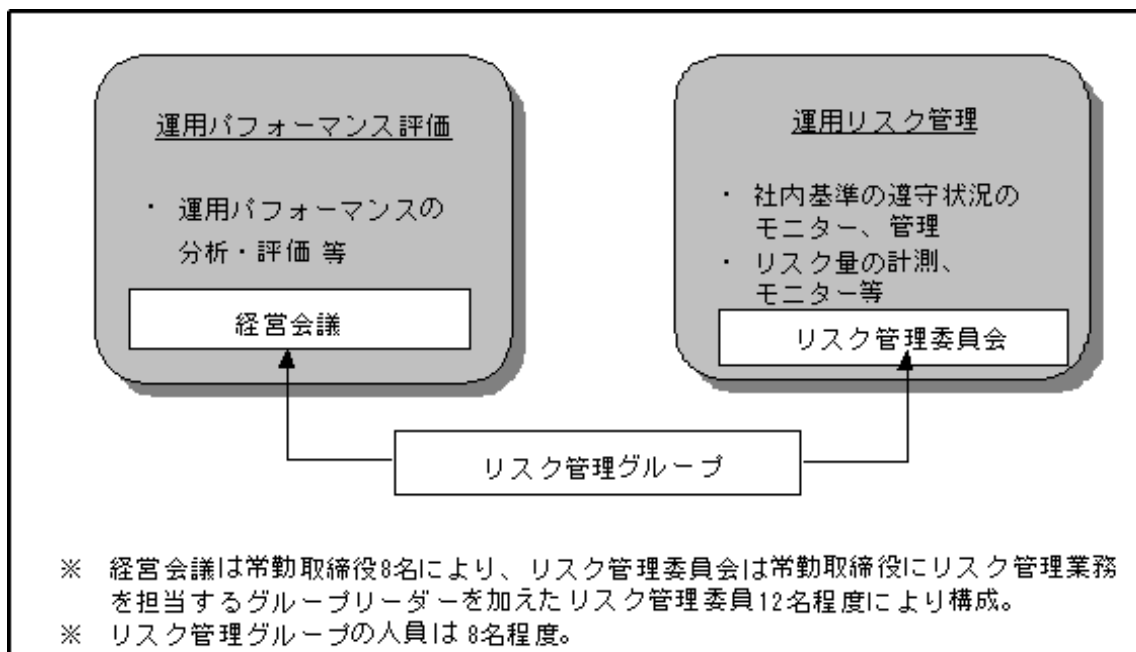
収益分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

(3)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。

(略)

<運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

上記体制は平成23年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

バランス物語30（安定型）

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	7,122,233,286	98.68
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		95,348,400	1.32
合 計（純資産総額）		7,217,581,686	100.00

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

バランス物語50（安定・成長型）

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,590,139,666	98.23
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		64,713,123	1.77
合 計（純資産総額）		3,654,852,789	100.00

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

バランス物語70（成長型）

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,300,084,037	97.91
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		49,184,258	2.09
合 計（純資産総額）		2,349,268,295	100.00

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

(参考) マザーファンドの投資状況

DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
-------	----	---------	---------

株式	米国	6,143,795,054	54.11
	英国	1,352,981,851	11.92
	カナダ	641,888,603	5.65
	スイス	473,580,168	4.17
	スウェーデン	165,661,618	1.46
	デンマーク	132,909,694	1.17
	ノルウェー	82,575,220	0.73
	オランダ	204,129,138	1.80
	ベルギー	61,758,271	0.54
	フランス	391,878,059	3.45
	ドイツ	419,233,209	3.69
	ポルトガル	29,758,906	0.26
	スペイン	142,790,584	1.26
	オーストリア	21,263,471	0.19
	香港	109,377,350	0.96
	シンガポール	155,787,825	1.37
	イスラエル	23,097,790	0.20
	オーストラリア	336,261,043	2.96
	バミューダ諸島	43,433,354	0.38
	オランダ領アンティル	92,118,604	0.81
	ジャージー・チャネル諸島	61,386,962	0.54
	小計	11,085,666,773	97.63
	現金・預金・その他の資産（負債控除後）	269,016,336	2.37
合 計（純資産総額）	11,354,683,109	100.00	

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

D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	29,342,381,700	98.46
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		459,282,299	1.54
合 計（純資産総額）		29,801,663,999	100.00

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

D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	米国	4,277,530,348	29.99
	英国	1,029,542,312	7.22
	カナダ	396,800,271	2.78
	スウェーデン	90,542,363	0.63
	オランダ	713,748,672	5.00
	フランス	435,469,001	3.05
	ドイツ	3,430,606,224	24.05
	スペイン	298,523,408	2.09
	イタリア	1,611,689,537	11.30
	フィンランド	434,284,578	3.04
	オーストリア	245,149,254	1.72
	小計	12,963,885,968	90.89
	特殊債券	ドイツ	90,275,659
オーストラリア		129,594,719	0.91
国際機関		417,981,314	2.93
小計		637,851,692	4.47
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		661,698,638	4.64
合 計（純資産総額）		14,263,436,298	100.00

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

D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成23年2月28日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	日本	26,880,627,295	55.42
社債券	日本	20,961,783,900	43.22
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		662,410,742	1.37
合計（純資産総額）		48,504,821,937	100.00

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

(2)【投資資産】

バランス物語30（安定型）

【投資有価証券の主要銘柄】

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	3,775,918,243	12,950.00	4,889,814,124	12,949.00	4,889,436,532	67.74
2	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,116,511,337	11,828.00	1,320,609,609	11,954.00	1,334,677,652	18.49
3	D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	385,880,556	15,430.00	595,413,697	15,339.00	591,902,184	8.20
4	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	279,548,036	10,862.00	303,645,076	10,954.00	306,216,918	4.24

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.68
合計	98.68

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

バランス物語50（安定・成長型）

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,219,975,096	12,950.00	1,579,867,749	12,949.00	1,579,745,751	43.22
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	933,320,832	11,828.00	1,103,931,880	11,954.00	1,115,691,722	30.53
3	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	292,072,274	15,430.00	450,667,518	15,339.00	448,009,661	12.26
4	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	407,789,422	10,862.00	442,940,870	10,954.00	446,692,532	12.22

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.23
合計	98.23

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

バランス物語70（成長型）

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	802,852,938	11,828.00	949,614,455	11,954.00	959,730,402	40.85

2	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	393,264,110	12,949.98	509,276,248	12,949.00	509,237,696	21.68
3	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	413,294,663	10,862.00	448,920,662	10,954.00	452,722,973	19.27
4	D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	246,686,855	15,426.39	380,548,827	15,339.00	378,392,966	16.11

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.91
合計	97.91

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	35,780	5,547.21	198,479,052	6,973.13	249,498,641	2.20
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	株式	英国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	67,112	2,466.75	165,548,564	2,894.97	194,286,958	1.71
3	APPLE INC	株式	米国	コン ピュー タ・周 辺機器	5,582	18,515.49	103,353,443	28,448.15	158,797,593	1.40
4	BHP BILLITON LTD	株式	オース トラリ ア	金属・ 鉱業	37,146	3,551.84	131,936,519	3,808.80	141,481,518	1.25
5	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀 行	143,319	891.47	127,765,215	934.67	133,955,946	1.18

6	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	33,029	3,506.83	115,827,162	3,814.22	125,979,965	1.11
7	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	14,739	6,515.57	96,033,010	8,342.59	122,961,449	1.08
8	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	53,560	2,391.65	128,096,865	2,169.40	116,193,091	1.02
9	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術サービス	8,129	10,453.98	84,980,382	13,259.90	107,789,717	0.95
10	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロメリット	62,770	1,392.34	87,397,081	1,701.20	106,784,462	0.94
11	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	436,618	196.10	85,620,430	229.63	100,258,704	0.88
12	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	21,117	4,719.07	99,652,518	4,598.52	97,107,000	0.86
13	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	株式	オーストラリア	商業銀行	21,048	4,570.31	96,195,981	4,400.63	92,624,462	0.82
14	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	1,850	47,795.01	88,420,761	49,846.37	92,215,782	0.81
15	SCHLUMBERGER LTD	株式	オランダ領アンティル	エネルギー設備・サービス	12,142	5,254.41	63,799,017	7,586.77	92,118,604	0.81
16	AT&T INC	株式	米国	各種電気通信サービス	39,901	2,094.47	83,571,604	2,298.50	91,712,540	0.81
17	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	株式	米国	タバコ	17,852	4,096.94	73,138,562	5,086.45	90,803,261	0.80
18	BANK OF NOVA SCOTIA	株式	カナダ	商業銀行	18,117	4,248.43	76,968,765	5,011.20	90,787,910	0.80
19	TELEFONICA S.A	株式	スペイン	各種電気通信サービス	43,736	2,042.26	89,320,142	2,049.92	89,655,266	0.79
20	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	33,728	2,465.35	83,151,422	2,647.40	89,291,642	0.79
21	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	17,346	5,163.02	89,557,766	5,134.66	89,065,750	0.78
22	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	31,334	2,046.84	64,135,544	2,692.34	84,361,923	0.74
23	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	16,554	5,248.09	86,876,902	4,873.18	80,670,695	0.71
24	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	122,596	778.69	95,464,775	650.23	79,716,048	0.70
25	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	50,633	1,418.37	71,816,284	1,541.05	78,028,015	0.69

26	BG GROUP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	39,312	1,531.95	60,223,982	1,967.66	77,352,524	0.68
27	BNP PARIBAS	株式	フランス	商業銀行	11,891	6,375.81	75,814,713	6,269.75	74,553,566	0.66
28	BANK OF AMERICA CORP	株式	米国	各種金融サービス	63,880	1,427.22	91,170,696	1,160.28	74,118,814	0.65
29	CONOCOPHILLIPS	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	11,646	4,470.00	52,057,574	6,314.55	73,539,235	0.65
30	ALLIANZ SE	株式	ドイツ	保険	6,380	9,862.70	62,924,029	11,494.35	73,333,953	0.65

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

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	11.49
	商業銀行	8.95
	医薬品	5.97
	金属・鉱業	4.79
	機械	3.50
	化学	3.31
	各種電気通信サービス	3.19
	半導体・半導体製造装置	2.97
	各種金融サービス	2.96
	ソフトウェア	2.90
	食品	2.80
	保険	2.68
	エネルギー設備・サービス	2.55
	飲料	2.55
	コングロマリット	2.49
	メディア	2.36
	コンピュータ・周辺機器	2.35
	タバコ	2.29
	総合公益事業	2.10
	資本市場	2.09
	情報技術サービス	1.89
	通信機器	1.81
	電気設備	1.77
	陸運・鉄道	1.69
	家庭用品	1.55
	航空宇宙・防衛	1.42
	繊維・アパレル・贅沢品	1.37
	インターネットソフトウェア・サービス	1.23
	ライフサイエンス・ツール/サービス	1.01
	無線通信サービス	0.88
	ホテル・レストラン・レジャー	0.83
	自動車	0.77
	インターネット販売・カタログ販売	0.74
	食品・生活必需品小売り	0.71
電子装置・機器・部品	0.69	
ヘルスケア機器・用品	0.66	
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.65	
バイオテクノロジー	0.51	
家庭用耐久財	0.48	

複合小売り	0.43
自動車部品	0.36
ヘルスケア・テクノロジー	0.29
販売	0.27
不動産管理・開発	0.26
運送インフラ	0.25
商業サービス・用品	0.24
専門小売り	0.20
建設関連製品	0.20
ガス	0.19
合計	97.63

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	294,900	3,471.09	1,023,624,869	3,820.00	1,126,518,000	3.78
2	三菱UFJ フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2,370,000	466.75	1,106,191,187	453.00	1,073,610,000	3.60
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	242,400	3,228.86	782,676,206	3,545.00	859,308,000	2.88
4	三井住友フィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	278,000	2,918.58	811,366,517	3,085.00	857,630,000	2.88
5	日本電産	株式	日本	電気機 器	111,500	9,261.44	1,032,650,508	7,600.00	847,400,000	2.84
6	日本セラミッ ク	株式	日本	電気機 器	418,800	1,196.22	500,976,751	1,687.00	706,515,600	2.37
7	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	174,500	3,868.81	675,108,175	3,990.00	696,255,000	2.34
8	三井不動産	株式	日本	不動産 業	381,000	1,612.49	614,358,544	1,734.00	660,654,000	2.22
9	任天堂	株式	日本	その他 製品	26,000	27,552.18	716,356,783	23,970.00	623,220,000	2.09
10	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	3,977	139,277.08	553,904,953	153,500.00	610,469,500	2.05
11	シークス	株式	日本	卸売業	510,000	1,030.15	525,376,490	1,192.00	607,920,000	2.04
12	ファナック	株式	日本	電気機 器	47,800	9,349.17	446,890,199	12,680.00	606,104,000	2.03
13	三井物産	株式	日本	卸売業	406,000	1,495.05	606,991,365	1,486.00	603,316,000	2.02
14	三菱商事	株式	日本	卸売業	257,700	2,309.56	595,172,740	2,261.00	582,659,700	1.96
15	キヤノン	株式	日本	電気機 器	143,300	4,123.64	590,917,167	3,940.00	564,602,000	1.89
16	東日本旅客鉄 道	株式	日本	陸運業	97,400	6,124.39	596,515,368	5,690.00	554,206,000	1.86
17	東京海上HD	株式	日本	保険業	204,000	2,558.20	521,871,801	2,679.00	546,516,000	1.83

18	KDDI	株式	日本	情報・通信業	946	455,113.52	430,537,394	530,000.00	501,380,000	1.68
19	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2,767,000	157.38	435,477,661	168.00	464,856,000	1.56
20	ヤフー	株式	日本	情報・通信業	15,000	33,831.82	507,477,370	30,750.00	461,250,000	1.55
21	村田製作所	株式	日本	電気機器	75,000	4,764.13	357,309,879	6,080.00	456,000,000	1.53
22	京セラ	株式	日本	電気機器	52,300	8,448.33	441,847,485	8,480.00	443,504,000	1.49
23	日東電工	株式	日本	化学	89,200	3,927.38	350,321,862	4,925.00	439,310,000	1.47
24	小松製作所	株式	日本	機械	176,000	1,900.33	334,458,225	2,495.00	439,120,000	1.47
25	東芝	株式	日本	電気機器	799,000	430.90	344,285,625	535.00	427,465,000	1.43
26	三菱地所	株式	日本	不動産業	256,000	1,532.21	392,245,739	1,668.00	427,008,000	1.43
27	住友電工	株式	日本	非鉄金属	346,900	1,100.88	381,894,350	1,195.00	414,545,500	1.39
28	アイシン精機	株式	日本	輸送用機器	129,800	2,490.70	323,293,163	3,115.00	404,327,000	1.36
29	三菱電機	株式	日本	電気機器	414,000	789.55	326,873,620	967.00	400,338,000	1.34
30	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	73,000	5,591.84	408,204,305	5,340.00	389,820,000	1.31

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

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	21.16
	情報・通信業	11.47
	輸送用機器	10.61
	銀行業	8.93
	卸売業	7.61
	小売業	5.78
	機械	4.00
	不動産業	3.83
	サービス業	3.74
	化学	3.68
	非鉄金属	2.52
	鉄鋼	2.42
	その他製品	2.09
	陸運業	1.86
	保険業	1.83
	医薬品	1.79
	食料品	1.56
	金属製品	1.17
	繊維製品	1.01
	証券、商品先物取引業	0.83
精密機器	0.55	
合計		98.46

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債 証券	ドイツ	1,300,824,000	102.60	1,334,708,783	98.90	1,286,514,936	3.00	2020/ 7/4	9.02
2	US T N/B 3.5 05/15/20	国債 証券	米国	817,100,000	104.17	851,168,601	101.55	829,732,366	3.50	2020/ 5/15	5.82
3	BUNDESUBL 4.25 10/12/12	国債 証券	ドイツ	740,124,000	108.80	805,254,912	104.49	773,355,568	4.25	2012/ 10/12	5.42
4	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債 証券	オランダ	672,840,000	110.30	742,142,520	106.08	713,748,672	4.00	2018/ 7/15	5.00
5	US T N/B 1.875 04/30/14	国債 証券	米国	555,628,000	100.95	560,900,226	101.85	565,890,449	1.88	2014/ 4/30	3.97
6	UK TREASURY 4.75 03/07/20	国債 証券	英国	486,328,000	113.96	554,215,051	108.67	528,492,638	4.75	2020/ 3/7	3.71
7	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	国債 証券	イタリア	515,844,000	107.37	553,861,703	101.15	521,776,206	4.50	2018/ 2/1	3.66
8	US T N/B 1.375 11/30/15	国債 証券	米国	531,115,000	96.64	513,272,856	96.89	514,597,324	1.38	2015/ 11/30	3.61
9	US T N/B 4.5 11/15/15	国債 証券	米国	449,405,000	115.27	518,012,674	111.24	499,927,110	4.50	2015/ 11/15	3.50
10	US T N/B 4.375 05/15/40	国債 証券	米国	490,260,000	107.36	526,337,789	97.62	478,577,104	4.38	2040/ 5/15	3.36
11	FINLAND 4.25 07/04/15	国債 証券	フィンランド	403,704,000	111.99	452,108,110	107.58	434,284,578	4.25	2015/ 7/4	3.04
12	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	国債 証券	イタリア	358,848,000	107.01	384,003,245	103.71	372,161,261	4.75	2013/ 2/1	2.61
13	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債 証券	ドイツ	325,206,000	110.98	360,920,123	105.80	344,051,688	4.00	2037/ 1/4	2.41
14	US T N/B 1.875 09/30/17	国債 証券	米国	326,840,000	101.05	330,287,141	94.78	309,782,220	1.88	2017/ 9/30	2.17
15	SPAIN 4.0 04/30/20	国債 証券	スペイン	313,992,000	96.11	301,771,431	91.63	287,695,170	4.00	2020/ 4/30	2.02
16	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	国債 証券	イタリア	291,564,000	102.07	297,596,459	97.93	285,528,625	4.25	2019/ 9/1	2.00
17	EIB 5.125 05/30/17	特殊 債券	国際 機関	245,130,000	112.55	275,893,815	111.65	273,687,645	5.13	2017/ 5/30	1.92
18	UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債 証券	英国	243,164,000	111.20	270,403,034	105.43	256,367,805	4.75	2030/ 12/7	1.80
19	US T N/B 2.625 11/15/20	国債 証券	米国	269,643,000	94.38	254,495,036	93.49	252,094,634	2.63	2020/ 11/15	1.77
20	US T N/B 2.25 01/31/15	国債 証券	米国	245,130,000	104.40	255,918,223	102.27	250,682,195	2.25	2015/ 1/31	1.76

21	AUSTRIA 3.5 07/15/15	国債 証券	オース トリア	235,494,000	107.00	251,978,580	104.10	245,149,254	3.50	2015/ 7/15	1.72
22	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	国債 証券	フラン ス	224,280,000	111.89	250,946,892	106.86	239,665,608	4.25	2019/ 4/25	1.68
23	US T N/B 1.25 08/31/15	国債 証券	米国	245,130,000	100.90	247,341,915	97.00	237,776,100	1.25	2015/ 8/31	1.67
24	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債 証券	ドイ ツ	234,372,600	105.55	247,380,279	101.31	237,442,881	3.25	2020/ 1/4	1.66
25	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債 証券	ドイ ツ	196,245,000	122.45	240,302,003	116.18	227,997,441	4.75	2034/ 7/4	1.60
26	CANADA 3.75 06/01/19	国債 証券	カナ ダ	167,040,000	103.79	173,370,816	104.05	173,808,461	3.75	2019/ 6/1	1.22
27	ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債 証券	イタ リア	168,210,000	100.98	169,858,458	94.68	159,261,228	4.00	2020/ 9/1	1.12
28	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	国債 証券	ドイ ツ	145,782,000	110.63	161,278,627	106.29	154,951,688	3.75	2017/ 1/4	1.09
29	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債 証券	イタ リア	168,210,000	89.83	151,109,771	81.10	136,418,310	4.00	2037/ 2/1	0.96
30	US T N/B 4.0 02/15/15	国債 証券	米国	122,565,000	109.17	133,805,436	109.12	133,739,251	4.00	2015/ 2/15	0.94

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

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	90.89
特殊債券	4.47
合計	95.36

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年2月28日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	305回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	10,686,000,000	101.64	10,861,615,640	101.44	10,839,985,260	1.30	2019/ 12/20	22.35
2	309回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,105,000,000	101.30	3,145,337,450	99.20	3,080,284,200	1.10	2020/ 6/20	6.35

3	114回利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2,782,000,000	101.62	2,827,068,400	101.99	2,837,445,260	2.10	2029/12/20	5.85
4	121回利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2,539,000,000	102.20	2,594,950,500	98.46	2,499,797,840	1.90	2030/9/20	5.15
5	ヤマダ電機JPY建て転換制限条項付CB3/28/13	社債券	日本	2,100,000,000	97.53	2,048,050,000	99.00	2,079,000,000	-	2013/3/28	4.29
6	川崎汽船JPY建てCB4/4/13	社債券	日本	2,116,000,000	97.03	2,053,052,500	97.75	2,068,390,000	-	2013/4/4	4.26
7	84回利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1,711,000,000	103.06	1,763,289,820	103.85	1,776,941,940	2.00	2025/12/20	3.66
8	1回野村総合研究所転換社債	社債券	日本	1,739,000,000	97.00	1,686,836,134	98.10	1,705,959,000	-	2014/3/31	3.52
9	12回物価連動国債(10年)	国債証券	日本	1,560,000,000	98.01	1,528,879,560	100.40	1,566,221,280	1.20	2017/6/10	3.23
10	33回ソフトバンク社債	社債券	日本	1,500,000,000	100.00	1,500,000,000	101.17	1,517,475,000	1.24	2013/9/17	3.13
11	8回物価連動国債(10年)	国債証券	日本	1,470,000,000	97.31	1,430,415,840	99.35	1,460,460,435	1.00	2016/6/10	3.01
12	カシオ計算機JPY建てCB3/31/15	社債券	日本	1,380,000,000	98.26	1,355,990,000	99.63	1,374,825,000	-	2015/3/31	2.83
13	33回利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	1,314,000,000	100.29	1,317,746,640	97.38	1,279,533,780	2.00	2040/9/20	2.64
14	20回シャープ転換社債	社債券	日本	1,100,000,000	97.89	1,076,820,000	98.50	1,083,500,000	-	2013/9/30	2.23
15	288回利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	777,000,000	106.69	829,009,300	105.87	822,571,050	1.70	2017/9/20	1.70
16	42回プロミス社債	社債券	日本	800,000,000	99.59	796,704,000	99.85	798,800,000	3.50	2015/4/30	1.65
17	東レJPY建て転換制限条項付CB3/12/12	社債券	日本	785,000,000	98.77	775,312,500	99.48	780,918,000	-	2012/3/12	1.61
18	コニカミノルタホールディングスJPY建てCB12/7/16	社債券	日本	755,000,000	98.34	742,431,250	99.25	749,337,500	-	2016/12/7	1.54

19	10回NEC転換社債	社債券	日本	700,000,000	99.97	699,790,000	100.10	700,700,000	1.00	2011/9/30	1.44
20	7回ウエストパック銀行円貨社債	社債券	日本	700,000,000	100.00	700,000,000	99.65	697,550,000	1.07	2015/9/3	1.44
21	7回平和不動産転換社債	社債券	日本	665,000,000	98.50	655,057,500	98.80	657,020,000	-	2012/6/22	1.35
22	3回りそな銀行劣後社債	社債券	日本	500,000,000	105.01	525,055,000	104.96	524,775,000	2.52	2019/6/4	1.08
23	3回千葉銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	500,000,000	101.89	509,440,000	101.57	507,835,000	1.71	2018/3/13	1.05
24	4回福岡銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	500,000,000	100.00	500,000,000	100.08	500,400,000	1.11	2020/8/20	1.03
25	120回利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	500,000,000	97.32	486,596,000	93.78	468,885,000	1.60	2030/6/20	0.97
26	36回鹿島建設社債	社債券	日本	400,000,000	100.00	400,000,000	99.87	399,492,000	1.24	2016/2/5	0.82
27	3回ほくほくフィナンシャルグループ期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	400,000,000	99.60	398,400,000	99.74	398,944,000	1.27	2021/1/26	0.82
28	1回西日本シティ銀行劣後社債	社債券	日本	300,000,000	107.29	321,879,000	105.61	316,827,000	2.78	2015/4/15	0.65
29	6回西日本シティ銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	300,000,000	100.13	300,375,000	101.37	304,101,000	1.70	2020/4/15	0.63
30	2回宮崎銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	300,000,000	100.00	300,000,000	99.62	298,860,000	1.19	2020/11/26	0.62

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

種類別業種別投資比率

平成23年2月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	55.42
社債券	43.22
合計	98.63

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成23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。

バランス物語30（安定型）

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成13年8月27日現在）	34,460	34,478	0.9838	0.9843
第2期末（平成14年2月25日現在）	40,619	40,683	0.9566	0.9581
第3期末（平成14年8月26日現在）	41,571	41,637	0.9483	0.9498
第4期末（平成15年2月25日現在）	38,406	38,468	0.9291	0.9306
第5期末（平成15年8月25日現在）	36,149	36,414	0.9532	0.9602
第6期末（平成16年2月25日現在）	33,685	33,842	0.9703	0.9748
第7期末（平成16年8月25日現在）	31,104	31,120	0.9710	0.9715
第8期末（平成17年2月25日現在）	28,979	29,095	0.9924	0.9964
第9期末（平成17年8月25日現在）	25,656	25,795	1.0132	1.0187
第10期末（平成18年2月27日現在）	22,170	22,294	1.0708	1.0768
第11期末（平成18年8月25日現在）	20,592	20,708	1.0622	1.0682
第12期末（平成19年2月26日現在）	18,857	18,960	1.0994	1.1054
第13期末（平成19年8月27日現在）	16,750	16,844	1.0697	1.0757
第14期末（平成20年2月25日現在）	15,184	15,272	1.0295	1.0355
第15期末（平成20年8月25日現在）	13,906	13,961	1.0035	1.0075
第16期末（平成21年2月25日現在）	11,428	11,441	0.8588	0.8598
第17期末（平成21年8月25日現在）	10,889	10,901	0.9380	0.9390
第18期末（平成22年2月25日現在）	10,074	10,084	0.9354	0.9364
第19期末（平成22年8月25日現在）	8,832	8,841	0.9315	0.9325
第20期末（平成23年2月25日現在）	7,211	7,218	0.9601	0.9611
平成22年2月末	10,070		0.9349	
3月末	10,082		0.9611	
4月末	10,009		0.9721	
5月末	9,477		0.9385	
6月末	9,286		0.9328	
7月末	9,221		0.9406	
8月末	8,803		0.9292	
9月末	8,339		0.9437	
10月末	8,034		0.9377	
11月末	7,732		0.9429	
12月末	7,554		0.9524	
平成23年1月末	7,461		0.9533	
2月末	7,217		0.9617	

バランス物語50（安定・成長型）

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成13年8月27日現在）	9,031	9,031	0.9586	0.9586
第2期末（平成14年2月25日現在）	10,133	10,149	0.9234	0.9249
第3期末（平成14年8月26日現在）	10,253	10,270	0.8932	0.8947
第4期末（平成15年2月25日現在）	9,283	9,294	0.8493	0.8503
第5期末（平成15年8月25日現在）	9,794	9,874	0.9106	0.9181
第6期末（平成16年2月25日現在）	9,791	9,843	0.9346	0.9396
第7期末（平成16年8月25日現在）	9,334	9,364	0.9415	0.9445
第8期末（平成17年2月25日現在）	9,076	9,122	0.9728	0.9777
第9期末（平成17年8月25日現在）	8,684	8,744	1.0112	1.0182
第10期末（平成18年2月27日現在）	9,054	9,110	1.1230	1.1300

第11期末（平成18年8月25日現在）	9,314	9,372	1.1172	1.1242
第12期末（平成19年2月26日現在）	9,012	9,065	1.1880	1.1950
第13期末（平成19年8月27日現在）	7,870	7,918	1.1381	1.1451
第14期末（平成20年2月25日現在）	6,850	6,895	1.0631	1.0701
第15期末（平成20年8月25日現在）	6,362	6,393	1.0226	1.0276
第16期末（平成21年2月25日現在）	4,723	4,735	0.7845	0.7865
第17期末（平成21年8月25日現在）	5,027	5,038	0.8965	0.8985
第18期末（平成22年2月25日現在）	4,809	4,820	0.8820	0.8840
第19期末（平成22年8月25日現在）	4,115	4,125	0.8526	0.8546
第20期末（平成23年2月25日現在）	3,636	3,644	0.9085	0.9105
平成22年2月末	4,803		0.8806	
3月末	4,870		0.9234	
4月末	4,787		0.9332	
5月末	4,457		0.8787	
6月末	4,294		0.8623	
7月末	4,308		0.8739	
8月末	4,095		0.8513	
9月末	3,951		0.8749	
10月末	3,738		0.8678	
11月末	3,698		0.8821	
12月末	3,679		0.8944	
平成23年1月末	3,652		0.8983	
2月末	3,654		0.9116	

バランス物語 7 0（成長型）

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成13年8月27日現在）	3,476	3,476	0.9369	0.9369
第2期末（平成14年2月25日現在）	3,993	3,996	0.8963	0.8968
第3期末（平成14年8月26日現在）	4,023	4,030	0.8463	0.8478
第4期末（平成15年2月25日現在）	3,307	3,309	0.7794	0.7799
第5期末（平成15年8月25日現在）	3,620	3,652	0.8676	0.8751
第6期末（平成16年2月25日現在）	4,326	4,350	0.8981	0.9031
第7期末（平成16年8月25日現在）	4,285	4,304	0.9111	0.9151
第8期末（平成17年2月25日現在）	4,210	4,236	0.9508	0.9566
第9期末（平成17年8月25日現在）	4,058	4,090	1.0050	1.0130
第10期末（平成18年2月27日現在）	4,753	4,786	1.1689	1.1769
第11期末（平成18年8月25日現在）	4,749	4,782	1.1655	1.1735
第12期末（平成19年2月26日現在）	4,844	4,875	1.2714	1.2794
第13期末（平成19年8月27日現在）	4,392	4,421	1.1990	1.2070
第14期末（平成20年2月25日現在）	3,802	3,830	1.0882	1.0962
第15期末（平成20年8月25日現在）	3,542	3,562	1.0347	1.0407
第16期末（平成21年2月25日現在）	2,496	2,506	0.7158	0.7188
第17期末（平成21年8月25日現在）	2,887	2,897	0.8525	0.8555
第18期末（平成22年2月25日現在）	2,753	2,763	0.8267	0.8297
第19期末（平成22年8月25日現在）	2,485	2,495	0.7747	0.7777
第20期末（平成23年2月25日現在）	2,330	2,338	0.8523	0.8553
平成22年2月末	2,755		0.8245	
3月末	2,922		0.8801	
4月末	2,901		0.8886	
5月末	2,653		0.8155	
6月末	2,561		0.7906	
7月末	2,600		0.8053	
8月末	2,486		0.7743	
9月末	2,462		0.8049	
10月末	2,367		0.7969	
11月末	2,372		0.8184	
12月末	2,315		0.8326	

平成23年1月末	2,314		0.8390	
2月末	2,349		0.8564	

【分配の推移】

バランス物語30（安定型）

	1口当たりの分配額（円）
第1期	0.0005
第2期	0.0015
第3期	0.0015
第4期	0.0015
第5期	0.0070
第6期	0.0045
第7期	0.0005
第8期	0.0040
第9期	0.0055
第10期	0.0060
第11期	0.0060
第12期	0.0060
第13期	0.0060
第14期	0.0060
第15期	0.0040
第16期	0.0010
第17期	0.0010
第18期	0.0010
第19期	0.0010
第20期	0.0010

バランス物語50（安定・成長型）

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	0.0015
第3期	0.0015
第4期	0.0010
第5期	0.0075
第6期	0.0050
第7期	0.0030
第8期	0.0050
第9期	0.0070
第10期	0.0070
第11期	0.0070
第12期	0.0070
第13期	0.0070
第14期	0.0070
第15期	0.0050
第16期	0.0020
第17期	0.0020
第18期	0.0020
第19期	0.0020
第20期	0.0020

バランス物語70（成長型）

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	0.0005
第3期	0.0015
第4期	0.0005

第5期	0.0075
第6期	0.0050
第7期	0.0040
第8期	0.0060
第9期	0.0080
第10期	0.0080
第11期	0.0080
第12期	0.0080
第13期	0.0080
第14期	0.0080
第15期	0.0060
第16期	0.0030
第17期	0.0030
第18期	0.0030
第19期	0.0030
第20期	0.0030

【収益率の推移】

バランス物語30（安定型）

	収益率（％）
第1期	1.57
第2期	2.61
第3期	0.71
第4期	1.87
第5期	3.35
第6期	2.27
第7期	0.12
第8期	2.62
第9期	2.65
第10期	6.28
第11期	0.24
第12期	4.07
第13期	2.16
第14期	3.20
第15期	2.14
第16期	14.32
第17期	9.34
第18期	0.17
第19期	0.31
第20期	3.18

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

バランス物語50（安定・成長型）

	収益率（％）
第1期	4.14
第2期	3.52
第3期	3.11
第4期	4.80
第5期	8.10
第6期	3.18
第7期	1.06
第8期	3.84
第9期	4.67
第10期	11.75
第11期	0.11
第12期	6.96

第13期	3.61
第14期	5.97
第15期	3.34
第16期	23.09
第17期	14.53
第18期	1.39
第19期	3.11
第20期	6.79

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

バランス物語 7 0 (成長型)

	収益率 (%)
第1期	6.31
第2期	4.28
第3期	5.41
第4期	7.85
第5期	12.28
第6期	4.09
第7期	1.89
第8期	4.99
第9期	6.54
第10期	17.10
第11期	0.39
第12期	9.77
第13期	5.07
第14期	8.57
第15期	4.37
第16期	30.53
第17期	19.52
第18期	2.67
第19期	5.93
第20期	10.40

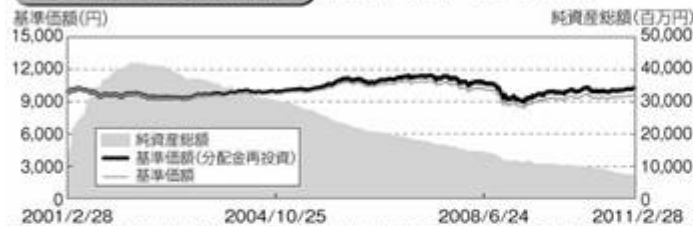
(注) 収益率 = (当期分配付き基準価額 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

<< 参考情報 >>

データの基準日：2011年2月28日

バランス物語30(安定型)

基準価額・純資産の推移 (2001年2月28日～2011年2月28日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日：2000年12月27日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

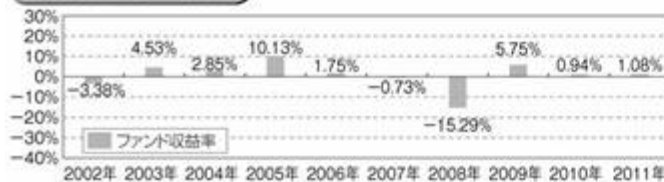
(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザー・ファンド	67.74
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザー・ファンド	18.49
3	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザー・ファンド	8.20
4	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザー・ファンド	4.24

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

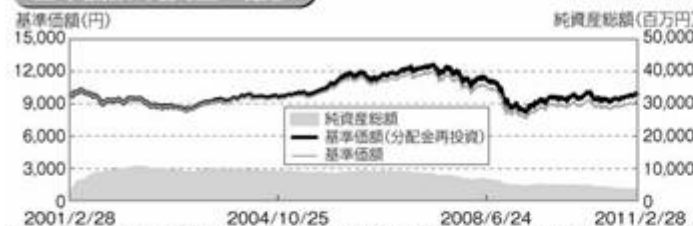
年間収益率の推移



※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として算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2011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。

バランス物語50(安定・成長型)

基準価額・純資産の推移 (2001年2月28日～2011年2月28日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日：2000年12月27日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

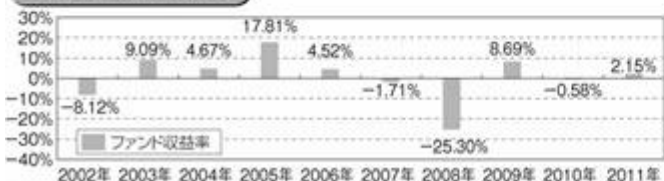
(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザー・ファンド	43.22
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザー・ファンド	30.53
3	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザー・ファンド	12.26
4	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザー・ファンド	12.22

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

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として算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2011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。

分配の推移(税引前)

第16期	(2009.02.25)	10円
第17期	(2009.08.25)	10円
第18期	(2010.02.25)	10円
第19期	(2010.08.25)	10円
第20期	(2011.02.25)	10円
設定来累計		655円

(注)分配金は1万口当たりです。

分配の推移(税引前)

第16期	(2009.02.25)	20円
第17期	(2009.08.25)	20円
第18期	(2010.02.25)	20円
第19期	(2010.08.25)	20円
第20期	(2011.02.25)	20円
設定来累計		815円

(注)分配金は1万口当たりです。

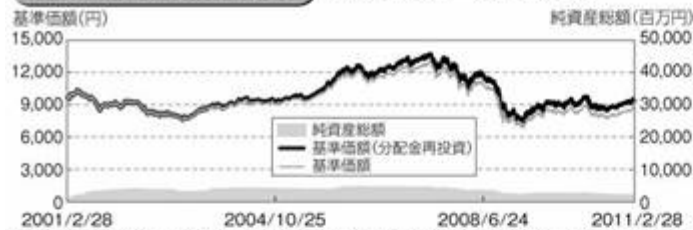
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2011年2月28日

バランス物語70(成長型)

基準価額・純資産の推移 (2001年2月28日～2011年2月28日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日：2000年12月27日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第16期	(2009.02.25)	30円
第17期	(2009.08.25)	30円
第18期	(2010.02.25)	30円
第19期	(2010.08.25)	30円
第20期	(2011.02.25)	30円
設定来累計		940円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	40.85
2	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	21.68
3	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	19.27
4	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	16.11

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

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計算しております。

※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、2011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。

各マザーファンドの主要な資産の状況

DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	日本	98.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.54
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	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.78
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	3.60
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2.88
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.88
5	日本電産	株式	日本	電気機器	2.84
6	日本セラミック	株式	日本	電気機器	2.37
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	2.34
8	三井不動産	株式	日本	不動産業	2.22
9	任天堂	株式	日本	その他製品	2.09
10	エヌ・ティ・ティ・コム	株式	日本	情報・通信業	2.05

組入上位5業種

業種	投資比率(%)
電気機器	21.16
情報・通信業	11.47
輸送用機器	10.61
銀行業	8.93
卸売業	7.61

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2011年2月28日

■DLジャパン・ボンド・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	日本	55.42
社債券	日本	43.22
現金・預金-その他の資産(負債控除後)		1.37
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	305回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2019/12/20	22.35
2	309回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.10	2020/6/20	6.35
3	114回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2.10	2029/12/20	5.85
4	121回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.90	2030/9/20	5.15
5	ヤマダ電機JPY建て転換制限条項付CB 3/28/13	社債券	日本	-	2013/3/28	4.29
6	川崎汽船JPY建てCB 4/4/13	社債券	日本	-	2013/4/4	4.26
7	84回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2.00	2025/12/20	3.66
8	1回 野村総合研究所 転換社債	社債券	日本	-	2014/3/31	3.52
9	12回 物産運動国債(10年)	国債証券	日本	1.20	2017/6/10	3.23
10	33回 ソフトバンク社債	社債券	日本	1.24	2013/9/17	3.13

■DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	米国	54.11
	英国	11.92
	カナダ	5.65
	スイス	4.17
	ドイツ	3.69
	その他	18.09
	小計	97.63
現金・預金-その他の資産(負債控除後)		2.37
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	業種	投資比率(%)
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	2.20
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	1.71
3	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ周辺機器	1.40
4	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	1.25
5	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	1.18
6	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	1.11
7	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	1.08
8	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	1.02
9	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術サービス	0.95
10	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロマリット	0.94

組入上位5業種

業種	投資比率(%)
石油・ガス・消耗燃料	11.49
商業銀行	8.95
医薬品	5.97
金属・鉱業	4.79
機械	3.50

■DLインターナショナル・ボンド・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	米国	29.99
	ドイツ	24.05
	イタリア	11.30
	英国	7.22
	オランダ	5.00
	その他	13.33
	小計	90.89
特殊債券	国際機関	2.93
	オーストラリア	0.91
	ドイツ	0.63
	小計	4.47
現金・預金-その他の資産(負債控除後)		4.64
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	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	ドイツ	3.00	2020/7/4	9.02
2	US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	米国	3.50	2020/5/15	5.82
3	BUNDESUBL 4.25 10/12/12	国債証券	ドイツ	4.25	2012/10/12	5.42
4	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債証券	オランダ	4.00	2018/7/15	5.00
5	US T N/B 1.875 04/30/14	国債証券	米国	1.88	2014/4/30	3.97
6	UK TREASURY 4.75 03/07/20	国債証券	英国	4.75	2020/3/7	3.71
7	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	国債証券	イタリア	4.50	2018/2/1	3.66
8	US T N/B 1.375 11/30/15	国債証券	米国	1.38	2015/11/30	3.61
9	US T N/B 4.5 11/15/15	国債証券	米国	4.50	2015/11/15	3.50
10	US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	米国	4.38	2040/5/15	3.36

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(4)【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

バランス物語30（安定型）

	設定口数	解約口数
第1期	35,605,108,659	576,049,126
第2期	9,827,334,105	2,391,997,411
第3期	3,990,117,278	2,616,038,507
第4期	1,249,186,026	3,751,696,272
第5期	444,905,299	3,858,184,738
第6期	610,545,757	3,817,558,279
第7期	494,903,539	3,177,829,514
第8期	257,808,111	3,091,014,076
第9期	346,297,021	4,224,704,681
第10期	644,216,372	5,260,340,384
第11期	738,045,702	2,057,461,774
第12期	279,381,369	2,512,700,038
第13期	155,935,941	1,648,789,107
第14期	142,082,604	1,052,615,028
第15期	138,415,414	1,030,107,291
第16期	231,258,044	781,488,777
第17期	70,069,607	1,766,755,361
第18期	60,516,732	900,614,199
第19期	60,131,552	1,349,162,006
第20期	38,549,347	2,008,857,995

(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。

バランス物語50（安定・成長型）

	設定口数	解約口数
第1期	9,757,408,415	336,218,737
第2期	2,222,012,375	669,464,883
第3期	1,082,252,628	576,566,653
第4期	271,787,655	819,878,871
第5期	524,918,461	700,011,219
第6期	394,096,699	674,492,749
第7期	352,730,223	913,236,306
第8期	312,319,365	897,957,058
第9期	310,444,579	1,052,016,315
第10期	851,740,445	1,377,642,526
第11期	971,313,753	696,726,325
第12期	172,072,707	922,846,422
第13期	113,906,019	784,590,427
第14期	95,691,183	567,728,975
第15期	107,427,913	328,740,738
第16期	94,289,964	294,957,841
第17期	109,618,982	522,721,252
第18期	81,961,999	236,943,277
第19期	62,517,775	688,403,720
第20期	42,464,037	866,831,805

(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。

バランス物語70（成長型）

	設定口数	解約口数
--	------	------

第1期	3,799,711,848	89,227,158
第2期	918,973,663	173,358,243
第3期	512,171,751	213,875,512
第4期	295,927,734	806,980,299
第5期	235,318,904	305,250,213
第6期	1,070,495,885	427,193,903
第7期	335,104,416	448,393,791
第8期	130,943,623	406,111,910
第9期	246,537,732	636,486,882
第10期	653,691,053	625,361,209
第11期	375,837,525	367,115,061
第12期	173,524,207	438,344,538
第13期	149,589,640	296,962,322
第14期	90,562,299	259,584,258
第15期	78,749,603	149,229,368
第16期	137,057,880	73,171,732
第17期	78,670,303	179,724,398
第18期	59,084,628	114,373,354
第19期	46,077,702	168,297,278
第20期	30,671,736	505,121,198

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間（平成22年2月26日から平成22年8月25日まで）及び第20期計算期間（平成22年8月26日から平成23年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【バランス物語30（安定型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 平成22年8月25日現在	第20期 平成23年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	319,595,067	191,228,160
親投資信託受益証券	8,605,268,531	7,109,482,506
未収入金	-	30,000,000
流動資産合計	8,924,863,598	7,330,710,666
資産合計	8,924,863,598	7,330,710,666
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,481,152	7,510,843
未払解約金	7,846,521	48,781,203
未払受託者報酬	5,012,491	4,203,919
未払委託者報酬	70,175,413	58,855,567
その他未払費用	250,525	199,598
流動負債合計	92,766,102	119,551,130
負債合計	92,766,102	119,551,130
純資産の部		
元本等		
元本	9,481,152,563	7,510,843,915
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* ₃ 649,055,067	* ₃ 299,684,379
（分配準備積立金）	861,018,939	714,050,929
元本等合計	8,832,097,496	7,211,159,536
純資産合計	8,832,097,496	7,211,159,536
負債純資産合計	8,924,863,598	7,330,710,666

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期 自 平成22年 2月26日 至 平成22年 8月25日	第20期 自 平成22年 8月26日 至 平成23年 2月25日
営業収益		
受取利息	55,718	46,483
有価証券売買等損益	65,785,956	314,213,975
営業収益合計	65,841,674	314,260,458
営業費用		
受託者報酬	5,012,491	4,203,919
委託者報酬	70,175,413	58,855,567
その他費用	250,525	199,598
営業費用合計	75,438,429	63,259,084
営業利益又は営業損失（ ）	9,596,755	251,001,374
経常利益又は経常損失（ ）	9,596,755	251,001,374
当期純利益又は当期純損失（ ）	9,596,755	251,001,374
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	17,857,208	29,358,433
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	696,040,454	649,055,067
剰余金増加額又は欠損金減少額	87,136,379	137,490,995
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	87,136,379	137,490,995
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,215,877	2,252,405
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,215,877	2,252,405
分配金	* ₁ 9,481,152	* ₁ 7,510,843
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	649,055,067	299,684,379

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 同左

（追加情報）

第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用していません。	

（貸借対照表に関する注記）

区分	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23年2月25日現在
*1 期首元本額	10,770,183,017円	9,481,152,563円
期中追加設定元本額	60,131,552円	38,549,347円
期中解約元本額	1,349,162,006円	2,008,857,995円
*2 計算期間末日における受益権の総数	9,481,152,563口	7,510,843,915口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は649,055,067円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は299,684,379円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（73,856,409円）及び分配準備積立金（870,500,091円）より分配対象収益は944,356,500円（1万口当たり996.04円）であり、うち9,481,152円（1万口当たり10円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（42,488,969円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（61,559,790円）及び分配準備積立金（679,072,803円）より分配対象収益は783,121,562円（1万口当たり1,042.65円）であり、うち7,510,843円（1万口当たり10円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	---	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23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)親投資信託受益証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	18,971,480	221,467,373
合計	18,971,480	221,467,373

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額	0.9315円	0.9601円
(1万口当たり純資産額)	(9,315円)	(9,601円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
----	----	----	--------	----

親投資信託受益証券	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	1,116,511,337	1,320,609,609	
親投資信託受益証券	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	3,775,918,243	4,889,814,124	
親投資信託受益証券	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	279,548,036	303,645,076	
親投資信託受益証券	D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	385,880,556	595,413,697	
合計		5,557,858,172	7,109,482,506	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【バランス物語50（安定・成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 平成22年8月25日現在	第20期 平成23年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	160,614,943	117,065,753
親投資信託受益証券	4,003,668,291	3,577,408,017
流動資産合計	4,164,283,234	3,694,473,770
資産合計	4,164,283,234	3,694,473,770
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,654,733	8,005,998
未払解約金	3,104,728	19,430,207
未払受託者報酬	2,367,155	2,016,075
未払委託者報酬	33,140,822	28,225,768
その他未払費用	118,276	95,675
流動負債合計	48,385,714	57,773,723
負債合計	48,385,714	57,773,723
純資産の部		
元本等		
元本	4,827,366,846	4,002,999,078
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* ₃ 711,469,326	* ₃ 366,299,031
（分配準備積立金）	775,220,847	656,262,272
元本等合計	4,115,897,520	3,636,700,047
純資産合計	4,115,897,520	3,636,700,047
負債純資産合計	4,164,283,234	3,694,473,770

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第19期	第20期
	自 平成22年 2月26日 至 平成22年 8月25日	自 平成22年 8月26日 至 平成23年 2月25日
営業収益		
受取利息	24,618	22,508
有価証券売買等損益	88,018,307	283,739,726
営業収益合計	87,993,689	283,762,234
営業費用		
受託者報酬	2,367,155	2,016,075
委託者報酬	33,140,822	28,225,768
その他費用	118,276	95,675
営業費用合計	35,626,253	30,337,518
営業利益又は営業損失()	123,619,942	253,424,716
経常利益又は経常損失()	123,619,942	253,424,716
当期純利益又は当期純損失()	123,619,942	253,424,716
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	9,050,056	22,674,666
期首剰余金又は期首欠損金()	643,557,771	711,469,326
剰余金増加額又は欠損金減少額	81,185,549	127,709,392
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	81,185,549	127,709,392
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,772,373	5,283,149
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,772,373	5,283,149
分配金	* ₁ 9,654,733	* ₁ 8,005,998
期末剰余金又は期末欠損金()	711,469,326	366,299,031

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 同左

（追加情報）

第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用していません。	

（貸借対照表に関する注記）

区分	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23年2月25日現在
*1 期首元本額	5,453,252,791円	4,827,366,846円
期中追加設定元本額	62,517,775円	42,464,037円
期中解約元本額	688,403,720円	866,831,805円
*2 計算期間末日における受益権の総数	4,827,366,846口	4,002,999,078口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は711,469,326円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は366,299,031円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,834,819円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(195,503,735円)及び分配準備積立金(781,040,761円)より分配対象収益は980,379,315円(1万口当たり2,030.88円)であり、うち9,654,733円(1万口当たり20円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(27,563,658円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(168,292,386円)及び分配準備積立金(636,704,612円)より分配対象収益は832,560,656円(1万口当たり2,079.84円)であり、うち8,005,998円(1万口当たり20円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23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)親投資信託受益証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	110,860,999	236,789,826
合計	110,860,999	236,789,826

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23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)	0.8526円 (8,526円)	0.9085円 (9,085円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
----	----	----	--------	----

親投資信託受益証券	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	933,320,832	1,103,931,880	
親投資信託受益証券	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	1,219,975,096	1,579,867,749	
親投資信託受益証券	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	407,789,422	442,940,870	
親投資信託受益証券	D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	292,072,274	450,667,518	
合計		2,853,157,624	3,577,408,017	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【バランス物語 70（成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 平成22年 8月25日現在	第20期 平成23年 2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	108,206,634	99,003,965
親投資信託受益証券	2,409,393,133	2,263,360,192
流動資産合計	2,517,599,767	2,362,364,157
資産合計	2,517,599,767	2,362,364,157
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,626,966	8,203,618
未払解約金	663,252	4,420,904
未払受託者報酬	1,419,279	1,272,780
未払委託者報酬	19,870,515	17,819,520
その他未払費用	70,879	60,370
流動負債合計	31,650,891	31,777,192
負債合計	31,650,891	31,777,192
純資産の部		
元本等		
元本	3,208,988,967	2,734,539,505
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* ₃ 723,040,091	* ₃ 403,952,540
（分配準備積立金）	725,437,985	623,985,631
元本等合計	2,485,948,876	2,330,586,965
純資産合計	2,485,948,876	2,330,586,965
負債純資産合計	2,517,599,767	2,362,364,157

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期	第20期
	自 平成22年 2月26日 至 平成22年 8月25日	自 平成22年 8月26日 至 平成23年 2月25日
営業収益		
受取利息	16,988	18,067
有価証券売買等損益	132,824,137	258,967,059
営業収益合計	132,807,149	258,985,126
営業費用		
受託者報酬	1,419,279	1,272,780
委託者報酬	19,870,515	17,819,520
その他費用	70,879	60,370
営業費用合計	21,360,673	19,152,670
営業利益又は営業損失（ ）	154,167,822	239,832,456
経常利益又は経常損失（ ）	154,167,822	239,832,456
当期純利益又は当期純損失（ ）	154,167,822	239,832,456
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	3,203,944	20,204,678
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	577,358,058	723,040,091
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,155,324	113,776,813
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	29,155,324	113,776,813
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,838,625	6,113,422
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,838,625	6,113,422
分配金	* ₁ 9,626,966	* ₁ 8,203,618
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	723,040,091	403,952,540

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 同左

（追加情報）

第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用していません。	

（貸借対照表に関する注記）

区分	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23年2月25日現在
*1 期首元本額	3,331,208,543円	3,208,988,967円
期中追加設定元本額	46,077,702円	30,671,736円
期中解約元本額	168,297,278円	505,121,198円
*2 計算期間末日における受益権の総数	3,208,988,967口	2,734,539,505口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は723,040,091円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は403,952,540円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
*1 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,127,139円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(267,337,606円)及び分配準備積立金(728,937,812円)より分配対象収益は1,002,402,557円(1万口当たり3,123.73円)であり、うち9,626,966円(1万口当たり30円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,213,657円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(234,047,046円)及び分配準備積立金(611,975,592円)より分配対象収益は866,236,295円(1万口当たり3,167.76円)であり、うち8,203,618円(1万口当たり30円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23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)親投資信託受益証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 19 期 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	第 20 期 自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	135,659,958	222,079,898
合計	135,659,958	222,079,898

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第 19 期 平成22年8月25日現在	第 20 期 平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額	0.7747円	0.8523円
(1万口当たり純資産額)	(7,747円)	(8,523円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
----	----	----	--------	----

親投資信託受益証券	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	802,852,938	949,614,455	
親投資信託受益証券	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	385,541,505	499,276,248	
親投資信託受益証券	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	413,294,663	448,920,662	
親投資信託受益証券	D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	236,907,860	365,548,827	
合計		1,838,596,966	2,263,360,192	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

（参考）

バランス物語30（安定型）、バランス物語50（安定・成長型）、バランス物語70（成長型）は、「DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド」、「DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」、「DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド」、「DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		89,931,929	29,331,194
コール・ローン		194,867,270	126,793,234
株式		9,861,245,839	11,075,464,960
未収配当金		19,159,236	27,894,972
流動資産合計		10,165,204,274	11,259,484,360
資産合計		10,165,204,274	11,259,484,360
負債の部			
流動負債			
未払金		66,463,723	-
流動負債合計		66,463,723	-
負債合計		66,463,723	-
純資産の部			
元本等			
元本		11,308,489,661	10,365,520,746
剰余金			
剰余金又は欠損金()	*3	1,209,749,110	893,963,614
元本等合計		10,098,740,551	11,259,484,360
純資産合計		10,098,740,551	11,259,484,360
負債純資産合計		10,165,204,274	11,259,484,360

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年3月16日から平成23年3月15日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 同左
----------------------------	---	---

(追加情報)

自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用していません。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中解約元本額	11,488,651,105円 423,121,219円 603,282,663円	11,308,489,661円 338,131,319円 1,281,100,234円
同期末における元本の内訳 バランス物語30（安定型） バランス物語50（安定・成長型） バランス物語70（成長型） D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型 D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型 D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型 D I A Mライフサイクル・ファンドVA1（安定型） D I A Mライフサイクル・ファンドVA2（安定・成長型） D I A Mライフサイクル・ファンドVA3（成長型） D I A Mバランス物語30VA（安定型） D I A Mバランス物語50VA（安定・成長型） D I A Mバランス物語70VA（成長型） （合計）	454,649,869円 536,976,144円 526,433,335円 249,418,824円 1,321,237,193円 1,722,777,655円 797,215,617円 2,768,492,457円 1,327,229,066円 458,648,234円 845,489,093円 299,922,174円 11,308,489,661円	279,548,036円 407,789,422円 413,294,663円 251,882,044円 1,359,783,754円 1,747,214,137円 733,890,123円 2,525,673,562円 1,194,279,641円 403,224,068円 764,911,317円 284,029,979円 10,365,520,746円

*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	11,308,489,661口	10,365,520,746口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,209,749,110円であります。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年8月25日現在	平成23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)株式 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。	(1)株式 同左

	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	498,300,410	1,264,402,539
合計	498,300,410	1,264,402,539

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成22年8月25日現在	平成23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)	0.8930円 (8,930円)	1.0862円 (10,862円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成23年2月25日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	SCHLUMBERGER LTD	12,142	89.650	1,088,530.300	
	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,621	49.480	278,127.080	
	NXP SEMICONDUCTOR NV	11,917	29.120	347,023.040	
	JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	6,000	45.020	270,120.000	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	7,466	33.980	253,694.680	
	AMAZON.COM INC	2,190	177.750	389,272.500	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	8,129	160.770	1,306,899.330	

	ALLERGAN INC	4,957	73.000	361,861.000	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	12,365	53.040	655,839.600	
	HESS CORP	5,259	83.730	440,336.070	
	FORTUNE BRANDS INC	6,058	60.610	367,175.380	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	11,966	35.110	420,126.260	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,349	92.170	400,847.330	
	APACHE CORP	4,856	120.500	585,148.000	
	APPLE INC	6,130	342.790	2,101,302.700	
	ALBEMARLE CORP	9,400	56.020	526,588.000	
	ATMEL CORP	28,147	14.650	412,353.550	
	AUTOLIV INC	3,966	72.040	285,710.640	
	AMETEK INC	9,813	41.190	404,197.470	
	VERIZON COMM INC	22,190	35.580	789,520.200	
	YUM! BRANDS INC	8,536	49.370	421,422.320	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	13,662	25.400	347,014.800	
	CORN PRODUCTS INTL INC	6,648	46.470	308,932.560	
	AMPHENOL CORP	7,487	56.710	424,587.770	
	WADDELL & REED FINANCIAL-A	6,988	40.050	279,869.400	
	CSX CORP	10,480	71.890	753,407.200	
	CERNER CORP	4,022	97.630	392,667.860	
	JPMORGAN CHASE & CO	33,029	45.910	1,516,361.390	
	CISCO SYSTEMS INC	33,537	18.350	615,403.950	
	COCA-COLA CO/THE	13,839	63.880	884,035.320	
	COMERICA INC	9,346	38.340	358,325.640	
	COMCAST CORP-CL A	14,515	24.940	362,004.100	
	CMS ENERGY CORP	35,220	19.060	671,293.200	
	DIRECTV	13,940	45.700	637,058.000	
	CUMMINS INC	5,366	100.870	541,268.420	
	DANAHER CORP	9,910	49.760	493,121.600	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	6,295	74.930	471,684.350	
	TARGET CORP	4,387	52.000	228,124.000	
	MIPS TECHNOLOGIES INC-CLA	14,433	12.170	175,649.610	
	DEERE & CO	6,621	88.910	588,673.110	
	DECKERS OUTDOOR CORP	3,338	89.800	299,752.400	
	THE WALT DISNEY CO	19,175	42.420	813,403.500	
	EBAY INC	8,442	33.090	279,345.780	
	EMC CORP/MASS	22,477	26.550	596,764.350	
	BANK OF AMERICA CORP	63,880	13.970	892,403.600	
	CITIGROUP INC	126,140	4.690	591,596.600	
	EATON CORP	6,369	104.900	668,108.100	
	EXPRESS SCRIPTS INC	11,293	54.500	615,468.500	
	EXXON MOBIL CORP	32,658	85.970	2,807,608.260	
	FMC CORP	5,616	75.180	422,210.880	
	FIFTH THIRD BANCORP	23,281	14.300	332,918.300	
	FORD MOTOR CO	19,468	14.700	286,179.600	
	FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	10,603	51.860	549,871.580	
	GILEAD SCIENCES INC	7,580	38.780	293,952.400	
	GENESEE & WYOMING INC-CL A	5,408	50.800	274,726.400	
	GOODRICH CORP	4,849	86.530	419,583.970	
	GENERAL ELECTRIC CO	62,770	20.580	1,291,806.600	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,961	52.450	365,104.450	
	HALLIBURTON CO	17,758	45.550	808,876.900	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,344	163.440	546,543.360	
	INFORMATICA CORP	7,229	46.080	333,112.320	
	HEWLETT-PACKARD CO	13,604	42.170	573,680.680	
	F5 NETWORKS INC	2,194	117.060	256,829.640	
	JUNIPER NETWORKS INC	6,708	43.170	289,584.360	
	TIBCO SOFTWARE INC	15,037	24.010	361,038.370	
	INTUIT INC	5,678	51.680	293,439.040	

	INTEL CORP	31,928	21.285	679,587.480	
	JOHNSON & JOHNSON	16,554	60.250	997,378.500	
	KLA-TENCOR CORP	7,391	47.780	353,141.980	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,589	41.150	394,587.350	
	MCDONALD'S CORPORATION	5,461	75.210	410,721.810	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	6,846	84.580	579,034.680	
	METLIFE INC	18,132	46.220	838,061.040	
	MERCK & CO. INC.	22,417	32.030	718,016.510	
	ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	27,078	11.100	300,565.800	
	MICROSOFT CORP	53,560	26.760	1,433,265.600	
	MYLAN LABORATORIES	16,365	22.130	362,157.450	
	ILLUMINA INC	5,302	68.100	361,066.200	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,434	77.890	656,924.260	
	NETAPP INC	5,816	50.840	295,685.440	
	NOBLE ENERGY INC	6,675	86.760	579,123.000	
	NORDSTROM INC	8,219	45.000	369,855.000	
	COACH INC	12,730	54.120	688,947.600	
	WELLS FARGO & CO	33,728	31.440	1,060,408.320	
	ORACLE CORP	31,334	32.250	1,010,521.500	
	PEPSICO INC	11,103	63.030	699,822.090	
	PFIZER INC	42,731	18.900	807,615.900	
	CONOCOPHILLIPS	11,646	77.280	900,002.880	
	ALTRIA GROUP INC	20,340	24.710	502,601.400	
	IPG PHOTONICS CORP	5,454	51.860	282,844.440	
	PRAXAIR INC	4,697	97.460	457,769.620	
	PRECISION CASTPARTS CORP	3,176	140.240	445,402.240	
	T ROWE PRICE GROUP INC	5,442	66.300	360,804.600	
	PROCTER & GAMBLE CO	20,347	63.050	1,282,878.350	
	QUALCOMM INC	13,563	57.800	783,941.400	
	US BANCORP	26,301	27.500	723,277.500	
	ROPER INDUSTRIES INC	4,420	82.230	363,456.600	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	10,580	59.330	627,711.400	
	PRICELINE.COM INC	684	462.340	316,240.560	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,562	64.010	676,073.620	
	AT&T INC	39,901	27.920	1,114,035.920	
	CHEVRON CORP	12,012	102.030	1,225,584.360	
	NETFLIX INC	1,529	215.180	329,010.220	
	TESORO CORP	11,338	23.010	260,887.380	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,901	55.330	381,832.330	
	MARATHON OIL CORP	10,234	48.130	492,562.420	
	UNION PACIFIC CORP	8,628	93.710	808,529.880	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	8,956	82.720	740,840.320	
	CBS CORP	16,379	22.030	360,829.370	
	WAL-MART STORES INC	11,991	52.090	624,611.190	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,920	34.910	276,487.200	
	CB RICHARD ELLIS GROUP INC	14,487	24.210	350,730.270	
	GOOGLE INC	1,850	608.820	1,126,317.000	
	POLYPORE INTERNATIONAL INC	7,498	56.530	423,861.940	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	4,260	53.730	228,889.800	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,542	134.020	340,678.840	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,264	245.300	310,059.200	
	VIRGIN MEDIA INC	16,846	26.870	452,652.020	
	TRANSDIGM GROUP INC	4,366	79.230	345,918.180	
	MASTERCARD INC	2,394	244.180	584,566.920	
	RIVERBED TECHNOLOGY INC	5,998	40.850	245,018.300	
	OWENS CORNING	7,808	35.160	274,529.280	
	TIME WARNER CABLE INC	8,502	70.900	602,791.800	
	ARUBA NETWORKS INC	13,025	29.650	386,191.250	
	CAVIUM NETWORKS INC	5,607	42.080	235,942.560	

	WABCO HOLDING INC	4,494	57.480	258,315.120	
	TERADATA CORP	7,825	46.870	366,757.750	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	17,852	62.290	1,112,001.080	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,459	35.840	554,050.560	
	LORILLARD INC	3,933	78.460	308,583.180	
	MOLYCORP INC	5,738	46.990	269,628.620	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	8,581	59.210	508,081.010	
	INTRALINKS HOLDINGS INC	10,504	28.260	296,843.040	
	FORTINET INC	10,704	40.780	436,509.120	
	MOTRICITY INC	7,541	15.880	119,751.080	
米ドル小計	銘柄数 : 135	1,796,514		75,492,858.300	
	組入時価比率 : 54.95%			(6,187,394,666)	
	合計時価比率 : 55.87%				
英ポンド	XSTRATA PLC	26,841	13.595	364,903.390	
	ABERDEEN ASSET MGMT	148,580	2.063	306,520.540	
	AMEC PLC	20,478	11.540	236,316.120	
	BARCLAYS PLC	67,860	3.125	212,062.500	
	AGGREKO PLC	14,619	13.890	203,057.910	
	CRODA INTERNATIONAL	12,247	15.510	189,950.970	
	DIAGEO PLC	35,531	11.970	425,306.070	
	GKN PLC	102,437	1.974	202,210.630	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	21,776	23.965	521,861.840	
	SPECTRIS PLC	10,052	12.510	125,750.520	
	HSBC HOLDINGS PLC	143,319	6.948	995,780.410	
	ARM HOLDINGS PLC	48,477	5.735	278,015.590	
	CENTRICA PLC	102,588	3.336	342,233.560	
	INTL POWER PLC	64,304	3.267	210,081.160	
	PRUDENTIAL PLC	59,477	6.805	404,740.980	
	RIO TINTO PLC	16,417	41.700	684,588.900	
	VODAFONE GROUP PLC	436,618	1.732	756,222.370	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12,522	31.920	399,702.240	
	ROTORK PLC	10,516	17.440	183,399.040	
	BP PLC	122,596	4.930	604,398.280	
	SMITHS GROUP PLC	13,632	13.240	180,487.680	
	STANDARD CHARTERED PLC	13,354	15.985	213,463.690	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	264,986	0.657	174,095.800	
	BG GROUP PLC	39,312	14.810	582,210.720	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	35,237	11.780	415,091.860	
	WEIR GROUP	10,414	16.080	167,457.120	
	ASTRAZENECA PLC	11,255	29.450	331,459.750	
	PREMIER OIL	9,530	20.100	191,553.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	67,112	21.900	1,469,752.800	
	EXPERIAN PLC	21,603	7.555	163,210.660	
	SHIRE PLC	17,343	16.850	292,229.550	
	PETROFAC LTD	11,968	13.820	165,397.760	
英ポンド小計	銘柄数 : 32	1,993,001		11,993,513.410	
	組入時価比率 : 14.08%			(1,585,182,667)	
	合計時価比率 : 14.31%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	6,028	67.700	408,095.600	
	BARRICK GOLD CORP	16,121	50.230	809,757.830	
	BANK OF NOVA SCOTIA	18,117	59.350	1,075,243.950	
	NATIONAL BANK OF CANADA	8,659	73.600	637,302.400	
	BCE INC	12,979	35.400	459,456.600	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	10,933	39.400	430,760.200	
	CAMECO CORP	8,219	39.450	324,239.550	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	16,790	47.060	790,137.400	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,723	69.810	469,332.630	
	AGRIUM INC	8,935	90.050	804,596.750	
	ENBRIDGE INC	7,850	57.080	448,078.000	

	TECK RESOURCES LTD-CL B	7,742	52.580	407,074.360	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	15,204	36.830	559,963.320	
カナダドル小計	銘柄数 : 13	144,300		7,624,038.590	
	組入時価比率 : 5.65%			(636,226,020)	
	合計時価比率 : 5.74%				
スイスフラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	13,398	42.770	573,032.460	
	NESTLE SA-REGISTERED	21,117	52.650	1,111,810.050	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	4,639	136.700	634,151.300	
	SULZER AG-REG	1,892	135.100	255,609.200	
	NOVARTIS AG-REG SHS	12,690	51.150	649,093.500	
	SWISSCOM AG-REG	835	404.700	337,924.500	
	UBS AG-REGISTERED	37,094	18.130	672,514.220	
	THE SWATCH GROUP AG-B	838	387.300	324,557.400	
	DUFREY GROUP	2,422	105.500	255,521.000	
スイスフラン小計	銘柄数 : 9	94,925		4,814,213.630	
	組入時価比率 : 3.79%			(426,539,328)	
	合計時価比率 : 3.85%				
スウェーデンクローネ	ATLAS COPCO AB-A SHS	21,151	154.000	3,257,254.000	
	ELEKTA AB	8,622	244.600	2,108,941.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	15,614	208.600	3,257,080.400	
	SWEDISH MATCH AB	12,882	196.900	2,536,465.800	
	HEXAGON AB	13,329	132.600	1,767,425.400	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 5	71,598		12,927,166.800	
	組入時価比率 : 1.48%			(166,114,093)	
	合計時価比率 : 1.50%				
ユーロ	ANDRITZ AG	3,130	59.610	186,579.300	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	8,294	39.995	331,718.530	
	BEKAERT NV	2,848	73.930	210,552.640	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,407	57.000	251,199.000	
	MAN SE	3,842	85.850	329,835.700	
	SIEMENS AG-REG	5,796	93.810	543,722.760	
	BAYER AG	4,874	55.000	268,070.000	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,157	42.620	305,031.340	
	DAIMLER AG	6,074	50.490	306,676.260	
	BASF SE	9,067	59.000	534,953.000	
	ALLIANZ SE	6,380	101.800	649,484.000	
	LINDE AG	2,424	107.950	261,670.800	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	31,868	7.663	244,204.480	
	TELEFONICA S.A	43,736	18.000	787,248.000	
	BANCO SANTANDER SA	53,013	8.743	463,492.650	
	DANONE	6,793	44.750	303,986.750	
	BNP PARIBAS	11,891	54.650	649,843.150	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	1,832	111.200	203,718.400	
	RUBIS	2,353	79.100	186,122.300	
	SEB SA	3,032	67.710	205,296.720	
	SOCIETE GENERALE-A	4,135	48.570	200,836.950	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	3,521	114.500	403,154.500	
	GDF SUEZ	21,623	28.805	622,850.510	
	ALSTOM	6,252	42.525	265,866.300	
	ING GROEP NV-CVA	23,351	8.879	207,333.520	
	ASML HOLDING NV	8,764	31.100	272,560.400	
	UNILEVER NV-CVA	18,060	21.710	392,082.600	
	VOPAK (KON.)	7,547	33.770	254,862.190	
	KONINKLIJKE KPN NV	35,662	11.610	414,035.820	
	JERONIMO MARTINS	22,976	11.510	264,453.760	
ユーロ小計	銘柄数 : 30	370,702		10,521,442.330	
	組入時価比率 : 10.58%			(1,190,922,057)	

	合計時価比率：10.75%				
デンマーククローネ	CARLSBERG AS-B	3,595	569.500	2,047,352.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	5,350	655.500	3,506,925.000	
	PANDORA A/S	4,755	328.200	1,560,591.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,936	123.000	1,591,128.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数：4	26,636		8,705,996.500	
	組入時価比率：1.17%			(132,157,027)	
	合計時価比率：1.19%				
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	13,990	211.900	2,964,481.000	
	DNB HOLDING ASA	41,105	84.800	3,485,704.000	
	STATOIL ASA	14,954	148.000	2,213,192.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数：3	70,049		8,663,377.000	
	組入時価比率：1.12%			(126,571,938)	
	合計時価比率：1.14%				
香港ドル	LI & FUNG LTD	62,000	46.200	2,864,400.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24,700	164.100	4,053,270.000	
	FIRST PACIFIC CO	356,000	6.260	2,228,560.000	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	38,000	87.500	3,325,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	22,500	106.100	2,387,250.000	
香港ドル小計	銘柄数：5	503,200		14,858,480.000	
	組入時価比率：1.39%			(156,162,625)	
	合計時価比率：1.41%				
シンガポール・ドル	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	527,000	0.625	329,375.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,000	7.970	334,740.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	87,000	5.670	493,290.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	99,000	9.180	908,820.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数：4	755,000		2,066,225.000	
	組入時価比率：1.18%			(132,713,632)	
	合計時価比率：1.20%				
オーストラリアドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	28,910	24.080	696,152.800	
	BHP BILLITON LTD	37,146	45.990	1,708,344.540	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	21,048	52.730	1,109,861.040	
	NEWCREST MINING LTD	6,679	39.110	261,215.690	
	PANAUST LTD	340,271	0.800	272,216.800	
オーストラリアドル小計	銘柄数：5	434,054		4,047,790.870	
	組入時価比率：2.98%			(335,480,907)	
	合計時価比率：3.03%				
合計				11,075,464,960	
				(11,075,464,960)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

株式以外の有価証券
該当事項はありません。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 135銘柄	54.95%	55.87%
英ポンド	株式 32銘柄	14.08%	14.31%
カナダドル	株式 13銘柄	5.65%	5.74%
スイスフラン	株式 9銘柄	3.79%	3.85%
スウェーデンクローネ	株式 5銘柄	1.48%	1.50%
ユーロ	株式 30銘柄	10.58%	10.75%
デンマーククローネ	株式 4銘柄	1.17%	1.19%
ノルウェークローネ	株式 3銘柄	1.12%	1.14%
香港ドル	株式 5銘柄	1.39%	1.41%
シンガポール・ドル	株式 4銘柄	1.18%	1.20%
オーストラリアドル	株式 5銘柄	2.98%	3.03%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		107,182	352,189
コール・ローン		515,956,359	525,153,812
株式		26,008,640,000	29,004,169,600
未収入金		27,165,947	37,020,203
未収配当金		26,021,800	45,734,150
流動資産合計		26,577,891,288	29,612,429,954
資産合計		26,577,891,288	29,612,429,954
負債の部			
流動負債			
未払金		53,765,344	124,829,534
流動負債合計		53,765,344	124,829,534
負債合計		53,765,344	124,829,534
純資産の部			
元本等			
元本		26,739,946,972	24,929,829,888
剰余金			
剰余金又は欠損金()	*3	215,821,028	4,557,770,532
元本等合計		26,524,125,944	29,487,600,420
純資産合計		26,524,125,944	29,487,600,420
負債純資産合計		26,577,891,288	29,612,429,954

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年3月16日から平成23年3月15日までとなっております。	計算期間の取扱い 同左

(追加情報)

自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用していません。	

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	27,497,434,569円	26,739,946,972円
同期中追加設定元本額	571,086,741円	1,497,433,361円
同期中解約元本額	1,328,574,338円	3,307,550,445円
同期末における元本の内訳		
バランス物語30（安定型）	1,606,410,122円	1,116,511,337円
バランス物語50（安定・成長型）	1,217,884,766円	933,320,832円
バランス物語70（成長型）	986,003,764円	802,852,938円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型	924,419,393円	912,725,524円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,148,249,918円	3,177,028,305円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型	3,352,016,574円	3,454,333,587円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA1（安定型）	2,797,496,396円	2,629,832,631円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA2（安定・成長型）	6,155,207,578円	5,891,541,486円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA3（成長型）	2,502,155,293円	2,326,268,685円
D I A Mバランス物語30VA（安定型）	1,553,704,038円	1,393,551,430円
D I A Mバランス物語50VA（安定・成長型）	1,913,363,140円	1,746,976,137円
D I A Mバランス物語70VA（成長型）	583,035,990円	544,886,996円
（合計）	26,739,946,972円	24,929,829,888円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	26,739,946,972口	24,929,829,888口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は215,821,028円であります。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年8月25日現在	平成23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)株式 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)株式 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	4,310,312,654	962,695,066
合計	4,310,312,654	962,695,066

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成22年8月25日現在	平成23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)	0.9919円 (9,919円)	1.1828円 (11,828円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成23年2月25日現在

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
エムスリー	369	424,500	156,640,500	
麒麟HD	105,000	1,150	120,750,000	
大黒天物産	66,700	2,715	181,090,500	
日本たばこ産業	1,014	337,500	342,225,000	
三越伊勢丹HD	203,000	979	198,737,000	
グローウェルHD	171,700	2,104	361,256,800	
セブン&アイ・HLDGS	95,300	2,278	217,093,400	
東レ	487,000	600	292,200,000	
グリーン	274,000	1,312	359,488,000	
信越化学	75,000	4,640	348,000,000	
武田薬品	89,200	4,015	358,138,000	
アステラス製薬	53,500	3,210	171,735,000	
オリエンタルランド	25,900	8,100	209,790,000	
ヤフー	15,000	30,700	460,500,000	
アルファシステムズ	186,500	1,422	265,203,000	
楽天	4,258	71,600	304,872,800	
大塚商会	31,200	5,720	178,464,000	
富士フイルムHLDGS	107,000	2,856	305,592,000	
新日本製鐵	639,000	292	186,588,000	
神戸製鋼所	1,034,000	220	227,480,000	
JFEホールディングス	117,600	2,571	302,349,600	
住友鉱山	219,000	1,500	328,500,000	
住友電工	346,900	1,200	416,280,000	
東京製綱	1,250,000	273	341,250,000	
東芝機械	360,000	478	172,080,000	
小松製作所	176,000	2,422	426,272,000	
クボタ	296,000	827	244,792,000	
日本精工	389,000	769	299,141,000	
東芝	799,000	529	422,671,000	
三菱電機	414,000	939	388,746,000	
日本電産	111,500	7,580	845,170,000	
日新電機	349,000	567	197,883,000	
オムロン	162,000	2,238	362,556,000	

パナソニック	231,000	1,096	253,176,000
ソニー	129,000	2,967	382,743,000
デンソー	52,800	3,015	159,192,000
日本セラミック	418,800	1,651	691,438,800
ファナック	47,800	12,220	584,116,000
エンプラス	205,000	1,210	248,050,000
京セラ	52,300	8,420	440,366,000
村田製作所	75,000	5,920	444,000,000
日東電工	89,200	4,785	426,822,000
川崎重工業	669,000	319	213,411,000
日産自動車	466,500	838	390,927,000
トヨタ自動車	294,900	3,755	1,107,349,500
アイシン精機	129,800	3,100	402,380,000
本田技研	242,400	3,540	858,096,000
サイゼリヤ	29,000	1,548	44,892,000
シークス	510,000	1,130	576,300,000
キャノン	143,300	3,915	561,019,500
シチズンホールディングス	310,000	525	162,750,000
任天堂	26,000	25,000	650,000,000
伊藤忠	158,000	837	132,246,000
三井物産	406,000	1,463	593,978,000
東京エレクトロン	73,000	5,270	384,710,000
住友商事	282,000	1,207	340,374,000
三菱商事	257,700	2,256	581,371,200
三菱UFJフィナンシャルG	2,370,000	450	1,066,500,000
三井住友フィナンシャルG	278,000	3,060	850,680,000
住友信託	511,000	506	258,566,000
みずほフィナンシャルG	2,767,000	165	456,555,000
野村ホールディングス	479,000	508	243,332,000
東京海上HD	204,000	2,658	542,232,000
三井不動産	381,000	1,715	653,415,000
三菱地所	256,000	1,652	422,912,000
住友不動産	25,000	2,147	53,675,000
東日本旅客鉄道	97,400	5,700	555,180,000
日本テレビ放送網	25,200	13,440	338,688,000
日本電信電話	174,500	3,985	695,382,500
KDDI	946	532,000	503,272,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	3,977	153,500	610,469,500
セコム	67,000	4,065	272,355,000
メイテック	87,300	1,800	157,140,000
ヤマダ電機	60,000	6,080	364,800,000
ニトリホールディングス	46,700	7,190	335,773,000
合計	21,787,164		29,004,169,600

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

「D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		275,839,344	8,889,766
コール・ローン		192,761,961	270,277,080
国債証券		12,945,286,568	13,057,563,170
特殊債券		612,571,751	639,467,082
派生商品評価勘定		63,338,010	12,966,871
未収入金		57,513,227	21,092,773
未収利息		134,564,128	166,966,493
前払費用		25,798,923	28,428,990
流動資産合計		14,307,673,912	14,205,652,225
資産合計		14,307,673,912	14,205,652,225
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		39,204,200	26,898,768
未払金		292,828,119	31,464,095
流動負債合計		332,032,319	58,362,863
負債合計		332,032,319	58,362,863
純資産の部			
元本等			
元本		8,868,372,648	9,168,550,077
剰余金			
剰余金又は欠損金()		5,107,268,945	4,978,739,285
元本等合計		13,975,641,593	14,147,289,362
純資産合計		13,975,641,593	14,147,289,362
負債純資産合計		14,307,673,912	14,205,652,225

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、原則として時価 で評価しております。時価評価に あたっては、金融商品取引業者、 銀行等の提示する価額（但し、売 気配相場は使用しない）、価格情 報会社の提供する価額又は日本 証券業協会発表の売買参考統計 値(平均値)等で評価してありま す。	国債証券及び特殊債券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及 び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算 期間末日の対顧客先物売買相場 の仲値によって計算してありま す。	為替予約取引 同左

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年5月26日から平成23年5月25日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 同左
----------------------------	---	---

(追加情報)

自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用していません。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中解約元本額	8,617,011,627円 428,158,876円 176,797,855円	8,868,372,648円 405,690,307円 105,512,878円
同期末における元本の内訳 バランス物語30（安定型） バランス物語50（安定・成長型） バランス物語70（成長型） D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型 D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型	436,527,630円 310,765,170円 256,038,541円 256,027,192円 827,121,021円	385,880,556円 292,072,274円 236,907,860円 281,546,418円 922,785,413円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型 外国債券私募オープン（適格機関投資家向け）	888,721,922円 1,534,137,646円	1,017,156,688円 1,673,167,342円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA1（安定型） D I A Mライフサイクル・ファンドVA2（安定・成長型） D I A Mライフサイクル・ファンドVA3（成長型）	805,317,015円 1,729,255,114円 669,267,689円	805,317,015円 1,729,255,114円 669,267,689円
D I A Mバランス物語30VA（安定型）	468,445,696円	468,445,696円
D I A Mバランス物語50VA（安定・成長型）	534,166,935円	534,166,935円
D I A Mバランス物語70VA（成長型）	152,581,077円	152,581,077円

(合 計)	8,868,372,648円	9,168,550,077円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	8,868,372,648口	9,168,550,077口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年8月25日現在	平成23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)国債証券及び特殊債券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。	(1)国債証券及び特殊債券 同左 (2)派生商品評価勘定 同左

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	350,067,377	487,149,286
特殊債券	20,419,281	5,070,662
合計	370,486,658	492,219,948

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

(通貨関連)

平成22年8月25日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	カナダドル	544,041,760	-	527,880,000	16,161,760
	スウェーデンクローネ	19,640,950	-	19,176,000	464,950
	ユーロ	1,878,786,500	-	1,832,075,200	46,711,300
	買建				
	オーストラリアドル	47,641,860	-	46,802,700	839,160
	シンガポール・ドル	126,637,035	-	124,579,800	2,057,235
	スイスフラン	72,895,240	-	71,984,000	911,240
	ノルウェークローネ	35,589,190	-	34,550,600	1,038,590
	ポーランドズロチ	118,035,060	-	113,770,800	4,264,260
	英ポンド	617,422,350	-	604,500,000	12,922,350
	米ドル	1,425,707,977	-	1,408,536,612	17,171,365
合 計	4,886,397,922	-	4,783,855,712	24,133,810	

平成23年2月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	シンガポール・ドル	214,385	-	213,210	1,175
	スイスフラン	139,117,744	-	139,574,643	456,899
	ユーロ	1,438,554,000	-	1,436,370,000	2,184,000
	英ポンド	268,300,000	-	264,160,000	4,140,000
	米ドル	135,315,780	-	132,476,756	2,839,024
	買建				
	オーストラリアドル	23,367,400	-	23,100,000	267,400
	カナダドル	3,394,080	-	3,334,400	59,680
	シンガポール・ドル	134,211,382	-	131,797,522	2,413,860
	スイスフラン	206,227,110	-	209,945,543	3,718,433
	スウェーデンクローネ	3,630,480	-	3,589,600	40,880
	ノルウェークローネ	38,092,180	-	38,173,400	81,220
	ポーランドズロチ	128,320,440	-	125,518,800	2,801,640
	英ポンド	56,690,159	-	55,664,703	1,025,456
	米ドル	1,257,796,381	-	1,237,966,447	19,829,934
	合 計		3,833,231,521	-	3,801,885,024

（注）時価の算定方法

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.5759円	1.5430円
（1万口当たり純資産額）	（15,759円）	（15,430円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 4.0 11/15/12	200,000.00	211,750.000	
	US T N/B 3.5 05/31/13	1,100,000.00	1,167,331.000	
	US T N/B 1.875 04/30/14	6,800,000.00	6,923,216.000	
	US T N/B 2.25 01/31/15	3,000,000.00	3,065,970.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	1,500,000.00	1,636,395.000	
	US T N/B 1.25 08/31/15	3,000,000.00	2,908,710.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	5,500,000.00	6,115,725.000	
	US T N/B 1.375 11/30/15	6,500,000.00	6,293,040.000	
	US T N/B 1.875 09/30/17	4,000,000.00	3,787,160.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	10,000,000.00	10,144,500.000	
	US T N/B 2.625 08/15/20	1,200,000.00	1,126,020.000	
	US T N/B 2.625 11/15/20	3,300,000.00	3,081,606.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	6,000,000.00	5,835,900.000	
米ドル小計	銘柄数 : 13	52,100,000.00	52,297,323.000	
	組入時価比率 : 30.30%		(4,286,288,593)	
	合計時価比率 : 31.29%			
	UK TREASURY 5.0 03/07/12	400,000.00	416,680.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	780,000.00	855,504.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	3,700,000.00	4,017,090.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,850,000.00	1,952,675.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	600,000.00	589,320.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 5	7,330,000.00	7,831,269.000	
	組入時価比率 : 7.32%		(1,035,058,824)	
	合計時価比率 : 7.56%			
	CANADA 5.25 06/01/12	860,000.00	900,316.800	
	CANADA 5.0 06/01/14	400,000.00	435,036.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	300,000.00	296,529.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	110,000.00	117,024.600	
	CANADA 3.75 06/01/19	2,000,000.00	2,079,660.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	600,000.00	919,716.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 6	4,270,000.00	4,748,282.400	
	組入時価比率 : 2.80%		(396,244,166)	
	合計時価比率 : 2.89%			
	SWEDEN 6.75 05/05/14	2,000,000.00	2,242,260.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	1,800,000.00	1,915,074.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	3,000,000.00	2,989,050.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 3	6,800,000.00	7,146,384.000	
	組入時価比率 : 0.65%		(91,831,034)	
	合計時価比率 : 0.67%			
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	2,100,000.00	2,186,100.000	
	BUNDESOBL 3.5 04/08/11	800,000.00	802,280.000	
	BUNDESOBL 4.25 10/12/12	6,600,000.00	6,903,534.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	100,000.00	105,565.000	
	BUNDESOBL 2.5 10/10/14	500,000.00	509,925.000	
	BUNDESOBL 1.75 10/09/15	1,100,000.00	1,077,395.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	550,000.00	579,645.000	

	DEUTSCHLAND 6.0 06/20/16	300,000.00	351,960.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	1,300,000.00	1,383,980.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	190,000.00	200,735.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,090,000.00	2,120,932.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	11,600,000.00	11,501,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,750,000.00	2,046,450.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,900,000.00	3,068,432.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	100,000.00	95,810.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,800,000.00	2,574,320.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	3,600,000.00	3,879,900.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/11	240,000.00	246,144.000	
	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	300,000.00	315,600.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	500,000.00	557,500.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	600,000.00	628,320.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	2,000,000.00	2,141,200.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	3,200,000.00	3,318,720.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	500,000.00	512,950.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	4,600,000.00	4,663,020.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	700,000.00	706,510.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	2,600,000.00	2,549,040.000	
	ITALY BTPS 4.0 09/01/20	1,500,000.00	1,420,950.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,500,000.00	1,217,250.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	6,000,000.00	6,369,600.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 30	62,620,000.00	64,035,167.000	
	組入時価比率 : 51.23%		(7,248,140,553)	
	合計時価比率 : 52.92%			
国債証券計			13,057,563,170	
			(13,057,563,170)	
特殊債券	IADB 3.5 03/15/13	1,000,000.00	1,052,250.000	
	EIB 5.125 05/30/17	3,000,000.00	3,352,500.000	
	KFW 4.875 06/17/19	1,000,000.00	1,100,230.000	
米ドル小計	銘柄数 : 3	5,000,000.00	5,504,980.000	
	組入時価比率 : 3.19%		(451,188,161)	
	合計時価比率 : 3.29%			
	EIB 3.625 10/15/13	500,000.00	520,350.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 1	500,000.00	520,350.000	
	組入時価比率 : 0.42%		(58,898,417)	
	合計時価比率 : 0.43%			
	QUEENSLAND 6.0 10/14/15	1,140,000.00	1,157,134.200	
	NEW S WALES 6.0 04/01/19	400,000.00	403,924.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 2	1,540,000.00	1,561,058.200	
	組入時価比率 : 0.91%		(129,380,504)	
	合計時価比率 : 0.94%			
特殊債券計			639,467,082	
			(639,467,082)	
合計			13,697,030,252	
			(13,697,030,252)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 13銘柄	30.30%	31.29%
米ドル	特殊債券 3銘柄	3.19%	3.29%
英ポンド	国債証券 5銘柄	7.32%	7.56%
カナダドル	国債証券 6銘柄	2.80%	2.89%
スウェーデンクローネ	国債証券 3銘柄	0.65%	0.67%
ユーロ	国債証券 30銘柄	51.23%	52.92%
ユーロ	特殊債券 1銘柄	0.42%	0.43%
オーストラリアドル	特殊債券 2銘柄	0.91%	0.94%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,138,575,401	240,493,840
国債証券		22,382,242,030	26,690,683,185
地方債証券		25,603,584	-
社債券		26,572,224,250	21,172,968,100
未収利息		134,629,915	143,956,579
前払費用		9,195,521	7,298,501
流動資産合計		50,262,470,701	48,255,400,205
資産合計		50,262,470,701	48,255,400,205
負債の部			
流動負債			
未払金		97,650,000	25,369,680
未払解約金		-	30,000,000
流動負債合計		97,650,000	55,369,680
負債合計		97,650,000	55,369,680
純資産の部			
元本等			
元本		38,479,381,054	37,220,375,715
剰余金			
剰余金又は欠損金()		11,685,439,647	10,979,654,810
元本等合計		50,164,820,701	48,200,030,525
純資産合計		50,164,820,701	48,200,030,525
負債純資産合計		50,262,470,701	48,255,400,205

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)国債証券、地方債証券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。	(1)国債証券、地方債証券及び社債券 同左

	(2)社債券（転換社債及び新株予約権付社債） 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	(2)社債券（転換社債及び新株予約権付社債） 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年5月26日から平成23年5月25日までとなっております。	計算期間の取扱い 同左

(追加情報)

自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年8月25日現在	平成23年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	41,815,574,948円	38,479,381,054円
同期中追加設定元本額	383,688,535円	679,078,544円
同期中解約元本額	3,719,882,429円	1,938,083,883円
同期末における元本の内訳		
バランス物語30（安定型）	4,539,345,023円	3,775,918,243円
バランス物語50（安定・成長型）	1,400,931,093円	1,219,975,096円
バランス物語70（成長型）	427,843,750円	385,541,505円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	2,605,295,367円	2,744,137,551円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	3,712,804,439円	4,021,370,445円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	1,496,084,634円	1,665,840,274円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA1（安定型）	8,384,807,017円	7,952,726,957円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA2（安定・成長型）	7,612,846,821円	7,382,415,336円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA3（成長型）	1,108,762,971円	1,105,092,419円
D I A Mバランス物語30VA（安定型）	4,625,590,020円	4,440,624,618円

D I A Mバランス物語 5 0 V A （安定・成長型）	2,311,590,322円	2,273,253,674円
D I A Mバランス物語 7 0 V A （成長型）	253,479,597円	253,479,597円
（合計）	38,479,381,054円	37,220,375,715円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	38,479,381,054口	37,220,375,715口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年8月25日現在	平成23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)国債証券、地方債証券及び社債券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)国債証券及び社債券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成22年8月26日 至平成23年2月25日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	808,537,140	138,345,715
地方債証券	10,496	-
社債券	141,248,875	138,207,436
合計	949,775,519	138,279

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年8月25日現在	平成23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)	1.3037円 (13,037円)	1.2950円 (12,950円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	288回 利付国庫債券(10年)	777,000,000	822,850,770	
	305回 利付国庫債券(10年)	10,686,000,000	10,844,366,520	
	309回 利付国庫債券(10年)	3,105,000,000	3,081,588,300	
	33回 利付国庫債券(30年)	1,314,000,000	1,280,690,100	
	84回 利付国庫債券(20年)	1,711,000,000	1,774,854,520	
	114回 利付国庫債券(20年)	2,782,000,000	2,837,445,260	

	120回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	469,205,000	
	121回 利付国庫債券(20年)	2,339,000,000	2,304,499,750	
	7回 物価連動国債(10年)	250,000,000	248,501,250	
	8回 物価連動国債(10年)	1,470,000,000	1,460,460,435	
	12回 物価連動国債(10年)	1,560,000,000	1,566,221,280	
国債証券計			26,690,683,185	
社債券	7回 ウエストパック銀行円貨社債	700,000,000	697,739,000	
	36回 鹿島建設社債	400,000,000	399,624,000	
	1回 野村総合研究所 転換社債	1,739,000,000	1,705,959,000	
	23回 コスモ石油社債	100,000,000	99,617,000	
	1回 コバレントマテリアル社債	600,000,000	419,148,000	
	10回 NEC 転換社債	700,000,000	700,700,000	
	20回 シャープ転換社債	1,100,000,000	1,084,050,000	
	4回 アンリツ社債	200,000,000	199,908,000	
	28回 クレディセゾン社債	100,000,000	104,987,000	
	33回 クレディセゾン社債	100,000,000	102,595,000	
	5回 みずほコーポレート銀行期限前償還条項付劣後社債	200,000,000	207,316,000	
	17回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	207,712,000	
	3回 りそな銀行劣後社債	500,000,000	524,960,000	
	4回 福岡銀行期限前償還条項付劣後社債	500,000,000	500,550,000	
	5回 福岡銀行期限前償還条項付劣後社債	200,000,000	198,948,000	
	1回 西日本シティ銀行劣後社債	300,000,000	316,797,000	
	6回 西日本シティ銀行期限前償還条項付劣後社債	300,000,000	304,170,000	
	3回 千葉銀行期限前償還条項付劣後社債	500,000,000	507,870,000	
	2回 福井銀行劣後社債	300,000,000	294,900,000	
	3回 ほくほくフィナンシャルグループ期限前償還条項付劣後社債	400,000,000	399,072,000	
	5回 阿波銀行期限前償還条項付劣後社債	300,000,000	296,817,000	
	2回 宮崎銀行期限前償還条項付劣後社債	300,000,000	298,980,000	
	3回 みずほ信託銀行劣後社債	100,000,000	104,022,000	
	8回 中央三井信託銀行期限前償還条項付劣後社債	200,000,000	203,440,000	
	18回 三井住友銀行期限前償還条項付劣後社債	100,000,000	102,980,000	
	56回 アコム社債	300,000,000	294,918,000	
	35回 プロミス社債	100,000,000	97,659,000	
	37回 プロミス社債	100,000,000	97,915,000	
	42回 プロミス社債	800,000,000	798,568,000	
	4回 ジャックス社債	100,000,000	101,203,000	
	133回 オリックス社債	100,000,000	105,387,000	
	7回 平和不動産転換社債	665,000,000	657,020,000	
	29回 ソフトバンク社債	255,000,000	270,152,100	
	33回 ソフトバンク社債	1,500,000,000	1,517,550,000	
	東レJPY建て転換制限条項付CB 3/12/12	785,000,000	780,682,500	
	ヤマダ電機JPY建て転換制限条項付CB 3/28/13	2,100,000,000	2,079,000,000	
	川崎汽船JPY建てCB 4/4/13	2,116,000,000	2,068,390,000	
	カシオ計算機JPY建てCB 3/31/15	1,380,000,000	1,374,825,000	
	コニカミノルタホールディングスJPY建てCB 12/7/16	755,000,000	749,337,500	

	岩手銀行 J P Y 建て新株予約権付 C B 8 / 1 3 / 1 7	200,000,000	197,500,000	
社債券計			21,172,968,100	
合計			47,863,651,285	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

バランス物語30（安定型）

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
資産総額	7,263,624,415円
負債総額	46,042,729円
純資産総額（ - ）	7,217,581,686円
発行済数量	7,505,226,624口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9617円

バランス物語50（安定・成長型）

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
資産総額	3,676,032,287円
負債総額	21,179,498円
純資産総額（ - ）	3,654,852,789円
発行済数量	4,009,485,330口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9116円

バランス物語70（成長型）

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
資産総額	2,353,058,818円
負債総額	3,790,523円
純資産総額（ - ）	2,349,268,295円
発行済数量	2,743,057,200口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8564円

（参考）マザーファンドの現況

D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
資産総額	11,812,204,811円
負債総額	457,521,702円
純資産総額（ - ）	11,354,683,109円
発行済数量	10,365,520,746口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0954円

D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
資産総額	29,896,377,257円
負債総額	94,713,258円
純資産総額（ - ）	29,801,663,999円
発行済数量	24,929,829,888口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1954円

D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
----	--------

資産総額	14,295,565,456円
負債総額	32,129,158円
純資産総額(-)	14,263,436,298円
発行済数量	9,298,936,676口
1口当たり純資産額(/)	1.5339円

D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成23年2月28日現在

項目	金額又は口数
資産総額	48,702,119,937円
負債総額	197,298,000円
純資産総額(-)	48,504,821,937円
発行済数量	37,459,776,447口
1口当たり純資産額(/)	1.2949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

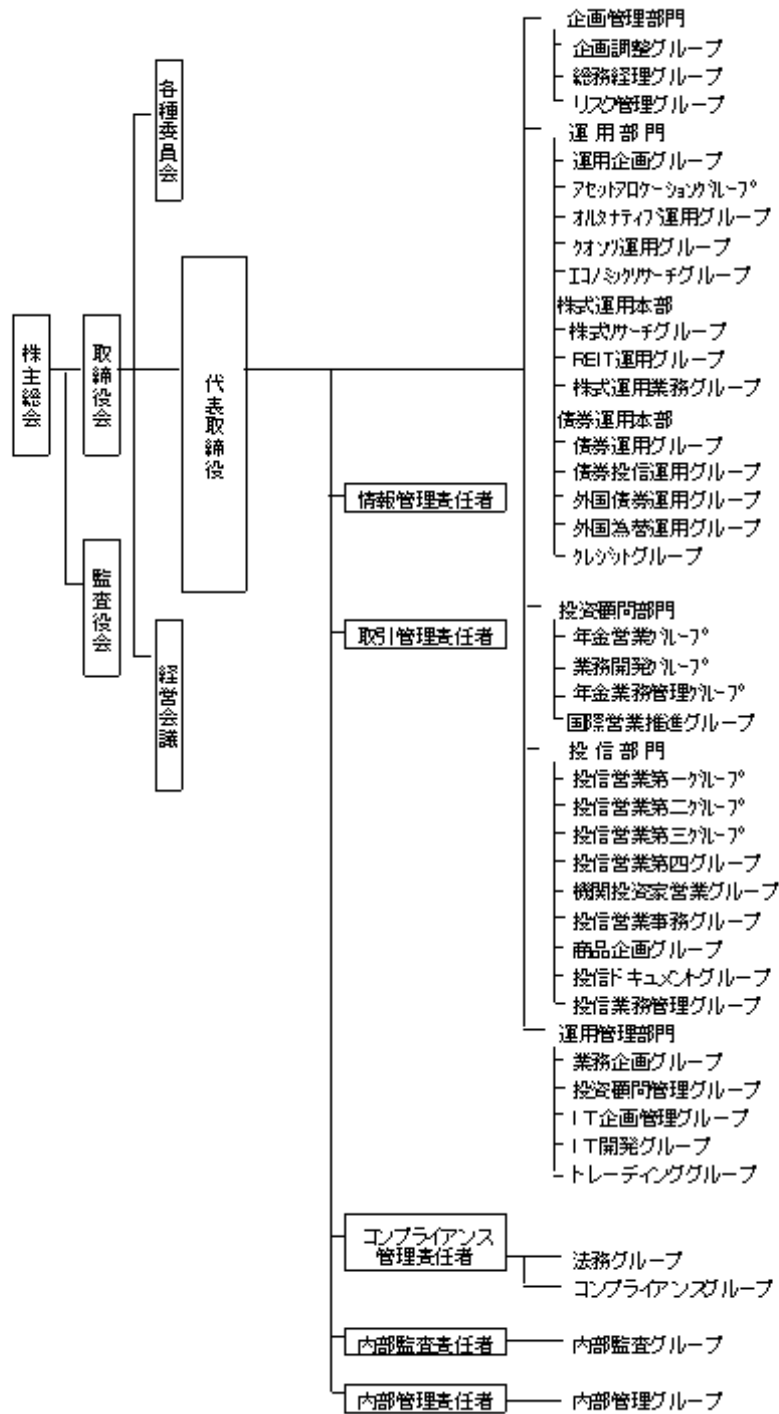
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

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

会社の組織図



上記組織は、平成23年4月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

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。

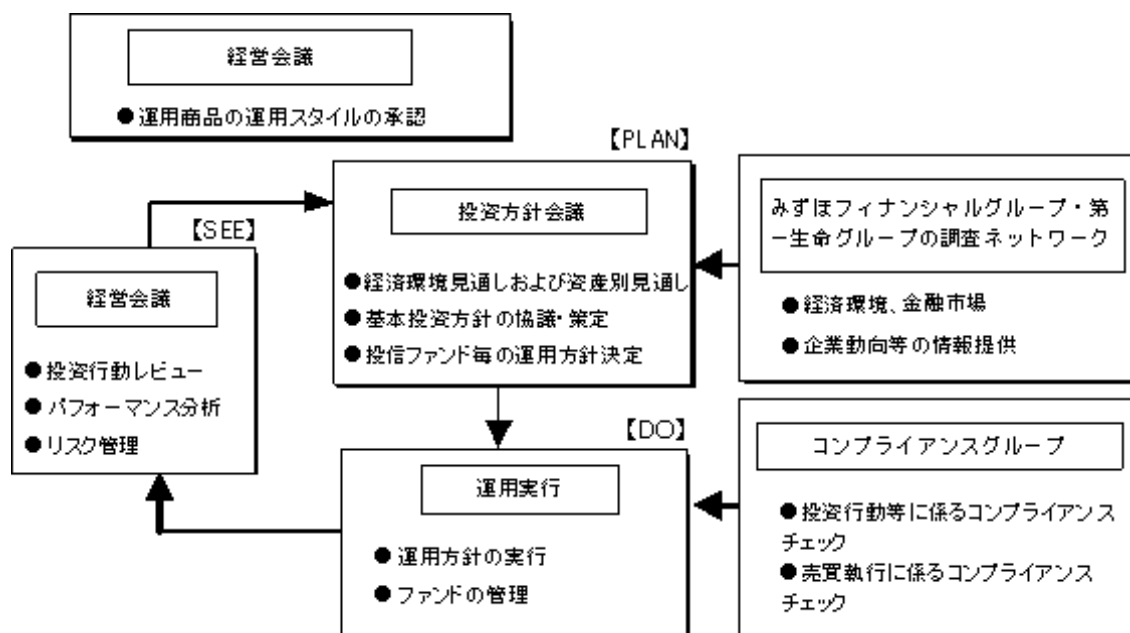
投資運用の意思決定機構

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23年2月28日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

<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」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は283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	18	76,217,626,291
追加型株式投資信託	251	4,223,166,294,931
単位型公社債投資信託	13	110,051,164,480
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	307,143,149
合計	283	4,409,742,228,851

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。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

なお、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。

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

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）および第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）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26期中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22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24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,558,999	13,820,588
金銭の信託	-	399,833
前払費用	54,242	33,221
未収委託者報酬	2,254,741	3,169,323
未収運用受託報酬	1,046,291	1,000,785
未収投資助言報酬	2 252,337	2 271,577
未収収益	197,045	247,552
未収消費税等	98,402	-
繰延税金資産	369,826	383,608
その他	23,865	21,009
流動資産計	16,855,752	19,347,501
固定資産		
有形固定資産	501,481	599,421
建物	1 283,511	1 237,642
器具備品	1 201,169	1 351,237
建設仮勘定	16,799	10,541
無形固定資産	721,812	964,184
商標権	1 1,335	1 804
ソフトウェア	1 555,121	1 557,870
ソフトウェア仮勘定	157,595	397,829
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 611	1 531
投資その他の資産	4,051,090	5,247,891
投資有価証券	498,041	1,194,081
関係会社株式	1,661,144	2,161,144
繰延税金資産	442,390	403,908
長期差入保証金	1,169,961	1,187,070
その他	306,478	328,612
貸倒引当金	26,925	26,925
固定資産計	5,274,384	6,811,497
資産合計	22,130,137	26,158,999

（単位：千円）

	第24期 （平成21年3月31日現在）	第25期 （平成22年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	37,445	119,466
未払金	1,293,636	1,526,031
未払収益分配金	8,201	7,837
未払償還金	48,993	96,340
未払手数料	931,529	1,206,815
その他未払金	304,912	215,038
未払費用	2 1,040,620	2 1,522,325
未払法人税等	179,557	1,283,275
未払消費税等	-	113,923
賞与引当金	618,303	572,614
その他	20,741	38,231
流動負債計	3,190,304	5,175,867
固定負債		
退職給付引当金	404,437	488,790
役員退職慰労引当金	145,732	96,342
固定負債計	550,169	585,133
負債合計	3,740,474	5,761,000
（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	13,962,732	15,737,995
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	10,040,000	11,650,000
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	3,299,438	3,464,702
株主資本計	18,391,210	20,166,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,547	231,525
評価・換算差額等計	1,547	231,525
純資産合計	18,389,662	20,397,999
負債・純資産合計	22,130,137	26,158,999

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)		第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		24,552,133		26,734,588
運用受託報酬		4,509,994		4,297,349
投資助言報酬		1,228,096		1,027,153
その他営業収益		697,007		723,055
営業収益計		30,987,232		32,782,146
営業費用				
支払手数料		10,967,681		13,000,141
広告宣伝費		488,151		218,782
公告費		-		1,767
調査費		5,076,631		5,056,427
調査費		2,506,175		2,555,070
委託調査費		2,570,455		2,501,356
委託計算費		325,174		351,370
営業雑経費		812,013		679,608
通信費		35,872		32,088
印刷費		732,985		613,198
協会費		25,313		21,225
諸会費		41		41
支払販売手数料		17,800		13,054
営業費用計		17,669,652		19,308,097
一般管理費				
給料		4,587,983		4,678,614
役員報酬	1	234,353	1	244,725
給料・手当		3,647,502		3,840,052
賞与		706,127		593,836
交際費		44,085		45,342
寄付金		4,462		3,450
旅費交通費		308,237		269,516
租税公課		82,762		85,030
不動産賃借料		801,086		791,980
退職給付費用		106,223		132,513
固定資産減価償却費		330,412		397,252
福利厚生費		22,556		22,233
修繕費		6,755		5,615
賞与引当金繰入		618,303		572,614
役員退職慰労引当金繰入		42,570		45,086
役員退職金		13,175		18,129
機器リース料		973		2,191
事務委託費		247,087		285,449
消耗品費		84,099		78,753
器具備品費		6,094		2,046
諸経費		177,386		88,728
一般管理費計		7,484,253		7,524,549
営業利益		5,833,325		5,949,500

（単位：千円）

	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）		第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		4,558		5,287
受取利息		59,458		18,745
時効成立分配金		164		157
投資信託解約益		-		559,971
先物利益		180,422		-
雑収入		5,482		3,431
営業外収益計		250,086		587,592
営業外費用				
為替差損		24,553		17,771
時効成立後支払分配金		517		444
投資信託解約損		38,254		-
先物損失		-		719,577
金銭の信託運用損		-		1,116
営業外費用計		63,325		738,911
経常利益		6,020,086		5,798,181
特別損失				
固定資産除却損	2	14,476	2	21,626
固定資産売却損		-		2,464
ゴルフ会員権評価損		6,000		-
投資有価証券評価損		484,009		-
特別損失計		504,485		24,090
税引前当期純利益		5,515,600		5,774,091
法人税、住民税及び事業税		2,301,373		2,508,095
法人税等調整額		30,266		135,267
法人税等合計		2,271,106		2,372,828
当期純利益		3,244,494		3,401,263

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	7,040,000	10,040,000
当期変動額	3,000,000	1,610,000
当期末残高	10,040,000	11,650,000
研究開発積立金		
前期末残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
前期末残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	6,054,944	3,299,438
当期変動額		
剰余金の配当	3,000,000	1,626,000
別途積立金の積立	3,000,000	1,610,000
当期純利益	3,244,494	3,401,263
当期末残高	3,299,438	3,464,702
株主資本合計		
前期末残高	18,146,716	18,391,210
当期変動額	244,494	1,775,263
当期末残高	18,391,210	20,166,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	10,012	1,547
当期変動額(純額)	8,464	233,073
当期末残高	1,547	231,525
純資産合計		
前期末残高	18,136,703	18,389,662
当期変動額	252,958	2,008,336
当期末残高	18,389,662	20,397,999

[次へ](#)

重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)</p>
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：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</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法</p> <p>4. 外貨建の資産およ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。</p> <p>5. 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。 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. 金銭の信託の評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 同左 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 同左 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） 同左</p> <p>5. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>6. 引当金の計上基準 (1) 同左 (2) 同左 (3) 同左 (会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正（その3）」（企業会計基準委員会 平成20年7月31日 企業会計基準第19号）を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響はありません。</p> <p>(4) 同左</p>

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
<p>6. リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>7. リース取引の処理方法 同左</p> <p>8. 消費税等の処理方法 同左</p>

会計方針の変更

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当事業年度における貸借対照表および損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>	<hr/>

表示方法の変更

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<p>(貸借対照表)</p> <p>1. 前事業年度において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当事業年度から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前事業年度末における「未収運用受託報酬」の金額は1,299,666千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は369,475千円であります。</p> <p>2. 前事業年度において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は31,213千円であります。</p> <p>(損益計算書)</p> <p>前事業年度において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」の金額は4,929,946千円であり、「投資助言報酬」の金額は1,874,941千円であります。</p>	<hr/>

追加情報

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<hr/>	<p>当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）																																
<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr><td>建物</td><td>426,679千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>290,397千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td>6,351千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>648,713千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td>985千円</td></tr> </table> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産およ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。</p> <table border="1"> <tr> <td>流動資産</td> <td>未収投資助言報酬</td> <td>251,392千円</td> </tr> <tr> <td>流動負債</td> <td>未払費用</td> <td>345,744千円</td> </tr> </table>	建物	426,679千円	器具備品	290,397千円	商標権	6,351千円	ソフトウェア	648,713千円	電話施設利用権	985千円	流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円	流動負債	未払費用	345,744千円	<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr><td>建物</td><td>471,484千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>356,326千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td>6,882千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>684,370千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td>1,065千円</td></tr> </table> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産およ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。</p> <table border="1"> <tr> <td>流動資産</td> <td>未収投資助言報酬</td> <td>270,492千円</td> </tr> <tr> <td>流動負債</td> <td>未払費用</td> <td>400,075千円</td> </tr> </table>	建物	471,484千円	器具備品	356,326千円	商標権	6,882千円	ソフトウェア	684,370千円	電話施設利用権	1,065千円	流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動負債	未払費用	400,075千円
建物	426,679千円																																
器具備品	290,397千円																																
商標権	6,351千円																																
ソフトウェア	648,713千円																																
電話施設利用権	985千円																																
流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円																															
流動負債	未払費用	345,744千円																															
建物	471,484千円																																
器具備品	356,326千円																																
商標権	6,882千円																																
ソフトウェア	684,370千円																																
電話施設利用権	1,065千円																																
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円																															
流動負債	未払費用	400,075千円																															

(損益計算書関係)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1. 役員報酬の限度額 取締役 年額250,000千円 監査役 年額 50,000千円 2. 固定資産除却損の内訳 建物 2,251千円 器具備品 9,818千円 ソフトウェア 2,406千円	1. 役員報酬の限度額 同左 2. 固定資産除却損の内訳 建物 1,199千円 器具備品 15,159千円 ソフトウェア 5,267千円

(株主資本等変動計算書関係)

第24期(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

第25期(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(リース取引関係)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)				第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)			
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額 相当額	52,335千円	-	52,335千円	減価償却累計額 相当額	75,063千円	-	75,063千円
期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円	期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円	未経過リース料 期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払 利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払 利息相当額			
支払リース料		24,096千円		支払リース料		24,096千円	
減価償却費相当額		22,727千円		減価償却費相当額		22,727千円	
支払利息相当額		1,501千円		支払利息相当額		845千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定 額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との 差額を利息相当額とし、各期への配分方法につい ては、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2. オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。				2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能の ものに係る未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
	1,609千円	1,475千円	3,084千円				

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	
(1)金融商品に対する取組方針	<p>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。</p> <p>デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。</p> <p>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。</p>
(2)金融商品の内容およびそのリスク	<p>投資有価証券および金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託であり、為替およ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。</p> <p>長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金であります。</p> <p>デリバティブ取引は、投資有価証券および金銭の信託に係る為替および市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引および株価指数先物取引等であります。</p>
(3)金融商品に係るリスク管理体制	<p>信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理</p> <p>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。</p> <p>市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理</p> <p>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、損益およ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。</p> <p>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</p> <p>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。</p>
(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。

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

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 投資有価証券

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

(4) 長期差入保証金

長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負債

(1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等（貸借対照表計上額1,125,584千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

(注3) 金銭債権および満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,819,459	-	-	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
(3) 長期差入保証金(*)	61,485	-	-	-
合計	13,880,945	-	-	-

(*) 長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

(注4) 社債、新株予約権付社債および長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	146,101	146,101	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	271,802	269,192	2,610
小計	417,904	415,294	2,610
合計	417,904	415,294	2,610

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
3,021,000	20,615	58,869

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 82,746千円

8. その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的の債券の今後の償還予定額

該当事項はありません。

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

（金銭の信託関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	399,833	838

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 取引の状況に関する事項

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
<p>(1)取引の内容 為替予約取引及び株価指数先物取引を利用しております。</p> <p>(2)取引に対する取組方針 実需の範囲内でのみデリバティブ取引を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。</p> <p>(3)取引の利用目的 その他有価証券に含まれる為替変動リスク及び株価変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(4)取引に係るリスクの内容 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。</p> <p>(5)取引に係るリスク管理体制 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。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。</p> <p>(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

2. 取引の時価等に関する事項

(1) 通貨関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	24,432	-	24,960	528
	香港ドル	34,020	-	34,412	392
	豪ドル	77,510	-	78,736	1,226
	シンガポールドル	12,564	-	12,672	107
合計		148,527	-	150,782	2,255

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	212,667	-	230,215	17,547
合計		212,667	-	230,215	17,547

(注2) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

第25期(平成22年3月31日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

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

(注2) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 不動産投資信託関連

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

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

第24期(平成21年3月31日現在)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

当社は、原則法を適用しております。

(1) 退職給付債務 (平成21年3月31日現在) (千円)

退職給付債務	431,448
未認識数理計算上の差異	27,011
退職給付引当金	404,437

(2) 退職給付費用 (千円)

勤務費用	71,958
確定拠出年金 拠出額	34,264
退職給付費用	106,223

3. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第24期 (平成21年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

第25期（平成22年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

第25期
（平成22年3月31日現在）（千円）

(1)	退職給付債務	530,305
(2)	未認識数理計算上の差異	41,515
	退職給付引当金	488,790

3．退職給付費用に関する事項

第25期
（自平成21年4月1日
至平成22年3月31日）（千円）

(1)	勤務費用	82,653
(2)	利息費用	6,471
(3)	数理計算上の差異の費用処理額	5,402
(4)	確定拠出年金 拠出額	37,987
	退職給付費用	132,513

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	19,218	108,541
未払事業所税	6,269	6,290
賞与引当金	251,649	233,054
未払法定福利費	27,146	26,912
未払確定拠出年金掛金	2,667	2,712
減価償却超過額	7,579	17,598
減価償却超過額（一括償却資産）	8,559	6,098
繰延資産償却超過額（税法上）	46,274	89,657
その他（未払金等）	461	-
退職給付引当金	164,605	198,937
役員退職慰労引当金	59,313	39,211
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	196,991	66,421
貸倒引当金繰入額	14,840	14,840
その他有価証券評価差額金	1,062	-
繰延税金資産合計	812,216	815,851
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	28,334
繰延税金負債合計	-	28,334
差引繰延税金資産の純額	812,216	787,517

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

第24期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第25期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（関連当事者との取引）

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

（追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に対し、重要な追加はありません。

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円(基金および基金償却積立金)	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向3名, 転籍2名	資産の運用および助言、当社設定投信の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	718,870	未収投資助言報酬	172,117
								販売手数料の支払	17,800	-	-
								保険料の支払	5,828	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

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

（注2）支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

（注3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	933,784	未払費用	236,518
	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	324,748	未払費用	109,093

取引条件およ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）上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	6,500 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,531,236	未払 手数料	96,917
								預金の引出 (純額)	300,370	現金・ 預金	322,365
								受取利息	894	未収 収益	-
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほコー ポレート銀行	東京都 千代田 区	10,709 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	701,162	未払 手数料	91,628
								預金の引出 (純額)	1,034,219	現金・ 預金	11,438,676
								受取利息	55,734	未収 収益	4,158
その他の 関係会 社の子 会社	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の 運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	299,054	未払 費用	117,438
								業務委託料 の支払	17,550	未払 費用	2,677

取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円(基金償却積立金)	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向3名, 転籍2名	資産の運用および助言, 当社設定投資の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	711,279	未収投資助言報酬	190,025
								販売手数料の支払	13,054	-	-
								保険料の支払	6,572	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注2) 支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注5) 平成22年4月1日付にて、第一生命保険相互会社は、相互会社から株式会社へ組織変更しております。新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	785,924	未払費用	296,169
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	244,629	未払費用	98,673

取引条件およ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) 上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払 手数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコーポ レート銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払 手数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の 運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	資産管理サー ビス信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産 管理等	-	-	当社信託 財産の 運用	信託元本の 追加 (純額)	401,000	金銭の 信託	399,833
								信託報酬の 支払	130		

取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 766,235円93銭 1株当たり当期純利益金額 135,187円25銭	1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
当期純利益	3,244,494千円	3,401,263千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,244,494千円	3,401,263千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
<p>平成21年2月13日開催の臨時取締役会の決議により平成21年3月19日に設立した100%出資の子会社DIAM Asset Management(HK)Limitedに対して、平成21年4月9日に資本金の払込みを実施いたしました。</p> <p>当該子会社の設立は、運用・営業両面においてビジネス機会の広がる中国圏での業容拡大や、当社におけるアジア株関連商品の営業強化などを主な目的とするものです。</p> <p><子会社の概要> 商号：DIAM Asset Management(HK)Limited 主な事業内容：資産運用業務 設立年月日：平成21年3月19日 資本金：500,000千円 発行済株式総数：500,000株 出資の総額：500,000千円 出資比率：当社100%</p>	—

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,413,600
金銭の信託		2,920,386
前払費用		70,721
未収委託者報酬		2,870,054
未収運用受託報酬		1,587,601
未収投資助言報酬		258,177
未収収益		248,853
繰延税金資産		379,771
その他		27,218
	流動資産計	19,776,384
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,226
器具備品	1	275,229
無形固定資産		
商標権	1	657
ソフトウェア	1	843,268
ソフトウェア仮勘定		201,594
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	491
投資その他の資産		
投資有価証券		744,900
関係会社株式		2,161,144
繰延税金資産		501,175
長期差入保証金		1,126,064
その他		274,365
貸倒引当金		26,925
	固定資産計	6,309,341
資産合計		26,085,726

(単位：千円)

	第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	48,469
未払金	1,382,417
未払収益分配金	5,782
未払償還金	96,340
未払手数料	1,104,913
その他未払金	175,381
未払費用	1,319,766
未払法人税等	1,403,804
未払消費税等	127,640
前受収益	4,618
賞与引当金	574,949
その他	1,954
流動負債計	4,863,621
固定負債	
退職給付引当金	527,297
役員退職慰労引当金	114,975
固定負債計	642,273
負債合計	5,505,894
(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	16,008,292
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	13,430,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	1,954,999
株主資本計	20,436,770
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	143,061
評価・換算差額等計	143,061
純資産合計	20,579,831
負債・純資産合計	26,085,726

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,201,192	
運用受託報酬	2,208,627	
投資助言報酬	507,704	
その他営業収益	389,513	
営業収益計		15,307,036
営業費用		
支払手数料	5,187,472	
広告宣伝費	138,372	
公告費	2,297	
調査費	2,474,627	
調査費	1,342,551	
委託調査費	1,132,076	
委託計算費	170,599	
営業雑経費	360,908	
通信費	15,757	
印刷費	314,154	
協会費	11,780	
諸会費	19	
支払販売手数料	19,198	
営業費用計		8,334,278
一般管理費		
給料	2,017,035	
役員報酬	114,069	
給料・手当	1,902,965	
交際費	19,811	
寄付金	3,335	
旅費交通費	125,337	
租税公課	48,553	
不動産賃借料	379,036	
退職給付費用	66,781	
固定資産減価償却費	1 243,188	
福利厚生費	11,501	
修繕費	20,312	
賞与引当金繰入	574,949	
役員退職慰労引当金繰入	26,751	
役員退職金	540	
機器リース料	1,135	
事務委託費	140,006	
消耗品費	35,920	
器具備品費	258	
諸経費	78,421	
一般管理費計		3,792,878
営業利益		3,179,879

(単位：千円)

	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	4,651	
受取利息	5,935	
時効成立分配金	15	
為替差益	4,255	
投資信託解約益	86,546	
先物利益	26,131	
金銭信託運用益	20,662	
雑収入	7,666	
営業外収益計		155,865
経常利益		3,335,745
特別損失		
固定資産除却損	27,791	
固定資産売却損	1,440	
特別損失計		29,232
税引前中間純利益		3,306,512
法人税、住民税及び事業税		1,388,928
法人税等調整額		32,712
法人税等合計		1,356,215
中間純利益		1,950,296

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	前期末残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	前期末残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	前期末残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	前期末残高	11,650,000
	当中間期変動額	1,780,000
	当中間期末残高	13,430,000
	研究開発積立金	
	前期末残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	前期末残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	前期末残高	3,464,702
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	1,680,000
	別途積立金の積立	1,780,000
	中間純利益	1,950,296
	当中間期末残高	1,954,999
	利益剰余金合計	
	前期末残高	15,737,995
	当中間期変動額	270,296
	当中間期末残高	16,008,292
	株主資本合計	
	前期末残高	20,166,473
	当中間期変動額	270,296

	当中間期末残高	20,436,770
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	前期末残高	231,525
	当中間期変動額(純額)	88,464
	当中間期末残高	143,061
純資産合計		
	前期末残高	20,397,999
	当中間期変動額	181,832
	当中間期末残高	20,579,831

[前](#) [次](#)

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

項目	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)
1. 有価証券の評価基準および評価方法	(1)子会社株式および関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)其他有価証券 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および評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、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。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建ての資産および負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税および地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)

1. 固定資産の減価償却累計額	建物	...	468,310千円
	器具備品	...	423,931千円
	商標権	...	2,281千円
	ソフトウェア	...	667,311千円
	電話施設利用権	...	1,105千円

(中間損益計算書関係)

項目	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)		
	1. 減価償却実施額	有形固定資産	...
	無形固定資産	...	142,297千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第26期中間会計期間(自平成22年4月1日 至平成22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	前事業年度末 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22年6月30日 定時株主総会	普通株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(リース取引関係)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

1. ファイナンス・リース取引

(1) 所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース資産の内容

該当事項はありません。

リース資産の減価償却の方法

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項「4. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

(2) 所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および中間期末残高相当額

	器具備品
取得価額相当額	56,261千円
減価償却累計額相当額	50,252千円
中間期末残高相当額	6,009千円

未経過リース料中間期末残高相当額

	1年以内	1年超	合計
	6,401千円	-	6,401千円

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額

支払リース料	10,125千円
減価償却費相当額	9,528千円
支払利息相当額	176千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

2. オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料中間期末残高相当額

	1年以内	1年超	合計
	1,609千円	670千円	2,279千円

（金融商品関係）

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,413,600	11,413,600	-
(2) 金銭の信託	2,920,386	2,920,386	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	662,154	662,154	-
資産計	14,996,141	14,996,141	-
(1) 未払法人税等	1,403,804	1,403,804	-
負債計	1,403,804	1,403,804	-
デリバティブ取引(*)	(195)	(195)	-

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引所の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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額82,746千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等（中間貸借対照表計上額1,126,064千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（平成22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. 子会社株式および関連会社株式
関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
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	339,574	146,101	193,472
債券	-	-	-
その他（投資信託）	299,201	244,802	54,398
小計	638,775	390,904	247,870
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）	23,379	30,000	6,621
小計	23,379	30,000	6,621
合計	662,154	420,904	241,249

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額82,746千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（金銭の信託関係）

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

1. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

区分	種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	21,781	-	565	565
	香港ドル	24,339	-	128	128
	豪ドル	92,448	-	229	229
	シンガポールドル	13,986	-	17	17
	合計	152,556	-	481	481

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

区分	種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	292,423	-	676	676
	合計	292,423	-	676	676

(注2) 時価の算定方法

取引所の価格によっております。

(セグメント情報等)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	12,201,192	2,716,331	389,513	15,307,036

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(追加情報)

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

(持分法損益等)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）	
1株当たり純資産額	857,492円 98銭
1株当たり中間純利益金額	81,262円 37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いません。	

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第26期中間会計期間 （自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
中間純利益	1,950,296千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,950,296千円
期中平均株式数	24,000株

(重要な後発事象)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）	
該当事項はありません。	

[前へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年4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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語30（安定型）の平成22年8月26日から平成23年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語30（安定型）の平成23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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年4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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語50（安定・成長型）の平成22年8月26日から平成23年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討している。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語50（安定・成長型）の平成23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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年4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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語70（成長型）の平成22年8月26日から平成23年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語70（成長型）の平成23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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#) [委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

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 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21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[ファンド監査報告書3へ](#) [委託会社の監査報告書\(中間\)へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月10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	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22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、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22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22年4月1日から平成22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。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年10月13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 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語30（安定型）の平成22年2月26日から平成22年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語30（安定型）の平成22年8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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年10月13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 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語50（安定・成長型）の平成22年2月26日から平成22年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語50（安定・成長型）の平成22年8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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年10月13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 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語70（成長型）の平成22年2月26日から平成22年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語70（成長型）の平成22年8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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#) [委託会社の監査報告書\(前期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月29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 山本禎良 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山内正彦 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20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[ファンド監査報告書3へ](#)