

【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24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23年11月25日付をもって提出した有価証券届出書（平成24年1月27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。

### 第一部【証券情報】

#### (4)【発行（売出）価格】

<訂正前>

（略）

<基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

<訂正後>

（略）

<基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

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

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：バラ物語30、バラ物語50、バラ物語70）

**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】**

&lt; 訂正前 &gt;

(略)

資本金の額

20億円（平成23年8月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日

平成10年 3月31日

平成10年12月 1日

平成11年10月 1日

平成20年 1月 1日

会社設立

「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

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

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。

「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8月31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%

&lt; 訂正後 &gt;

(略)

資本金の額

20億円（平成24年2月29日現在）

委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日

平成10年 3月31日

平成10年12月 1日

平成11年10月 1日

平成20年 1月 1日

会社設立

「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

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

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。

「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24年2月29日現在）

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

&lt;訂正前&gt;

(略)

(略)

TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、同マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

同マザーファンド及び同マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、同マザーファンドおよび同マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、同マザーファンドおよび同マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、当社又は同マザーファンドおよび同マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は同マザーファンドおよび同マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

(略)

東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（株東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

(略)

**(3)【運用体制】**

< 訂正前 >

(略)

上記体制は平成23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 >

(略)

上記体制は平成24年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

**(5)【投資制限】**

< 訂正前 >

(略)

共通

(3)投資信託証券への実質投資割合（約款第14条第5項）

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(略)

< 訂正後 >

(略)

共通

(3)マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合（約款第14条第5項）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(略)

**3【投資リスク】**

< 訂正前 >

(略)

**注意事項**

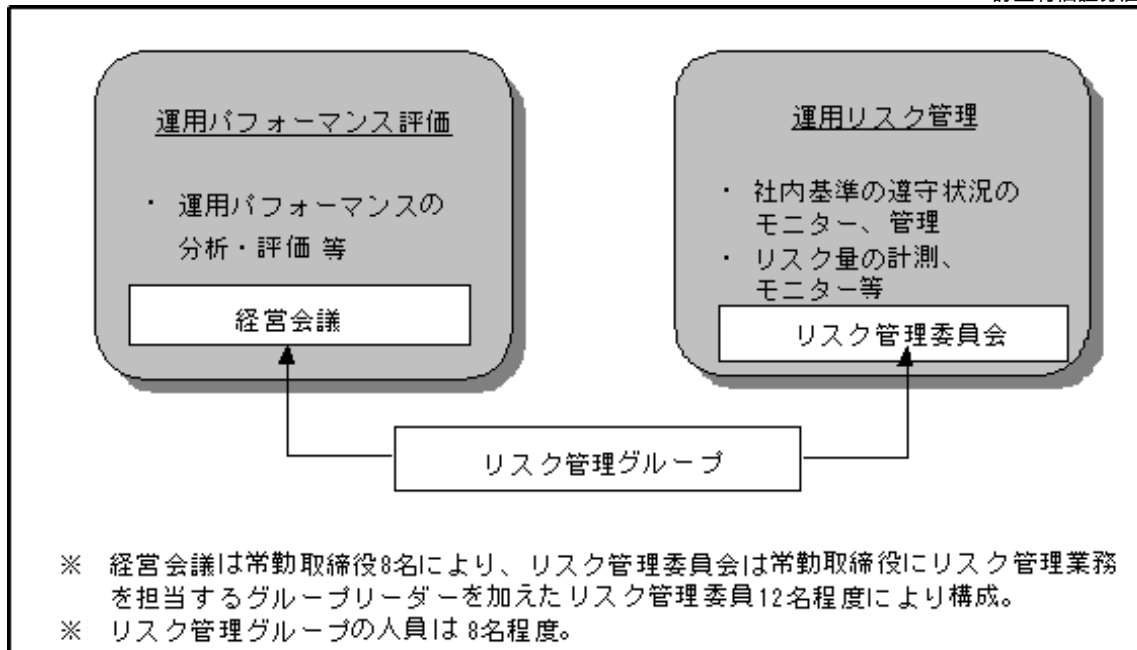
イ．当ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ．投資信託は、預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

ハ．投資信託は、金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< 運用評価・運用リスク管理体制 >



(略)

上記体制は平成23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。

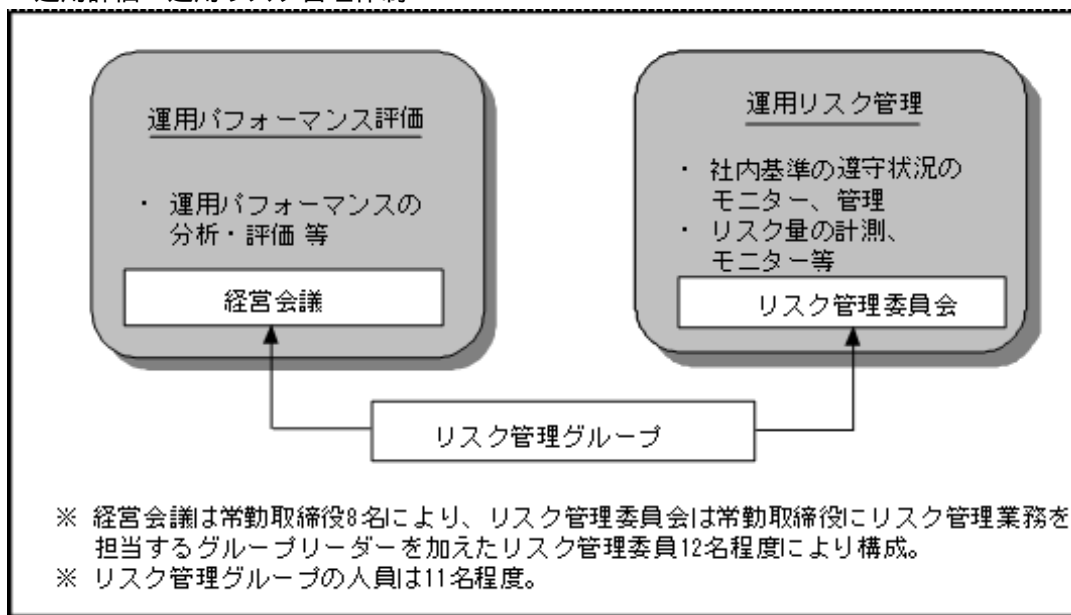
<訂正後>

(略)

#### 注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

#### <運用評価・運用リスク管理体制>



（略）

上記体制は平成24年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (3)【信託報酬等】

<訂正前>

（略）

信託報酬の総額は、日々の基準価額に反映され、毎計算期間末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

（略）

<訂正後>

（略）

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎計算期間末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

（略）

##### (5)【課税上の取扱い】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」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>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

平成24年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、原則として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

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

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時

平成24年12月31日までの間は、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率での申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

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

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株

式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

平成24年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

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

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

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成24年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

##### < 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

##### < 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

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24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,917,879,722	98.78
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		72,852,054	1.22
合 計（純資産総額）		5,990,731,776	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24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,958,311,026	99.19
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		24,163,348	0.81
合 計（純資産総額）		2,982,474,374	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24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,020,286,043	98.70
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		26,638,098	1.30
合 計（純資産総額）		2,046,924,141	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

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24年2月29日現在

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

株式	米国	6,442,018,917	55.97
	英国	1,531,056,333	13.30
	カナダ	537,773,363	4.67
	スイス	434,320,977	3.77
	スウェーデン	173,004,252	1.50
	デンマーク	55,670,397	0.48
	ノルウェー	81,762,073	0.71
	オランダ	96,722,551	0.84
	ベルギー	26,783,447	0.23
	フランス	238,298,859	2.07
	ドイツ	604,679,965	5.25
	スペイン	39,673,595	0.34
	イタリア	25,279,739	0.22
	フィンランド	46,575,846	0.40
	オーストリア	24,598,014	0.21
	香港	276,951,168	2.41
	シンガポール	210,816,058	1.83
	イスラエル	23,755,907	0.21
	オーストラリア	310,548,745	2.70
	オランダ領キュラソー	80,008,955	0.70
	英領ヴァージン諸島	24,171,601	0.21
	ジャージー・チャネル諸島	88,636,434	0.77
小計	11,373,107,195	98.81	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		137,526,974	1.19
合 計（純資産総額）		11,510,634,169	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24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	28,361,703,100	98.13
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		539,561,363	1.87
合 計（純資産総額）		28,901,264,463	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24年2月29日現在

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

国債証券	米国	5,630,004,095	37.64
	英国	556,563,772	3.72
	カナダ	431,771,583	2.89
	スウェーデン	91,932,678	0.61
	オランダ	745,903,980	4.99
	フランス	1,706,355,964	11.41
	ドイツ	4,428,197,202	29.61
	フィンランド	96,681,116	0.65
	オーストリア	244,935,128	1.64
	小計	13,932,345,517	93.16
特殊債券	ドイツ	96,451,326	0.64
	オーストラリア	179,785,037	1.20
	国際機関	422,491,691	2.82
	小計	698,728,054	4.67
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		324,698,042	2.17
合 計（純資産総額）		14,955,771,613	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24年2月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	日本	22,768,310,180	51.13
社債券	日本	20,556,343,000	46.17
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,202,920,315	2.70
合 計（純資産総額）		44,527,573,495	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24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	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	2,893,420,764	13,395.00	3,875,737,113	13,409.00	3,879,787,902	64.76
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	1,082,103,616	11,021.00	1,192,586,395	11,073.00	1,198,213,333	20.00
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	315,146,837	16,325.00	514,477,211	16,268.00	512,680,874	8.56

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	296,133,237	11,077.00	328,026,786	11,049.00	327,197,613	5.46
---	---------------------------------	-----------	----	-------------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

#### 種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.78
合計	98.78

(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24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	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	935,351,202	13,395.16	1,252,917,856	13,409.00	1,254,212,426	42.05
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	854,191,698	11,021.00	941,404,670	11,073.00	945,846,467	31.71
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	親投資信託受益証券	日本	345,805,987	11,077.00	383,049,291	11,049.00	382,081,035	12.81
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	親投資信託受益証券	日本	231,233,771	16,325.00	377,489,131	16,268.00	376,171,098	12.61

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

## 種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.19
合計	99.19

(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24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	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	765,718,259	11,021.00	843,898,093	11,073.00	847,879,828	41.42
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	313,560,148	13,395.19	420,019,785	13,409.00	420,452,802	20.54
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	370,001,207	11,077.00	409,850,336	11,049.00	408,814,333	19.97
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	210,928,867	16,314.19	344,113,382	16,268.00	343,139,080	16.76

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

## 種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.70
合計	98.70

(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24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	APPLE INC	株式	米国	コンピ ュータ ・周辺 機器	6,790	29,812.84	202,429,171	43,196.88	293,306,807	2.55
2	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	29,993	6,548.49	196,408,802	7,030.46	210,864,443	1.83
3	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	50,479	2,087.60	105,379,739	2,571.27	129,795,219	1.13
4	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技 術サー ビス	7,587	13,382.25	101,531,144	15,973.03	121,187,351	1.05
5	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	株式	英国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	40,010	2,677.85	107,140,703	3,017.12	120,714,889	1.05
6	BHP BILLITON LTD	株式	オース トラリ ア	金属・ 鉱業	37,146	3,843.77	142,780,539	3,116.69	115,772,381	1.01
7	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイ ス	食品	22,788	4,606.87	104,981,428	5,002.14	113,988,869	0.99
8	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	株式	米国	タバコ	16,387	5,266.07	86,295,030	6,765.82	110,871,571	0.96
9	GOOGLE INC	株式	米国	インタ ーネッ トソフト ウェア・サ ービス	2,189	46,704.95	102,237,127	49,891.71	109,212,943	0.95
10	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	11,694	8,059.86	94,252,013	8,843.33	103,413,957	0.90

11	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	449,347	222.59	100,021,956	221.35	99,464,670	0.86
12	RIO TINTO PLC	株式	英国	金属・鉱業	19,498	5,168.40	100,773,389	4,792.57	93,445,595	0.81
13	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	129,490	835.06	108,131,272	718.53	93,042,801	0.81
14	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	16,956	4,964.76	84,182,528	5,437.03	92,190,199	0.80
15	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	株式	オーストラリア	商業銀行	21,048	4,409.56	92,812,511	4,284.90	90,188,512	0.78
16	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	35,400	2,530.85	89,591,994	2,530.93	89,594,979	0.78
17	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	138,580	590.22	81,792,468	641.45	88,892,239	0.77
18	PRUDENTIAL PLC	株式	英国	保険	95,578	882.40	84,337,781	929.48	88,837,882	0.77
19	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	株式	英国	タバコ	21,776	3,039.60	66,190,334	4,072.50	88,682,738	0.77
20	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	27,711	3,604.39	99,881,387	3,163.46	87,662,718	0.76
21	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	39,772	1,737.12	69,088,573	2,197.72	87,407,847	0.76
22	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	50,633	1,598.27	80,925,245	1,712.03	86,685,195	0.75
23	UNION PACIFIC CORP	株式	米国	陸運・鉄道	9,255	7,987.83	73,927,404	9,053.91	83,793,933	0.73
24	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロマーット	53,279	1,577.26	84,035,075	1,545.83	82,360,213	0.72
25	EMC CORP/MASS	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	36,023	2,103.63	75,779,017	2,257.43	81,319,271	0.71
26	QUALCOMM INC	株式	米国	通信機器	15,866	4,265.53	67,676,915	5,057.02	80,234,717	0.70
27	SCHLUMBERGER LTD	株式	オランダ領キュラソー	エネルギー設備・サービス	12,588	6,634.90	83,520,171	6,355.97	80,008,955	0.70
28	ALLIANZ SE	株式	ドイツ	保険	7,882	9,890.35	77,955,702	9,949.08	78,418,653	0.68
29	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	14,589	4,854.09	70,816,258	5,258.72	76,719,501	0.67



30	US BANCORP	株式	米国	商業銀行	32,519	2,140.83	69,617,592	2,353.44	76,531,372	0.66
----	------------	----	----	------	--------	----------	------------	----------	------------	------

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

### 種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.99
	商業銀行	7.80
	医薬品	6.65
	機械	4.46
	金属・鉱業	3.88
	化学	3.60
	保険	3.57
	コングロマリット	3.51
	コンピュータ・周辺機器	3.47
	ソフトウェア	3.40
	各種金融サービス	2.78
	飲料	2.59
	タバコ	2.49
	食品	2.42
	半導体・半導体製造装置	2.40
	情報技術サービス	2.18
	専門小売り	2.17
	ホテル・レストラン・レジャー	2.14
	エネルギー設備・サービス	2.03
	メディア	2.00
	通信機器	1.60
	インターネットソフトウェア・サービス	1.55
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.41
	バイオテクノロジー	1.31
	繊維・アパレル・贅沢品	1.30
	航空宇宙・防衛	1.27
	陸運・鉄道	1.21
	家庭用品	1.14
	資本市場	1.08
	食品・生活必需品小売り	1.07
	各種電気通信サービス	1.05
	無線通信サービス	0.86
	自動車	0.83
	複合小売り	0.83
電気設備	0.81	
自動車部品	0.71	
電子装置・機器・部品	0.69	
インターネット販売・カタログ販売	0.59	
建設関連製品	0.59	
商業サービス・用品	0.53	
商社・流通業	0.50	

ライフサイエンス・ツール/サービス	0.46
ヘルスケア・テクノロジー	0.39
ガス	0.33
消費者金融	0.32
紙製品・林産品	0.32
総合公益事業	0.31
不動産管理・開発	0.31
水道	0.25
専門サービス	0.24
レジャー用品	0.22
運送インフラ	0.20
合計	98.81

(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24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	三菱UFJフ ィナンシャル G	株式	日本	銀行業	2,649,000	364.81	966,382,449	420.00	1,112,580,000	3.85
2	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機 器	316,400	3,036.99	960,903,862	3,355.00	1,061,522,000	3.67
3	日本電産	株式	日本	電気機器	130,700	6,486.37	847,768,480	7,680.00	1,003,776,000	3.47
4	三井住友フイ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	313,200	2,473.65	774,748,046	2,757.00	863,492,400	2.99
5	本田技研	株式	日本	輸送用機 器	261,000	2,915.17	760,859,361	3,095.00	807,795,000	2.80
6	日本電信電話	株式	日本	情報・通 信業	181,500	3,474.44	630,611,093	3,835.00	696,052,500	2.41
7	シークス	株式	日本	卸売業	574,000	897.55	515,194,600	1,162.00	666,988,000	2.31
8	三菱商事	株式	日本	卸売業	324,000	1,928.90	624,963,046	1,991.00	645,084,000	2.23
9	三井不動産	株式	日本	不動産業	408,000	1,228.14	501,079,414	1,542.00	629,136,000	2.18
10	三井物産	株式	日本	卸売業	436,000	1,263.84	551,032,414	1,399.00	609,964,000	2.11
11	日本セラミッ ク	株式	日本	電気機器	400,000	1,292.83	517,130,608	1,517.00	606,800,000	2.10
12	日産自動車	株式	日本	輸送用機 器	691,000	697.48	481,958,762	832.00	574,912,000	1.99
13	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	株式	日本	情報・通 信業	4,120	134,442.11	553,901,501	138,800.00	571,856,000	1.98

14	キヤノン	株式	日本	電気機器	154,500	3,502.87	541,193,033	3,680.00	568,560,000	1.97
15	東京海上HD	株式	日本	保険業	243,500	2,168.28	527,977,354	2,245.00	546,657,500	1.89
16	ファナック	株式	日本	電気機器	36,800	11,523.88	424,078,952	14,730.00	542,064,000	1.88
17	三菱地所	株式	日本	不動産業	342,000	1,333.57	456,080,257	1,470.00	502,740,000	1.74
18	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	2,110,000	213.39	450,258,545	234.00	493,740,000	1.71
19	小松製作所	株式	日本	機械	203,500	2,317.37	471,583,972	2,422.00	492,877,000	1.71
20	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	3,300,000	127.27	420,001,207	136.00	448,800,000	1.55
21	ヤマダ電機	株式	日本	小売業	84,500	4,953.35	418,558,242	5,270.00	445,315,000	1.54
22	日立	株式	日本	電気機器	918,000	415.72	381,631,858	473.00	434,214,000	1.50
23	ソニー	株式	日本	電気機器	246,000	1,989.65	489,452,922	1,737.00	427,302,000	1.48
24	グローウェルHD	株式	日本	小売業	195,700	1,738.40	340,204,544	2,094.00	409,795,800	1.42
25	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	78,300	4,218.31	330,293,695	5,210.00	407,943,000	1.41
26	アイシン精機	株式	日本	輸送用機器	139,200	2,557.02	355,937,034	2,862.00	398,390,400	1.38
27	東レ	株式	日本	繊維製品	671,000	502.98	337,499,467	578.00	387,838,000	1.34
28	オリックス	株式	日本	その他金融業	48,130	7,773.23	374,125,445	7,830.00	376,857,900	1.30
29	住友商事	株式	日本	卸売業	303,000	984.34	298,254,932	1,205.00	365,115,000	1.26
30	東芝機械	株式	日本	機械	836,000	390.65	326,581,583	427.00	356,972,000	1.24

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

## 種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	電気機器	18.86
	輸送用機器	10.93
	情報・通信業	9.52
	卸売業	9.01
	銀行業	8.80
	小売業	6.47
	サービス業	4.29
	不動産業	4.09
	機械	4.04
	化学	3.13
	鉄鋼	2.88
	医薬品	2.78
	食料品	2.64
	保険業	1.89
	非鉄金属	1.84
	陸運業	1.41
	繊維製品	1.34
	その他金融業	1.30
	その他製品	1.15
	パルプ・紙	1.10
精密機器	0.65	
合計		98.13

(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24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	BUNDESSCHAT 0.75 09/13/13	国債 証券	ドイツ	1,901,375,000	100.70	1,914,726,238	100.87	1,917,821,894	0.75	2013/ 9/13	12.82
2	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債 証券	オランダ	651,900,000	105.99	690,948,810	114.42	745,903,980	4.00	2018/ 7/15	4.99
3	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債 証券	フランス	673,630,000	102.19	688,388,147	102.81	692,538,794	3.25	2021/ 10/25	4.63

4	US T N/B 1.75 05/31/16	国債 証券	米国	637,372,000	102.40	652,698,680	104.55	666,397,921	1.75	2016/ 5/31	4.46
5	US T N/B 4.375 05/15/40	国債 証券	米国	508,284,000	116.22	590,703,290	126.45	642,699,704	4.38	2040/ 5/15	4.30
6	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債 証券	ドイツ	542,163,500	107.58	583,282,093	113.28	614,162,813	3.25	2020/ 1/4	4.11
7	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債 証券	ドイツ	467,195,000	103.97	485,756,657	112.96	527,743,472	3.25	2021/ 7/4	3.53
8	US T N/B 3.125 05/15/21	国債 証券	米国	459,876,000	106.43	489,464,962	111.48	512,651,370	3.13	2021/ 5/15	3.43
9	US T N/B 4.5 11/15/15	国債 証券	米国	443,740,000	112.75	500,316,850	114.51	508,113,362	4.50	2015/ 11/15	3.40
10	US T N/B 1.875 09/30/17	国債 証券	米国	435,672,000	97.47	424,640,785	104.74	456,331,566	1.88	2017/ 9/30	3.05
11	US T N/B 3.5 05/31/13	国債 証券	米国	419,536,000	105.77	443,741,125	104.17	437,018,065	3.50	2013/ 5/31	2.92
12	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債 証券	ドイツ	380,275,000	101.48	385,897,529	104.12	395,942,330	2.25	2021/ 9/4	2.65
13	US T N/B 3.5 05/15/20	国債 証券	米国	338,856,000	104.41	353,785,995	114.98	389,630,183	3.50	2020/ 5/15	2.61
14	US T N/B 1.875 04/30/14	国債 証券	米国	346,924,000	102.87	356,870,311	103.35	358,535,546	1.88	2014/ 4/30	2.40
15	US T N/B 1.375 11/30/15	国債 証券	米国	346,924,000	99.04	343,576,183	103.02	357,411,513	1.38	2015/ 11/30	2.39
16	FR TREASURY 2.5 07/25/16	国債 証券	フランス	325,950,000	103.76	338,189,423	103.79	338,287,208	2.50	2016/ 7/25	2.26
17	US T N/B 0.125 08/31/13	国債 証券	米国	306,584,000	99.81	306,013,567	99.83	306,056,676	0.13	2013/ 8/31	2.05
18	UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債 証券	英国	237,669,500	108.60	258,109,077	126.69	301,103,490	4.75	2030/ 12/7	2.01
19	EIB 5.125 05/30/17	特殊 債券	国際 機関	242,040,000	114.54	277,232,616	116.60	282,218,640	5.13	2017/ 5/30	1.89
20	DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債 証券	ドイツ	271,625,000	99.98	271,570,675	101.52	275,753,700	2.00	2022/ 1/4	1.84
21	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債 証券	ドイツ	217,300,000	104.99	228,143,270	117.53	255,392,690	3.25	2042/ 7/4	1.71
22	US T N/B 2.25 01/31/15	国債 証券	米国	242,040,000	103.76	251,143,124	105.30	254,868,120	2.25	2015/ 1/31	1.70

23	US T N/B 1.25 08/31/15	国債 証券	米国	242,040,000	99.04	239,713,996	102.63	248,400,811	1.25	2015/ 8/31	1.66
24	US T N/B 1.0 08/31/16	国債 証券	米国	242,040,000	100.21	242,560,008	101.22	244,997,729	1.00	2016/ 8/31	1.64
25	AUSTRIA 3.5 07/15/15	国債 証券	オーストリア	228,165,000	103.10	235,238,115	107.35	244,935,128	3.50	2015/ 7/15	1.64
26	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	国債 証券	フランス	217,300,000	106.95	232,402,350	111.82	242,989,206	4.25	2019/ 4/25	1.62
27	CANADA 3.75 06/01/19	国債 証券	カナダ	162,340,000	105.98	172,046,309	113.97	185,010,781	3.75	2019/ 6/1	1.24
28	BUNDESSCHAT 1.75 06/14/13	国債 証券	ドイツ	162,975,000	101.31	165,114,862	102.02	166,267,095	1.75	2013/ 6/14	1.11
29	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債 証券	フランス	141,245,000	106.33	150,178,746	105.73	149,336,926	4.00	2038/ 10/25	1.00
30	QUEENSLAND 6.0 10/14/15	特殊 債券	オーストラリア	134,257,200	102.92	138,176,168	105.62	141,802,455	6.00	2015/ 10/14	0.95

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

#### 種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	93.16
特殊債券	4.67
合計	97.83

(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24年2月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	315回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,825,000,000	101.51	4,897,856,900	102.70	4,955,468,000	1.20	2021/ 6/20	11.13
2	309回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,620,000,000	101.80	4,703,005,600	102.89	4,753,656,600	1.10	2020/ 6/20	10.68
3	121回利付 国庫債券 (20年)	国債 証券	日本	3,109,000,000	100.04	3,110,238,420	103.04	3,203,420,330	1.90	2030/ 9/20	7.19
4	130回利付 国庫債券 (20年)	国債 証券	日本	2,000,000,000	100.64	2,012,891,200	100.88	2,017,500,000	1.80	2031/ 9/20	4.53
5	84回利付 国庫債券(20年)	国債 証券	日本	1,611,000,000	105.16	1,694,079,270	107.94	1,738,832,850	2.00	2025/ 12/20	3.91
6	313回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	1,650,000,000	103.56	1,708,810,800	103.82	1,713,046,500	1.30	2021/ 3/20	3.85
7	33回利付 国庫債券(30年)	国債 証券	日本	1,674,000,000	99.45	1,664,785,140	101.66	1,701,821,880	2.00	2040/ 9/20	3.82
8	1回SCSK 転換社債	社債 券	日本	1,700,000,000	98.88	1,681,029,995	98.95	1,682,150,000	0.25	2013/ 9/30	3.78
9	1回野村総 合研究所 転換社債	社債 券	日本	1,700,000,000	98.00	1,666,000,000	98.60	1,676,200,000	-	2014/ 3/31	3.76
10	川崎汽船JP Y建てCB 4/4/13	社債 券	日本	1,400,000,000	98.12	1,373,747,000	97.88	1,370,320,000	-	2013/ 4/4	3.08
11	20回シャ ープ転換社債	社債 券	日本	1,300,000,000	98.40	1,279,228,232	98.75	1,283,750,000	-	2013/ 9/30	2.88
12	299回利付 国庫債券 (2年)	国債 証券	日本	1,200,000,000	100.08	1,201,007,500	100.07	1,200,888,000	0.20	2012/ 12/15	2.70
13	ヤマダ電機JP Y建て転換 制限条項付CB 3/31/15	社債 券	日本	1,100,000,000	97.50	1,072,500,000	98.60	1,084,600,000	-	2015/ 3/31	2.44
14	114回利付 国庫債券 (20年)	国債 証券	日本	832,000,000	103.31	859,539,200	106.56	886,545,920	2.10	2029/ 12/20	1.99

15	2回 琉球銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	800,000,000	100.45	803,584,000	99.26	794,088,000	1.74	2021/3/23	1.78
16	3回 りそな銀行劣後社債	社債券	日本	700,000,000	104.61	732,285,000	103.74	726,152,000	2.52	2019/6/4	1.63
17	20回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	社債券	日本	700,000,000	103.39	723,745,000	102.67	718,683,000	1.99	2019/6/10	1.61
18	3回 百五銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	700,000,000	100.00	700,000,000	100.48	703,353,000	1.33	2021/6/7	1.58
19	2回 大垣共立銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	700,000,000	99.73	698,100,000	100.30	702,121,000	1.31	2021/9/27	1.58
20	2回 百十四銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	600,000,000	100.00	600,000,000	100.64	603,828,000	1.42	2021/6/28	1.36
21	148回 オリックス社債	社債券	日本	600,000,000	100.87	605,244,000	100.25	601,524,000	1.26	2017/2/24	1.35
22	4回 みずほ銀行劣後特約付社債	社債券	日本	500,000,000	104.15	520,755,000	103.61	518,060,000	1.81	2016/1/29	1.16
23	9回 三菱UFJ信託銀行劣後社債	社債券	日本	500,000,000	100.88	504,395,000	102.08	510,400,000	1.68	2021/4/28	1.15
24	12回 東京建物社債	社債券	日本	500,000,000	100.72	503,614,000	101.88	509,380,000	1.80	2016/3/18	1.14
25	23回 コスモ石油社債	社債券	日本	500,000,000	98.60	492,975,000	100.81	504,030,000	1.44	2016/12/9	1.13
26	2回 武蔵野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	100.34	501,675,000	1.30	2021/7/28	1.13
27	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	100.71	503,550,000	100.08	500,400,000	1.11	2020/8/20	1.12
28	120回 利付国庫債券（20年）	国債証券	日本	500,000,000	95.14	475,685,000	98.47	492,335,000	1.60	2030/6/20	1.11
29	36回 鹿島建設社債	社債券	日本	400,000,000	99.72	398,876,000	101.11	404,448,000	1.24	2016/2/5	0.91
30	1回 京阪神不動産社債	社債券	日本	400,000,000	100.00	400,000,000	100.37	401,496,000	0.97	2016/7/22	0.90

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



## 種類別業種別投資比率

平成24年2月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	51.13
社債券	46.17
合計	97.30

(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24年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

## バランス物語 3 0（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
第21期末（平成23年8月25日現在）	6,340	6,347	0.9270	0.9280
第22期末（平成24年2月27日現在）	5,980	5,986	0.9614	0.9624
平成23年2月末	7,217		0.9617	
3月末	6,983		0.9530	
4月末	6,929		0.9556	
5月末	6,843		0.9547	
6月末	6,730		0.9564	
7月末	6,588		0.9524	
8月末	6,396		0.9343	
9月末	6,211		0.9278	
10月末	6,201		0.9368	
11月末	5,970		0.9222	
12月末	5,899		0.9266	
平成24年1月末	5,894		0.9333	
2月末	5,990		0.9624	

## バランス物語 5 0（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
第21期末（平成23年8月25日現在）	3,049	3,056	0.8443	0.8463
第22期末（平成24年2月27日現在）	2,986	2,993	0.8972	0.8992
平成23年2月末	3,654		0.9116	
3月末	3,527		0.8997	
4月末	3,497		0.9027	
5月末	3,409		0.8968	
6月末	3,374		0.8966	
7月末	3,267		0.8881	
8月末	3,093		0.8554	
9月末	3,000		0.8420	
10月末	2,995		0.8605	
11月末	2,872		0.8373	
12月末	2,871		0.8425	
平成24年1月末	2,882		0.8524	
2月末	2,982		0.8981	

## 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
第21期末（平成23年8月25日現在）	1,995	2,003	0.7644	0.7674
第22期末（平成24年2月27日現在）	2,038	2,045	0.8309	0.8339
平成23年2月末	2,349		0.8564	
3月末	2,289		0.8430	
4月末	2,282		0.8460	
5月末	2,246		0.8363	
6月末	2,225		0.8344	
7月末	2,163		0.8220	
8月末	2,007		0.7783	
9月末	1,931		0.7595	
10月末	1,984		0.7858	
11月末	1,898		0.7562	
12月末	1,903		0.7621	
平成24年1月末	1,915		0.7743	
2月末	2,046		0.8318	

## 【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
第21期	0.0010
第22期	0.0010

## バランス物語 5 0（安定・成長型）

	1口当たりの分配額（円）
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
第21期	0.0020
第22期	0.0020

## バランス物語 7 0（成長型）

	1口当たりの分配額（円）
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
第21期	0.0030
第22期	0.0030

## 【収益率の推移】

## バランス物語 3 0（安定型）

	収益率（％）
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
第21期	3.34
第22期	3.82

(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 5 0（安定・成長型）

	収益率（％）
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
第21期	6.85
第22期	6.50

(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70（成長型）

	収益率（％）
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
第21期	9.96
第22期	9.09

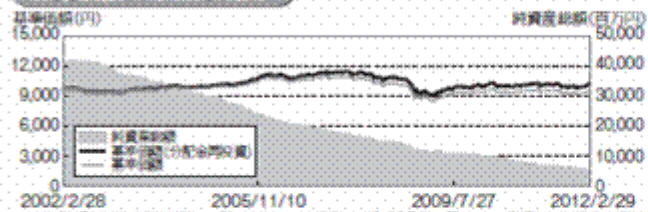
(注) 収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2012年2月29日

## バランス物語30(安定型)

基準価額・純資産の推移 (2002年2月28日～2012年2月29日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと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

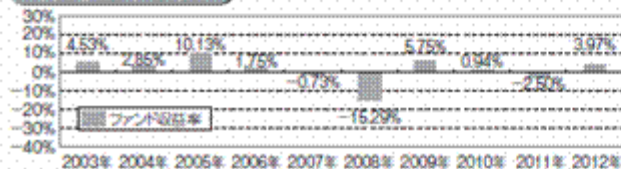
(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 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	64.76
2	DLジャパン・アクティブオープンマザーファンド	20.00
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	8.56
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	5.46

※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。

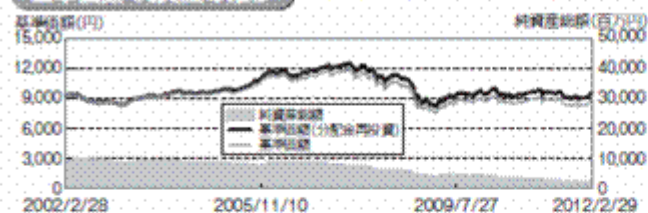
## 年間収益率の推移



※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、2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## バランス物語50(安定・成長型)

基準価額・純資産の推移 (2002年2月28日～2012年2月29日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと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

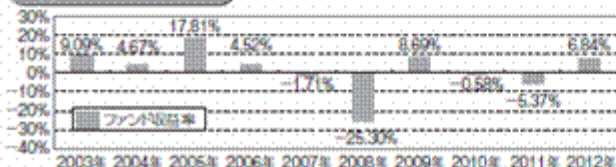
(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 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	42.05
2	DLジャパン・アクティブオープンマザーファンド	31.71
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	12.81
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	12.81

※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、2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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。

## 分配の推移(税引前)

第18期	(2010.02.25)	10円
第19期	(2010.08.25)	10円
第20期	(2011.02.25)	10円
第21期	(2011.08.25)	10円
第22期	(2012.02.27)	10円
設定来累計		675円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 分配の推移(税引前)

第18期	(2010.02.25)	20円
第19期	(2010.08.25)	20円
第20期	(2011.02.25)	20円
第21期	(2011.08.25)	20円
第22期	(2012.02.27)	20円
設定来累計		855円

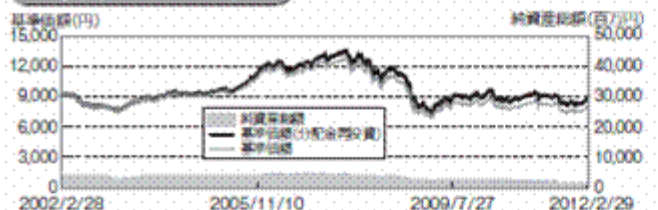
(注)分配金は1万口当たりです。



データの基準日：2012年2月29日

## バランス物語70(成長型)

## 基準価額・純資産の推移 (2002年2月28日～2012年2月29日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定後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)

期	日	金額
第18期	(2010.02.25)	30円
第19期	(2010.08.25)	30円
第20期	(2011.02.25)	30円
第21期	(2011.08.25)	30円
第22期	(2012.02.27)	30円
設定以来累計		1,000円

(注)分配金は1万円当たりです。

## 主要な資産の状況

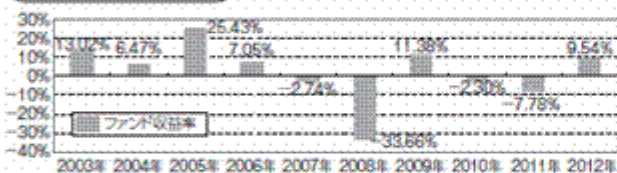
(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 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	41.42
2	DLジャパンボンドオープンマザーファンド	20.54
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	19.97
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	16.76

※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、毎年ベースで表示しています。但し、2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## 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	98.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.87
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	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	3.85
2	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.67
3	日本電産	株式	日本	電気機器	3.47
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.99
5	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2.80
6	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	2.41
7	シークス	株式	日本	卸売業	2.31
8	三菱商事	株式	日本	卸売業	2.23
9	三井不動産	株式	日本	不動産業	2.18
10	三井物産	株式	日本	卸売業	2.11

## 組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	電気機器	18.86
2	輸送用機器	10.93
3	情報・通信業	9.52
4	卸売業	9.01
5	銀行業	8.80

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2012年2月29日

## ■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	51.13
社債券	日本	46.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.70
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	315回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.20	2021/6/20	11.13
2	309回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.10	2020/6/20	10.68
3	121回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.90	2030/9/20	7.19
4	130回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.80	2031/9/20	4.53
5	84回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2.00	2025/12/20	3.91
6	313回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2021/3/20	3.85
7	33回 利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	2.00	2040/9/20	3.82
8	1回 SCSK 転換社債	社債券	日本	0.25	2013/9/30	3.78
9	1回 野村総合研究所 転換社債	社債券	日本	-	2014/3/31	3.76
10	川崎汽船JPHY建てCB 4/4/13	社債券	日本	-	2013/4/4	3.08

## ■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	米蘭	55.97
	英国	13.30
	ドイツ	5.25
	カナダ	4.67
	スイス	3.77
	その他	15.84
	小計	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.19
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	APPLE INC	株式	米蘭	コンピュータ周辺機器	2.55
2	EXXON MOBIL CORP	株式	米蘭	石油ガス・消耗燃料	1.83
3	MICROSOFT CORP	株式	米蘭	ソフトウェア	1.13
4	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米蘭	情報技術サービス	1.05
5	ROYAL DUTCH SHELL PLC B SHS	株式	英国	石油ガス・消耗燃料	1.05
6	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属鉱業	1.01
7	NESTLE SA REGISTERED	株式	スイス	食品	0.99
8	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL NV	株式	米蘭	タバコ	0.96
9	GOOGLE INC	株式	米蘭	インターネットソフトウェアサービス	0.95
10	CHEVRON CORP	株式	米蘭	石油ガス・消耗燃料	0.90

## 組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	石油ガス・消耗燃料	10.99
2	金属銀行	7.80
3	医薬品	6.65
4	機械	4.46
5	金属鉱業	3.88

## ■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	米蘭	37.64
	ドイツ	29.61
	フランス	11.41
	オランダ	4.99
	英国	3.72
	その他	5.79
	小計	93.16
特殊債券	国際機関	2.82
	オーストラリア	1.20
	ドイツ	0.64
小計	4.67	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.17
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	BUNDESSCHAT 0.75 09/13/13	国債証券	ドイツ	0.75	2013/9/13	12.82
2	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債証券	オランダ	4.00	2018/7/15	4.99
3	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	フランス	3.25	2021/10/25	4.63
4	US T N/B 1.75 05/31/16	国債証券	米蘭	1.75	2016/5/31	4.46
5	US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	米蘭	4.38	2040/5/15	4.30
6	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債証券	ドイツ	3.25	2020/1/4	4.11
7	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	ドイツ	3.25	2021/7/4	3.53
8	US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	米蘭	3.13	2021/5/15	3.43
9	US T N/B 4.5 11/15/15	国債証券	米蘭	4.50	2015/11/15	3.40
10	US T N/B 1.875 09/30/17	国債証券	米蘭	1.88	2017/9/30	3.05

○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 3 0（安定型）

	設定口数	解約口数
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
第21期	28,937,127	700,046,673
第22期	27,420,253	646,314,385

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

## バランス物語 5 0（安定・成長型）

	設定口数	解約口数
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

第21期	34,627,815	426,048,103
第22期	31,971,253	314,338,852

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

#### バランス物語 70 (成長型)

	設定口数	解約口数
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
第21期	24,455,175	148,410,519
第22期	25,225,172	182,736,740

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

### 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22期計算期間（平成23年8月26日から平成24年2月27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21期 平成23年8月25日現在	第22期 平成24年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	223,832,406	152,046,417
親投資信託受益証券	6,179,574,512	5,910,827,505
流動資産合計	6,403,406,918	6,062,873,922
資産合計	6,403,406,918	6,062,873,922
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	6,839,734	6,220,840
未払解約金	2,650,982	27,216,735
未払受託者報酬	3,542,844	3,239,460
未払委託者報酬	49,600,310	45,353,197
その他未払費用	168,185	153,790
流動負債合計	62,802,055	82,184,022
負債合計	62,802,055	82,184,022
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,839,734,369	6,220,840,237
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* <sub>3</sub> 499,129,506	* <sub>3</sub> 240,150,337
（分配準備積立金）	640,819,614	611,413,306
元本等合計	6,340,604,863	5,980,689,900
純資産合計	6,340,604,863	5,980,689,900
負債純資産合計	6,403,406,918	6,062,873,922

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期 自 平成23年 2月26日 至 平成23年 8月25日	第22期 自 平成23年 8月26日 至 平成24年 2月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	24,918	28,316
有価証券売買等損益	171,907,994	271,252,993
営業収益合計	171,883,076	271,281,309
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	3,542,844	3,239,460
委託者報酬	49,600,310	45,353,197
その他費用	168,185	153,790
営業費用合計	53,311,339	48,746,447
営業利益又は営業損失（ ）	225,194,415	222,534,862
経常利益又は経常損失（ ）	225,194,415	222,534,862
当期純利益又は当期純損失（ ）	225,194,415	222,534,862
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	5,963,820	2,549,160
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	299,684,379	499,129,506
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,938,218	47,162,933
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	27,938,218	47,162,933
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,313,016	1,948,626
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,313,016	1,948,626
分配金	* <sub>1</sub> 6,839,734	* <sub>1</sub> 6,220,840
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	499,129,506	240,150,337

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
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 当ファンドの計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成23年8月26日から平成24年2月27日までとなっております。

## （追加情報）

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

## （貸借対照表に関する注記）

区分	第 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
*1 期首元本額	7,510,843,915円	6,839,734,369円
期中追加設定元本額	28,937,127円	27,420,253円
期中解約元本額	700,046,673円	646,314,385円
*2 計算期間末日における受益権の総数	6,839,734,369口	6,220,840,237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499,129,506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240,150,337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 21 期 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日	第 22 期 自平成23年8月26日 至平成24年2月27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(58,677,477円)及び分配準備積立金(647,659,348円)より分配対象収益は706,336,825円(1万口当たり1,032.70円)であり、うち6,839,734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(37,212,004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(55,805,939円)及び分配準備積立金(580,422,142円)より分配対象収益は673,440,085円(1万口当たり1,082.55円)であり、うち6,220,840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 21 期 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日	第 22 期 自平成23年8月26日 至平成24年2月27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 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27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 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	178,515,752	258,711,012
合計	178,515,752	258,711,012

## (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 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	0.9270円	0.9614円

（1万口当たり純資産額）	（9,270円）	（9,614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24年2月27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	1,082,103,616	1,192,586,395	
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	2,893,420,764	3,875,737,113	
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	296,133,237	328,026,786	
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	315,146,837	514,477,211	
合計		4,586,804,454	5,910,827,505	

##### 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21期 平成23年8月25日現在	第22期 平成24年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	138,760,914	95,579,821
親投資信託受益証券	2,971,634,480	2,929,860,948
流動資産合計	3,110,395,394	3,025,440,769
資産合計	3,110,395,394	3,025,440,769
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	7,223,157	6,658,422
未払解約金	27,366,572	8,271,907
未払受託者報酬	1,769,182	1,568,362
未払委託者報酬	24,769,008	21,957,674
その他未払費用	83,943	74,405
流動負債合計	61,211,862	38,530,770
負債合計	61,211,862	38,530,770
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,611,578,790	3,329,211,191
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* <sub>3</sub> 562,395,258	* <sub>3</sub> 342,301,192
（分配準備積立金）	583,119,365	548,615,303
元本等合計	3,049,183,532	2,986,909,999
純資産合計	3,049,183,532	2,986,909,999
負債純資産合計	3,110,395,394	3,025,440,769

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第21期 自 平成23年 2月26日 至 平成23年 8月25日	第22期 自 平成23年 8月26日 至 平成24年 2月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	12,762	14,012
有価証券売買等損益	205,773,537	208,226,468
営業収益合計	205,760,775	208,240,480
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,769,182	1,568,362
委託者報酬	24,769,008	21,957,674
その他費用	83,943	74,405
営業費用合計	26,622,133	23,600,441
営業利益又は営業損失（ ）	232,382,908	184,640,039
経常利益又は経常損失（ ）	232,382,908	184,640,039
当期純利益又は当期純損失（ ）	232,382,908	184,640,039
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	8,096,407	1,930,216
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	366,299,031	562,395,258
剰余金増加額又は欠損金減少額	39,005,268	48,948,663
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	39,005,268	48,948,663
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,591,837	4,905,998
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,591,837	4,905,998
分配金	* <sub>1</sub> 7,223,157	* <sub>1</sub> 6,658,422
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	562,395,258	342,301,192

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
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 当ファンドの計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成23年8月26日から平成24年2月27日までとなっております。

## （追加情報）

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

## （貸借対照表に関する注記）

区分	第 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
*1 期首元本額	4,002,999,078円	3,611,578,790円
期中追加設定元本額	34,627,815円	31,971,253円
期中解約元本額	426,048,103円	314,338,852円
*2 計算期間末日における受益権の総数	3,611,578,790口	3,329,211,191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562,395,258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342,301,192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 21 期 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日	第 22 期 自平成23年8月26日 至平成24年2月27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(3,535,882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(157,161,261円)及び分配準備積立金(586,806,640円)より分配対象収益は747,503,783円(1万口当たり2,069.74円)であり、うち7,223,157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(22,630,167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(149,789,722円)及び分配準備積立金(532,643,558円)より分配対象収益は705,063,447円(1万口当たり2,117.81円)であり、うち6,658,422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 21 期 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日	第 22 期 自平成23年8月26日 至平成24年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27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 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	210,734,051	199,680,406
合計	210,734,051	199,680,406

## （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 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	0.8443円	0.8972円



(1万口当たり純資産額)	(8,443円)	(8,972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24年2月27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	854,191,698	941,404,670	
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	916,698,661	1,227,917,856	
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	345,805,987	383,049,291	
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	231,233,771	377,489,131	
合計		2,347,930,117	2,929,860,948	

##### 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 7 0（成長型）】

## （ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 平成23年 8 月25日現在	第22期 平成24年 2 月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	87,604,766	77,565,021
親投資信託受益証券	1,935,700,343	1,987,881,596
流動資産合計	2,023,305,109	2,065,446,617
資産合計	2,023,305,109	2,065,446,617
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	7,831,752	7,359,217
未払解約金	2,587,821	4,242,323
未払受託者報酬	1,156,001	1,031,785
未払委託者報酬	16,184,415	14,445,805
その他未払費用	54,827	48,918
流動負債合計	27,814,816	27,128,048
負債合計	27,814,816	27,128,048
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,610,584,161	2,453,072,593
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* <sub>3</sub> 615,093,868	* <sub>3</sub> 414,754,024
（分配準備積立金）	588,322,903	557,566,775
元本等合計	1,995,490,293	2,038,318,569
純資産合計	1,995,490,293	2,038,318,569
負債純資産合計	2,023,305,109	2,065,446,617

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第21期	第22期
	自 平成23年 2月26日 至 平成23年 8月25日	自 平成23年 8月26日 至 平成24年 2月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	10,112	9,990
有価証券売買等損益	207,659,849	187,181,253
営業収益合計	207,649,737	187,191,243
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,156,001	1,031,785
委託者報酬	16,184,415	14,445,805
その他費用	54,827	48,918
営業費用合計	17,395,243	15,526,508
営業利益又は営業損失( )	225,044,980	171,664,735
経常利益又は経常損失( )	225,044,980	171,664,735
当期純利益又は当期純損失( )	225,044,980	171,664,735
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	3,761,008	1,112,793
期首剰余金又は期首欠損金( )	403,952,540	615,093,868
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,931,197	43,055,895
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,931,197	43,055,895
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,956,801	5,908,776
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,956,801	5,908,776
分配金	*1 7,831,752	*1 7,359,217
期末剰余金又は期末欠損金( )	615,093,868	414,754,024

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
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 当ファンドの計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成23年8月26日から平成24年2月27日までとなっております。

## （追加情報）

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

## （貸借対照表に関する注記）

区分	第 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
*1 期首元本額	2,734,539,505円	2,610,584,161円
期中追加設定元本額	24,455,175円	25,225,172円
期中解約元本額	148,410,519円	182,736,740円
*2 計算期間末日における受益権の総数	2,610,584,161口	2,453,072,593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615,093,868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414,754,024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 21 期 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日	第 22 期 自平成23年8月26日 至平成24年2月27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（5,819,330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（228,828,163円）及び分配準備積立金（590,335,325円）より分配対象収益は824,982,818円（1万口当たり3,160.15円）であり、うち7,831,752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（17,537,510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（220,479,883円）及び分配準備積立金（547,388,482円）より分配対象収益は785,405,875円（1万口当たり3,201.72円）であり、うち7,359,217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 21 期 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日	第 22 期 自平成23年8月26日 至平成24年2月27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 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27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 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	208,968,057	180,230,721
合計	208,968,057	180,230,721

## （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 21 期 平成23年8月25日現在	第 22 期 平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	0.7644円	0.8309円

(1万口当たり純資産額)	(7,644円)	(8,309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24年2月27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	765,718,259	843,898,093	
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	306,099,131	410,019,785	
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	370,001,207	409,850,336	
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	198,538,060	324,113,382	
合 計		1,640,356,657	1,987,881,596	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



（参考）

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23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		37,506,742	14,184,140
コール・ローン		204,899,520	98,357,201
株式		8,988,210,952	11,407,121,665
未収配当金		23,381,809	20,388,862
流動資産合計		9,253,999,023	11,540,051,868
資産合計		9,253,999,023	11,540,051,868
負債の部			
流動負債			
流動負債合計		-	-
負債合計		-	-
純資産の部			
元本等			
元本		9,908,886,680	10,418,066,289
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	654,887,657	1,121,985,579
元本等合計		9,253,999,023	11,540,051,868
純資産合計		9,253,999,023	11,540,051,868
負債純資産合計		9,253,999,023	11,540,051,868

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
--------------------	--

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年3月16日から平成24年3月15日までとなっております。

## （追加情報）

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

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年8月25日現在	平成24年2月27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	10,365,520,746円	9,908,886,680円
同期中追加設定元本額	128,783,716円	969,680,781円
同期中解約元本額	585,417,782円	460,501,172円
同期末における元本の内訳		
バランス物語30（安定型）	288,418,003円	296,133,237円
バランス物語50（安定・成長型）	367,874,573円	345,805,987円
バランス物語70（成長型）	386,684,764円	370,001,207円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	247,831,213円	302,824,955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	1,370,763,737円	1,566,015,909円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	1,767,064,086円	1,980,038,152円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	671,800,358円	704,110,536円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	2,374,884,134円	2,395,079,236円

D I A Mライフサイクル・ファン ドV A 3（成長型）	1,096,710,011円	1,098,367,707円
D I A Mバランス物語30VA （安定型）	358,874,236円	380,414,355円
D I A Mバランス物語50VA （安定・成長型）	711,691,519円	719,458,866円
D I A Mバランス物語70VA （成長型）	266,290,046円	259,816,142円
（合計）	9,908,886,680円	10,418,066,289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	9,908,886,680口	10,418,066,289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 654,887,657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23年2月26日 至平成23年8月25日	自平成23年8月26日 至平成24年2月27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23年8月25日現在	平成24年2月27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

	平成23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	711,166,132	973,081,516
合計	711,166,132	973,081,516

(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23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	0.9339円	1.1077円
（1万口当たり純資産額）	（9,339円）	（11,077円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成24年2月27日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ACE LTD	10,885	73.130	796,020.050	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	7,149	51.150	365,671.350	
	SCHLUMBERGER LTD	12,588	79.850	1,005,151.800	
	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,054	58.870	297,528.980	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	12,343	44.150	544,943.450	
	JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	13,200	49.500	653,400.000	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,785	36.320	246,431.200	
	AMAZON.COM INC	2,218	179.130	397,310.340	
	ABBOTT LABORATORIES	11,460	56.700	649,782.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	7,587	197.760	1,500,405.120	
	ALLERGAN INC	5,008	87.420	437,799.360	
	AMGEN INC	5,904	67.730	399,877.920	
	BEAM INC	6,058	55.600	336,824.800	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	10,821	87.300	944,673.300	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,235	84.630	443,038.050	
	APPLE INC	6,790	522.410	3,547,163.900	
	AUTOZONE INC	787	359.800	283,162.600	
	AMETEK INC	6,542	48.250	315,651.500	
	VERIZON COMM INC	17,709	38.140	675,421.260	
	YUM! BRANDS INC	6,245	65.540	409,297.300	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	11,379	32.600	370,955.400	
	CORN PRODUCTS INTL INC	6,648	56.870	378,071.760	
	ONEOK INC	5,653	83.870	474,117.110	
	UNITED RENTALS INC	7,144	42.890	306,406.160	
	CSX CORP	13,594	21.660	294,446.040	
	CELGENE CORP	4,726	74.890	353,930.140	
	CERNER CORP	7,479	73.760	551,651.040	
	JPMORGAN CHASE & CO	27,711	38.280	1,060,777.080	

	CISCO SYSTEMS INC	38,318	20.140	771,724.520	
	CLEAN HARBORS INC	4,515	69.560	314,063.400	
	EQUINIX INC	2,180	138.790	302,562.200	
	COCA-COLA CO/THE	11,689	69.000	806,541.000	
	COMCAST CORP-CL A	30,184	29.190	881,070.960	
	SARA LEE CORP	18,203	20.270	368,974.810	
	CMS ENERGY CORP	20,438	21.680	443,095.840	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	6,675	56.850	379,473.750	
	DIRECTV	9,283	45.610	423,397.630	
	BROADCOM CORP-CL A	11,552	36.750	424,536.000	
	CUMMINS INC	6,005	121.780	731,288.900	
	DANAHER CORP	10,000	53.320	533,200.000	
	DEERE & CO	3,499	83.270	291,361.730	
	DOLLAR TREE INC	5,120	87.820	449,638.400	
	EBAY INC	6,789	36.360	246,848.040	
	EMC CORP/MASS	36,023	27.520	991,352.960	
	BANK OF AMERICA CORP	60,068	7.880	473,335.840	
	CITIGROUP INC	15,573	32.350	503,786.550	
	EATON CORP	12,563	51.750	650,135.250	
	EOG RESOURCES INC	3,997	117.550	469,847.350	
	CONCUR TECHNOLOGIES INC	3,884	60.050	233,234.200	
	EXXON MOBIL CORP	29,993	87.340	2,619,588.620	
	FMC CORP	4,887	98.560	481,662.720	
	MACY'S INC	9,963	37.060	369,228.780	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD	11,933	43.910	523,978.030	
	FEI COMPANY	6,338	44.400	281,407.200	
	GILEAD SCIENCES INC	7,806	45.260	353,299.560	
	GENERAL ELECTRIC CO	53,279	19.240	1,025,087.960	
	WW GRAINGER INC	1,999	207.290	414,372.710	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	10,637	25.080	266,775.960	
	HALLIBURTON CO	12,058	38.510	464,353.580	
	MONSTER BEVERAGE CORP	7,202	56.380	406,048.760	
	F5 NETWORKS INC	2,316	127.480	295,243.680	
	HOLLYFRONTIER CORP	8,502	33.890	288,132.780	
	TIBCO SOFTWARE INC	9,123	28.880	263,472.240	
	HUMANA INC	5,789	89.000	515,221.000	
	BIOGEN IDEC INC	2,741	116.390	319,024.990	
	INTEL CORP	39,772	26.700	1,061,912.400	
	JOHNSON & JOHNSON	14,589	64.460	940,406.940	
	KLA-TENCOR CORP	4,166	47.750	198,926.500	
	TENNECO INC	7,792	38.980	303,732.160	
	LIMITED BRANDS	9,535	46.260	441,089.100	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,458	43.020	277,823.160	
	RANGE RESOURCES CORP	6,336	65.940	417,795.840	
	LOWE'S COS INC	20,627	27.160	560,229.320	
	MCDONALD'S CORPORATION	5,498	100.320	551,559.360	
	METLIFE INC	23,931	37.760	903,634.560	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,886	28.370	365,575.820	

CVS CAREMARK CORP	10,158	44.070	447,663.060
MERCK & CO. INC.	19,028	38.200	726,869.600
MICROSOFT CORP	50,479	31.480	1,589,078.920
KANSAS CITY SOUTHERN	5,602	69.240	387,882.480
MYLAN LABORATORIES	16,365	23.480	384,250.200
NATIONAL OILWELL VARCO INC	7,063	86.040	607,700.520
NOBLE ENERGY INC	4,233	104.570	442,644.810
COACH INC	3,589	75.280	270,179.920
WELLS FARGO & CO	35,400	30.180	1,068,372.000
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	4,871	103.860	505,902.060
ORACLE CORP	28,436	29.250	831,753.000
PEPSICO INC	7,024	63.310	444,689.440
PFIZER INC	50,633	21.180	1,072,406.940
CONOCOPHILLIPS	6,001	75.950	455,775.950
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,701	116.240	662,684.240
ALTRIA GROUP INC	9,564	29.990	286,824.360
POLARIS INDUSTRIES INC	4,823	66.810	322,224.630
PRAXAIR INC	6,089	109.890	669,120.210
PRECISION CASTPARTS CORP	2,137	168.770	360,661.490
T ROWE PRICE GROUP INC	5,305	61.030	323,764.150
PROCTER & GAMBLE CO	16,956	66.710	1,131,134.760
QUALCOMM INC	15,866	63.440	1,006,539.040
US BANCORP	32,519	28.730	934,270.870
ROPER INDUSTRIES INC	4,420	94.580	418,043.600
KRAFT FOODS INC-A	10,767	37.880	407,853.960
SANDISK CORP	6,078	49.140	298,672.920
PRICELINE.COM INC	684	590.410	403,840.440
CENTENE CORP	5,900	48.900	288,510.000
SMITH (A.O.) CORP	6,614	45.810	302,987.340
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,885	61.090	787,144.650
BB&T CORP	14,847	29.480	437,689.560
AT&T INC	26,894	30.340	815,963.960
CHEVRON CORP	11,694	109.080	1,275,581.520
STARBUCKS CORP	7,704	48.300	372,103.200
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,492	56.660	367,836.720
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,857	21.960	370,179.720
TRACTOR SUPPLY CO	3,602	84.330	303,756.660
TRIMBLE NAVIGATION LTD	5,646	50.970	287,776.620
UNION PACIFIC CORP	9,255	112.620	1,042,298.100
UNITED TECHNOLOGIES CORP	8,956	83.970	752,035.320
UNITEDHEALTH GROUP INC	12,899	55.650	717,829.350
CBS CORP	19,837	29.750	590,150.750
WAL-MART STORES INC	8,297	58.790	487,780.630
VIROPHARMA INC	9,379	31.740	297,689.460
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	7,122	64.140	456,805.080
WABTEC CORP	4,144	73.780	305,744.320
WHOLE FOODS MARKET INC	7,101	81.100	575,891.100
CME GROUP INC	1,285	292.390	375,721.150

	TJX COMPANIES INC	18,690	35.970	672,279.300	
	DOMINO'S PIZZA INC	6,426	33.200	213,343.200	
	GOOGLE INC	2,189	609.900	1,335,071.100	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,741	183.880	504,015.080	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	763	387.420	295,601.460	
	TRANSDIGM GROUP INC	2,821	117.070	330,254.470	
	MASTERCARD INC	1,997	415.610	829,973.170	
	COMMVault SYSTEMS INC	5,962	52.250	311,514.500	
	SYNCHRONOSS TECHNOLOGIES INC	8,359	33.910	283,453.690	
	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,881	44.020	346,921.620	
	SALLY BEAUTY CO INC	17,544	23.320	409,126.080	
	SPECTRA ENERGY CORP	18,839	31.730	597,761.470	
	TIME WARNER CABLE INC	6,672	78.210	521,817.120	
	SOURCEFIRE INC	9,073	44.620	404,837.260	
	ARUBA NETWORKS INC	9,924	21.700	215,350.800	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,669	94.750	347,637.750	
	DISCOVER FINANCIAL	15,145	30.190	457,227.550	
	CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	4,770	113.430	541,061.100	
	TERADATA CORP	5,871	65.480	384,433.080	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	16,387	83.020	1,360,448.740	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,483	33.920	355,583.360	
	COLFAX CORP	8,714	34.950	304,554.300	
	GNC HOLDINGS INC	11,152	32.240	359,540.480	
	SOLARWINDS INC	8,583	38.870	333,621.210	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,095	78.020	241,471.900	
	MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	7,018	41.510	291,317.180	
米ドル小計	銘柄数 : 150	1,689,385		83,559,457.820	
	組入時価比率 : 58.86%			(6,792,548,326)	
	合計時価比率 : 59.55%				
英ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	125,315	2.473	309,903.990	
	BARCLAYS PLC	203,261	2.476	503,274.230	
	AGGREKO PLC	12,714	22.500	286,065.000	
	TULLOW OIL PLC	11,583	15.430	178,725.690	
	CRODA INTERNATIONAL	11,692	21.680	253,482.560	
	DIAGEO PLC	35,531	14.945	531,010.790	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	21,776	31.270	680,935.520	
	SPECTRIS PLC	14,774	17.500	258,545.000	
	FENNER PLC	49,501	4.709	233,100.200	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	11,941	25.080	299,480.280	
	IMI PLC	31,608	9.855	311,496.840	
	SABMILLER PLC	12,755	25.730	328,186.150	
	HSBC HOLDINGS PLC	129,490	5.749	744,438.010	
	ARM HOLDINGS PLC	40,711	5.740	233,681.140	
	PRUDENTIAL PLC	95,578	7.220	690,073.160	
	RIO TINTO PLC	19,498	36.705	715,674.090	
	VODAFONE GROUP PLC	449,347	1.717	771,528.790	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,879	34.210	303,750.590	
	ROTORK PLC	13,986	20.910	292,447.260	



	BP PLC	138,580	4.962	687,633.960	
	BG GROUP PLC	38,405	15.430	592,589.150	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	23,066	14.035	323,731.310	
	IMAGINATION TECHNOLOGIES GROUP PLC	30,376	5.895	179,066.520	
	WEIR GROUP	14,473	22.360	323,616.280	
	AEGIS GROUP PLC	152,036	1.724	262,110.060	
	ASTRAZENECA PLC	8,844	28.560	252,584.640	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	16,549	14.050	232,513.450	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	40,010	23.530	941,435.300	
	TELECITY GROUP PLC	27,322	6.820	186,336.040	
	SHIRE PLC	17,343	22.220	385,361.460	
	PETROFAC LTD	19,137	15.940	305,043.780	
英ポンド小計	銘柄数 : 31	1,826,081		12,597,821.240	
	組入時価比率 : 14.09%			(1,625,874,809)	
	合計時価比率 : 14.25%				
カナダドル	BARRICK GOLD CORP	9,352	48.850	456,845.200	
	NATIONAL BANK OF CANADA	10,534	76.590	806,799.060	
	AGRIUM INC	7,011	83.660	586,540.260	
	ENBRIDGE INC	11,651	38.410	447,514.910	
	INMET MINING CORPORATION	5,377	68.500	368,324.500	
	GOLDCORP INC	12,282	48.640	597,396.480	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	9,063	40.660	368,501.580	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	11,190	79.300	887,367.000	
	CENTERRA GOLD INC	12,497	21.430	267,810.710	
	PEMBINA PIPELINE CORP	11,394	28.360	323,133.840	
	DOLLARAMA INC	8,191	42.340	346,806.940	
	BAYTEX ENERGY CORP	9,720	58.130	565,023.600	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	15,078	39.110	589,700.580	
カナダドル小計	銘柄数 : 13	133,340		6,611,764.660	
	組入時価比率 : 4.65%			(537,139,761)	
	合計時価比率 : 4.71%				
スイスフラン	NESTLE SA-REGISTERED	22,788	55.450	1,263,594.600	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	8,165	54.450	444,584.250	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,949	159.300	469,775.700	
	NOVARTIS AG-REG SHS	11,634	51.500	599,151.000	
	ABB LTD	20,835	18.790	391,489.650	
	UBS AG-REGISTERED	50,365	12.880	648,701.200	
スイスフラン小計	銘柄数 : 6	116,736		3,817,296.400	
	組入時価比率 : 3.00%			(346,763,205)	
	合計時価比率 : 3.04%				
スウェーデンクローネ	ATLAS COPCO AB-A SHS	21,448	172.900	3,708,359.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	25,307	114.500	2,897,651.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	23,926	218.900	5,237,401.400	
	SWEDISH MATCH AB	8,294	248.700	2,062,717.800	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 4	78,975		13,906,129.900	

	組入時価比率： 1.50%			(172,714,133)	
	合計時価比率： 1.51%				
ユーロ	ANDRITZ AG	3,013	75.190	226,547.470	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	4,955	49.230	243,934.650	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,741	70.320	614,667.120	
	GEA GROUP AG	20,429	25.550	521,960.950	
	CONTINENTAL AG	4,507	68.640	309,360.480	
	SIEMENS AG-REG	4,665	75.020	349,968.300	
	BAYER AG	8,873	55.900	496,000.700	
	DAIMLER AG	5,857	47.445	277,885.360	
	BASF SE	5,909	64.700	382,312.300	
	DUERR AG	6,282	45.490	285,768.180	
	ALLIANZ SE	7,882	91.170	718,601.940	
	LINDE AG	5,089	126.350	642,995.150	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	39,684	7.586	301,042.820	
	DEUTSCHE BOERSE AG	5,579	50.320	280,735.280	
	LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,636	57.240	379,844.640	
	BANCO SANTANDER SA	58,247	6.283	365,965.900	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	6,533	33.800	220,815.400	
	KONECRANES OYJ	8,857	24.180	214,162.260	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	10,227	27.060	276,742.620	
	DANONE	4,199	50.700	212,889.300	
	BNP PARIBAS	15,016	36.920	554,390.720	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	2,807	126.350	354,664.450	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11,228	36.055	404,825.540	
	SANOFI	7,133	56.300	401,587.900	
	SALVATORE FERRAGAMO ITALIA SPA	16,667	14.130	235,504.710	
	UNILEVER NV-CVA	10,859	24.910	270,497.690	
	VOPAK (KON.)	5,273	41.625	219,488.620	
ユーロ小計	銘柄数： 27	295,147		9,763,160.450	
	組入時価比率： 9.26%			(1,068,187,385)	
	合計時価比率： 9.36%				
デンマーク ローネ	NOVO NORDISK A/S-B	4,769	794.000	3,786,586.000	
デンマーク ローネ小計	銘柄数： 1	4,769		3,786,586.000	
	組入時価比率： 0.48%			(55,700,680)	
	合計時価比率： 0.49%				
ノルウェー ローネ	DNB ASA	42,402	70.100	2,972,380.200	
	STATOIL ASA	16,351	157.100	2,568,742.100	
ノルウェー ローネ小計	銘柄数： 2	58,753		5,541,122.300	
	組入時価比率： 0.70%			(80,900,386)	
	合計時価比率： 0.71%				
香港ドル	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	30,000	111.000	3,330,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	41,600	144.500	6,011,200.000	
	FIRST PACIFIC CO	308,000	8.380	2,581,040.000	

	HUTCHISON WHAMPOA LTD	92,000	76.800	7,065,600.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	183,000	19.020	3,480,660.000	
	AIA GROUP LTD	137,200	28.300	3,882,760.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 6	791,800		26,351,260.000	
	組入時価比率 : 2.39%			(276,161,205)	
	合計時価比率 : 2.42%				
シンガポール・ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	59,000	14.160	835,440.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	113,000	6.600	745,800.000	
	KEPPEL CORP LTD	51,000	10.930	557,430.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 3	223,000		2,138,670.000	
	組入時価比率 : 1.20%			(138,222,242)	
	合計時価比率 : 1.21%				
オーストラリアドル	BHP BILLITON LTD	37,146	36.540	1,357,314.840	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	5,322	59.000	313,998.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	21,048	49.700	1,046,085.600	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	24,119	23.520	567,278.880	
	PANAUST LTD	89,675	3.590	321,933.250	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 5	177,310		3,606,610.570	
	組入時価比率 : 2.71%			(312,909,533)	
	合計時価比率 : 2.74%				
合計				11,407,121,665	
				(11,407,121,665)	

(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 150銘柄	58.86%	59.55%
英ポンド	株式 31銘柄	14.09%	14.25%
カナダドル	株式 13銘柄	4.65%	4.71%
スイスフラン	株式 6銘柄	3.00%	3.04%
スウェーデンクローネ	株式 4銘柄	1.50%	1.51%

ユーロ	株式	27銘柄	9.26%	9.36%
デンマーククローネ	株式	1銘柄	0.48%	0.49%
ノルウェークローネ	株式	2銘柄	0.70%	0.71%
香港ドル	株式	6銘柄	2.39%	2.42%
シンガポール・ドル	株式	3銘柄	1.20%	1.21%
オーストラリアドル	株式	5銘柄	2.71%	2.74%

(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23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		804,371	348,855
コール・ローン		476,577,133	545,352,183
株式		24,826,083,200	28,180,784,500
未収入金		111,025,810	178,373,291
未収配当金		23,454,500	43,711,900
流動資産合計		25,437,945,014	28,948,570,729
資産合計		25,437,945,014	28,948,570,729
負債の部			
流動負債			
未払金		113,717,938	182,456,013
流動負債合計		113,717,938	182,456,013
負債合計		113,717,938	182,456,013
純資産の部			
元本等			
元本		25,932,251,619	26,100,203,764
剰余金			
剰余金又は欠損金( )	*3	608,024,543	2,665,910,952
元本等合計		25,324,227,076	28,766,114,716
純資産合計		25,324,227,076	28,766,114,716
負債純資産合計		25,437,945,014	28,948,570,729

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 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23年3月16日から平成24年3月15日までとなっております。

## (追加情報)

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年8月25日現在	平成24年2月27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	24,929,829,888円	25,932,251,619円
同期中追加設定元本額	1,196,271,031円	1,223,260,605円
同期中解約元本額	193,849,300円	1,055,308,460円
同期末における元本の内訳		
バランス物語30（安定型）	1,151,389,751円	1,082,103,616円
バランス物語50（安定・成長型）	916,965,888円	854,191,698円
バランス物語70（成長型）	803,965,533円	765,718,259円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	998,308,939円	1,096,750,511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	3,493,031,640円	3,830,223,159円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	3,768,467,735円	4,101,999,973円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	2,631,897,844円	2,548,846,632円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	5,992,458,918円	5,839,708,838円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	2,346,365,220円	2,271,462,940円
D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	1,439,690,203円	1,409,134,579円
D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	1,816,777,130円	1,762,258,506円
D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	572,932,818円	537,805,053円
（合計）	25,932,251,619円	26,100,203,764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	25,932,251,619口	26,100,203,764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608,024,543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23年2月26日 至平成23年8月25日	自平成23年8月26日 至平成24年2月27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23年8月25日現在	平成24年2月27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

	平成23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	564,452,589	2,476,802,238
合計	564,452,589	2,476,802,238

（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23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9766円 (9,766円)	1.1021円 (11,021円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成24年2月27日現在

銘 柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
エムスリー	950	309,500	294,025,000	
ディー・エヌ・エー	54,000	2,600	140,400,000	
麒麟HD	114,000	964	109,896,000	
大黒天物産	68,700	2,118	145,506,600	
味の素	76,000	941	71,516,000	
東洋水産	151,000	2,006	302,906,000	



日本たばこ産業	614	436,500	268,011,000
グローウェルHD	195,700	1,974	386,311,800
セブン&アイ・HLDGS	101,200	2,216	224,259,200
東レ	671,000	578	387,838,000
グリー	120,000	2,449	293,880,000
日本製紙G本社	182,000	1,755	319,410,000
住友化学	626,000	346	216,596,000
信越化学	80,200	4,395	352,479,000
ダイセル	320,000	525	168,000,000
電通	84,000	2,462	206,808,000
武田薬品	95,700	3,645	348,826,500
アステラス製薬	56,700	3,285	186,259,500
沢井製薬	18,400	7,870	144,808,000
大塚ホールディングス	51,000	2,242	114,342,000
フジ・メディア・HD	2,660	123,600	328,776,000
ヤフー	13,300	25,320	336,756,000
アルファシステムズ	186,500	1,338	249,537,000
楽天	3,800	79,200	300,960,000
新日本製鐵	2,110,000	235	495,850,000
JFEホールディングス	194,000	1,796	348,424,000
住友鉱山	235,000	1,223	287,405,000
住友電工	234,000	1,062	248,508,000
東芝機械	836,000	434	362,824,000
SMC	18,700	13,840	258,808,000
小松製作所	203,500	2,425	493,487,500
住友重機械	131,000	451	59,081,000
日立	918,000	474	435,132,000
三菱電機	443,000	738	326,934,000
日本電産	130,700	7,560	988,092,000
パナソニック	282,000	751	211,782,000
ソニー	246,000	1,760	432,960,000
メガチップス	131,000	1,473	192,963,000
日本セラミック	400,000	1,456	582,400,000
ファナック	36,800	14,320	526,976,000
エンプラス	190,000	1,687	320,530,000
京セラ	20,700	6,900	142,830,000
村田製作所	43,500	4,810	209,235,000
日東電工	49,500	3,395	168,052,500
日産自動車	691,000	837	578,367,000
トヨタ自動車	316,400	3,380	1,069,432,000
カルソニックカンセイ	476,000	471	224,196,000
アイシン精機	139,200	2,899	403,540,800
ダイハツ	60,000	1,522	91,320,000
本田技研	261,000	3,140	819,540,000
シークス	574,000	1,178	676,172,000
島津製作所	265,000	694	183,910,000
キヤノン	154,500	3,680	568,560,000
任天堂	27,800	12,660	351,948,000

伊藤忠	341,500	924	315,546,000
三井物産	436,000	1,397	609,092,000
東京エレクトロン	56,500	4,465	252,272,500
住友商事	303,000	1,199	363,297,000
三菱商事	324,000	2,008	650,592,000
しまむら	19,500	8,670	169,065,000
エイチ・ツー・オーリテイリング 新	238,000	566	134,708,000
イオン	80,100	1,032	82,663,200
三菱UFJフィナンシャルG	2,649,000	420	1,112,580,000
三井住友トラストHD	420,000	286	120,120,000
三井住友フィナンシャルG	313,200	2,756	863,179,200
みずほフィナンシャルG	3,300,000	136	448,800,000
オリックス	48,130	7,740	372,526,200
東京海上HD	243,500	2,221	540,813,500
三井不動産	408,000	1,548	631,584,000
三菱地所	342,000	1,459	498,978,000
住友不動産	27,000	1,884	50,868,000
東日本旅客鉄道	78,300	5,180	405,594,000
日本テレビ放送網	14,000	12,130	169,820,000
日本電信電話	181,500	3,750	680,625,000
KDDI	375	507,000	190,125,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	4,120	137,800	567,736,000
セコム	71,300	3,775	269,157,500
ヤマダ電機	84,500	5,200	439,400,000
ニトリホールディングス	41,500	6,850	284,275,000
合計	23,116,749		28,180,784,500

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。

「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23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		13,906,122	12,793,212
コール・ローン		325,536,998	249,473,923
国債証券		13,095,512,857	13,879,325,740
特殊債券		672,891,596	700,028,721
派生商品評価勘定		4,722,326	31,728,574
未収入金		867,205,990	74,590,451
未収利息		81,609,501	125,405,996
前払費用		42,408,166	25,681,922
流動資産合計		15,103,793,556	15,099,028,539
資産合計		15,103,793,556	15,099,028,539
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		14,156,768	44,364,775
未払金		877,106,847	65,711,206
流動負債合計		891,263,615	110,075,981
負債合計		891,263,615	110,075,981
純資産の部			
元本等			
元本		9,118,818,587	9,181,720,406
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		5,093,711,354	5,807,232,152
元本等合計		14,212,529,941	14,988,952,558
純資産合計		14,212,529,941	14,988,952,558
負債純資産合計		15,103,793,556	15,099,028,539

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(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。</p> <p>(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年5月26日から平成24年5月25日までとなっております。</p>
-----------------------------------	--

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
<p>*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</p>	<p>9,168,550,077円 370,793,189円 420,524,679円</p>	<p>9,118,818,587円 294,068,650円 231,166,831円</p>
<p>同期末における元本の内訳</p>		
<p>バランス物語30（安定型）</p>	<p>334,771,180円</p>	<p>315,146,837円</p>
<p>バランス物語50（安定・成長型）</p>	<p>250,841,650円</p>	<p>231,233,771円</p>
<p>バランス物語70（成長型）</p>	<p>217,994,038円</p>	<p>198,538,060円</p>
<p>D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金&gt; 1安定型</p>	<p>281,570,762円</p>	<p>304,306,255円</p>
<p>D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金&gt; 2安定・成長型</p>	<p>956,050,076円</p>	<p>1,015,075,039円</p>
<p>D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金&gt; 3成長型</p>	<p>1,056,536,966円</p>	<p>1,082,807,786円</p>
<p>外国債券私募オープン（適格機関投資家向け）</p>	<p>1,845,234,180円</p>	<p>1,997,092,351円</p>
<p>D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）</p>	<p>783,248,919円</p>	<p>770,064,134円</p>
<p>D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）</p>	<p>1,685,118,922円</p>	<p>1,619,605,513円</p>
<p>D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）</p>	<p>638,124,740円</p>	<p>611,971,959円</p>

D I A Mバランス物語 3 0 V A （安定型）	417,558,991円	411,025,605円
D I A Mバランス物語 5 0 V A （安定・成長型）	502,246,898円	482,550,148円
D I A Mバランス物語 7 0 V A （成長型）	149,521,265円	142,302,948円
（合 計）	9,118,818,587円	9,181,720,406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	9,118,818,587口	9,181,720,406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23年2月26日 至平成23年8月25日	自平成23年8月26日 至平成24年2月27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23年8月25日現在	平成24年2月27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。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)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 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

	平成23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	391,800,104	482,834,752
特殊債券	21,365,138	12,465,800
合計	413,165,242	495,300,552

（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23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	1,548,280	-	1,556,600	8,320
	ユーロ	1,604,469,100	-	1,614,735,000	10,265,900
	米ドル	287,128,450	-	288,036,065	907,615
	買建				
	オーストラリアドル	8,716,950	-	8,816,500	99,550
	シンガポール・ドル	134,371,960	-	135,150,000	778,040
	スウェーデンクローネ	8,341,900	-	8,477,000	135,100
	ノルウェークローネ	42,786,590	-	43,287,000	500,410
	ポーランドズロチ	115,972,970	-	117,527,900	1,554,930
	ユーロ	919,173	-	911,905	7,268
	英ポンド	630,950,570	-	628,041,400	2,909,170
	米ドル	831,166,065	-	832,761,866	1,595,801
	合 計	3,666,372,008	-	3,679,301,236	9,434,442

平成24年2月27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	800,150	-	811,500	11,350
	スウェーデンクローネ	1,795,350	-	1,858,500	63,150
	ユーロ	1,063,296,335	-	1,101,355,900	38,059,565
	英ポンド	143,574,255	-	146,888,033	3,313,778
	米ドル	137,037,424	-	139,954,356	2,916,932
	買建				
	オーストラリアドル	32,306,460	-	32,832,000	525,540
	シンガポール・ドル	137,912,180	-	140,160,300	2,248,120
	スイスフラン	63,880,110	-	66,305,900	2,425,790
	ノルウェークローネ	47,082,240	-	48,776,000	1,693,760
	ポーランドズロチ	108,232,410	-	112,054,800	3,822,390
	ユーロ	143,574,255	-	148,743,200	5,168,945
	英ポンド	670,515,365	-	685,495,190	14,979,825
	米ドル	11,241,905	-	12,106,109	864,204
	合計	2,561,248,439	-	2,637,341,788	12,636,201

## （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ではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.5586円	1.6325円
（1万口当たり純資産額）	（15,586円）	（16,325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24年2月27日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 3.5 05/31/13	5,200,000.00	5,415,488.000	
	US T N/B 0.125 08/31/13	3,800,000.00	3,792,096.000	
	US T N/B 1.875 04/30/14	4,300,000.00	4,442,072.000	
	US T N/B 2.25 01/31/15	3,000,000.00	3,156,660.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	1,500,000.00	1,656,675.000	
	US T N/B 1.25 08/31/15	3,000,000.00	3,073,230.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	5,500,000.00	6,287,600.000	
	US T N/B 1.375 11/30/15	4,300,000.00	4,421,260.000	
	US T N/B 1.75 05/31/16	7,900,000.00	8,241,280.000	
	US T N/B 1.0 08/31/16	3,000,000.00	3,029,280.000	
	US T N/B 1.875 09/30/17	5,400,000.00	5,639,598.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	4,200,000.00	4,811,940.000	
	US T N/B 2.625 08/15/20	1,200,000.00	1,288,968.000	
	US T N/B 2.625 11/15/20	100,000.00	107,195.000	
	US T N/B 3.125 05/15/21	5,100,000.00	5,662,989.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	6,300,000.00	7,911,414.000	
米ドル小計	銘柄数 : 16	63,800,000.00	68,937,745.000	
	組入時価比率 : 37.39%		(5,603,949,291)	
	合計時価比率 : 38.44%			
	UK TREASURY 5.0 03/07/12	400,000.00	400,440.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	780,000.00	870,324.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,850,000.00	2,325,265.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	600,000.00	711,300.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 4	3,630,000.00	4,307,329.000	
	組入時価比率 : 3.71%		(555,903,881)	
	合計時価比率 : 3.81%			
	CANADA 5.25 06/01/12	160,000.00	161,755.200	
	CANADA 5.0 06/01/14	400,000.00	434,632.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	500,000.00	511,220.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	110,000.00	124,069.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	2,000,000.00	2,272,340.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	700,000.00	772,135.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	600,000.00	1,027,638.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 7	4,470,000.00	5,303,789.200	
	組入時価比率 : 2.87%		(430,879,835)	
	合計時価比率 : 2.96%			
	SWEDEN 6.75 05/05/14	2,000,000.00	2,245,100.000	

	SWEDEN 4.5 08/12/15	1,800,000.00	2,002,248.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	3,000,000.00	3,215,820.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 3	6,800,000.00	7,463,168.000	
	組入時価比率 : 0.62%		(92,692,547)	
	合計時価比率 : 0.64%			
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	2,100,000.00	2,252,250.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	100,000.00	103,705.000	
	BUNDESSCHAT 1.75 06/14/13	1,500,000.00	1,529,850.000	
	BUNDESSCHAT 0.75 09/13/13	17,500,000.00	17,641,750.000	
	BUNDESOBL 2.5 10/10/14	500,000.00	528,150.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	200,000.00	222,160.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	4,990,000.00	5,627,722.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	4,300,000.00	4,833,630.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,500,000.00	3,624,950.000	
	DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,500,000.00	2,524,750.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	750,000.00	1,026,825.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	500,000.00	636,400.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,000,000.00	2,329,400.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	800,000.00	888,120.000	
	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	300,000.00	308,490.000	
	FR TREASURY 2.5 07/25/16	3,000,000.00	3,107,550.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	500,000.00	572,420.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	600,000.00	654,930.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	2,000,000.00	2,232,060.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	1,000,000.00	1,065,840.000	
	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,700,000.00	5,847,459.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,300,000.00	1,379,430.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	6,000,000.00	6,832,200.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 23	61,640,000.00	65,770,041.000	
	組入時価比率 : 48.01%		(7,195,900,186)	
	合計時価比率 : 49.36%			
国債証券計			13,879,325,740	
			(13,879,325,740)	
特殊債券	IADB 3.5 03/15/13	1,000,000.00	1,032,200.000	
	EIB 5.125 05/30/17	3,000,000.00	3,492,000.000	
	KFW 4.875 06/17/19	1,000,000.00	1,192,920.000	
米ドル小計	銘柄数 : 3	5,000,000.00	5,717,120.000	
	組入時価比率 : 3.10%		(464,744,685)	
	合計時価比率 : 3.19%			
	EIB 3.625 10/15/13	500,000.00	521,400.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 1	500,000.00	521,400.000	
	組入時価比率 : 0.38%		(57,046,374)	
	合計時価比率 : 0.39%			
	QUEENSLAND 6.0 10/14/15	1,540,000.00	1,621,620.000	
	NEW S WALES 6.0 04/01/19	400,000.00	432,756.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 2	1,940,000.00	2,054,376.000	
	組入時価比率 : 1.19%		(178,237,662)	

	合計時価比率： 1.22%			
特殊債券計			700,028,721	
			(700,028,721)	
合計			14,579,354,461	
			(14,579,354,461)	

(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 16銘柄	37.39%	38.44%
米ドル	特殊債券 3銘柄	3.10%	3.19%
英ポンド	国債証券 4銘柄	3.71%	3.81%
カナダドル	国債証券 7銘柄	2.87%	2.96%
スウェーデンクローネ	国債証券 3銘柄	0.62%	0.64%
ユーロ	国債証券 23銘柄	48.01%	49.36%
ユーロ	特殊債券 1銘柄	0.38%	0.39%
オーストラリアドル	特殊債券 2銘柄	1.19%	1.22%

(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。

## 「D L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23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		904,529,583	1,120,665,909
国債証券		24,520,250,550	21,832,684,460
社債券		19,943,947,970	20,554,341,000
未収入金		1,020,923,920	2,109,179,000
未収利息		128,668,208	131,122,803
前払費用		10,358,863	6,734,826
流動資産合計		46,528,679,094	45,754,727,998
資産合計		46,528,679,094	45,754,727,998
負債の部			
流動負債			
未払金		711,990,500	2,262,128,200
流動負債合計		711,990,500	2,262,128,200
負債合計		711,990,500	2,262,128,200
純資産の部			
元本等			
元本		34,636,380,803	32,469,223,321
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		11,180,307,791	11,023,376,477
元本等合計		45,816,688,594	43,492,599,798
純資産合計		45,816,688,594	43,492,599,798
負債純資産合計		46,528,679,094	45,754,727,998

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)国債証券及び社債券 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。
--------------------	--

	<p>(2)社債券（転換社債及び新株予約権付社債）</p> <p>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。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年5月26日から平成24年5月25日までとなっております。</p>

## (追加情報)

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年8月25日現在	平成24年2月27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	37,220,375,715円	34,636,380,803円
同期中追加設定元本額	571,787,324円	364,029,106円
同期中解約元本額	3,155,782,236円	2,531,186,588円
同期末における元本の内訳		
バランス物語30（安定型）	3,223,464,884円	2,893,420,764円
バランス物語50（安定・成長型）	1,014,216,614円	916,698,661円
バランス物語70（成長型）	339,928,331円	306,099,131円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	2,779,486,158円	2,850,915,941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	4,015,810,404円	4,098,491,658円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	1,598,701,986円	1,658,863,408円

D I A Mライフサイクル・ファン ドV A 1（安定型）	7,435,338,310円	6,880,340,615円
D I A Mライフサイクル・ファン ドV A 2（安定・成長型）	6,903,874,086円	6,228,878,820円
D I A Mライフサイクル・ファン ドV A 3（成長型）	994,841,158円	852,566,688円
D I A Mバランス物語30V A （安定型）	4,020,826,492円	3,713,103,923円
D I A Mバランス物語50V A （安定・成長型）	2,072,160,398円	1,854,622,474円
D I A Mバランス物語70V A （成長型）	237,731,982円	215,221,238円
（合計）	34,636,380,803円	32,469,223,321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	34,636,380,803口	32,469,223,321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23年2月26日 至平成23年8月25日	自平成23年8月26日 至平成24年2月27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23年8月25日現在	平成24年2月27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

	平成23年8月25日現在	平成24年2月27日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	222,000,860	297,539,000
社債券	55,573,228	40,491,773
合計	277,574,088	338,030,773

（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23年8月25日現在	平成24年2月27日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3228円 (13,228円)	1.3395円 (13,395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24年2月27日現在

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	299回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,200,900,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	4,620,000,000	4,744,509,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,140,645,000	
	315回 利付国庫債券(10年)	4,825,000,000	4,949,243,750	
	33回 利付国庫債券(30年)	1,454,000,000	1,476,813,260	
	84回 利付国庫債券(20年)	1,611,000,000	1,733,854,860	
	114回 利付国庫債券(20年)	832,000,000	884,133,120	
	120回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	490,960,000	
	121回 利付国庫債券(20年)	3,109,000,000	3,194,435,320	
	130回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,912,445,000	
	12回 物価連動国債(10年)	100,000,000	104,745,150	
国債証券計			21,832,684,460	
社債券	36回 鹿島建設社債	400,000,000	404,392,000	
	2回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	104,950,000	
	1回 野村総合研究所 転換社債	1,700,000,000	1,675,350,000	
	21回 コスモ石油社債	200,000,000	200,062,000	
	23回 コスモ石油社債	500,000,000	503,815,000	
	20回 シャープ転換社債	1,300,000,000	1,285,050,000	
	1回 オリックス・クレジット社債	300,000,000	300,312,000	
	28回 クレディセゾン社債	100,000,000	106,367,000	
	33回 クレディセゾン社債	100,000,000	105,327,000	
	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	205,362,000	
	17回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	204,768,000	
	20回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	700,000,000	718,718,000	
	3回 りそな銀行劣後社債	700,000,000	726,166,000	
	4回 福岡銀行期限前償還条項付劣後社債	500,000,000	500,300,000	
	5回 福岡銀行期限前償還条項付劣後社債	200,000,000	199,240,000	
	1回 西日本シティ銀行劣後社債	300,000,000	315,147,000	
	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	303,699,000	
	2回 武蔵野銀行期限前償還条項付劣後社債	500,000,000	501,510,000	
	2回 大垣共立銀行期限前償還条項付劣後債	700,000,000	701,883,000	



	2回 福井銀行劣後社債	300,000,000	298,224,000	
	2回 南都銀行期限前償還条項付劣後社債	200,000,000	203,542,000	
	2回 百五銀行期限前償還条項付劣後社債	300,000,000	302,100,000	
	3回 百五銀行期限前償還条項付劣後社債	700,000,000	703,143,000	
	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	398,552,000	
	2回 百十四銀行期限前償還条項付劣後社債	600,000,000	603,642,000	
	5回 阿波銀行期限前償還条項付劣後社債	300,000,000	298,587,000	
	2回 宮崎銀行期限前償還条項付劣後社債	300,000,000	298,170,000	
	2回 琉球銀行期限前償還条項付劣後社債	800,000,000	793,872,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	500,000,000	509,545,000	
	3回 みずほ信託銀行劣後社債	100,000,000	102,626,000	
	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	203,620,000	
	4回 みずほ銀行劣後特約付社債	500,000,000	518,000,000	
	4回 ジャックス社債	100,000,000	102,923,000	
	148回 オリックス社債	600,000,000	601,254,000	
	9回 東京建物社債	300,000,000	307,044,000	
	12回 東京建物社債	500,000,000	509,315,000	
	1回 京阪神不動産社債	400,000,000	401,344,000	
	1回 SCSK 転換社債	1,700,000,000	1,683,000,000	
	川崎汽船JPY建てCB 4 / 4 / 13	1,400,000,000	1,370,320,000	
	ヤマダ電機JPY建て転換制限条項付CB 3 / 31 / 15	1,100,000,000	1,084,600,000	
	岩手銀行JPY建て新株予約権付CB 8 / 13 / 17	200,000,000	198,500,000	
社債券計			20,554,341,000	
合計			42,387,025,460	

## 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。

## 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24年2月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	5,994,302,303円
負債総額	3,570,527円
純資産総額（ - ）	5,990,731,776円
発行済数量	6,224,486,136口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9624円

## バランス物語50（安定・成長型）

平成24年2月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	2,997,267,404円
負債総額	14,793,030円
純資産総額（ - ）	2,982,474,374円
発行済数量	3,320,708,580口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8981円

## バランス物語70（成長型）

平成24年2月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	2,048,290,208円
負債総額	1,366,067円
純資産総額（ - ）	2,046,924,141円
発行済数量	2,460,747,018口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8318円

## （参考）マザーファンドの現況

## 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24年2月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	11,510,634,169円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	11,510,634,169円
発行済数量	10,418,066,289口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1049円

## DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	29,192,997,048円
負債総額	291,732,585円
純資産総額（ - ）	28,901,264,463円

発行済数量	26,100,203,764口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1073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24年2月29日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	15,186,480,703円
負債総額	230,709,090円
純資産総額（ - ）	14,955,771,613円
発行済数量	9,193,367,766口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6268円

## D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成24年2月29日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	47,270,423,015円
負債総額	2,742,849,520円
純資産総額（ - ）	44,527,573,495円
発行済数量	33,207,830,545口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3409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>

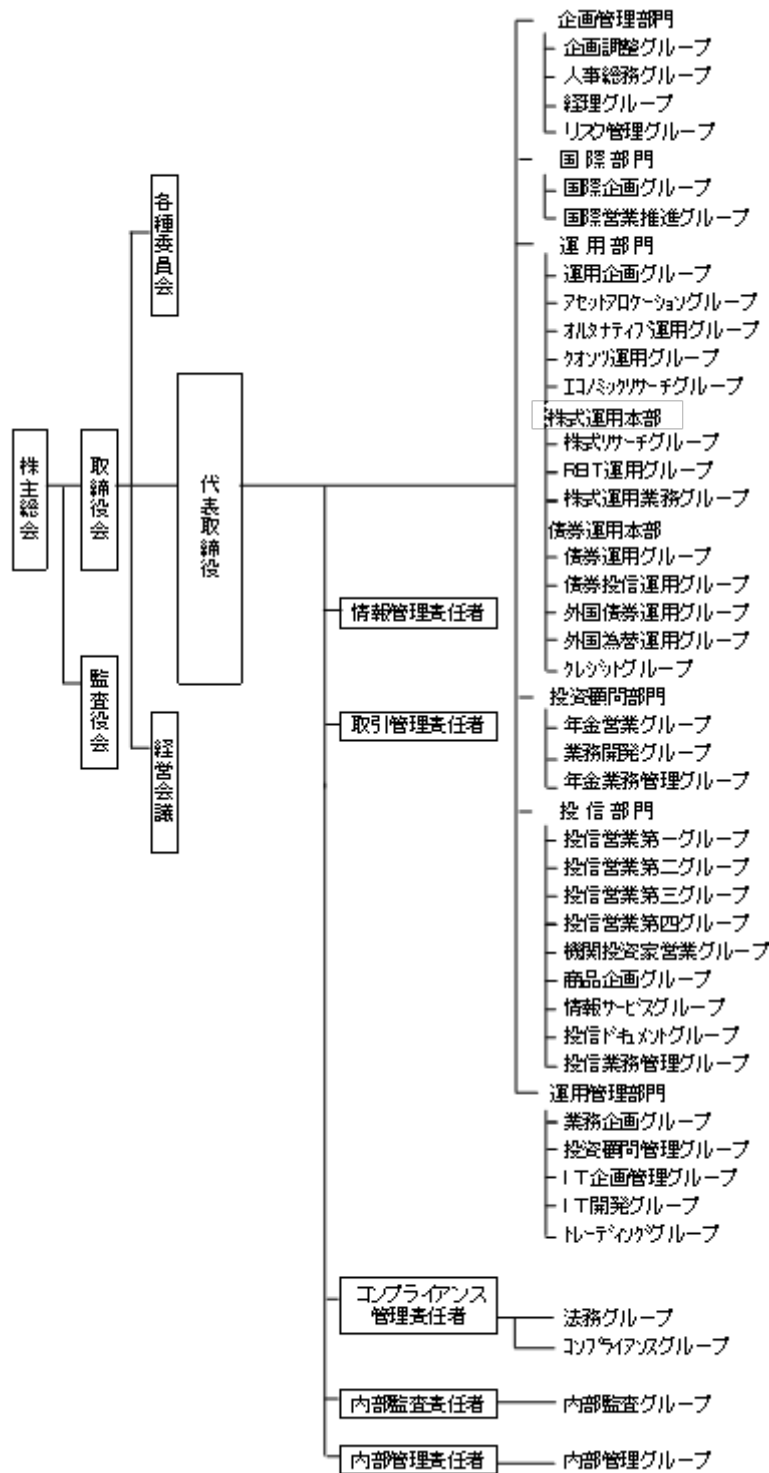
#### (1) 資本金の額

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カ年の資本金の変動

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24年4月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 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。

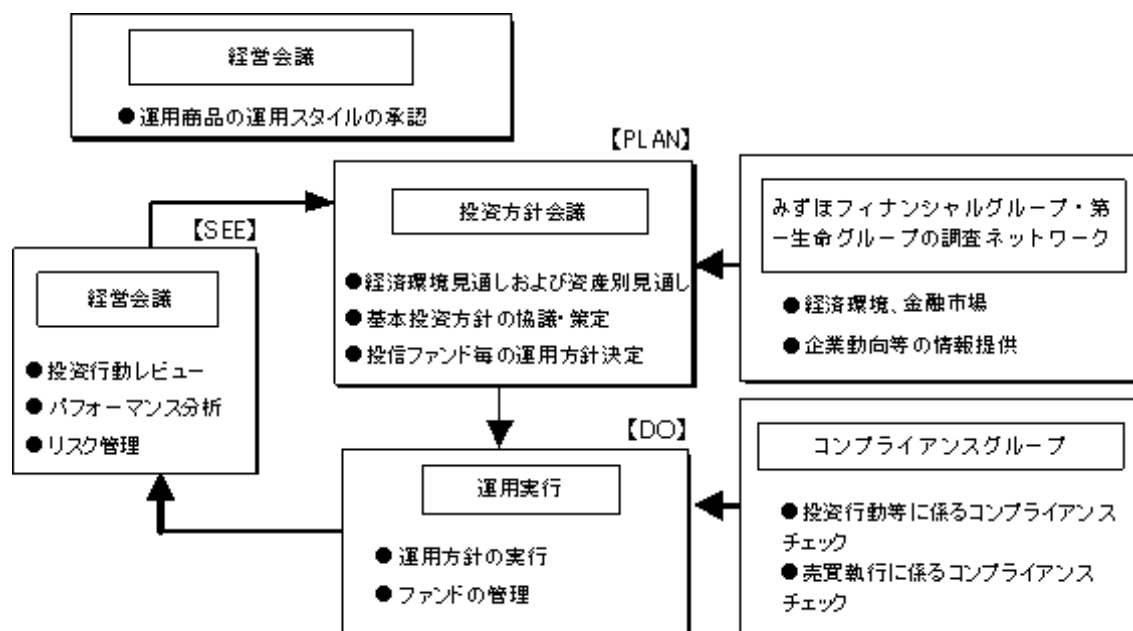
## 投資運用の意思決定機構

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24年2月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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24年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は275本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	13	25,098,443,613
追加型株式投資信託	252	4,185,613,693,844
単位型公社債投資信託	9	75,758,017,008
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	407,439,406
合計	275	4,286,877,593,871

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第27期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。



## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第25期 （平成22年3月31日現在）	第26期 （平成23年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	119,466	120,910
未払金	1,526,031	1,479,756
未払収益分配金	7,837	3,223
未払償還金	96,340	98,362
未払手数料	1,206,815	1,134,992
その他未払金	215,038	243,178
未払費用	2 1,522,325	2 1,226,658
未払法人税等	1,283,275	1,706,391
未払消費税等	113,923	143,728
賞与引当金	572,614	575,326
その他	38,231	10,000
流動負債計	5,175,867	5,262,771
固定負債		
退職給付引当金	488,790	579,063
役員退職慰労引当金	96,342	100,260
固定負債計	585,133	679,324
負債合計	5,761,000	5,942,095
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	15,737,995	18,512,674
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	11,650,000	13,430,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,464,702	4,459,380
株主資本計	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	231,525	216,534
評価・換算差額等計	231,525	216,534
純資産合計	20,397,999	23,157,686
負債・純資産合計	26,158,999	29,099,782

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

次へ



## 重要な会計方針

<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 style="text-align: center;">第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）</p>
<p>1.有価証券の評価基準及び評価方法            (1) 子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法</p> <p>(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.金銭の信託の評価基準及び評価方法            時価法</p> <p>3.デリバティブの評価基準及び評価方法            時価法</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）            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>5.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準            外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>6.引当金の計上基準            (1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(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。</p>	<p>1.有価証券の評価基準及び評価方法            (1) 子会社株式及び関連会社株式            同左</p> <p>(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及び評価方法            同左</p> <p>3.デリバティブの評価基準及び評価方法            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</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く）            同左</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）            同左</p> <p>5.外貨建の資産及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</p> <p>(2) 同左</p>

<p>(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。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準委員会平成20年7月31日 企業会計基準第19号)を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。</p> <p>(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>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。</p> <p>8. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>(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。</p> <hr/> <p>(4) 同左</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>
--	--

## 追加情報

第25期（平成22年3月31日現在）	第26期（平成23年3月31日現在）
<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）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。</p>	<hr/>



## 注記事項

(貸借対照表関係)

第25期（平成22年3月31日現在）			第26期（平成23年3月31日現在）		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物	471,484千円		建物	484,832千円	
器具備品	356,326千円		器具備品	499,620千円	
商標権	6,882千円		商標権	2,428千円	
ソフトウェア	684,370千円		ソフトウェア	809,403千円	
電話施設利用権	1,065千円		電話施設利用権	1,145千円	
2. 関係会社項目			2. 関係会社項目		
関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。			関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。		
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動資産	未収投資助言報酬	266,194千円
流動負債	未払費用	400,075千円	流動負債	未払費用	291,628千円

(損益計算書関係)

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

## （株主資本等変動計算書関係）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

平成23年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(リース取引関係)

第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)				第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)			
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額				1. リース物件の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及び期末残高相当額			
	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	46,681千円	-	46,681千円
減価償却累計額 相当額	75,063千円	-	75,063千円	減価償却累計額 相当額	46,138千円	-	46,138千円
期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円	期末残高相当額	543千円	-	543千円
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	15,764千円	586千円	16,350千円	未経過リース料 期末残高相当額	586千円	-	586千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額			
支払リース料		24,096千円		支払リース料		15,998千円	
減価償却費相当額		22,727千円		減価償却費相当額		14,995千円	
支払利息相当額		845千円		支払利息相当額		234千円	
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 オペレーティング・リース取引のうち解約不能の ものに係る未経過リース料期末残高相当額				2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能の ものに係る未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
	1,609千円	1,475千円	3,084千円		1,475千円	-	1,475千円

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

デリバティブ取引は、投資有価証券及び金銭の信託に係る為替及び市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引及び株価指数先物取引等であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。  
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

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

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## (4) 長期差入保証金

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

負債

## (1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

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

## (注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。  
デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。  
取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。  
金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。  
長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金であります。  
金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。  
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

負債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 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2,457,319千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金（貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。



## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,220,413	-	-	-
合計	12,220,413	-	-	-

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額  
該当事項はありません。

(有価証券関係)

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 4. その他有価証券

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
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

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 4. その他有価証券

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

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

（金銭の信託関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. 運用目的の金銭の信託

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

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	5,967,344	119,701

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (2) 株式関連

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

（注2）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 不動産投資信託関連

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

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

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

3. 退職給付費用に関する事項

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

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

## 3. 退職給付費用に関する事項

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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



## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	24,367,005	5,478,622	789,867	30,635,495

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## （追加情報）

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

( 関連当事者との取引 )

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

## (1)親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その 他の 関係 会社	第一生命 保険相互 会社	東京都 千代田 区	4,200億円 (基金償却 積立金)	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産の運 用及び助 言、当社 設定投信 の販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	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		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

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

## (2)子会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払手 数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払手 数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	401,000	金銭の 信託	399,833
信託報酬の 支払								130			

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## 第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1)親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産運 用の助 言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,392	未収投資 助言報酬	190,149

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	646,432	未払 費用	172,736
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	224,694	未払 費用	88,837
	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接100%	-	なし	増資の引 受	300,000	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,538,792	未払手 数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	536,163	未払手 数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収 収益	-
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	198,967	未払 費用	94,085
								業務委託料 の支払	17,740	未払 費用	21,598
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
信託報酬の 支払								3,163			

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## （1株当たり情報）

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

（注）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## （重要な後発事象）

第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
_____	_____

[次へ](#)

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

	第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	45,556
未払金	1,335,271
未払収益分配金	3,223
未払償還金	95,222
未払手数料	1,089,997
その他未払金	146,827
未払費用	1,253,226
未払法人税等	1,383,356
未払消費税等	121,733
前受収益	4,659
賞与引当金	566,648
流動負債計	4,710,452
固定負債	
退職給付引当金	616,545
役員退職慰労引当金	118,905
固定負債計	735,451
負債合計	5,445,903
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	18,252,663
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	15,630,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	1,999,370
株主資本計	22,681,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	88,650
評価・換算差額等計	88,650
純資産合計	22,769,792
負債・純資産合計	28,215,695



## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

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

[前](#) [次](#)

## 重要な会計方針

項目	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法  (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 ... 6～18年 器具備品 ... 2～20年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、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、それぞれ発生の日次会計期間から費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建ての資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

7. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 追加情報

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

## (リース取引関係)

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

## 1. ファイナンス・リース取引

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

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

重要な会計方針「4. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額

該当事項はありません。

未経過リース料中間期末残高相当額

該当事項はありません。

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料 588千円

減価償却費相当額 543千円

支払利息相当額 1千円

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
670千円	-	670千円



## （金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,268,020	11,268,020	-
(2) 金銭の信託	5,629,150	5,629,150	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	308,597	308,597	-
資産計	17,205,769	17,205,769	-
(1) 未払法人税等	1,383,356	1,383,356	-
負債計	1,383,356	1,383,356	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## （1）現金・預金

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

## （2）金銭の信託

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

## （3）投資有価証券

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

## 負 債

## （1）未払法人税等

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

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 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2,457,319千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等（中間貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## （有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券  
該当事項はありません。
2. 子会社株式及び関連会社株式  
関係会社株式(中間貸借対照表計上額2,457,319千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
3. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	298,359	146,101	152,257
債券	-	-	-
その他(投資信託)	3,118	3,000	118
小計	301,478	149,101	152,376
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	7,119	10,000	2,881
小計	7,119	10,000	2,881
合計	308,597	159,101	149,495

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

(金銭の信託関係)

第27期中間会計期間末(平成23年9月30日現在)

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

## （セグメント情報等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## （1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 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。

## （持分法損益等）

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

## （1株当たり情報）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）	
1株当たり純資産額	948,741円 34銭
1株当たり中間純利益金額	81,166円 22銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	

（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27期中間会計期間 （自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
中間純利益	1,947,989千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,947,989千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

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

[前へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成24年4月11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23年8月26日から平成24年2月27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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語30（安定型）の平成24年2月27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。

### 利害関係

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

以上

---

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

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24年4月11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 涉 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23年8月26日から平成24年2月27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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語50（安定・成長型）の平成24年2月27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。

### 利害関係

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

以上

---

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

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24年4月11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 涉 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23年8月26日から平成24年2月27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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語70（成長型）の平成24年2月27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。

### 利害関係

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

以上

---

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

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23年6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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[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23年12月9日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

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。