

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成27年11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 西 恵正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	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。

第一部【証券情報】

（１）【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）

（以上を総称して「バランス物語」、または「ファンド」、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また各々、「バランス物語30（安定型）」を「バランス物語30」、「バランス物語50（安定・成長型）」を「バランス物語50」、「バランス物語70（成長型）」を「バランス物語70」という場合もあります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。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」または「D I A M」（ダイヤモンド）といえます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（但し、便宜上1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

各ファンド間の乗換え（以下「スイッチング」といいます。）により、お申込みをする場合は、お申込日の翌営業日の基準価額とします。

（注1）販売会社によっては、スイッチングのお申込みを受付けられない場合があります。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

（注2）スイッチングとは、すでに保有している各ファンドの受益権の一部または全てを解約した際の解約代金をもって、当該解約の請求をすると同時に、当該ファンド以外のバランス物語の受益権の取得を申込みを言います。したがって、スイッチング前とスイッチング後で受益者の個別元本が変わり、スイッチング申込者の損益は一旦確定します。

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、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。

各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、ファンドの略称 バランス物語30（安定型）：パラ物語30、
バランス物語50（安定・成長型）：パラ物語50、バランス物語70（成長型）：パラ物語70）

（5）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に2.16%（税抜2.0%）を上限として各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合には、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

スイッチングによるお申込みの場合には、お申込手数料はかかりません。ただし、解約と同様の税金がかかる場合がありますのでご注意ください。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（6）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「一般コース」および「自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合およびスイッチングによるお申込みの場合には、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成27年11月26日から平成28年11月25日まで

お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・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）

(9) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとしします。

各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとしします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・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）

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、収益の分配がなされた場合に収益分配金を受領する「一般コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」があり、「自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとしします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）を行うことができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、スイッチングの可能な3本のファンドから構成され、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

各ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。

ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1

●分散投資

・主にマザーファンド[※]を通じて国内債券、国内株式、外国債券および外国株式の4つのアセット(資産)に投資します。

※DLジャパン・アクティブ・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、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インターナショナル・ボンド・オープン・マザー・ファンド

・4つのアセット(資産)の配分は、基本アロケーションを決定し、その基本アロケーションからそれぞれ±5%以内の範囲で配分比率の変動を抑えます。個々のアセット(資産)において、数多くの銘柄に分散投資することにより、より一層の分散投資効果を追求します。

・各ファンドの基本アロケーションのもと、個別資産毎にアクティブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックス^(注)をベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

(注)当社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式についてはTOPIX(東証株価指数)、国内債券についてはNOMURA-BPI 総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース)、外国債券についてはシティ世界債券インデックス(除く日本、円換算ベース)、短期金融資産についてはコール・ローン・オーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

・実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、エクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

ライフサイクル、リスク許容度、資金ニーズに応じて、3つのファンドから選択できます。

3ファンドの基本アロケーション

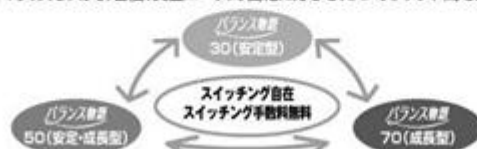
(注)運用環境見直し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。



2

●スイッチング[※]が可能です。

ライフサイクル、リスク許容度、資金ニーズの変化に応じて、3つのファンド間でスイッチングができます。



※「スイッチング」とは、すでに保有している各ファンドの一部または全てを換金した際の換金代金をもって、当該換金の請求をすると同時に、当該ファンド以外のバランス物語の取得を申込み場合をいいます。したがって、スイッチング前とスイッチング後で受益者の個別元本が変わり、スイッチング申込者の損益は一旦確定します。また、換金時と同様に、税金(課税対象の場合)がかかる場合がありますのでご注意ください。

分配方針

年2回の決算時(原則として毎年2月25日および8月25日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として経費控除後の利子、配当収入および売却益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金を決定します。

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

商品分類表

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）

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 () 資産複合

（注）各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

投資対象地域

「内外」とは目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資対象資産

「資産複合」とは目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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）

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般	年1回	グローバル (日本を含む)		
大型株	年2回			
中小型株		日本		
	年4回			
債券		北米	ファミリーファ ンド	あり ()
一般	年6回			
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
	日々			
不動産投信		中南米		なし
	その他		ファンド・オ ブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))	()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

（注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））に分類されます。

決算頻度

「年2回」とは目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。

投資対象地域

「グローバル（日本を含む）」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態

「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ

「なし」とは目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

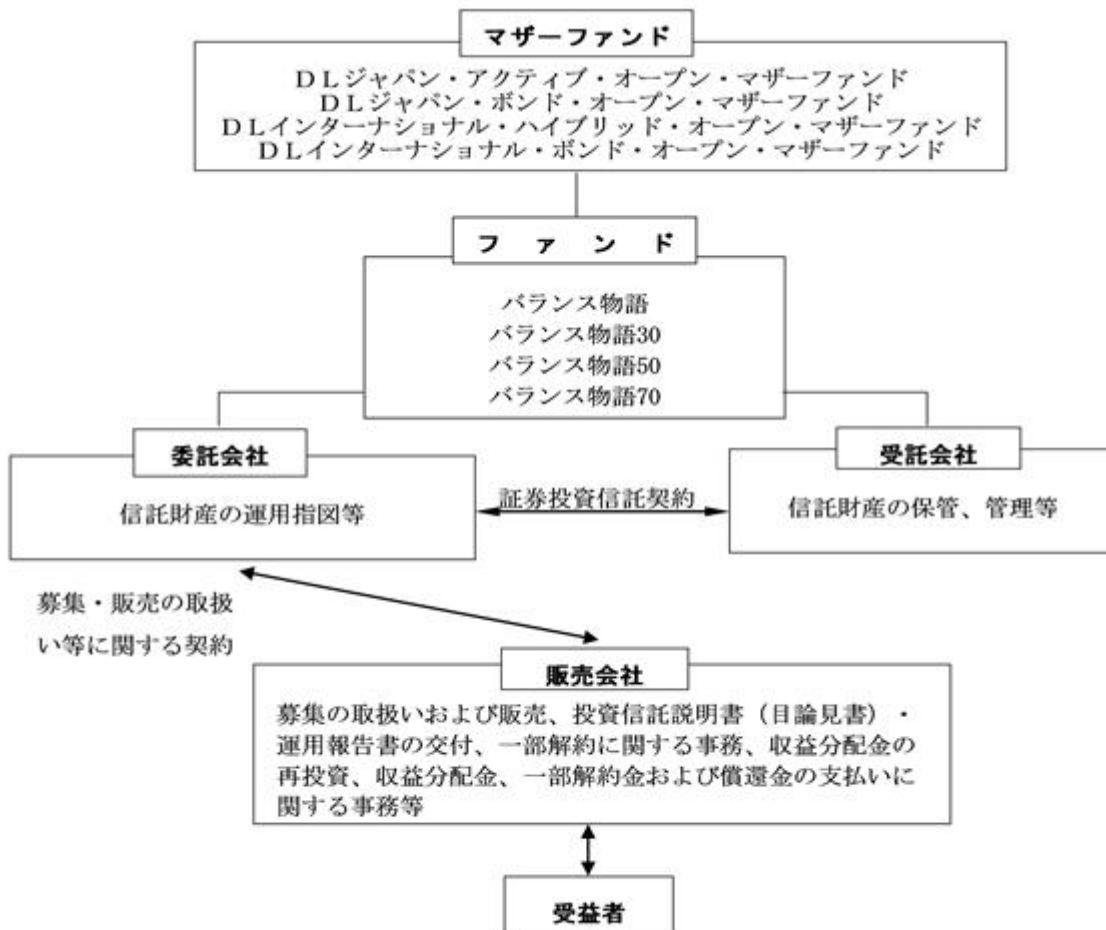
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

平成12年12月27日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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

受託会社：三菱UFJ信託銀行株式会社

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

販売会社

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

- ・「証券投資信託契約」の概要

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

ファミリーファンド方式とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成27年8月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（平成27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	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

・各ファンド

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

<投資対象>

・各ファンド

D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド受益証券、D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド受益証券、D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド受益証券およびD Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

・各ファンド

主としてD Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド受益証券、D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド受益証券、D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド受益証券およびD Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ中長期的に安定した収益の積み上げをめざします。

各資産につき、基本アロケーションにおける資産毎の比率から±5%以内の範囲で配分比率の変動を抑えます。ただし、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、エクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

・バランス物語30（安定型）

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への投資割合の上限が30%未満、かつ外貨建資産への投資割合の上限が30%未満の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックス（注）をベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

・バランス物語50（安定・成長型）

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への投資割合の上限が50%未満、かつ外貨建資産への投資割合の上限が50%未満の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックス（注）をベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

・バランス物語70（成長型）

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への投資割合の上限が70%未満、かつ外貨建資産への投資割合の上限が70%未満の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックス（注）をベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

（注）当社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式についてはTOPIX（東証株価指数）、国内債券についてはNOMURA BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース）、外国債券についてはシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

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

NOMURA - BPI総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース）は、MSCIコクサイ・インデックス（米ドルベース）をもとに委託会社が独自に円換算したものです。

MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

（２）【投資対象】

1. 有価証券の指図範囲（約款第14条第1項）

委託会社は、信託金を、主として(1)から(4)までのD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱U F J 信託銀行株式会社を受託会社として締結されたマザー信託の受益証券ならびに(5)以降の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- (1) D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド
- (2) D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド
- (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
- (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
- (5) 株券または新株引受権証券
- (6) 国債証券
- (7) 地方債証券
- (8) 特別の法律により法人の発行する債券
- (9) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- (10) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- (11) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- (12) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- (13) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- (14) コマーシャル・ペーパー
- (15) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- (16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)～(15)の証券または証書の性質を有するもの
- (17) 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
- (18) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- (19) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- (20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- (21) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- (22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- (23) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- (24) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- (25) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

(26)外国の者に対する権利で上記(25)の有価証券の性質を有するもの

なお、(5)の証券または証書、(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(5)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(6)から(10)までの証券および(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(6)から(10)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(17)の証券および(18)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

2. 金融商品の指図範囲（約款第14条第2項）

委託会社は、信託金を、上記1.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

(1)預金

(2)指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

(3)コール・ローン

(4)手形割引市場において売買される手形

(5)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(6)外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

3. 上記1.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記2.の(1)から(4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第14条第3項）

（参考）各ファンドが投資するマザーファンドの概要


ファンド名	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	日本の株式（全上場銘柄）を主要な投資対象とします。
投資態度	<p>TOPIX（東証株価指数）を中長期的に上回ることを目標に運用します。</p> <p>企業のファンダメンタルズ分析を重視したボトムアップによる銘柄選択を行うことを原則とします。</p> <p>銘柄選択はファンドマネージャーが自ら会社訪問を行い、企業の成長性と投資価値を総合的に判断し、組入銘柄を決定します。</p> <p>株式の組入比率は、原則として100%に近い状態を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>特定の銘柄や業種に対し、過度の集中がないように配慮します。</p>

<p>ポートフォリオ構築プロセス</p>	<p>1)全銘柄の中から、大型株と中小型株をセクター間の偏りを調整しつつ約600銘柄を組入候補銘柄群として選出します。</p> <p>2)株式運用本部のアナリストおよびファンドマネージャーは、1)の組入候補銘柄について、企業訪問等を中心にした積極的な調査活動により個別銘柄の調査・分析を行います。</p> <p>3)2)により得られた企業業績予測を、短期的・中長期的な視点で株価への織り込み度合い等から独自にレーティングし、バリュエーション評価を行ったうえ、組入銘柄を選出します。</p> <p>4)3)により選出された組入銘柄を、委託会社独自に細分化したサブ・セクターに分散して投資を行います。</p> <div data-bbox="427 577 1214 931" style="text-align: center;"> </div> <p>上記は、平成27年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます）への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p>

<p>ファンド名</p>	<p>D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることをめざして運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>

投資態度	<p>NOMURA - B P I 総合を中長期的に上回ることを目標に運用を行います。</p> <p>マクロ経済分析をベースとしたファンダメンタルズ分析等に基づき、金利の方向性予測、イールドカーブ戦略、セクター戦略により超過収益を積み上げることをめざします。</p>
ポートフォリオ構築プロセス	<p>1)マクロ経済分析をベースとしたファンダメンタルズ分析等に基づき、短中長期金利の方向性、イールドカーブ、セクターブレッドの予測を行います。</p> <p>2)1)により得られた分析に基づき、デュレーション戦略、イールドカーブ戦略および定性・定量分析に基づいた個別銘柄の決定を行い、ポートフォリオを構築します。</p> <p>3)委託会社独自の円債分析システム「YBAS」を活用することで、きめ細かい定量分析・リスク分析を行い、ポートフォリオを構築します。</p> <div data-bbox="343 629 1198 1043" style="text-align: center;"> <pre> graph TD A1[短中長期各局面の金利予測] --> B1[デュレーション戦略] A2[イールドカーブ形状変化予測] --> B2[イールドカーブ戦略] A3[セクターブレッド変化予測] --> B3[セクター戦略] B1 --> C([ポートフォリオ構築]) B2 --> C B3 --> C </pre> </div> <p>上記は、平成27年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p>

ファンド名	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
基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界主要先進国の株式を主要な投資対象とします。
投資態度	<p>積極的な企業調査活動を基にしたボトムアップ・アプローチと各国のマクロ経済分析等によるトップダウン・アプローチを併用することによりポートフォリオを構築します。</p> <p>M S C I コクサイ・インデックスを長期的に上回ることをめざして運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として100%に近い状態を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p>

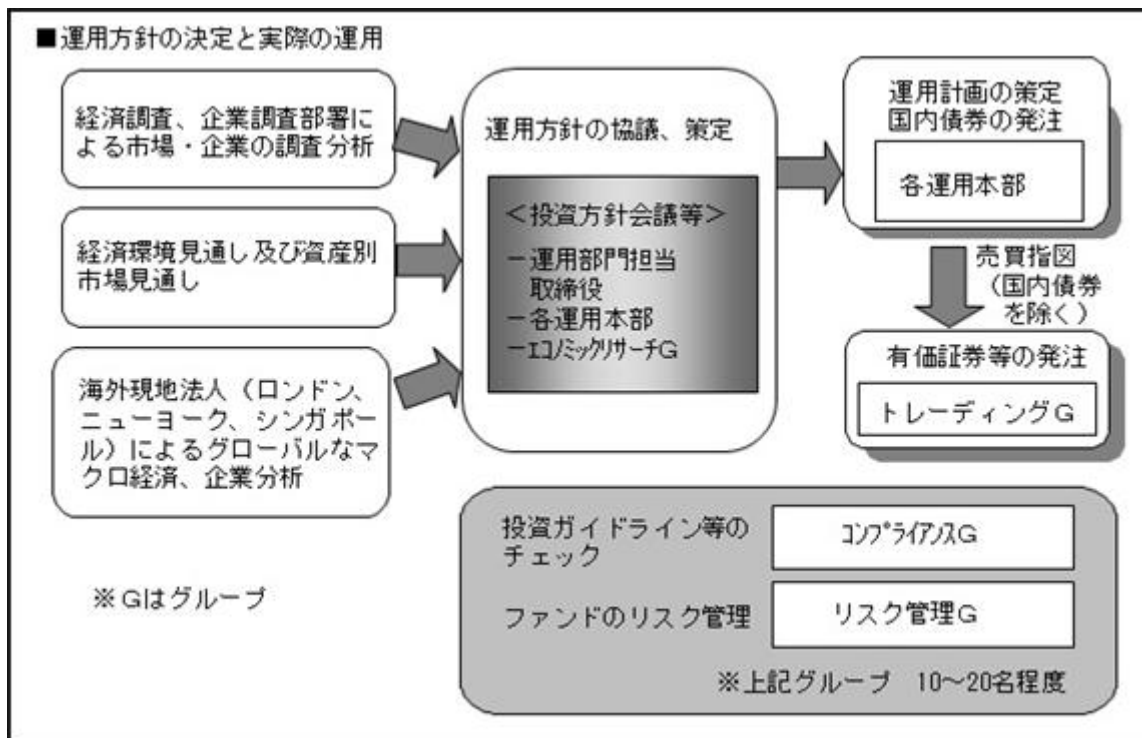
<p>ポートフォリオ構築プロセス</p>	<p>1)グローバルセクター別に調査・運用チームを編成し、ファンドマネジャーが主に直接現地へ訪問、個別企業およびマクロ経済の調査を行います。</p> <p>2)1)の調査活動を基に、ボトムアップ企業調査に基づくミクロ分析とマクロ分析を相互補完的にを行います。</p> <p>3)2)の分析を基に、当社独自のグローバルな視点からの総合的な銘柄評価手法を用い、地域配分・セクター配分を加味したうえでポートフォリオを構築します。</p>  <p>上記は、平成27年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます）への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

<p>ファンド名</p>	<p>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</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）を中長期的に上回ることを目標に運用を行います。</p> <p>委託会社が独自に開発した外債分析システム「G L O B A S」を活用して運用を行います。</p> <p>金利見通しに基づく各国市場配分に加え、各国ポートフォリオにおけるデュレーション、償還構成をコントロールすることにより超過収益を獲得することをめざします。</p> <p>為替については、金利とは独立した投資対象と考え、エクスポージャーのコントロールを行うことにより、運用効率の向上を図ります。ただし、為替エクスポージャーは原則として信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p>

<p>ポートフォリオ構築プロセス</p>	<p>1)世界主要国のファンダメンタルズ分析・テクニカル分析等に基づき、主要国の金利トレンド・イールドカーブの形状・通貨別為替相場の見通しを策定します。</p> <p>2)当社独自開発の外債分析システム「GLOBAS」を活用し、イールドカーブ分析等の定量分析を行います。</p> <p>3)「GLOBAS」等を活用し、為替・金利見通しに基づく市場配分・通貨配分戦略、デュレーション・償還構成戦略より、ポートフォリオ属性を決定・構築します。</p> <div data-bbox="357 389 1307 779" style="text-align: center;"> </div> <p>上記は、平成27年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



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

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

国内債券の発注は、債券運用本部で執行されます。それ以外の個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

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

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成27年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。

(4) 【配分方針】

収益配分方針

毎決算時（原則として2月25日および8月25日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含む）等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の配分方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査報酬及び当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬及び当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、その効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（5）【投資制限】

「バランス物語30（安定型）」

(1) 株式への実質投資割合（運用の基本方針 2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%未満とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合（運用の基本方針 2.運用方法（3）投資制限）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%未満とします。

「バランス物語50（安定・成長型）」

(1) 株式への実質投資割合（運用の基本方針 2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合（運用の基本方針 2.運用方法（3）投資制限）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。

「バランス物語70（成長型）」

(1)株式への実質投資割合（運用の基本方針 2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

(2)外貨建資産への実質投資割合（運用の基本方針 2.運用方法（3）投資制限）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

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（運用の基本方針 2.運用方法（3）投資制限）

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。

(4)新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（運用の基本方針 2.運用方法（3）投資制限）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の15%以下とします。

(5)投資する株式等の範囲（約款第16条）

(a)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

(b)上記(a)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

(6)同一銘柄の株式への実質投資制限（約款第17条第1項および第3項）

(a)委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(7)同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資制限（約款第17条第2項および第3項）

(a)委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(8)同一銘柄の転換社債等への実質投資制限（約款第18条）

(a)委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(9)信用取引の指図範囲（約款第19条）

(a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(b)上記(a)の信用取引の指図は、次の1)～6)に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1)～6)に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1)信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2)株式分割により取得する株券

3)有償増資により取得する株券

4)売出しにより取得する株券

5)信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6)信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(10)先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第20条）

(a)委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。))。

1)先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2)先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託

財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。）を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象 2．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象 2．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象 2．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

3)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本項で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(b)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。

(c)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。

1)先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象 2．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

2)先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象 2．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入

可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

- 3)コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(11)スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

- (a)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (b)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- (f)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(12)金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第22条)

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品

の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(e)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(f)上記(e)においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(g)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(h)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(13)デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第22条の2）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

(14)有価証券の貸付の指図および範囲（約款第23条）

(a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1)株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価総額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2)公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(b)上記(a)1)2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(c)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入の指図を行うものとします。

(15)公社債の空売りの指図範囲（約款第24条）

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。
- (b)上記(a)の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c)信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとしします。

(16)公社債の借入れ（約款第25条）

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとしします。
- (b)上記(a)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c)信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとしします。
- (d)上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

(17)特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第27条）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(18)外国為替予約の指図（約款第28条）

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (b)上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとしします。
- (c)上記(b)においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (d)上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとしします。

(19)資金の借入れ（約款第35条）

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みま

す。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(b)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

(c)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(d)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(20)同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律 第9条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

(1)基準価額の主な変動要因

各ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き、為替変動等により影響を受けますが、運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

資産配分リスク

各資産(国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産)の資産配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、±5%以内の変動に抑えます。

この資産配分が各ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、各ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

国別配分リスク

各ファンドでは、組入れられる資産の国別配分が、当該資産のベンチマークを構成する国別構成比率と若干異なる場合があります。

この国別配分が、各ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、各ファンドの投資対象国のうち一部の国における証券市場全体の市場価値が下落する場合には、各ファンドの各資産の国別配分が各ベンチマークの国別比率と同等あるいは優れたものであったとしても、各ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

株式投資リスク

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

1) 価格変動リスク

株式の価格は、一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により、各ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

2) 信用リスク

各ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

債券投資リスク

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

1) 金利リスク

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

2) 信用リスク

各ファンドが実質的に投資する債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

為替リスク

各ファンドでは実質的に外貨建資産を保有します。外貨建資産に投資する場合には、一般に為替リスクがあります。

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、各ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがって、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。各ファンドでは、為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としており、また為替リスクのエクスポージャーを積極的にコントロールする場合がありますため、円と投資対象国通貨の為替レートの変化が各ファンドの資産価値に影響します。

カントリーリスク

実質的な投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合または新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下がる要因となる場合があります。

(2)分配金に関する留意点

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

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

(3)その他の留意点

各ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

各ファンドはベンチマークを採用しておりますが、ベンチマークは市場の構造変化等の影響により今後見直す場合があります。また、各ファンドの運用成果は、ベンチマークを上回ることも下回ることもあり、ベンチマークに対して一定の運用成果をあげることを保証するものではありません。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度に従った運用ができない場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

注記事項

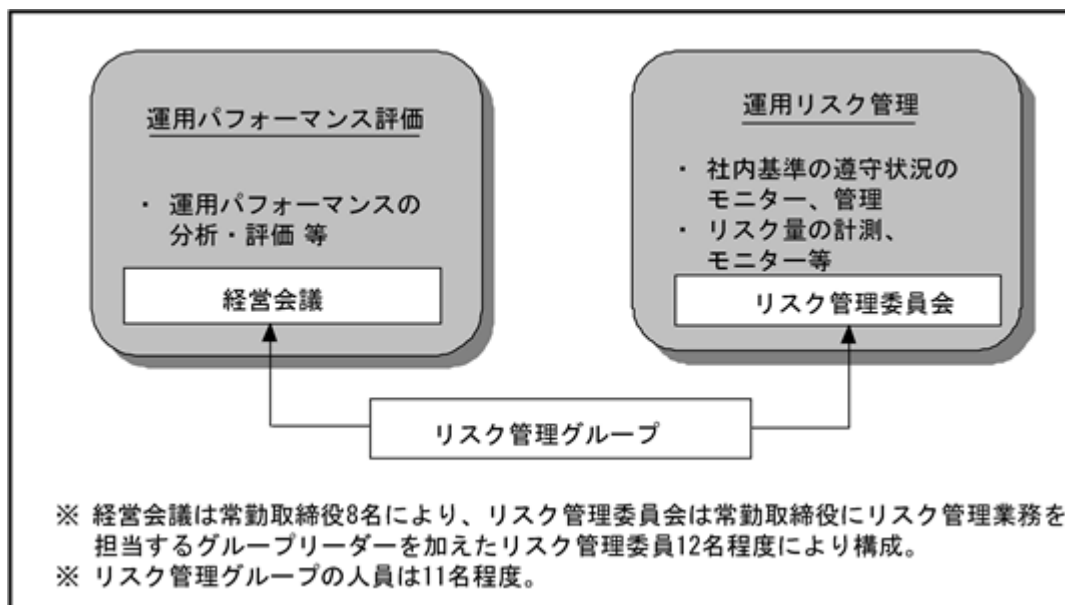
イ.各ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

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。

二.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>



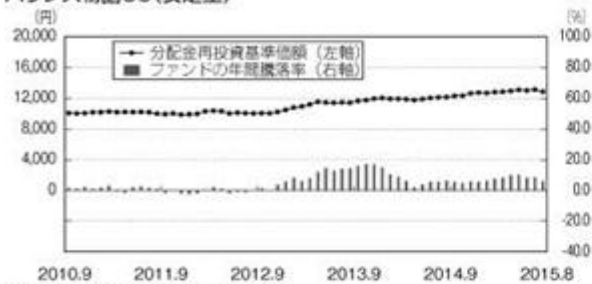
運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

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

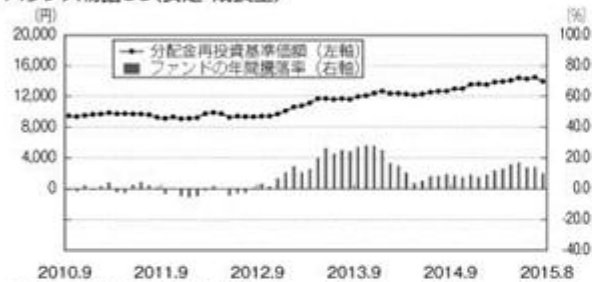
上記体制は平成27年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）**ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移**

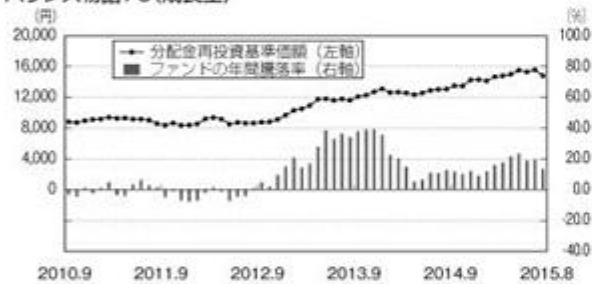
バランス物語30(安定型)



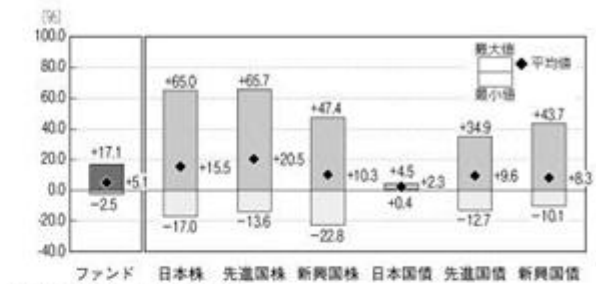
バランス物語50(安定・成長型)



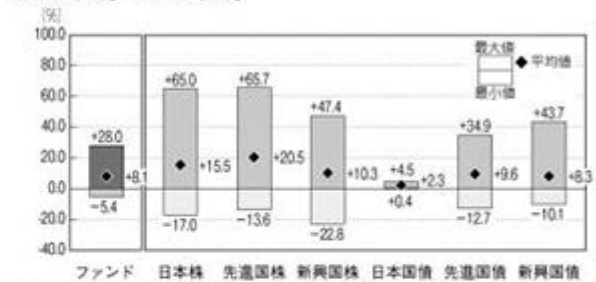
バランス物語70(成長型)



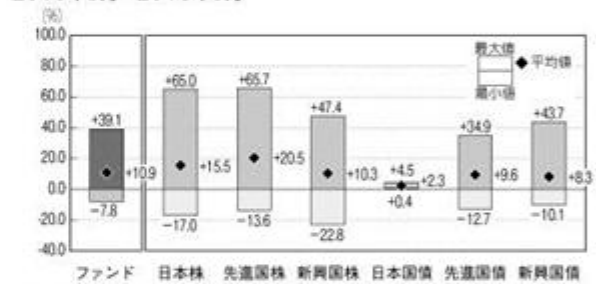
- *ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

**ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較**

2010年9月～2015年8月



2010年9月～2015年8月



2010年9月～2015年8月

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

***各資産クラスの指数**

- 日本株…東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
 日本国債…NOMURA-BPI国債
 先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)
 (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

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

●「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

●「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込み時に、お申込日の翌営業日の基準価額に2.16%（税抜2.0%）を上限として各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合には、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

スイッチングによるお申込みの場合には、お申込手数料はかかりません。ただし、解約と同様の税金がかかる場合がありますのでご注意ください。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.62%（税抜1.50%）

信託報酬の配分（税抜）		主な役務
委託会社	年率0.75%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.65%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.10%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間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。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

信託財産留保額

ありません。

その他の費用

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

- 1) 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 2) 監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

- 3) 有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 4) マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に各ファンドで負担することになります。税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

(5) 【課税上の取扱い】

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

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、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%）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。

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

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、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%）の税率での申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、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%）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。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等が追加される予定です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円（平成28年1月1日以降、年間120万円）の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、平成28年4月1日より、未成年者口座内の少額上場株式等に係る配当所得及び譲渡所得等の非課税措置（ジュニアNISA）が開始され、20歳未満の居住者などを

対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成27年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

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】

(1)【投資状況】

バランス物語30（安定型）

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	3,467,980,763	97.90
内 日本	3,467,980,763	97.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	74,346,170	2.10
純資産総額	3,542,326,933	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

バランス物語50（安定・成長型）

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	1,553,759,382	97.72
内 日本	1,553,759,382	97.72
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	36,333,018	2.28
純資産総額	1,590,092,400	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

バランス物語70（成長型）

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	885,481,397	97.78
内 日本	885,481,397	97.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	20,089,658	2.22
純資産総額	905,571,055	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	23,067,072,910	98.68
内 日本	23,067,072,910	98.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	308,420,563	1.32
純資産総額	23,375,493,473	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	14,962,005,430	44.99
内 日本	14,962,005,430	44.99
社債券	17,391,022,180	52.29
内 日本	16,483,672,180	49.56
内 アメリカ	403,140,000	1.21
内 韓国	301,248,000	0.91
内 フランス	202,962,000	0.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	906,165,079	2.72
純資産総額	33,259,192,689	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	9,512,347,894	98.48
内 アメリカ	6,109,539,692	63.25
内 イギリス	841,774,281	8.71
内 フランス	505,542,987	5.23
内 ドイツ	417,460,439	4.32
内 スイス	337,052,020	3.49
内 アイルランド	259,135,677	2.68
内 オランダ	253,381,068	2.62
内 カナダ	236,275,363	2.45
内 イタリア	144,385,309	1.49
内 ベルギー	86,416,545	0.89
内 スペイン	55,367,938	0.57
内 オーストラリア	47,227,809	0.49
内 デンマーク	36,091,407	0.37
内 香港	34,069,081	0.35
内 ケイマン諸島	33,536,852	0.35
内 バミューダ	31,555,264	0.33
内 シンガポール	30,574,288	0.32
内 ジャージー	18,856,565	0.20
内 リベリア	18,553,358	0.19
内 スウェーデン	15,551,951	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	147,163,525	1.52
純資産総額	9,659,511,419	100.00

その他資産の投資状況

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	52,103,100	0.54
-	52,103,100	0.54
為替予約取引（売建）	36,888,960	0.38
-	36,888,960	0.38

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	10,992,760,042	94.00
内 アメリカ	4,325,083,734	36.98
内 イタリア	1,231,415,586	10.53
内 フランス	1,170,336,577	10.01
内 ドイツ	1,163,009,816	9.95
内 イギリス	1,010,435,900	8.64
内 スペイン	754,957,318	6.46
内 ベルギー	286,372,556	2.45
内 カナダ	243,032,360	2.08
内 オーストリア	214,130,683	1.83
内 オーストラリア	176,561,973	1.51
内 メキシコ	112,835,891	0.96
内 アイルランド	98,313,281	0.84
内 南アフリカ	57,810,753	0.49
内 スウェーデン	53,210,347	0.46
内 マレーシア	51,982,440	0.44
内 シンガポール	43,270,827	0.37
特殊債券	526,496,805	4.50
内 国際機関	390,078,420	3.34
内 ドイツ	136,418,385	1.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	174,916,532	1.50
純資産総額	11,694,173,379	100.00

その他資産の投資状況

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	1,142,395,910	9.77
-	1,142,395,910	9.77
為替予約取引（売建）	968,526,891	8.28
-	968,526,891	8.28

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

バランス物語30（安定型）

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,614,451,783	1.4667 2,368,077,875	1.4662 2,367,109,204	- -	66.82%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	295,460,604	2.0296 599,685,288	2.1881 646,497,347	- -	18.25%
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 日本	親投資信託受益証券	115,654,936	2.4803 286,870,503	2.4653 285,124,113	- -	8.05%
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 日本	親投資信託受益証券	71,437,658	2.2237 158,863,063	2.3692 169,250,099	- -	4.78%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.90%
合計	97.90%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

バランス物語50（安定・成長型）

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	484,375,470	1.4667 710,481,939	1.4662 710,191,314	- -	44.66%
2	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	211,060,859	2.0291 428,270,679	2.1881 461,822,265	- -	29.04%
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 日本	親投資信託受益証券	79,745,919	2.4803 197,801,777	2.4653 196,597,614	- -	12.36%
4	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	78,147,978	2.2237 173,785,473	2.3692 185,148,189	- -	11.64%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.72%
合計	97.72%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

バランス物語 70（成長型）

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	165,232,262	2.0310 335,595,233	2.1881 361,544,712	- -	39.92%
2	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	140,131,639	1.4667 205,545,088	1.4662 205,461,009	- -	22.69%
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 日本	親投資信託受益証券	71,000,081	2.2237 157,889,980	2.3692 168,213,391	- -	18.58%
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 日本	親投資信託受益証券	60,950,913	2.4803 151,182,644	2.4653 150,262,285	- -	16.59%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.78%
合計	97.78%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	167,400	8,277.76 1,385,698,400	7,192.00 1,203,940,800	- -	5.15%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,355,100	797.09 1,080,137,100	800.10 1,084,215,510	- -	4.64%
3	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	159,600	4,859.16 775,522,500	4,964.00 792,254,400	- -	3.39%
4	KDDI 日本	株式 情報・通信業	218,000	2,740.00 597,320,000	3,018.00 657,924,000	- -	2.81%
5	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	145,400	4,149.99 603,408,695	4,270.50 620,930,700	- -	2.66%
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	86,700	7,135.92 618,684,368	7,063.00 612,362,100	- -	2.62%

7	三井不動産 日本	株式 不動産業	178,000	3,516.02 625,852,500	3,360.00 598,080,000	- -	2.56%
8	日本電産 日本	株式 電気機器	62,800	7,698.00 483,435,000	9,506.00 596,976,800	- -	2.55%
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	106,100	3,688.11 391,309,250	4,629.50 491,189,950	- -	2.10%
10	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	96,000	4,477.75 429,864,000	4,876.00 468,096,000	- -	2.00%
11	エムスリー 日本	株式 サービス業	163,700	2,616.35 428,298,000	2,812.00 460,324,400	- -	1.97%
12	ウエルシアホールディングス 日本	株式 小売業	77,800	4,460.00 346,988,000	5,820.00 452,796,000	- -	1.94%
13	アルプス電気 日本	株式 電気機器	117,300	3,227.77 378,618,461	3,805.00 446,326,500	- -	1.91%
14	塩野義製薬 日本	株式 医薬品	90,400	3,888.93 351,560,000	4,760.00 430,304,000	- -	1.84%
15	日東電工 日本	株式 化学	52,100	8,562.31 446,096,380	8,172.00 425,761,200	- -	1.82%
16	ニトリホールディングス 日本	株式 小売業	37,200	8,209.41 305,390,200	9,650.00 358,980,000	- -	1.54%
17	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	66,700	4,941.94 329,627,600	5,290.00 352,843,000	- -	1.51%
18	オリックス 日本	株式 その他金融業	212,300	1,773.54 376,522,600	1,634.00 346,898,200	- -	1.48%
19	H O Y A 日本	株式 精密機器	71,400	5,107.50 364,676,200	4,749.50 339,114,300	- -	1.45%
20	エイチ・ツー・オー リテイリング 日本	株式 小売業	140,100	2,245.62 314,612,100	2,418.00 338,761,800	- -	1.45%
21	日本M & Aセンター 日本	株式 サービス業	66,900	3,836.24 256,645,000	4,950.00 331,155,000	- -	1.42%
22	S C S K 日本	株式 情報・通信業	74,700	3,304.93 246,878,500	4,385.00 327,559,500	- -	1.40%
23	クボタ 日本	株式 機械	170,000	1,975.60 335,853,000	1,898.50 322,745,000	- -	1.38%
24	村田製作所 日本	株式 電気機器	18,000	16,307.20 293,529,600	17,550.00 315,900,000	- -	1.35%
25	三菱商事 日本	株式 卸売業	134,100	2,456.73 329,447,673	2,255.00 302,395,500	- -	1.29%
26	新日鉄住金ソリューションズ 日本	株式 情報・通信業	64,100	3,565.39 228,541,500	4,695.00 300,949,500	- -	1.29%
27	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	68,600	3,773.18 258,840,749	4,329.50 297,003,700	- -	1.27%
28	住友大阪セメント 日本	株式 ガラス・土石製品	623,000	357.00 222,411,000	471.00 293,433,000	- -	1.26%
29	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	14,600	23,410.00 341,786,000	19,885.00 290,321,000	- -	1.24%
30	カシオ計算機 日本	株式 電気機器	122,000	2,229.14 271,956,000	2,334.00 284,748,000	- -	1.22%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
株式	98.68%
合計	98.68%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.91%
情報・通信業		13.80%
輸送用機器		9.08%
銀行業		8.89%
小売業		8.07%
化学		5.76%
医薬品		5.22%
サービス業		5.01%
食料品		3.21%
不動産業		3.11%
卸売業		3.09%
精密機器		2.86%
ガラス・土石製品		2.81%
陸運業		2.68%
機械		2.55%
保険業		2.00%
建設業		1.70%
その他金融業		1.48%
鉄鋼		1.23%
ゴム製品		1.14%
金属製品	1.07%	
合計		98.68%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	33回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証券	1,626,000,000	113.01 1,837,542,600	114.30 1,858,631,820	2.000000 2040/9/20	5.59%
2	130回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	1,090,000,000	113.12 1,233,084,300	114.14 1,244,136,900	1.800000 2031/9/20	3.74%
3	145回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	996,000,000	110.28 1,098,478,440	111.41 1,109,713,320	1.700000 2033/6/20	3.34%
4	140回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	843,000,000	110.82 934,237,890	111.99 944,075,700	1.700000 2032/9/20	2.84%
5	327回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	902,000,000	103.90 937,218,120	104.50 942,626,080	0.800000 2022/12/20	2.83%
6	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	900,000,000	100.59 905,333,000	100.60 905,481,000	0.200000 2018/12/20	2.72%
7	44回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証券	746,000,000	105.72 788,737,300	106.96 797,981,280	1.700000 2044/9/20	2.40%
8	32回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	700,000,000	102.33 716,310,000	102.03 714,259,000	3.700000 2016/3/21	2.15%
9	117回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	557,000,000	118.07 657,688,890	118.79 661,688,150	2.100000 2030/3/20	1.99%
10	316回 北海道電力社債 日本	社債券	630,000,000	103.44 651,697,200	103.49 651,987,000	1.164000 2020/6/25	1.96%
11	131回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	564,000,000	111.61 629,510,820	112.64 635,289,600	1.700000 2031/9/20	1.91%
12	10回 西日本シティ銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	600,000,000	101.24 607,476,000	101.43 608,604,000	0.870000 2025/12/16	1.83%
13	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	568,000,000	99.48 565,095,000	100.23 569,340,480	0.400000 2025/6/20	1.71%
14	495回 関西電力社債 日本	社債券	560,000,000	100.63 563,578,400	101.09 566,109,600	0.746000 2021/9/17	1.70%
15	1回 あいおいニッセイ同和損害保険劣後社債 日本	社債券	500,000,000	107.63 538,180,000	107.94 539,720,000	1.809000 2022/9/27	1.62%
16	8回 ジャックス社債 日本	社債券	500,000,000	103.09 515,455,000	103.10 515,545,000	1.130000 2020/6/19	1.55%

17	335回 利付国庫債券（2年） 日本	国債証券	500,000,000	100.04 500,200,000	100.02 500,140,000	0.100000 2015/12/15	1.50%
18	329回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	450,000,000	103.93 467,716,500	104.44 470,007,000	0.800000 2023/6/20	1.41%
19	117回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	420,000,000	100.55 422,310,000	100.63 422,675,400	0.200000 2019/3/20	1.27%
20	21回 トピー工業社債 日本	社債券	400,000,000	103.73 414,924,000	103.81 415,244,000	1.260000 2020/6/5	1.25%
21	28回 双日社債 日本	社債券	400,000,000	102.57 410,284,000	102.78 411,152,000	1.230000 2020/10/16	1.24%
22	12回 森ビル社債 日本	社債券	400,000,000	101.81 407,240,000	101.88 407,556,000	0.800000 2020/11/5	1.23%
23	2回 あいおいニッセイ同和損害保険期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	400,000,000	101.76 407,056,000	101.62 406,516,000	1.270000 2022/9/27	1.22%
24	9回 モルガン・スタンレー円貨債 アメリカ	社債券	400,000,000	100.67 402,684,000	100.78 403,140,000	0.557000 2018/5/22	1.21%
25	93回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	400,000,000	100.15 400,620,000	100.14 400,596,000	0.500000 2015/12/20	1.20%
26	1回 三井住友フィナンシャルG実質破綻時免除特約付劣後社債 日本	社債券	400,000,000	100.60 402,412,000	100.07 400,316,000	0.849000 2024/9/12	1.20%
27	146回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	327,000,000	110.07 359,928,900	111.21 363,663,240	1.700000 2033/9/20	1.09%
28	76回 伊藤忠商事社債 日本	社債券	320,000,000	100.69 322,227,200	100.86 322,761,600	0.560000 2021/1/29	0.97%
29	473回 東北電力社債 日本	社債券	310,000,000	100.75 312,346,700	100.97 313,031,800	0.597000 2021/4/23	0.94%
30	17回 東京建物社債 日本	社債券	300,000,000	103.81 311,433,000	103.75 311,250,000	1.300000 2020/3/18	0.94%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	44.99%
社債券	52.29%
合計	97.28%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	15,790	14,976.63 236,481,085	13,728.48 216,772,733	- -	2.24%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	16,235	9,969.73 161,858,631	9,096.98 147,689,512	- -	1.53%
3	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェア・サービス	1,799	69,099.10 124,309,297	79,941.23 143,814,280	- -	1.49%
4	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	9,570	14,075.13 134,699,039	14,241.07 136,287,074	- -	1.41%
5	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	18,301	6,754.26 123,609,855	6,487.97 118,736,470	- -	1.23%
6	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	21,238	5,160.63 109,601,538	5,323.43 113,059,163	- -	1.17%
7	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	10,895	9,478.61 103,269,556	8,951.83 97,530,231	- -	1.01%
8	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	11,208	7,487.15 83,916,077	7,771.27 87,100,432	- -	0.90%
9	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェア・サービス	7,710	9,794.16 75,512,999	11,028.59 85,030,442	- -	0.88%
10	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	26,343	3,743.17 98,606,463	3,189.10 84,010,650	- -	0.87%
11	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	40,955	2,035.32 83,356,914	1,982.50 81,193,484	- -	0.84%
12	HAIN CELESTIAL GROUP INC アメリカ	株式 食品	10,395	7,799.34 81,074,200	7,536.18 78,338,634	- -	0.81%
13	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	6,527	12,266.15 80,061,219	11,893.69 77,630,127	- -	0.80%

14	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	6,676	12,022.26 80,260,659	11,532.70 76,992,309	- -	0.80%
15	INTESA SANPAOLO イタリア	株式 商業銀行	169,425	423.34 71,725,980	441.37 74,780,576	- -	0.77%
16	WHITEWAVE FOODS CO アメリカ	株式 食品	13,158	5,194.19 68,345,229	5,670.01 74,606,020	- -	0.77%
17	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	11,321	6,668.67 75,496,094	6,456.47 73,093,701	- -	0.76%
18	ALLERGAN PLC アイルランド	株式 医薬品	1,852	36,389.28 67,392,956	37,324.65 69,125,255	- -	0.72%
19	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・カタ ログ販売	1,100	44,906.88 49,397,572	62,772.45 69,049,696	- -	0.71%
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	17,239	4,120.11 71,026,748	3,957.73 68,227,459	- -	0.71%
21	MONSTER BEVERAGE CORP アメリカ	株式 飲料	3,992	16,417.46 65,538,525	17,017.30 67,933,091	- -	0.70%
22	ING GROEP NV-CVA オランダ	株式 商業銀行	36,525	1,875.12 68,489,114	1,859.25 67,909,467	- -	0.70%
23	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	7,585	8,105.68 61,481,602	8,780.70 66,601,630	- -	0.69%
24	PINNACLE WEST CAPITAL CORP アメリカ	株式 電力	8,931	7,516.09 67,126,208	7,328.96 65,454,998	- -	0.68%
25	AXA フランス	株式 保険	20,762	3,215.84 66,767,432	3,060.66 63,545,624	- -	0.66%
26	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC アメリカ	株式 食品・生活必 需品小売り	5,943	10,592.81 62,953,126	10,593.55 62,957,500	- -	0.65%
27	MONDELEZ INTERNATIONAL INC アメリカ	株式 食品	12,046	5,081.89 61,216,551	5,186.50 62,476,627	- -	0.65%
28	STROEER SE ドイツ	株式 メディア	8,749	4,776.46 41,789,332	6,887.35 60,257,488	- -	0.62%
29	CIGNA CORP アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	3,577	15,696.95 56,148,013	16,707.08 59,761,248	- -	0.62%
30	CVS HEALTH CORP アメリカ	株式 食品・生活必 需品小売り	4,690	12,526.77 58,750,585	12,624.53 59,209,056	- -	0.61%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
株式	98.48%
合計	98.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品	外国	9.07%
商業銀行		8.68%
食品		5.70%
石油・ガス・消耗燃料		5.38%
メディア		4.27%
保険		4.16%
バイオテクノロジー		3.60%
ソフトウェア		3.50%
専門小売り		3.18%
インターネットソフトウェア・サービス		3.17%
飲料		3.13%
食品・生活必需品小売り		3.01%
航空宇宙・防衛		2.91%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.77%
ホテル・レストラン・レジャー		2.45%
コンピュータ・周辺機器		2.44%
情報技術サービス		2.36%
タバコ		2.34%
各種電気通信サービス		2.26%
ヘルスケア機器・用品		2.19%
通信機器		1.85%
化学		1.58%
各種金融サービス		1.38%
電力		1.30%
インターネット販売・カタログ販売		1.28%
半導体・半導体製造装置		1.23%
資本市場		1.18%
家庭用耐久財		1.13%
繊維・アパレル・贅沢品		1.12%
コングロマリット		1.09%
水道		0.60%
ガス		0.59%
無線通信サービス		0.58%
建設・土木		0.57%
複合小売り		0.56%
消費者金融		0.55%
総合公益事業		0.54%
金属・鉱業		0.52%
陸運・鉄道		0.47%
パーソナル用品		0.43%

機械	0.42%
電子装置・機器・部品	0.38%
商業サービス・用品	0.35%
建設関連製品	0.34%
自動車	0.31%
容器・包装	0.31%
旅客航空輸送業	0.28%
電気設備	0.28%
レジャー用品	0.27%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.20%
不動産管理・開発	0.19%
合計	98.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	575,605,000	100.93 580,998,418	101.03 581,585,535	1.500000 2018/12/31	4.97%
2	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	484,720,000	100.75 488,389,330	100.82 488,694,704	1.375000 2018/9/30	4.18%
3	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	478,661,000	100.88 482,912,694	101.63 486,491,893	1.875000 2020/6/30	4.16%
4	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	465,331,200	101.69 473,234,239	101.81 473,800,227	2.375000 2024/8/15	4.05%
5	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 ドイツ	国債証券	466,685,800	98.92 461,665,049	98.50 459,685,513	0.500000 2025/2/15	3.93%
6	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20 ドイツ	国債証券	368,722,600	114.20 421,118,081	114.36 421,689,601	3.000000 2020/7/4	3.61%
7	SPAIN 2.1 04/30/17 スペイン	国債証券	408,180,000	103.96 424,360,255	103.27 421,543,813	2.100000 2017/4/30	3.60%
8	US T N/B 1.875 09/30/17 アメリカ	国債証券	412,012,000	102.55 422,518,306	102.23 421,232,828	1.875000 2017/9/30	3.60%
9	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	402,317,600	98.78 397,410,112	99.09 398,684,672	1.750000 2022/5/15	3.41%
10	ITALY BTPS 4.5 02/01/20 イタリア	国債証券	340,150,000	117.25 398,845,603	116.00 394,574,000	4.500000 2020/2/1	3.37%
11	EIB 5.125 05/30/17 国際機関	特殊債券	363,540,000	108.50 394,440,900	107.30 390,078,420	5.125000 2017/5/30	3.34%
12	ITALY BTPS 2.5 12/01/24 イタリア	国債証券	353,756,000	105.61 373,619,399	105.11 371,850,619	2.500000 2024/12/1	3.18%
13	US T N/B 3.125 02/15/42 アメリカ	国債証券	290,832,000	102.64 298,533,231	104.55 304,076,489	3.125000 2042/2/15	2.60%
14	FRANCE OAT 3.25 10/25/21 フランス	国債証券	217,696,000	118.12 257,159,930	116.90 254,504,039	3.250000 2021/10/25	2.18%
15	BELGIUM 4.0 03/28/22 ベルギー	国債証券	190,484,000	123.58 235,403,800	122.81 233,935,305	4.000000 2022/3/28	2.00%
16	FRANCE OAT 4.0 10/25/38 フランス	国債証券	163,272,000	148.12 241,843,384	139.85 228,347,321	4.000000 2038/10/25	1.95%

17	FRANCE OAT 1.0 05/25/19 フランス	国債証券	217,696,000	103.37 225,036,709	103.40 225,119,433	1.000000 2019/5/25	1.93%
18	ITALY BTPS 2.75 11/15/16 イタリア	国債証券	204,090,000	103.97 212,202,577	103.21 210,645,370	2.750000 2016/11/15	1.80%
19	UK TREASURY 4.75 12/07/30 イギリス	国債証券	158,848,000	131.98 209,653,009	132.06 209,790,553	4.750000 2030/12/7	1.79%
20	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	187,829,000	105.06 197,336,903	105.29 197,776,423	2.750000 2023/11/15	1.69%
21	ITALY BTPS 3.75 09/01/24 イタリア	国債証券	156,469,000	116.36 182,071,750	115.47 180,679,448	3.750000 2024/9/1	1.55%
22	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	169,652,000	102.60 174,064,648	102.87 174,529,495	2.250000 2021/3/31	1.49%
23	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	169,652,000	99.83 169,380,291	98.35 166,868,010	2.000000 2025/8/15	1.43%
24	UK TREASURY 4.75 12/07/38 イギリス	国債証券	112,128,000	139.03 155,902,771	139.46 156,384,921	4.750000 2038/12/7	1.34%
25	UK TREASURY 1.75 07/22/19 イギリス	国債証券	145,766,400	102.12 148,859,563	102.23 149,022,821	1.750000 2019/7/22	1.27%
26	UK TREASURY 3.25 01/22/44 イギリス	国債証券	130,816,000	112.58 147,285,734	113.80 148,868,608	3.250000 2044/1/22	1.27%
27	FRANCE OAT 3.75 04/25/21 フランス	国債証券	122,454,000	120.24 147,241,138	118.92 145,634,542	3.750000 2021/4/25	1.25%
28	US T N/B 3.0 11/15/44 アメリカ	国債証券	138,145,200	100.87 139,347,385	101.48 140,195,274	3.000000 2044/11/15	1.20%
29	CANADA 8.0 06/01/23 カナダ	国債証券	92,505,900	148.53 137,400,515	150.40 139,135,349	8.000000 2023/6/1	1.19%
30	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23 オーストラリア	国債証券	115,111,500	120.39 138,585,097	120.65 138,883,175	5.500000 2023/4/21	1.19%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	94.00%
特殊債券	4.50%
合計	98.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

バランス物語30（安定型）

該当事項はありません。

バランス物語50（安定・成長型）

該当事項はありません。

バランス物語70（成長型）

該当事項はありません。

（参考）

D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

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

該当事項はありません。

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27年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2015年09月	買建	430,000	52,083,750	52,103,100	0.54%
		イギリス・ポンド売/ 円買2015年09月	売建	168,000	31,360,106	31,394,160	0.33%
		カナダ・ドル売/円買 2015年09月	売建	60,000	5,509,200	5,494,800	0.06%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

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27年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売2015年10月	買建	4,910,000	671,866,494	667,956,400	5.71%
		アメリカ・ドル買/円売2015年10月	買建	870,000	106,444,620	105,357,000	0.90%
		ユーロ買/円売2015年09月	買建	770,997	105,868,957	104,894,185	0.90%
		ポーランド・ズロチ買/円売2015年10月	買建	2,153,296	70,557,000	69,185,413	0.59%
		マレーシア・リングgit買/円売2015年09月	買建	1,791,970	51,541,549	51,752,106	0.44%
		アメリカ・ドル買/円売2015年09月	買建	324,770	38,784,798	39,352,429	0.34%
		イギリス・ポンド買/円売2015年09月	買建	202,053	37,840,903	37,757,677	0.32%
		スイス・フラン買/円売2015年10月	買建	270,000	34,704,180	34,101,000	0.29%
		ノルウェー・クローネ買/円売2015年10月	買建	2,190,000	32,595,960	32,039,700	0.27%
		アメリカ・ドル売/円買2015年10月	売建	3,517,847	420,969,704	426,011,295	3.64%
		イギリス・ポンド売/円買2015年10月	売建	1,900,000	368,011,120	354,749,000	3.03%
		オーストラリア・ドル売/円買2015年10月	売建	1,260,000	113,806,980	108,763,200	0.93%
		アメリカ・ドル売/円買2015年09月	売建	416,233	50,384,631	50,434,996	0.43%
		ユーロ売/円買2015年10月	売建	210,000	28,831,257	28,568,400	0.24%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

（ 3 ） 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成27年8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 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）(円)	1口当たりの 純資産額 （分配付）(円)
第10計算期間末 （平成18年2月27日）	22,170	22,294	1.0708	1.0768
第11計算期間末 （平成18年8月25日）	20,592	20,708	1.0622	1.0682
第12計算期間末 （平成19年2月26日）	18,857	18,960	1.0994	1.1054
第13計算期間末 （平成19年8月27日）	16,750	16,844	1.0697	1.0757
第14計算期間末 （平成20年2月25日）	15,184	15,272	1.0295	1.0355
第15計算期間末 （平成20年8月25日）	13,906	13,961	1.0035	1.0075
第16計算期間末 （平成21年2月25日）	11,428	11,441	0.8588	0.8598
第17計算期間末 （平成21年8月25日）	10,889	10,901	0.9380	0.9390
第18計算期間末 （平成22年2月25日）	10,074	10,084	0.9354	0.9364
第19計算期間末 （平成22年8月25日）	8,832	8,841	0.9315	0.9325
第20計算期間末 （平成23年2月25日）	7,211	7,218	0.9601	0.9611
第21計算期間末 （平成23年8月25日）	6,340	6,347	0.9270	0.9280
第22計算期間末 （平成24年2月27日）	5,980	5,986	0.9614	0.9624
第23計算期間末 （平成24年8月27日）	5,280	5,286	0.9404	0.9414
第24計算期間末 （平成25年2月25日）	5,010	5,015	1.0201	1.0211
第25計算期間末 （平成25年8月26日）	4,567	4,571	1.0685	1.0695
第26計算期間末 （平成26年2月25日）	3,912	3,916	1.1143	1.1153
第27計算期間末 （平成26年8月25日）	3,737	3,740	1.1292	1.1302
第28計算期間末 （平成27年2月25日）	3,712	3,715	1.1872	1.1882
第29計算期間末 （平成27年8月25日）	3,488	3,491	1.1755	1.1765

平成26年8月末日	3,729	-	1.1280	-
9月末日	3,752	-	1.1440	-
10月末日	3,746	-	1.1456	-
11月末日	3,786	-	1.1751	-
12月末日	3,747	-	1.1824	-
平成27年1月末日	3,699	-	1.1772	-
2月末日	3,718	-	1.1897	-
3月末日	3,682	-	1.1936	-
4月末日	3,684	-	1.2029	-
5月末日	3,695	-	1.2166	-
6月末日	3,644	-	1.2093	-
7月末日	3,653	-	1.2196	-
8月末日	3,542	-	1.1935	-

バランス物語 50 (安定・成長型)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第10計算期間末 (平成18年2月27日)	9,054	9,110	1.1230	1.1300
第11計算期間末 (平成18年8月25日)	9,314	9,372	1.1172	1.1242
第12計算期間末 (平成19年2月26日)	9,012	9,065	1.1880	1.1950
第13計算期間末 (平成19年8月27日)	7,870	7,918	1.1381	1.1451
第14計算期間末 (平成20年2月25日)	6,850	6,895	1.0631	1.0701
第15計算期間末 (平成20年8月25日)	6,362	6,393	1.0226	1.0276
第16計算期間末 (平成21年2月25日)	4,723	4,735	0.7845	0.7865
第17計算期間末 (平成21年8月25日)	5,027	5,038	0.8965	0.8985
第18計算期間末 (平成22年2月25日)	4,809	4,820	0.8820	0.8840
第19計算期間末 (平成22年8月25日)	4,115	4,125	0.8526	0.8546
第20計算期間末 (平成23年2月25日)	3,636	3,644	0.9085	0.9105
第21計算期間末 (平成23年8月25日)	3,049	3,056	0.8443	0.8463
第22計算期間末 (平成24年2月27日)	2,986	2,993	0.8972	0.8992
第23計算期間末 (平成24年8月27日)	2,631	2,637	0.8663	0.8683
第24計算期間末 (平成25年2月25日)	2,595	2,601	0.9926	0.9946

第25計算期間末 (平成25年8月26日)	2,333	2,338	1.0718	1.0738
第26計算期間末 (平成26年2月25日)	1,899	1,903	1.1386	1.1406
第27計算期間末 (平成26年8月25日)	1,763	1,767	1.1589	1.1609
第28計算期間末 (平成27年2月25日)	1,731	1,734	1.2540	1.2560
第29計算期間末 (平成27年8月25日)	1,546	1,548	1.2318	1.2338
平成26年8月末日	1,749	-	1.1564	-
9月末日	1,750	-	1.1839	-
10月末日	1,740	-	1.1837	-
11月末日	1,759	-	1.2341	-
12月末日	1,750	-	1.2405	-
平成27年1月末日	1,718	-	1.2308	-
2月末日	1,740	-	1.2592	-
3月末日	1,707	-	1.2663	-
4月末日	1,696	-	1.2805	-
5月末日	1,690	-	1.3106	-
6月末日	1,654	-	1.2977	-
7月末日	1,664	-	1.3155	-
8月末日	1,590	-	1.2660	-

バランス物語 70 (成長型)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第10計算期間末 (平成18年2月27日)	4,753	4,786	1.1689	1.1769
第11計算期間末 (平成18年8月25日)	4,749	4,782	1.1655	1.1735
第12計算期間末 (平成19年2月26日)	4,844	4,875	1.2714	1.2794
第13計算期間末 (平成19年8月27日)	4,392	4,421	1.1990	1.2070
第14計算期間末 (平成20年2月25日)	3,802	3,830	1.0882	1.0962
第15計算期間末 (平成20年8月25日)	3,542	3,562	1.0347	1.0407
第16計算期間末 (平成21年2月25日)	2,496	2,506	0.7158	0.7188
第17計算期間末 (平成21年8月25日)	2,887	2,897	0.8525	0.8555
第18計算期間末 (平成22年2月25日)	2,753	2,763	0.8267	0.8297
第19計算期間末 (平成22年8月25日)	2,485	2,495	0.7747	0.7777

第20計算期間末 (平成23年2月25日)	2,330	2,338	0.8523	0.8553
第21計算期間末 (平成23年8月25日)	1,995	2,003	0.7644	0.7674
第22計算期間末 (平成24年2月27日)	2,038	2,045	0.8309	0.8339
第23計算期間末 (平成24年8月27日)	1,834	1,841	0.7908	0.7938
第24計算期間末 (平成25年2月25日)	1,971	1,977	0.9512	0.9542
第25計算期間末 (平成25年8月26日)	1,245	1,248	1.0559	1.0589
第26計算期間末 (平成26年2月25日)	1,033	1,036	1.1418	1.1448
第27計算期間末 (平成26年8月25日)	979	982	1.1670	1.1700
第28計算期間末 (平成27年2月25日)	975	978	1.2958	1.2988
第29計算期間末 (平成27年8月25日)	868	870	1.2614	1.2644
平成26年8月末日	978	-	1.1634	-
9月末日	966	-	1.2015	-
10月末日	960	-	1.1995	-
11月末日	995	-	1.2681	-
12月末日	977	-	1.2730	-
平成27年1月末日	953	-	1.2593	-
2月末日	981	-	1.3036	-
3月末日	952	-	1.3140	-
4月末日	950	-	1.3320	-
5月末日	977	-	1.3780	-
6月末日	953	-	1.3596	-
7月末日	964	-	1.3847	-
8月末日	905	-	1.3122	-

【分配の推移】

バランス物語30（安定型）

	1口当たりの分配金(円)
第10計算期間	0.0060
第11計算期間	0.0060
第12計算期間	0.0060
第13計算期間	0.0060
第14計算期間	0.0060
第15計算期間	0.0040
第16計算期間	0.0010
第17計算期間	0.0010
第18計算期間	0.0010
第19計算期間	0.0010
第20計算期間	0.0010
第21計算期間	0.0010
第22計算期間	0.0010
第23計算期間	0.0010
第24計算期間	0.0010
第25計算期間	0.0010
第26計算期間	0.0010
第27計算期間	0.0010
第28計算期間	0.0010
第29計算期間	0.0010

バランス物語 5 0（安定・成長型）

	1口当たりの分配金(円)
第10計算期間	0.0070
第11計算期間	0.0070
第12計算期間	0.0070
第13計算期間	0.0070
第14計算期間	0.0070
第15計算期間	0.0050
第16計算期間	0.0020
第17計算期間	0.0020
第18計算期間	0.0020
第19計算期間	0.0020
第20計算期間	0.0020
第21計算期間	0.0020
第22計算期間	0.0020
第23計算期間	0.0020
第24計算期間	0.0020
第25計算期間	0.0020
第26計算期間	0.0020
第27計算期間	0.0020
第28計算期間	0.0020
第29計算期間	0.0020

バランス物語 70（成長型）

	1口当たりの分配金(円)
第10計算期間	0.0080
第11計算期間	0.0080
第12計算期間	0.0080
第13計算期間	0.0080
第14計算期間	0.0080
第15計算期間	0.0060
第16計算期間	0.0030
第17計算期間	0.0030
第18計算期間	0.0030
第19計算期間	0.0030
第20計算期間	0.0030
第21計算期間	0.0030
第22計算期間	0.0030
第23計算期間	0.0030
第24計算期間	0.0030
第25計算期間	0.0030
第26計算期間	0.0030
第27計算期間	0.0030
第28計算期間	0.0030
第29計算期間	0.0030

【収益率の推移】

バランス物語30（安定型）

	収益率(%)
第10計算期間	6.3
第11計算期間	0.2
第12計算期間	4.1
第13計算期間	2.2
第14計算期間	3.2
第15計算期間	2.1
第16計算期間	14.3
第17計算期間	9.3
第18計算期間	0.2
第19計算期間	0.3
第20計算期間	3.2
第21計算期間	3.3
第22計算期間	3.8
第23計算期間	2.1
第24計算期間	8.6
第25計算期間	4.8
第26計算期間	4.4
第27計算期間	1.4
第28計算期間	5.2
第29計算期間	0.9

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

バランス物語50（安定・成長型）

	収益率(%)
第10計算期間	11.7
第11計算期間	0.1
第12計算期間	7.0
第13計算期間	3.6
第14計算期間	6.0
第15計算期間	3.3
第16計算期間	23.1
第17計算期間	14.5
第18計算期間	1.4
第19計算期間	3.1
第20計算期間	6.8
第21計算期間	6.8
第22計算期間	6.5
第23計算期間	3.2
第24計算期間	14.8
第25計算期間	8.2
第26計算期間	6.4
第27計算期間	2.0
第28計算期間	8.4
第29計算期間	1.6

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

バランス物語 70（成長型）

	収益率(%)
第10計算期間	17.1
第11計算期間	0.4
第12計算期間	9.8
第13計算期間	5.1
第14計算期間	8.6
第15計算期間	4.4
第16計算期間	30.5
第17計算期間	19.5
第18計算期間	2.7
第19計算期間	5.9
第20計算期間	10.4
第21計算期間	10.0
第22計算期間	9.1
第23計算期間	4.5
第24計算期間	20.7
第25計算期間	11.3
第26計算期間	8.4
第27計算期間	2.5
第28計算期間	11.3
第29計算期間	2.4

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（４）【設定及び解約の実績】

バランス物語 30（安定型）

	設定口数	解約口数
第10計算期間	644,216,372	5,260,340,384
第11計算期間	738,045,702	2,057,461,774
第12計算期間	279,381,369	2,512,700,038
第13計算期間	155,935,941	1,648,789,107
第14計算期間	142,082,604	1,052,615,028
第15計算期間	138,415,414	1,030,107,291
第16計算期間	231,258,044	781,488,777
第17計算期間	70,069,607	1,766,755,361
第18計算期間	60,516,732	900,614,199
第19計算期間	60,131,552	1,349,162,006
第20計算期間	38,549,347	2,008,857,995
第21計算期間	28,937,127	700,046,673
第22計算期間	27,420,253	646,314,385
第23計算期間	25,984,817	631,414,837
第24計算期間	20,892,800	724,245,387
第25計算期間	18,759,515	656,132,537
第26計算期間	28,695,833	792,024,838
第27計算期間	10,729,914	212,639,183
第28計算期間	11,580,908	194,166,543
第29計算期間	12,247,243	171,546,907

（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10計算期間	851,740,445	1,377,642,526
第11計算期間	971,313,753	696,726,325
第12計算期間	172,072,707	922,846,422
第13計算期間	113,906,019	784,590,427
第14計算期間	95,691,183	567,728,975
第15計算期間	107,427,913	328,740,738
第16計算期間	94,289,964	294,957,841
第17計算期間	109,618,982	522,721,252
第18計算期間	81,961,999	236,943,277
第19計算期間	62,517,775	688,403,720
第20計算期間	42,464,037	866,831,805
第21計算期間	34,627,815	426,048,103
第22計算期間	31,971,253	314,338,852
第23計算期間	25,870,800	317,812,501
第24計算期間	23,083,720	445,107,452
第25計算期間	19,890,013	457,524,002
第26計算期間	15,171,242	524,354,069
第27計算期間	11,540,118	157,905,728
第28計算期間	15,056,325	156,245,612
第29計算期間	11,523,560	137,015,957

（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10計算期間	653,691,053	625,361,209
第11計算期間	375,837,525	367,115,061
第12計算期間	173,524,207	438,344,538
第13計算期間	149,589,640	296,962,322
第14計算期間	90,562,299	259,584,258
第15計算期間	78,749,603	149,229,368
第16計算期間	137,057,880	73,171,732
第17計算期間	78,670,303	179,724,398
第18計算期間	59,084,628	114,373,354
第19計算期間	46,077,702	168,297,278
第20計算期間	30,671,736	505,121,198
第21計算期間	24,455,175	148,410,519
第22計算期間	25,225,172	182,736,740
第23計算期間	22,061,855	154,634,692
第24計算期間	20,138,195	267,939,921
第25計算期間	14,067,699	907,462,285
第26計算期間	10,878,686	284,917,088
第27計算期間	9,733,403	75,617,076
第28計算期間	9,372,021	95,660,034
第29計算期間	9,502,794	74,312,020

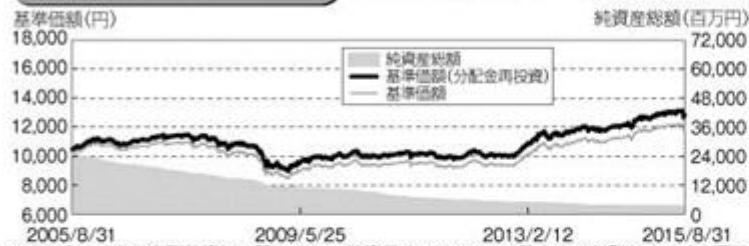
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日：2015年8月31日

バランス物語30(安定型)

基準価額・純資産の推移 (2005年8月31日～2015年8月31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	66.82%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	18.25%
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	8.05%
4	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	4.78%

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

年間収益率の推移

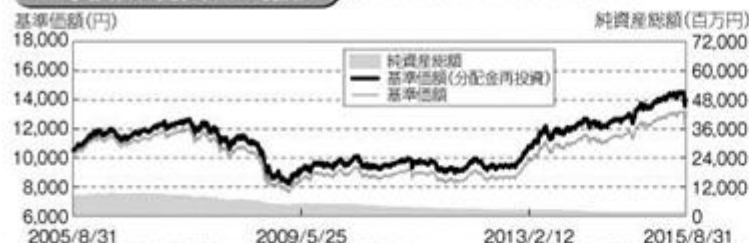


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

バランス物語50(安定・成長型)

基準価額・純資産の推移 (2005年8月31日～2015年8月31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

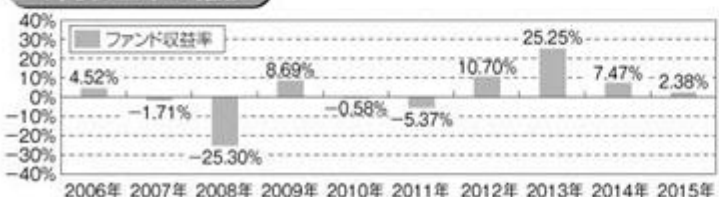
(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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	44.66%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	29.04%
3	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	12.36%
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	11.64%

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

分配の推移(税引前)

第25期	(2013.08.26)	10円
第26期	(2014.02.25)	10円
第27期	(2014.08.25)	10円
第28期	(2015.02.25)	10円
第29期	(2015.08.25)	10円
設定来累計		745円

(注)分配金は1万口当たりです。

分配の推移(税引前)

第25期	(2013.08.26)	20円
第26期	(2014.02.25)	20円
第27期	(2014.08.25)	20円
第28期	(2015.02.25)	20円
第29期	(2015.08.25)	20円
設定来累計		995円

(注)分配金は1万口当たりです。

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

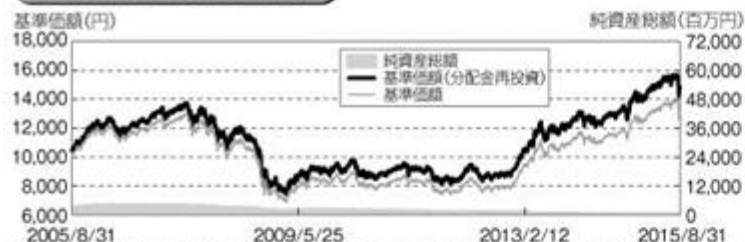
○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日: 2015年8月31日

バランス物語70(成長型)

基準価額・純資産の推移

(2005年8月31日～2015年8月31日)



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

分配の推移(税引前)

第25期	(2013.08.26)	30円
第26期	(2014.02.25)	30円
第27期	(2014.08.25)	30円
第28期	(2015.02.25)	30円
第29期	(2015.08.25)	30円
設定来累計		1,210円

(注) 分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注) 投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	39.92%
2	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	22.69%
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	18.58%
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	16.59%

※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、2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.68
内 日本	98.68
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.32
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	5.15%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	4.64%
3	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	3.39%
4	KDDI	株式	日本	情報・通信業	2.81%
5	富士重工業	株式	日本	輸送用機器	2.66%
6	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.62%
7	三井不動産	株式	日本	不動産業	2.56%
8	日本電産	株式	日本	電気機器	2.55%
9	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	2.10%
10	東京海上ホールディングス	株式	日本	保険業	2.00%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	13.91%
2	情報・通信業	13.80%
3	輸送用機器	9.08%
4	銀行業	8.89%
5	小売業	8.07%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日: 2015年8月31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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	44.99
内 日本	44.99
社債券	52.29
内 日本	49.56
内 アメリカ	1.21
内 韓国	0.91
内 フランス	0.61
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.72
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	33回 利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	2.000000	2040/9/20	5.59%
2	130回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.800000	2031/9/20	3.74%
3	145回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.700000	2033/6/20	3.34%
4	140回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.700000	2032/9/20	2.84%
5	327回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2022/12/20	2.83%
6	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	2.72%
7	44回 利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	1.700000	2044/9/20	2.40%
8	32回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	3.700000	2016/3/21	2.15%
9	117回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2.100000	2030/3/20	1.99%
10	316回 北海道電力社債	社債券	日本	1.164000	2020/6/25	1.96%

■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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.48
内 アメリカ	63.25
内 イギリス	8.71
内 フランス	5.23
内 ドイツ	4.32
内 スイス	3.49
内 その他	13.48
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.52
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	2.24%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.53%
3	GOOGLE INC-CL A	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	1.49%
4	HOME DEPOT INC	株式	アメリカ	専門小売り	1.41%
5	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	1.23%
6	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.17%
7	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	1.01%
8	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.90%
9	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	0.88%
10	ROYAL DUTCH-SHELL PLC-B SHS	株式	イギリス	石油・ガス・消耗燃料	0.87%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.54
為替予約取引(売建)	△0.38

組入上位5業種(外国株式)

	業種	投資比率
1	医薬品	9.07%
2	商業銀行	8.68%
3	食品	5.70%
4	石油・ガス・消耗燃料	5.38%
5	メディア	4.27%

■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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	94.00
内 アメリカ	36.98
内 イタリア	10.53
内 フランス	10.01
内 ドイツ	9.95
内 イギリス	8.64
内 その他	17.89
特殊債券	4.50
内 国際機関	3.34
内 ドイツ	1.17
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.50
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	アメリカ	1.500000	2018/12/31	4.97%
2	US T N/B 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	4.18%
3	US T N/B 1.875 06/30/20	国債証券	アメリカ	1.875000	2020/6/30	4.16%
4	US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	アメリカ	2.375000	2024/8/15	4.05%
5	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	ドイツ	0.500000	2025/2/15	3.93%
6	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	ドイツ	3.000000	2020/7/4	3.61%
7	SPAIN 2.1 04/30/17	国債証券	スペイン	2.100000	2017/4/30	3.60%
8	US T N/B 1.875 09/30/17	国債証券	アメリカ	1.875000	2017/9/30	3.60%
9	US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	アメリカ	1.750000	2022/5/15	3.41%
10	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	国債証券	イタリア	4.500000	2020/2/1	3.37%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	9.77
為替予約取引(売建)	△8.28

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、収益の分配がなされた場合に収益分配金を受領する「一般コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」があり、「自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」に従って分配金再投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせ下さい。

ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の中止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

- ・お申込価額（発行価格）は、お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（但し、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

スイッチングによりお申込みをする場合の取得価額は、お申込日の翌営業日の基準価額とします。

- ・基準価額は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。

各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）

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「一般コース」および「自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合およびスイッチングによるお申込みの場合には、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・お申込手数料は、お申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合には、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

スイッチングによるお申込みの場合には、お申込手数料はかかりません。ただし、解約と同様の税金がかかる場合がありますのでご注意ください。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、各販売会社が定める単位をもって解約の請求をすることができます。

受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の中止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。
- ・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ・解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。
- ・解約価額の照会方法等
解約価額は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。
各ファンドの解約価額は、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）

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

各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）

(2)【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は平成12年12月27日から原則として無期限です。ただし、下記（５）イ．の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年2月26日から8月25日まで、8月26日から翌年2月25日とします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

イ．償還規定

- a. 委託会社は、各ファンドにつき、信託契約を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 上記d. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は、上記d. の規定により、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a. からe. の規定に従い信託約款を変更します。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。
- h. 上記b. に該当しない場合の約款変更のお知らせは「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。（URL <http://www.diam.co.jp/>）

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年2月25日、8月25日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
 - ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。
- （URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金受領権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

また、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

なお、「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金を販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3)一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口

数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

受益証券をお手許で保有されている方は、解約のお申込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

バランス物語30（安定型）

（1）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、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29期計算期間（平成27年2月26日から平成27年8月25日まで）の財務諸表について、P w C 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28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	126,376,869	121,973,273
親投資信託受益証券	3,622,837,741	3,403,496,729
流動資産合計	3,749,214,610	3,525,470,002
資産合計	3,749,214,610	3,525,470,002
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,126,860	2,967,561
未払解約金	3,451,565	4,715,002
未払受託者報酬	2,030,152	1,964,839
未払委託者報酬	28,422,855	27,508,282
その他未払費用	96,349	93,247
流動負債合計	37,127,781	37,248,931
負債合計	37,127,781	37,248,931
純資産の部		
元本等		
元本	1,312,860,699	1,296,756,035
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	585,226,130	520,660,036
（分配準備積立金）	599,254,898	563,483,304
元本等合計	3,712,086,829	3,488,221,071
純資産合計	3,712,086,829	3,488,221,071
負債純資産合計	3,749,214,610	3,525,470,002

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第28期		第29期	
	自	平成26年8月26日 平成27年2月25日	自	平成27年2月26日 平成27年8月25日
営業収益				
受取利息		22,830		21,318
有価証券売買等損益		220,955,551		658,988
営業収益合計		220,978,381		680,306
営業費用				
受託者報酬		2,030,152		1,964,839
委託者報酬		28,422,855		27,508,282
その他費用		96,349		93,247
営業費用合計		30,549,356		29,566,368
営業利益又は営業損失（ ）		190,429,025		28,886,062
経常利益又は経常損失（ ）		190,429,025		28,886,062
当期純利益又は当期純損失（ ）		190,429,025		28,886,062
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（ ）		6,466,737		3,081,636
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		427,733,017		585,226,130
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,758,463		2,479,701
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,758,463		2,479,701
剰余金減少額又は欠損金増加額		25,100,778		32,110,536
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		25,100,778		32,110,536
分配金		1 3,126,860		1 2,967,561
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		585,226,130		520,660,036

（ 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。
---------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

項目	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
1 . 1 期首元本額	3,309,446,334円	3,126,860,699円
期中追加設定元本額	11,580,908円	12,247,243円
期中一部解約元本額	194,166,543円	171,546,907円
2 . 受益権の総数	3,126,860,699口	2,967,561,035口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第28期 自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	第29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（20,558,649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（163,403,639円）、信託約款に規定される収益調整金（37,076,919円）及び分配準備積立金（418,419,470円）より分配対象収益は639,458,677円（1万口当たり2,045.05円）であり、うち3,126,860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。	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（37,475,303円）及び分配準備積立金（566,450,865円）より分配対象収益は603,926,168円（1万口当たり2,035.09円）であり、うち2,967,561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。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第28期 自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	第29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	198,791,797	13,066,313
合計	198,791,797	13,066,313

（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28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1872円 (11,872円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年8月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	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	290,786,177	589,685,288	
	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザ ーファンド	1,614,451,783	2,368,077,875	
	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	71,437,658	158,863,063	
	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	115,654,936	286,870,503	
親投資信託受益証券 合計		2,092,330,554	3,403,496,729	
合計		2,092,330,554	3,403,496,729	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

バランス物語 5 0 (安定・成長型)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、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29期計算期間(平成27年2月26日から平成27年8月25日まで)の財務諸表について、P w C あらた監査法人による監査を受けております。

【バランス物語50（安定・成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	66,210,847	58,750,991
親投資信託受益証券	1,685,314,126	1,505,339,868
流動資産合計	1,751,524,973	1,564,090,859
資産合計	1,751,524,973	1,564,090,859
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,761,748	2,510,763
未払解約金	2,899,402	1,651,600
未払受託者報酬	944,630	903,994
未払委託者報酬	13,225,364	12,656,570
その他未払費用	44,784	42,852
流動負債合計	19,875,928	17,765,779
負債合計	19,875,928	17,765,779
純資産の部		
元本等		
元本	1,380,874,045	1,255,381,648
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	350,775,000	290,943,432
（分配準備積立金）	353,865,302	316,402,823
元本等合計	1,731,649,045	1,546,325,080
純資産合計	1,731,649,045	1,546,325,080
負債純資産合計	1,751,524,973	1,564,090,859

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第28期		第29期	
	自	平成26年8月26日 平成27年2月25日	自	平成27年2月26日 平成27年8月25日
営業収益				
受取利息		10,449		10,421
有価証券売買等損益		154,315,327		7,974,258
営業収益合計		154,325,776		7,963,837
営業費用				
受託者報酬		944,630		903,994
委託者報酬		13,225,364		12,656,570
その他費用		44,784		42,852
営業費用合計		14,214,778		13,603,416
営業利益又は営業損失（ ）		140,110,998		21,567,253
経常利益又は経常損失（ ）		140,110,998		21,567,253
当期純利益又は当期純損失（ ）		140,110,998		21,567,253
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（ ）		6,761,903		4,221,734
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		241,918,285		350,775,000
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,118,859		3,286,193
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,118,859		3,286,193
剰余金減少額又は欠損金増加額		24,849,491		34,818,011
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		24,849,491		34,818,011
分配金		1 2,761,748		1 2,510,763
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		350,775,000		290,943,432

(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。
---------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
1 . 1 期首元本額	1,522,063,332円	1,380,874,045円
期中追加設定元本額	15,056,325円	11,523,560円
期中一部解約元本額	156,245,612円	137,015,957円
2 . 受益権の総数	1,380,874,045口	1,255,381,648口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第28期 自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	第29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,102,575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（99,456,982円）、信託約款に規定される収益調整金（73,854,147円）及び分配準備積立金（246,067,493円）より分配対象収益は430,481,197円（1万口当たり3,117.45円）であり、うち2,761,748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。	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（69,949,707円）及び分配準備積立金（318,913,586円）より分配対象収益は388,863,293円（1万口当たり3,097.57円）であり、うち2,510,763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。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第28期 自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	第29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	138,471,001	18,788,525
合計	138,471,001	18,788,525

（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28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2540円 (12,540円)	1.2318円 (12,318円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年8月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	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	208,723,645	423,270,679	
	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザー ファンド	484,375,470	710,481,939	
	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	78,147,978	173,785,473	
	D L インターナショナル・ボンド・オーブ ン・マザーファンド	79,745,919	197,801,777	
親投資信託受益証券 合計		850,993,012	1,505,339,868	
合計		850,993,012	1,505,339,868	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

バランス物語 70 (成長型)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、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29期計算期間(平成27年2月26日から平成27年8月25日まで)の財務諸表について、P w C あらた監査法人による監査を受けております。

【バランス物語 70（成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,539,404	37,818,263
親投資信託受益証券	947,904,832	840,212,945
流動資産合計	987,444,236	878,031,208
資産合計	987,444,236	878,031,208
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,259,280	2,064,852
未払解約金	1,429,883	708
未払受託者報酬	524,495	515,242
未払委託者報酬	7,343,526	7,213,941
その他未払費用	24,824	24,388
流動負債合計	11,582,008	9,819,131
負債合計	11,582,008	9,819,131
純資産の部		
元本等		
元本	1,753,093,356	1,688,284,130
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	222,768,872	179,927,947
（分配準備積立金）	232,138,983	207,612,637
元本等合計	975,862,228	868,212,077
純資産合計	975,862,228	868,212,077
負債純資産合計	987,444,236	878,031,208

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第28期		第29期	
	自	平成26年8月26日 平成27年2月25日	自	平成27年2月26日 平成27年8月25日
営業収益				
受取利息		5,721		6,026
有価証券売買等損益		111,835,347		10,691,887
営業収益合計		111,841,068		10,685,861
営業費用				
受託者報酬		524,495		515,242
委託者報酬		7,343,526		7,213,941
その他費用		24,824		24,388
営業費用合計		7,892,845		7,753,571
営業利益又は営業損失（ ）		103,948,223		18,439,432
経常利益又は経常損失（ ）		103,948,223		18,439,432
当期純利益又は当期純損失（ ）		103,948,223		18,439,432
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（ ）		5,134,746		3,554,587
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		140,170,743		222,768,872
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,033,254		3,210,860
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,033,254		3,210,860
剰余金減少額又は欠損金増加額		15,989,322		21,992,914
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,989,322		21,992,914
分配金		1 2,259,280		1 2,064,852
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		222,768,872		179,927,947

(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。
---------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
1 . 1 期首元本額	839,381,369円	753,093,356円
期中追加設定元本額	9,372,021円	9,502,794円
期中一部解約元本額	95,660,034円	74,312,020円
2 . 受益権の総数	753,093,356口	688,284,130口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第28期 自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	第29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,869,748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(50,751,196円)、信託約款に規定される収益調整金(78,133,468円)及び分配準備積立金(176,777,319円)より分配対象収益は312,531,731円(1万口当たり4,149.97円)であり、うち2,259,280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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(303,827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(74,215,685円)及び分配準備積立金(209,373,662円)より分配対象収益は283,893,174円(1万口当たり4,124.65円)であり、うち2,064,852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。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第28期	第29期
	自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	103,757,891	17,970,918
合計	103,757,891	17,970,918

（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28期 平成27年2月25日現在	第29期 平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2958円 (12,958円)	1.2614円 (12,614円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年8月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	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	160,557,835	325,595,233	
	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザ ーファンド	140,131,639	205,545,088	
	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	71,000,081	157,889,980	
	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	60,950,913	151,182,644	
親投資信託受益証券 合計		432,640,468	840,212,945	
合計		432,640,468	840,212,945	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「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ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」受益証券、「DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」受益証券、「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」受益証券及び「DLインターナショナル・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あります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「DL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

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		206,880	174,487
コール・ローン		229,420,444	225,634,047
株式		26,128,514,700	21,228,732,050
未収入金		177,620,863	183,013,102
未収配当金		27,832,050	13,882,430
流動資産合計		26,563,594,937	21,651,436,116
資産合計		26,563,594,937	21,651,436,116
負債の部			
流動負債			
未払金		165,897,799	173,507,429
流動負債合計		165,897,799	173,507,429
負債合計		165,897,799	173,507,429
純資産の部			
元本等			
元本	1	12,725,225,416	10,591,138,440
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		13,672,471,722	10,886,790,247
元本等合計		26,397,697,138	21,477,928,687
純資産合計		26,397,697,138	21,477,928,687
負債純資産合計		26,563,594,937	21,651,436,116

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 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,695,488,366円	12,725,225,416円
	同期中追加設定元本額	34,257,952円	10,426,659円
	同期中一部解約元本額	2,004,520,902円	2,144,513,635円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30（安定型）	352,136,671円	290,786,177円
	バランス物語50（安定・成長型）	259,538,919円	208,723,645円
	バランス物語70（成長型）	194,666,163円	160,557,835円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	808,463,522円	721,314,320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	3,175,424,872円	2,896,457,724円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	3,800,890,466円	3,495,052,688円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	455,397,712円	311,674,600円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	1,922,773,768円	1,254,391,628円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	854,834,376円	613,652,684円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	237,319,060円	162,908,930円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	467,282,310円	318,411,737円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	196,497,577円	157,206,472円
	計	12,725,225,416円	10,591,138,440円
2 .	受益権の総数	12,725,225,416口	10,591,138,440口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	5,330,412,621	1,385,717,230
合計	5,330,412,621	1,385,717,230

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年3月18日から平成27年2月25日まで及び平成27年3月17日から平成27年8月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	2.0744円	2.0279円
（1万口当たり純資産額）	(20,744円)	(20,279円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年8月25日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
大林組	193,000	963.00	185,859,000	
西松建設	200,000	480.00	96,000,000	
東洋建設	157,000	471.00	73,947,000	
日本M&Aセンター	66,500	4,580.00	304,570,000	
江崎グリコ	26,500	5,840.00	154,760,000	
新日鉄住金ソリューションズ	63,500	4,080.00	259,080,000	
エムスリー	163,000	2,573.00	419,399,000	
アサヒグループホールディングス	22,600	3,675.00	83,055,000	
大黒天物産	28,600	4,140.00	118,404,000	
味の素	74,000	2,445.50	180,967,000	
日本たばこ産業	68,200	3,984.50	271,742,900	
ウエルシアホールディングス	77,800	4,895.00	380,831,000	
セブン&アイ・ホールディングス	66,400	4,995.00	331,668,000	
ITホールディングス	84,500	2,563.00	216,573,500	
GMOペイメントゲートウェイ	28,600	3,470.00	99,242,000	
東ソー	455,000	509.00	231,595,000	
三菱ケミカルホールディングス	254,500	640.50	163,007,250	
ダイセル	101,000	1,418.00	143,218,000	
日立化成	61,500	1,747.00	107,440,500	
電通	16,600	5,630.00	93,458,000	
イオンファンタジー	40,000	1,659.00	66,360,000	
ADEKA	101,000	1,457.00	147,157,000	
武田薬品工業	40,200	5,690.00	228,738,000	
アステラス製薬	127,000	1,719.50	218,376,500	
塩野義製薬	90,000	4,420.00	397,800,000	
ロート製薬	121,000	1,983.00	239,943,000	
参天製薬	34,000	1,739.00	59,126,000	
アルファシステムズ	106,800	1,643.00	175,472,400	
楽天	121,000	1,594.50	192,934,500	
大塚商会	26,000	6,100.00	158,600,000	
ブリヂストン	65,400	3,800.00	248,520,000	
住友大阪セメント	623,000	467.00	290,941,000	
太平洋セメント	514,000	383.00	196,862,000	
日本碍子	38,000	2,563.00	97,394,000	
新日鉄住金	632,000	232.30	146,813,600	
日立金属	81,000	1,472.00	119,232,000	
三和ホールディングス	170,000	872.00	148,240,000	
東京製綱	462,000	178.00	82,236,000	
富士ダイス	58,800	505.00	29,694,000	
クボタ	169,000	1,744.00	294,736,000	
日本精工	159,000	1,505.00	239,295,000	
ミネベア	168,000	1,486.00	249,648,000	
日立製作所	238,000	653.70	155,580,600	
三菱電機	100,000	1,146.50	114,650,000	

日本電産	62,700	8,680.00	544,236,000
日新電機	165,000	633.00	104,445,000
ソニー	72,600	2,834.50	205,784,700
アルプス電気	116,100	3,335.00	387,193,500
エスベック	64,800	1,044.00	67,651,200
キーエンス	4,200	52,610.00	220,962,000
デンソー	25,100	5,146.00	129,164,600
カシオ計算機	121,000	2,193.00	265,353,000
村田製作所	17,900	15,330.00	274,407,000
日東電工	52,000	7,418.00	385,736,000
トヨタ自動車	167,000	6,725.00	1,123,075,000
富士重工業	144,800	3,802.00	550,529,600
ヤマハ発動機	117,800	2,148.00	253,034,400
小糸製作所	64,200	3,735.00	239,787,000
ガリバーインターナショナル	70,000	990.00	69,300,000
シークス	16,000	2,812.00	44,992,000
島津製作所	93,000	1,647.00	153,171,000
スター精密	81,400	1,610.00	131,054,000
H O Y A	70,400	4,354.00	306,521,600
朝日インテック	33,000	4,150.00	136,950,000
日立ハイテクノロジーズ	41,700	2,517.00	104,958,900
三菱商事	133,000	2,083.50	277,105,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	139,500	2,234.00	311,643,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,350,000	744.30	1,004,805,000
三井住友トラスト・ホールディングス	403,000	476.70	192,110,100
三井住友フィナンシャルグループ	159,000	4,555.00	724,245,000
オリックス	211,500	1,519.00	321,268,500
東京海上ホールディングス	95,600	4,378.50	418,584,600
三井不動産	177,000	3,200.00	566,400,000
三菱地所	48,000	2,522.50	121,080,000
東日本旅客鉄道	19,500	10,555.00	205,822,500
東海旅客鉄道	14,600	18,300.00	267,180,000
阪急阪神ホールディングス	101,000	685.00	69,185,000
日本電信電話	105,700	4,310.00	455,567,000
K D D I	218,000	2,904.50	633,181,000
K A D O K A W A ・ D W A N G O	81,800	1,372.00	112,229,600
S C S K	74,000	4,010.00	296,740,000
ニトリホールディングス	37,000	9,170.00	339,290,000
ミスミグループ本社	124,000	1,331.00	165,044,000
ソフトバンクグループ	86,400	6,890.00	595,296,000
サンドラッグ	37,400	6,430.00	240,482,000
合計	11,710,700		21,228,732,050

（２）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 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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,154,767,871	1,288,787,018
国債証券		11,944,993,260	14,837,106,430
社債券		21,520,442,630	17,191,303,470
未収入金		395,729,110	-
未収利息		106,425,614	99,023,856
前払費用		8,134,874	14,835,248
流動資産合計		35,130,493,359	33,431,056,022
資産合計		35,130,493,359	33,431,056,022
負債の部			
流動負債			
未払金		168,000,000	-
流動負債合計		168,000,000	-
負債合計		168,000,000	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,950,673,340	22,792,349,502
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		11,011,820,019	10,638,706,520
元本等合計		34,962,493,359	33,431,056,022
純資産合計		34,962,493,359	33,431,056,022
負債純資産合計		35,130,493,359	33,431,056,022

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	国債証券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
--------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	24,862,702,690円	23,950,673,340円
	同期中追加設定元本額	1,328,598,272円	709,717,725円
	同期中一部解約元本額	2,240,627,622円	1,868,041,563円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30（安定型）	1,655,310,425円	1,614,451,783円
	バランス物語50（安定・成長型）	500,233,289円	484,375,470円
	バランス物語70（成長型）	133,273,869円	140,131,639円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	3,844,258,759円	3,984,726,392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	6,299,874,703円	6,615,366,138円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	2,878,336,557円	3,019,091,295円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	2,178,536,657円	1,722,899,911円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	3,692,144,246円	2,930,484,007円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	591,287,214円	505,686,498円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	1,125,238,243円	909,457,110円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	913,377,817円	735,070,470円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	138,801,561円	130,608,789円
	計	23,950,673,340円	22,792,349,502円
2 .	受益権の総数	23,950,673,340口	22,792,349,502口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	358,819,560	122,418,540
社債券	132,063,480	17,086,990
合計	490,883,040	139,505,530

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月27日から平成27年2月25日まで及び平成27年5月26日から平成27年8月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	1.4598円	1.4668円
（1万口当たり純資産額）	(14,598円)	(14,668円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年8月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 3 5 回 利付国庫債券（2年）	500,000,000	500,150,000	
	9 2 回 利付国庫債券（5年）	150,000,000	150,028,500	
	9 8 回 利付国庫債券（5年）	200,000,000	200,488,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券（5年）	100,000,000	100,888,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券（5年）	900,000,000	905,508,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券（5年）	620,000,000	623,856,400	
	6 回 利付国庫債券（40年）	120,000,000	133,617,600	
	7 回 利付国庫債券（40年）	18,000,000	18,948,780	
	8 回 利付国庫債券（40年）	26,000,000	25,012,780	
	3 2 5 回 利付国庫債券（10年）	48,000,000	50,181,120	
	3 2 7 回 利付国庫債券（10年）	902,000,000	942,716,280	
	3 2 9 回 利付国庫債券（10年）	450,000,000	470,047,500	
	3 3 2 回 利付国庫債券（10年）	75,000,000	77,106,750	
	3 3 9 回 利付国庫債券（10年）	568,000,000	569,613,120	
	2 4 回 利付国庫債券（30年）	35,000,000	43,342,950	
	3 3 回 利付国庫債券（30年）	1,626,000,000	1,862,290,320	
	3 9 回 利付国庫債券（30年）	33,000,000	37,044,480	
	4 3 回 利付国庫債券（30年）	82,000,000	88,044,220	
	4 4 回 利付国庫債券（30年）	746,000,000	800,502,760	
	4 5 回 利付国庫債券（30年）	68,000,000	69,629,960	
	3 2 回 利付国庫債券（20年）	700,000,000	714,686,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券（20年）	50,000,000	59,458,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券（20年）	111,000,000	131,992,320	
	1 1 5 回 利付国庫債券（20年）	40,000,000	48,119,600	
	1 1 7 回 利付国庫債券（20年）	557,000,000	662,234,010	
	1 1 9 回 利付国庫債券（20年）	250,000,000	286,717,500	
	1 2 6 回 利付国庫債券（20年）	90,000,000	105,677,100	
	1 2 9 回 利付国庫債券（20年）	200,000,000	228,716,000	
	1 3 0 回 利付国庫債券（20年）	1,090,000,000	1,246,055,300	
	1 3 1 回 利付国庫債券（20年）	564,000,000	636,259,680	
	1 3 8 回 利付国庫債券（20年）	39,000,000	42,572,400	
	1 4 0 回 利付国庫債券（20年）	843,000,000	945,559,380	
	1 4 1 回 利付国庫債券（20年）	277,000,000	309,963,000	
1 4 5 回 利付国庫債券（20年）	996,000,000	1,111,496,160		
1 4 6 回 利付国庫債券（20年）	327,000,000	364,251,840		
1 4 7 回 利付国庫債券（20年）	54,000,000	59,106,780		
1 4 8 回 利付国庫債券（20年）	90,000,000	96,817,500		
1 5 2 回 利付国庫債券（20年）	117,000,000	118,406,340		
国債証券 合計		13,662,000,000	14,837,106,430	
社債券	1 2 回 ポスコ円貨社債	300,000,000	301,254,000	

9回	モルガン・スタンレー円貨債	400,000,000	403,116,000	
16回	ルノー円貨債	200,000,000	202,978,000	
41回	鹿島建設社債	300,000,000	303,660,000	
7回	西松建設社債	200,000,000	200,894,000	
3回	五洋建設社債	100,000,000	100,811,000	
28回	双日社債	400,000,000	411,108,000	
29回	双日社債	100,000,000	101,943,000	
31回	双日社債	200,000,000	200,584,000	
37回	東洋紡社債	100,000,000	100,079,000	
11回	森ビル社債	200,000,000	204,618,000	
12回	森ビル社債	400,000,000	407,492,000	
17回	森ビル社債	200,000,000	200,046,000	
41回	住友化学社債	100,000,000	105,461,000	
42回	三井化学社債	100,000,000	104,831,000	
44回	三井化学社債	300,000,000	303,564,000	
4回	東燃ゼネラル石油社債	200,000,000	203,794,000	
3回	JXホールディングス社債	100,000,000	105,478,000	
5回	東海ゴム工業社債	200,000,000	200,494,000	
23回	太平洋セメント社債	200,000,000	203,102,000	
24回	太平洋セメント社債	100,000,000	100,315,000	
25回	太平洋セメント社債	100,000,000	100,590,000	
13回	三井金属社債	100,000,000	101,714,000	
1回	小森コーポレーション社債	200,000,000	201,544,000	
47回	N E C社債	100,000,000	100,120,000	
48回	N E C社債	200,000,000	200,688,000	
12回	パナソニック社債	200,000,000	200,298,000	
13回	パナソニック社債	200,000,000	200,472,000	
5回	アンリツ社債	200,000,000	201,928,000	
6回	アンリツ社債	100,000,000	100,032,000	
23回	日立造船社債	100,000,000	100,118,000	
38回	I H I社債	200,000,000	206,830,000	
21回	トピー工業社債	400,000,000	415,352,000	
23回	トピー工業社債	200,000,000	202,216,000	
76回	伊藤忠商事社債	320,000,000	322,681,600	
1回	三菱UFJフィナンシャルG実質破綻時免除特約付劣後社債	200,000,000	202,732,000	
1回	三井住友トラストHD実質破綻時免除特約付劣後社債	100,000,000	100,225,000	
1回	三井住友フィナンシャルG実質破綻時免除特約付劣後社債	400,000,000	400,800,000	
10回	西日本シティ銀行期限前償還条項付劣後社債	600,000,000	608,622,000	
1回	千葉銀行実質破綻時免除特約付劣後社債	200,000,000	201,526,000	
2回	清水銀行期限前償還条項付劣後社債	100,000,000	101,080,000	
3回	宮崎銀行期限前償還条項付劣後社債	100,000,000	101,080,000	
3回	琉球銀行期限前償還条項付劣後社債	100,000,000	101,074,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	214,290,000	
1回	みずほフィナンシャルG実質破綻時免除特約付劣後社債	200,000,000	201,404,000	
19回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	214,664,000	

20回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,653,000	
16回	ポケットカード社債	100,000,000	100,841,000	
17回	ポケットカード社債	100,000,000	100,322,000	
65回	アコム社債	200,000,000	201,732,000	
66回	アコム社債	300,000,000	304,269,000	
68回	アコム社債	100,000,000	101,085,000	
8回	ジャックス社債	500,000,000	515,420,000	
9回	ジャックス社債	100,000,000	101,249,000	
1回	オリエントコーポレーション社債	300,000,000	300,858,000	
2回	オリエントコーポレーション社債	100,000,000	99,943,000	
3回	オリエントコーポレーション社債	200,000,000	199,872,000	
178回	オリックス社債	190,000,000	191,060,200	
1回	あいおいニッセイ同和損害保険劣後社債	500,000,000	539,765,000	
2回	あいおいニッセイ同和損害保険期限前償還条項付劣後社債	400,000,000	406,544,000	
17回	東京建物社債	300,000,000	311,208,000	
2回	京阪神不動産社債	100,000,000	103,075,000	
7回	大京社債	100,000,000	102,814,000	
1回	山九社債	200,000,000	201,552,000	
1回	神奈川中央交通社債	100,000,000	100,116,000	
36回	日本郵船社債	300,000,000	302,868,000	
15回	商船三井社債	100,000,000	103,446,000	
483回	関西電力社債	100,000,000	103,083,000	
495回	関西電力社債	560,000,000	565,269,600	
496回	関西電力社債	168,000,000	168,485,520	
307回	北陸電力社債	210,000,000	214,326,000	
471回	東北電力社債	200,000,000	207,694,000	
473回	東北電力社債	310,000,000	312,945,000	
426回	九州電力社債	250,000,000	254,937,500	
316回	北海道電力社債	630,000,000	651,249,900	
317回	北海道電力社債	245,000,000	252,889,000	
321回	北海道電力社債	95,000,000	95,624,150	
1回	S C S K社債	200,000,000	200,962,000	
11回	コナミ社債	100,000,000	101,443,000	
社債券 合計		16,878,000,000	17,191,303,470	
合計		30,540,000,000	32,028,409,900	

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・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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		83,564,088	13,935,707
コール・ローン		182,552,101	114,632,477
株式		10,534,628,469	8,930,055,815
未収入金		-	266,177,261
未収配当金		14,748,420	15,229,342
流動資産合計		10,815,493,078	9,340,030,602
資産合計		10,815,493,078	9,340,030,602
負債の部			
流動負債			
未払金		75,493,008	273,423,440
流動負債合計		75,493,008	273,423,440
負債合計		75,493,008	273,423,440
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,480,941,253	4,077,120,898
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		6,259,058,817	4,989,486,264
元本等合計		10,740,000,070	9,066,607,162
純資産合計		10,740,000,070	9,066,607,162
負債純資産合計		10,815,493,078	9,340,030,602

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 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,466,940,205円	4,480,941,253円
	同期中追加設定元本額	12,349,339円	7,734,850円
	同期中一部解約元本額	998,348,291円	411,555,205円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30（安定型）	79,507,977円	71,437,658円
	バランス物語50（安定・成長型）	88,909,392円	78,147,978円
	バランス物語70（成長型）	83,085,687円	71,000,081円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	184,336,031円	184,336,031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	1,090,126,766円	1,090,126,766円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	1,546,889,059円	1,546,889,059円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	104,828,766円	71,371,367円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	658,748,436円	468,350,855円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	348,227,889円	270,546,842円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	54,993,798円	38,893,356円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	161,307,125円	117,752,797円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	79,980,327円	68,268,108円
	計	4,480,941,253円	4,077,120,898円
2 .	受益権の総数	4,480,941,253口	4,077,120,898口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	1,324,110,904	630,582,331
合計	1,324,110,904	630,582,331

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年3月18日から平成27年2月25日まで及び平成27年3月17日から平成27年8月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	2.3968円	2.2238円
（1万口当たり純資産額）	(23,968円)	(22,238円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年8月25日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,100	463.370	509,707.000	
	ABBOTT LABORATORIES	4,321	43.700	188,827.700	
	ADOBE SYSTEMS INC	4,048	74.270	300,644.960	
	AMGEN INC	2,064	147.640	304,728.960	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	4,440	65.550	291,042.000	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	668	166.850	111,455.800	
	TIME WARNER	3,816	69.810	266,394.960	
	JONES LANG LASALLE INC	1,005	149.280	150,026.400	
	VALERO ENERGY CORP	6,434	58.520	376,517.680	
	APPLE INC	15,790	103.120	1,628,264.800	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	8,931	61.690	550,953.390	
	AUTOZONE INC	376	684.990	257,556.240	
	CR BARD INC	1,046	184.230	192,704.580	
	VERIZON COMM INC	9,221	44.740	412,547.540	
	BOEING CO	1,888	127.190	240,134.720	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,581	58.650	268,675.650	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,394	44.420	239,601.480	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	7,821	22.660	177,223.860	
	CONSTELLATION BRANDS INC	1,617	119.280	192,875.760	
	CELGENE CORP	2,970	113.380	336,738.600	
	JPMORGAN CHASE & CO	12,588	60.250	758,427.000	
	CIGNA CORP	3,577	135.750	485,577.750	
	CISCO SYSTEMS INC	13,715	25.190	345,480.850	
	COCA-COLA CO/THE	10,610	38.380	407,211.800	
	COCA-COLA ENTERPRISES INC	3,993	50.600	202,045.800	
	CIENA CORP	7,732	20.560	158,969.920	
	MOLINA HEALTHCARE INC	2,358	72.680	171,379.440	
	COMCAST CORP-CL A	7,171	54.410	390,174.110	
	CONAGRA FOODS INC	8,627	41.490	357,934.230	
	DR HORTON INC	6,513	29.530	192,328.890	
	DANAHER CORP	2,296	84.050	192,978.800	
	MORGAN STANLEY	8,373	32.260	270,112.980	
	THE WALT DISNEY CO	4,269	95.360	407,091.840	
DOLLAR TREE INC	3,262	73.710	240,442.020		
XL GROUP PLC	7,727	36.790	284,276.330		
EBAY INC	4,164	24.930	103,808.520		
BANK OF AMERICA CORP	40,955	15.290	626,201.950		

CITIGROUP INC	11,321	50.340	569,899.140	
DISH NETWORK CORP	2,515	58.230	146,448.450	
SALESFORCE.COM INC	5,636	65.170	367,298.120	
EOG RESOURCES INC	3,330	69.260	230,635.800	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	1,893	81.810	154,866.330	
EXXON MOBIL CORP	16,235	68.720	1,115,669.200	
ASSURANT INC	2,126	71.590	152,200.340	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,527	140.810	355,826.870	
GENERAL MILLS INC	5,055	54.520	275,598.600	
GILEAD SCIENCES INC	4,398	100.655	442,680.690	
GENERAL ELECTRIC CO	11,306	23.870	269,874.220	
MONSTER BEVERAGE CORP	3,992	135.460	540,756.320	
HASBRO INC	2,848	71.180	202,720.640	
F5 NETWORKS INC	1,759	117.470	206,629.730	
REYNOLDS AMERICAN INC	5,042	80.810	407,444.020	
HOLOGIC INC	4,141	38.030	157,482.230	
UNUM GROUP	4,721	31.850	150,363.850	
HOME DEPOT INC	9,570	112.540	1,077,007.800	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,255	119.680	150,198.400	
HORMEL FOODS CORP	3,427	59.330	203,323.910	
HUMANA INC	2,067	175.180	362,097.060	
BIOGEN INC	745	278.350	207,370.750	
INTEL CORP	7,005	26.250	183,881.250	
INCYTE CORP	1,933	97.370	188,216.210	
JOHNSON & JOHNSON	6,676	92.820	619,666.320	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7,910	44.480	351,836.800	
HAIN CELESTIAL GROUP INC	10,395	60.130	625,051.350	
KROGER CO	11,899	33.770	401,829.230	
LACLEDE GROUP INC/THE	4,542	53.060	240,998.520	
AKAMAI TECHNOLOGIES	3,602	66.520	239,605.040	
LENNAR CORP	5,821	50.080	291,515.680	
ELI LILLY & CO	2,994	80.730	241,705.620	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,084	197.460	411,506.640	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	879	133.930	117,724.470	
METLIFE INC	5,476	47.400	259,562.400	
MEDTRONIC PLC	3,234	70.910	229,322.940	
CVS HEALTH CORP	4,690	100.210	469,984.900	
MERCK & CO. INC.	7,232	53.990	390,455.680	
MICROSOFT CORP	21,238	41.680	885,199.840	
MYLAN NV	3,051	49.810	151,970.310	
NEWELL RUBBERMAID INC	4,755	39.970	190,057.350	
NIKE INC-CL B	2,494	103.870	259,051.780	
NORTHERN TRUST CORP	3,495	67.160	234,724.200	
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,020	160.020	323,240.400	
WELLS FARGO & CO	20,314	51.250	1,041,092.500	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,278	73.530	167,501.340	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,878	231.850	435,414.300	
ORACLE CORP	9,363	36.080	337,817.040	
PPL CORPORATION	7,510	31.370	235,588.700	
PEPSICO INC	4,757	91.830	436,835.310	
PFIZER INC	17,239	32.130	553,889.070	
ALTRIA GROUP INC	7,940	52.140	413,991.600	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6,157	88.830	546,926.310	
AETNA INC	2,587	110.510	285,889.370	
GLOBAL PAYMENTS INC	2,867	105.900	303,615.300	
REGENERON PHARMACEUTICALS	416	504.580	209,905.280	
RITE AID CORP	32,217	7.790	250,970.430	
ROSS STORES INC	7,198	48.330	347,879.340	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	12,046	41.960	505,450.160	
PRICELINE GROUP INC	190	1,174.120	223,082.800	
AMSURG CORP	2,438	78.300	190,895.400	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,671	50.650	185,936.150	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,032	254.320	262,458.240	
CENTENE CORP	3,137	60.830	190,823.710	
ACUITY BRANDS INC	1,109	188.000	208,492.000	
SNAP-ON INC	2,105	154.260	324,717.300	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,858	75.910	292,860.780	
SOUTHWEST AIRLINES	3,950	37.210	146,979.500	
AT&T INC	13,578	32.370	439,519.860	
STARBUCKS CORP	4,069	50.340	204,833.460	
NETFLIX INC	1,740	96.880	168,571.200	
SYNOPSIS INC	4,144	45.700	189,380.800	
UNION PACIFIC CORP	2,245	82.660	185,571.700	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,788	132.850	237,535.800	
VF CORP	2,796	69.430	194,126.280	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,822	119.270	217,309.940	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	5,943	82.270	488,930.610	
ALLERGAN PLC	1,852	291.820	540,450.640	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,180	80.510	175,511.800	
WILLIAMS COS INC	3,862	46.740	180,509.880	
FOOT LOCKER INC	3,001	67.740	203,287.740	
CARTER'S INC	2,017	93.380	188,347.460	
CIMAREX ENERGY CO	2,996	98.930	296,394.280	
LIBERTY GLOBAL PLC	3,074	46.670	143,463.580	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,304	45.500	150,332.000	

GOOGLE INC-CL A	1,714	618.110	1,059,440.540		
T-MOBILE US INC	5,645	38.730	218,630.850		
MEDIVATION INC	1,305	85.040	110,977.200		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,065	55.900	227,233.500		
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	283	704.250	199,302.750		
TRANSDIGM GROUP INC	1,258	221.560	278,722.480		
MASTERCARD INC	3,430	87.830	301,256.900		
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	3,752	50.010	187,637.520		
TIME WARNER CABLE INC	896	179.170	160,536.320		
INFINERA CORP	8,610	19.720	169,789.200		
MASIMO CORP	4,048	39.560	160,138.880		
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	3,103	95.380	295,964.140		
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	1,264	158.720	200,622.080		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	5,435	78.340	425,777.900		
VISA INC	6,739	68.360	460,678.040		
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	2,964	77.250	228,969.000		
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	1,322	109.940	145,340.680		
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	709	161.950	114,822.550		
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	5,146	57.460	295,689.160		
NXP SEMICONDUCTOR NV	2,069	79.260	163,988.940		
FORTINET INC	7,980	40.920	326,541.600		
VANTIV INC	5,866	41.490	243,380.340		
FACEBOOK INC	7,710	82.090	632,913.900		
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,996	61.750	370,253.000		
WHITEWAVE FOODS CO	13,158	42.730	562,241.340		
PALO ALTO NETWORKS INC	2,233	155.010	346,137.330		
ABBVIE INC	4,931	63.450	312,871.950		
PINNACLE FOODS INC	7,475	43.660	326,358.500		
ZOETIS INC	6,778	43.530	295,046.340		
PERRIGO CO PLC	1,122	178.500	200,277.000		
PHIBRO ANIMAL HEALTH CORP	4,348	33.720	146,614.560		
ARISTA NETWORKS INC	2,085	71.620	149,327.700		
SYNCHRONY FINANCIAL	7,560	33.150	250,614.000		
MOBILEYE NV	3,090	52.450	162,070.500		
CYBERARK SOFTWARE LTD	2,017	48.550	97,925.350		
KRAFT HEINZ CO	4,048	70.870	286,881.760		
PAYPAL HOLDINGS INC	4,169	33.750	140,703.750		
アメリカ・ドル 小計	835,786		50,203,330.220 (5,969,175,963)		
イギリス・ポンド	SEVERN TRENT PLC	7,630	20.390	155,575.700	

	BARCLAYS PLC	68,151	2.447	166,765.490	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	21,603	5.900	127,457.700	
	TED BAKER PLC	4,381	29.520	129,327.120	
	BT GROUP PLC	41,581	4.142	172,228.500	
	DIAGEO PLC	5,969	16.400	97,891.600	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,347	33.555	179,418.580	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	7,424	29.910	222,051.840	
	SABMILLER PLC	4,145	28.775	119,272.370	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	17,751	8.320	147,688.320	
	UNITE GROUP PLC	15,344	6.365	97,664.560	
	PRUDENTIAL PLC	10,668	13.600	145,084.800	
	RIO TINTO PLC	13,901	21.545	299,497.040	
	VODAFONE GROUP PLC	89,267	2.145	191,477.710	
	BP PLC	47,176	3.310	156,152.560	
	SHIRE PLC	2,008	47.050	94,476.400	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	132,473	0.734	97,235.180	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	12,063	12.820	154,647.660	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	7,715	23.710	182,922.650	
	ASTRAZENECA PLC	3,879	39.035	151,416.760	
	WHITBREAD PLC	4,832	47.260	228,360.320	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	8,867	22.870	202,788.290	
	ITV PLC	115,423	2.382	274,937.580	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	26,343	15.860	417,799.980	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	35,579	3.460	123,103.340	
イギリス・ポンド 小計		709,520		4,335,242.050 (812,814,532)	
オーストラリア・ドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	17,279	29.450	508,866.550	
オーストラリア・ドル 小計		17,279		508,866.550 (43,482,647)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	11,402	53.690	612,173.380	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	1,702	291.700	496,473.400	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	3,224	72.740	234,513.760	
	LOBLAW CO LTD	4,761	70.140	333,936.540	
	ROYAL BANK OF CANADA	5,041	70.710	356,449.110	
	DOLLARAMA INC	4,758	73.690	350,617.020	
カナダ・ドル 小計	CONCORDIA HEALTHCARE CORP	2,186	90.650	198,160.900	
		33,074		2,582,324.110 (231,247,124)	
スイス・フラン	SYNGENTA AG	391	357.600	139,821.600	
	NESTLE SA-REGISTERED	10,895	68.400	745,218.000	

	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	1,727	254.000	438,658.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	6,527	89.600	584,819.200	
	CLARIANT AG-REG	7,750	17.030	131,982.500	
	ACTELION	1,203	124.500	149,773.500	
	UBS GROUP AG	17,259	19.280	332,753.520	
スイス・フラン	小計	45,752		2,523,026.320 (321,736,316)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	10,150	104.900	1,064,735.000	
スウェーデン・クローナ	小計	10,150		1,064,735.000 (15,310,889)	
デンマーク・ク ローネ	NOVO NORDISK A/S-B	5,358	349.700	1,873,692.600	
デンマーク・クローネ	小計	5,358		1,873,692.600 (34,550,891)	
ユーロ	KINGSPAN GROUP PLC	11,187	20.325	227,375.770	
	AXA	20,762	21.090	437,870.580	
	GLANBIA PLC	15,758	17.150	270,249.700	
	SAFRAN SA	5,938	63.330	376,053.540	
	INTESA SANPAOLO	169,425	2.968	502,853.400	
	ACCOR SA	9,422	39.460	371,792.120	
	BNP PARIBAS	5,852	52.850	309,278.200	
	CAP GEMINI SA	3,101	76.460	237,102.460	
	INGENICO GROUP	2,406	111.350	267,908.100	
	UNITED INTERNET	5,342	40.990	218,968.580	
	KBC GROUPE	4,959	54.380	269,670.420	
	L'OREAL	1,987	146.350	290,797.450	
	SOCIETE GENERALE-A	4,896	40.635	198,948.960	
	ING GROEP NV-CVA	36,525	12.470	455,466.750	
	BAYER AG	2,398	112.350	269,415.300	
	DAIMLER AG	3,056	67.080	204,996.480	
	ALLIANZ SE	1,528	133.700	204,293.600	
	PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	9,391	39.520	371,132.320	
	HEINEKEN NV	3,018	67.860	204,801.480	
	A2A SPA	194,397	1.072	208,393.580	
	AGEAS	5,372	34.510	185,387.720	
	SANOFI	4,415	83.640	369,270.600	
	ION BEAM APPLICATIONS	5,664	24.010	135,992.640	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	23,414	14.040	328,732.560	
	DEUTSCHE BOERSE AG	4,630	73.830	341,832.900	
	ESSILOR INTL	2,354	100.400	236,341.600	
	ORPEA	2,807	65.000	182,455.000	
	HERA SPA	74,188	2.150	159,504.200	
	FERROVIAL SA	19,141	19.675	376,599.170	
	SYMRISE AG	7,195	52.800	379,896.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,410	24.475	205,834.750	
	GERRESHEIMER AG	2,307	58.080	133,990.560	
	STROEER SE	8,749	47.670	417,064.830	

	ANIMA HOLDING SPA	14,994	8.000	119,952.000	
	ELIOR	14,078	16.875	237,566.250	
	EURONEXT NV	8,544	37.100	316,982.400	
	ALTICE NV-A	5,048	23.420	118,224.160	
ユーロ	小計	722,658		10,142,996.130 (1,396,284,847)	
香港・ドル	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	32,000	61.750	1,976,000.000	
	AIA GROUP LTD	50,600	40.800	2,064,480.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	20,500	98.550	2,020,275.000	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	16,000	50.850	813,600.000	
香港・ドル	小計	119,100		6,874,355.000 (105,452,606)	
合計		2,498,677		8,930,055,815 (8,930,055,815)	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式 159銘柄	65.84%	66.84%
イギリス・ポンド	株式 25銘柄	8.96%	9.10%
オーストラリア・ドル	株式 1銘柄	0.48%	0.49%
カナダ・ドル	株式 7銘柄	2.55%	2.59%
スイス・フラン	株式 7銘柄	3.55%	3.60%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	0.17%	0.17%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	0.38%	0.39%
ユーロ	株式 37銘柄	15.40%	15.64%
香港・ドル	株式 4銘柄	1.16%	1.18%

(注) 「組入時価比率」は、純資産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。

「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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,065,669	3,848,690
コール・ローン		132,914,989	106,403,601
国債証券		10,714,747,275	10,886,200,156
特殊債券		524,857,695	517,866,572
派生商品評価勘定		5,087,066	23,359,225
未収入金		416,252,228	215,136,970
未収利息		67,882,698	69,726,372
前払費用		35,245,078	9,202,357
流動資産合計		11,902,052,698	11,831,743,943
資産合計		11,902,052,698	11,831,743,943
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,699,577	9,389,439
未払金		418,374,819	214,930,041
流動負債合計		426,074,396	224,319,480
負債合計		426,074,396	224,319,480
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,650,847,610	4,679,682,170
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		6,825,130,692	6,927,742,293
元本等合計		11,475,978,302	11,607,424,463
純資産合計		11,475,978,302	11,607,424,463
負債純資産合計		11,902,052,698	11,831,743,943

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。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,254,412,012円	4,650,847,610円
	同期中追加設定元本額	44,372,305円	309,826,658円
	同期中一部解約元本額	647,936,707円	280,992,098円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30（安定型）	115,654,936円	115,654,936円
	バランス物語50（安定・成長型）	82,507,805円	79,745,919円
	バランス物語70（成長型）	60,950,913円	60,950,913円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	276,724,687円	288,881,989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	1,022,793,975円	1,101,940,793円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	1,221,454,953円	1,335,126,501円
	外国債券私募オープン（適格機関投資家向け）	501,466,648円	602,243,156円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	145,502,831円	127,631,504円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	636,884,182円	486,894,967円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	282,289,632円	234,235,770円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	83,748,537円	65,731,882円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	158,809,514円	120,428,689円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	62,058,997円	60,215,151円
	計	4,650,847,610円	4,679,682,170円
2 .	受益権の総数	4,650,847,610口	4,679,682,170口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年8月26日 至 平成27年2月25日	自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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

種類	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	373,099,424	93,766,413
特殊債券	13,526,715	3,961,748
合計	359,572,709	89,804,665

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年5月27日から平成27年2月25日まで及び平成27年5月26日から平成27年8月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成27年8月25日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	850,510,300	-	853,841,263	3,330,963	740,721,267	-	717,362,042	23,359,225
アメリカ・ドル	64,772,932	-	65,318,000	545,068	285,099,407	-	280,331,842	4,767,565
イギリス・債券	-	-	-	-	341,814,880	-	329,665,600	12,149,280
オーストラリア・ドル	114,825,240	-	115,642,400	817,160	113,806,980	-	107,364,600	6,442,380
ポーランド・ズロチ	220,313,263	-	220,184,000	129,263	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	129,659,791	-	129,823,500	163,709	-	-	-	-
ユーロ	320,939,074	-	322,873,363	1,934,289	-	-	-	-
買 建	855,507,736	-	856,226,188	718,452	744,154,101	-	734,764,662	9,389,439
アメリカ・ドル	83,218,730	-	83,132,000	86,730	71,242,488	-	68,286,040	2,956,448
シンガポール・ドル	51,334,720	-	51,642,700	307,980	43,749,638	-	43,255,198	494,440
スイス・フラン	42,801,000	-	41,306,100	1,494,900	34,704,180	-	34,454,700	249,480
ノルウェー・クローネ	30,526,734	-	31,789,800	1,263,066	32,595,960	-	31,579,800	1,016,160
ポーランド・ズロチ	219,576,020	-	222,147,088	2,571,068	70,557,000	-	69,594,539	962,461
メキシコ・ペソ	123,623,280	-	123,066,000	557,280	112,031,958	-	110,037,918	1,994,040
ユーロ	304,427,252	-	303,142,500	1,284,752	321,453,790	-	320,701,200	752,590
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	57,819,087	-	56,855,267	963,820
合計	1,706,018,036	-	1,710,067,451	2,612,511	1,484,875,368	-	1,452,126,704	13,969,786

（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取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取相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	2,4675円	2,4804円
(1万口当たり純資産額)	(24,675円)	(24,804円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成27年8月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.5 07/31/17	2,120,000.000	2,116,099.200	
		US T N/B 1.0 09/30/19	800,000.000	792,936.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	4,000,000.000	4,051,840.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	4,750,000.000	4,824,575.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	3,000,000.000	3,006,540.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	3,950,000.000	4,043,654.500	
		US T N/B 1.875 09/30/17	3,400,000.000	3,485,102.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	500,000.000	510,095.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	340,000.000	339,785.800	
		US T N/B 2.25 03/31/21	1,800,000.000	1,868,202.000	
		US T N/B 2.375 08/15/24	3,840,000.000	3,966,566.400	
		US T N/B 2.625 11/15/20	100,000.000	105,792.000	
		US T N/B 2.75 11/15/23	1,550,000.000	1,653,400.500	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,140,000.000	1,201,890.600	
		US T N/B 3.125 02/15/42	2,400,000.000	2,598,000.000	
		US T N/B 3.75 11/15/43	500,000.000	605,350.000	
		US T N/B 4.375 05/15/40	800,000.000	1,051,936.000	
		アメリカ・ドル 小計			34,990,000.000 (4,160,311,000)
イギリス・ボンド		UK TREASURY 1.75 07/22/19	780,000.000	800,155.200	
		UK TREASURY 1.75 09/07/22	100,000.000	101,610.000	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	700,000.000	822,570.000	
		UK TREASURY 4.0 03/07/22	300,000.000	348,690.000	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	500,000.000	645,050.000	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	300,000.000	403,680.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	700,000.000	942,900.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	600,000.000	859,680.000	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	300,000.000	387,840.000	
イギリス・ボンド 小計			4,280,000.000 (802,457,200)	5,312,175.200 (995,979,728)	
オーストラリア・ドル		AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	390,000.000	437,065.200	
		AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,330,000.000	1,626,842.700	
オーストラリア・ドル 小計			1,720,000.000	2,063,907.900	

		(146,974,000)	(176,360,930)	
カナダ・ドル	CANADA 1.25 09/01/18	730,000.000	749,826.800	
	CANADA 3.5 12/01/45	300,000.000	402,300.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	1,010,000.000	1,539,189.500	
カナダ・ドル 小計		2,040,000.000 (182,682,000)	2,691,316.300 (241,007,375)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.625 10/01/19	200,000.000	199,600.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	200,000.000	204,800.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	100,000.000	106,395.000	
シンガポール・ドル 小計		500,000.000 (42,225,000)	510,795.000 (43,136,638)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 3.0 07/12/16	1,000,000.000	1,031,740.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	2,200,000.000	2,695,528.000	
スウェーデン・クローナ 小計		3,200,000.000 (46,016,000)	3,727,268.000 (53,598,114)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	7,000,000.000	8,933,190.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 06/15/17	1,500,000.000	1,519,215.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	3,500,000.000	3,466,960.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	1,500,000.000	1,687,500.000	
メキシコ・ペソ 小計		13,500,000.000 (93,555,000)	15,606,865.000 (108,155,574)	
ユーロ	AUSTRIA 1.65 10/21/24	700,000.000	756,399.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	700,000.000	829,850.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	900,000.000	1,111,527.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	160,000.000	243,995.200	
	BUNDESOBL 0.5 10/13/17	220,000.000	223,566.200	
	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	4,230,000.000	4,219,848.000	
	DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	750,000.000	990,975.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,040,000.000	3,491,744.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	560,000.000	917,112.000	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/25	720,000.000	689,529.600	
	FRANCE OAT 1.0 05/25/18	650,000.000	669,506.500	
	FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,600,000.000	1,659,280.000	
	FRANCE OAT 1.0 11/25/18	740,000.000	765,100.800	
	FRANCE OAT 1.75 11/25/24	200,000.000	215,862.000	
	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	1,600,000.000	1,881,136.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	900,000.000	1,075,608.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,200,000.000	1,722,600.000	
	IRISH 3.4 03/18/24	300,000.000	356,370.000	

		IRISH 5.0 10/18/20	100,000.000	123,035.000	
		IRISH 5.9 10/18/19	200,000.000	246,230.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	2,600,000.000	2,730,910.000	
		ITALY BTPS 2.75 11/15/16	1,500,000.000	1,548,900.000	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,150,000.000	1,327,778.500	
		ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,500,000.000	2,902,750.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	400,000.000	548,300.000	
		SPAIN 2.1 04/30/17	3,000,000.000	3,100,200.000	
		SPAIN 2.75 10/31/24	700,000.000	746,900.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	380,000.000	534,546.000	
	ユーロ 小計		31,700,000.000 (4,363,822,000)	35,629,558.800 (4,904,765,064)	
	南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	4,500,000.000	4,351,635.000	
		SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	2,000,000.000	1,918,240.000	
	南アフリカ・ランド 小計		6,500,000.000 (58,500,000)	6,269,875.000 (56,428,875)	
国債証券 合計			9,896,542,200 (9,896,542,200)	10,886,200,156 (10,886,200,156)	
特殊債券	アメリカ・ドル	EIB 5.125 05/30/17	3,000,000.000	3,223,500.000	
		KFW 4.875 06/17/19	1,000,000.000	1,131,980.000	
	アメリカ・ドル 小計		4,000,000.000 (475,600,000)	4,355,480.000 (517,866,572)	
特殊債券 合計			475,600,000 (475,600,000)	517,866,572 (517,866,572)	
合計			10,372,142,200 (10,372,142,200)	11,404,066,728 (11,404,066,728)	

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 17銘柄	37.10%	42.31%
	特殊債券 2銘柄	4.46%	
イギリス・ポンド	国債証券 9銘柄	8.58%	8.73%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄	1.52%	1.55%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	2.08%	2.11%
シンガポール・ドル	国債証券 3銘柄	0.37%	0.38%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.46%	0.47%
メキシコ・ペソ	国債証券 4銘柄	0.93%	0.95%
ユーロ	国債証券 28銘柄	42.26%	43.01%
南アフリカ・ランド	国債証券 2銘柄	0.49%	0.49%

（注）「組入時価比率」は、純資産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

「（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。

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27年8月31日現在

資産総額	3,543,266,325円
負債総額	939,392円
純資産総額（ - ）	3,542,326,933円
発行済数量	2,968,040,860口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1935円

バランス物語50（安定・成長型）

平成27年8月31日現在

資産総額	1,591,764,892円
負債総額	1,672,492円
純資産総額（ - ）	1,590,092,400円
発行済数量	1,256,015,841口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2660円

バランス物語70（成長型）

平成27年8月31日現在

資産総額	905,809,202円
負債総額	238,147円
純資産総額（ - ）	905,571,055円
発行済数量	690,114,874口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3122円

（参考）

D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	23,581,862,118円
負債総額	206,368,645円
純資産総額（ - ）	23,375,493,473円
発行済数量	10,682,888,625口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1881円

D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	33,619,192,689円
負債総額	360,000,000円
純資産総額（ - ）	33,259,192,689円
発行済数量	22,683,208,983口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4662円

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27年8月31日現在

資産総額	9,811,823,478円
負債総額	152,312,059円
純資産総額(-)	9,659,511,419円
発行済数量	4,077,120,898口
1口当たり純資産額(/)	2.3692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27年8月31日現在

資産総額	11,960,124,800円
負債総額	265,951,421円
純資産総額(-)	11,694,173,379円
発行済数量	4,743,602,077口
1口当たり純資産額(/)	2.4653円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(5) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

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】

(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

会社の意思決定機構

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

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

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

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

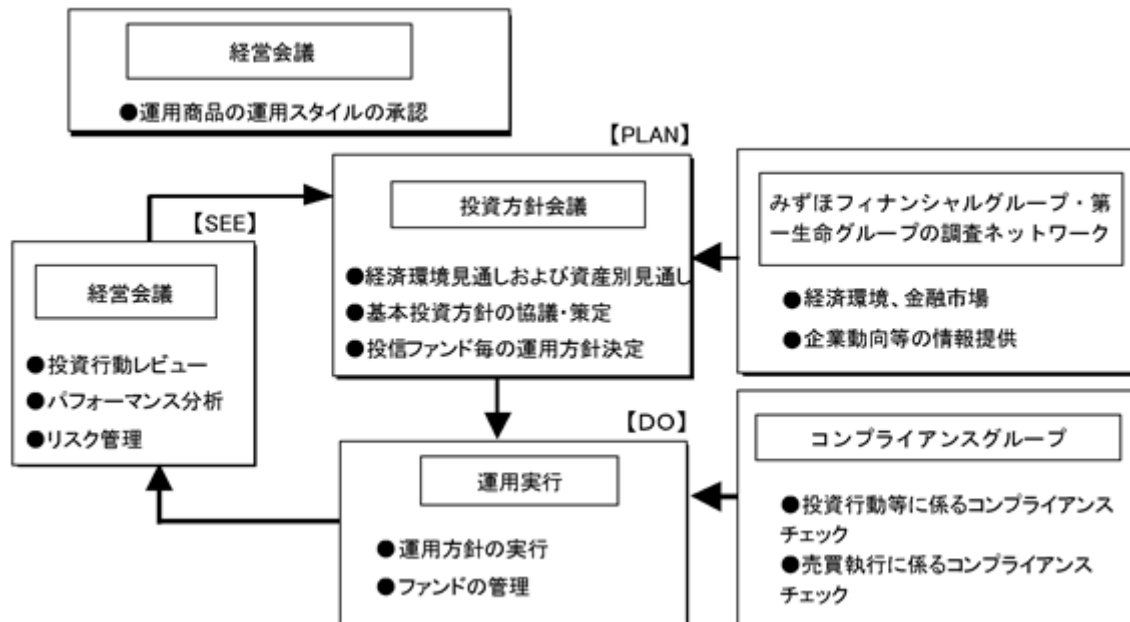
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成27年8月31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】

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

平成27年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は377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	5	22,940,325,967
追加型株式投資信託	341	5,696,703,539,881
単位型公社債投資信託	31	246,234,027,023
追加型公社債投資信託	0	0
合計	377	5,965,877,892,871

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	617,159	613,137
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（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	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
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	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	15,024		17,346	
受取利息	2,318		2,404	
時効成立分配金・償還金	33,872		974	
為替差益	-		652	
雑収入	4,746		1,822	
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損	7,364		-	
金銭の信託運用損	213,744		163,033	
時効成立後支払分配金・償還金	-		65	
外国税支払損失	-		47,515	
雑損失	10,952		-	
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
会計方針の変 更による累積 的影響額									
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金の 積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
会計方針の変 更による累積 的影響額		
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の配当		3,096,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	139,391	139,391
当期変動額合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(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>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</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。
6. 引当金の計上基準	<p>(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>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</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>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ9,168千円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

2. 関係会社項目

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

（千円）

		第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

（株主資本等変動計算書関係）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成27年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

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

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
会計方針の変更による累積的影響額	-	203,600
会計方針の変更を反映した期首残高	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
過去勤務費用の発生額	24,260	-
退職給付債務の期末残高	1,079,828	973,035

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

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840	174,402

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり
ます。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102 億円	生命保険業	(被所有) 直接 50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431 億円	生命保険業	(被所有) 直接 50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	2,217,439 551,351 2,139	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	306,365 11,276,198 71
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	407,531 8,540	未払 費用 未払金	240,725 6,501
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額) 信託報酬の 支払	3,500,000 8,254	金銭の 信託	14,169,657

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（1株当たり情報）

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（注3）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の実行の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3) (4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・公告の方法の変更(電子公告(ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。)に変更)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成27年3月末日現在 324,279百万円

c. 事業の内容

日本において信託業務および銀行業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行(1)	1,404,000	日本において銀行業務を営んでおります。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成27年3月末日現在

(1) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金・収益分配金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2) 目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3) 請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4) ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。
（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：バラ物語30、バラ物語50、バラ物語70）

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語30（安定型）の平成27年2月26日から平成27年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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27年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成27年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語50（安定・成長型）の平成27年2月26日から平成27年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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27年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成27年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス物語70（成長型）の平成27年2月26日から平成27年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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27年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。