

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券届出書の訂正届出書

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成28年5月25日

**【発行者名】** D I A Mアセットマネジメント株式会社

**【代表者の役職氏名】** 代表取締役社長 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。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書の提出に伴い、平成27年11月25日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

## 2【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第一部【証券情報】

## (4)【発行（売出）価格】

<訂正前>

(略)

<基準価額の照会方法等>

(略)

(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）：バラ物語30、  
バランス物語50（安定・成長型）：バラ物語50、バランス物語70（成長型）：バラ物語70)

<訂正後>

(略)

<基準価額の照会方法等>

(略)

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成27年8月31日現在）

(略)

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%

&lt;訂正後&gt;

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成28年2月29日現在）

(略)

大株主の状況

(平成28年2月29日現在)

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

## 2【投資方針】

## (2)【投資対象】

&lt;訂正前&gt;

(略)

(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
	(略)
ポートフォリオ構築プロセス	(略) 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。
	(略)

ファンド名	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド
	(略)
ポートフォリオ構築プロセス	(略) 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。
	(略)

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
	(略)
ポートフォリオ構築プロセス	(略) 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。
	(略)

ファンド名	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
(略)	
ポートフォリオ構築プロセス	(略) 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。
(略)	

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。

<訂正後>

(略)

(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
(略)	
ポートフォリオ構築プロセス	(略) 上記は、平成28年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
(略)	

ファンド名	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド
(略)	
ポートフォリオ構築プロセス	(略) 上記は、平成28年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
(略)	

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
(略)	
ポートフォリオ構築プロセス	(略) 上記は、平成28年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
(略)	

ファンド名	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
(略)	

ポートフォリオ構築プロセス	(略) 上記は、平成28年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
(略)	

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】

<訂正前>

(略)

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。

<訂正後>

(略)

上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3 【投資リスク】

<運用評価・運用リスク管理体制>

<訂正前>

(略)

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。

<訂正後>

(略)

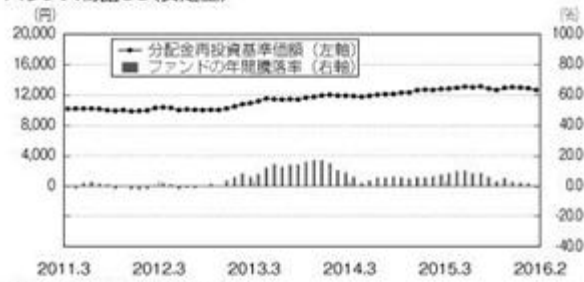
上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

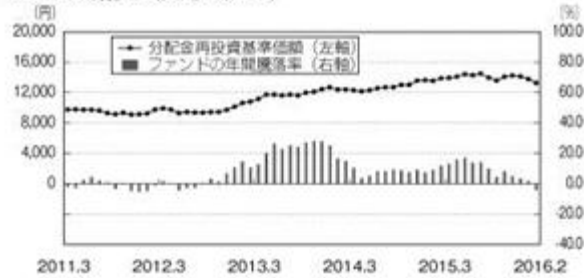
<更新・訂正後>

**(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**

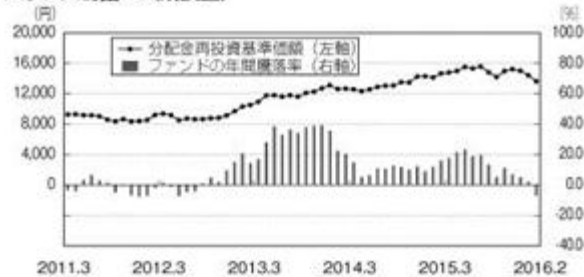
## バランス物語30(安定型)



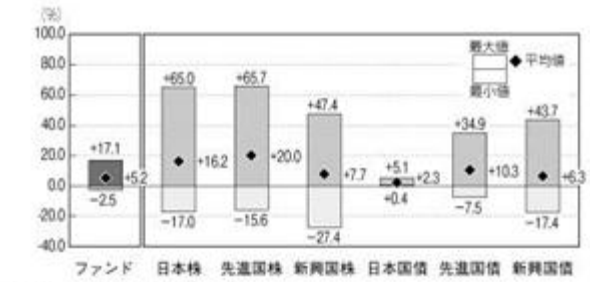
## バランス物語50(安定・成長型)



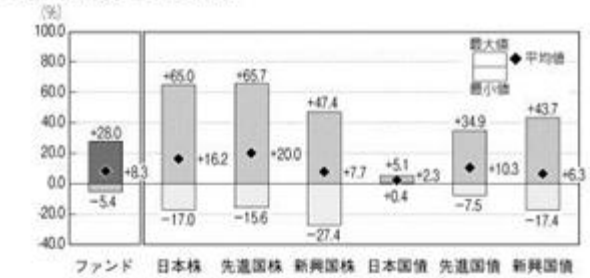
## バランス物語70(成長型)



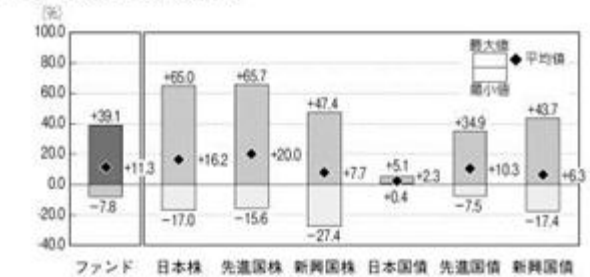
- \*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- \*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

**ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較**

## 2011年3月～2016年2月



## 2011年3月～2016年2月



## 2011年3月～2016年2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・ディバーシファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(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、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、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、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

&lt;訂正前&gt;

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
（略）	

（略）

&lt;訂正後&gt;

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%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
（略）		

（略）

## (4)【その他の手数料等】

&lt;訂正前&gt;

（略）

その他の費用

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

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。

（略）

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。

&lt;訂正後&gt;

（略）

その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

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、信託財産から支払われます。

（略）

- 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、信託財産から支払われます。
- 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。  
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。  
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。

#### (5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

(略)

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。

(略)

< 訂正後 >

(略)



### 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ならびに特定公社債等（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。

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアN I S A」をご利用の場合

N I S AおよびジュニアN I S Aは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額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一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、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。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。

上記は、平成28年4月1日現在のものです。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。

（略）

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

バランス物語30（安定型）

平成28年2月29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	3,178,133,987	98.15
内 日本	3,178,133,987	98.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	59,878,899	1.85
純資産総額	3,238,012,886	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28年2月29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	1,390,634,258	98.32
内 日本	1,390,634,258	98.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	23,808,923	1.68
純資産総額	1,414,443,181	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28年2月29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	774,027,449	98.09
内 日本	774,027,449	98.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,063,159	1.91
純資産総額	789,090,608	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）

D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	21,300,985,100	98.81
内 日本	21,300,985,100	98.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	256,454,707	1.19
純資産総額	21,557,439,807	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28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	12,981,170,840	43.70
内 日本	12,981,170,840	43.70
社債券	15,622,782,450	52.59
内 日本	14,617,936,450	49.21
内 アメリカ	403,232,000	1.36
内 韓国	300,285,000	1.01
内 フランス	201,338,000	0.68
内 イギリス	99,991,000	0.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,103,544,153	3.71
純資産総額	29,707,497,443	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28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	8,701,294,754	96.60
内 アメリカ	5,768,031,504	64.04
内 イギリス	636,634,167	7.07
内 ドイツ	447,730,251	4.97
内 フランス	438,665,711	4.87
内 スイス	324,072,297	3.60
内 アイルランド	264,765,677	2.94
内 オランダ	192,118,030	2.13
内 カナダ	159,327,007	1.77
内 デンマーク	112,051,914	1.24
内 ベルギー	64,759,301	0.72
内 イタリア	53,413,460	0.59
内 スペイン	52,299,069	0.58
内 ジョージア	43,842,344	0.49
内 オーストラリア	42,215,878	0.47
内 シンガポール	30,202,544	0.34
内 香港	23,177,817	0.26
内 ケイマン諸島	22,940,973	0.25
内 スウェーデン	14,237,353	0.16
内 イスラエル	10,809,457	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	305,994,474	3.40
純資産総額	9,007,289,228	100.00

## その他資産の投資状況

平成28年2月29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）	418,965,900	4.65
-	418,965,900	4.65

（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28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	9,888,101,834	94.02
内 アメリカ	4,035,437,953	38.37
内 イタリア	1,457,784,473	13.86
内 フランス	1,028,333,283	9.78
内 イギリス	807,232,485	7.68
内 スペイン	716,363,222	6.81
内 ドイツ	531,888,041	5.06
内 オーストラリア	389,419,740	3.70
内 ベルギー	268,925,220	2.56
内 オーストリア	166,067,681	1.58
内 メキシコ	137,398,171	1.31
内 アイルランド	86,211,706	0.82
内 デンマーク	70,568,680	0.67
内 ポーランド	57,165,905	0.54
内 マレーシア	49,636,406	0.47
内 スウェーデン	48,863,201	0.46
内 シンガポール	36,805,667	0.35
特殊債券	484,683,604	4.61
内 国際機関	358,073,430	3.40
内 ドイツ	126,610,174	1.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	144,486,533	1.37
純資産総額	10,517,271,971	100.00

## その他資産の投資状況

平成28年2月29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）	1,064,027,412	10.12
-	1,064,027,412	10.12
為替予約取引（売建）	958,769,658	9.12
-	958,769,658	9.12

（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28年2月29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	1,393,357,454	1.5323 2,135,180,962	1.5327 2,135,598,969	- -	65.95%
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	324,078,118	1.9146 620,482,049	1.9103 619,086,428	- -	19.12%
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	111,344,841	2.3229 258,652,353	2.3403 260,580,331	- -	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	78,710,738	2.0205 159,039,749	2.0692 162,868,259	- -	5.03%

（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28年2月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.15%
合計	98.15%

（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28年2月29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	400,789,087	1.5323 614,169,196	1.5327 614,289,433	- -	43.43%
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	224,068,820	1.9143 428,949,378	1.9103 428,038,666	- -	30.26%
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 日本	親投資信託受益証券	85,421,058	2.0202 172,569,768	2.0692 176,753,253	- -	12.50%
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 日本	親投資信託受益証券	73,303,810	2.3227 170,268,025	2.3403 171,552,906	- -	12.13%

（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28年2月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.32%
合計	98.32%

（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28年2月29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	165,271,851	1.9141 316,355,419	1.9103 315,718,816	- -	40.01%
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	113,391,623	1.5323 173,761,323	1.5327 173,795,340	- -	22.02%
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	75,848,801	2.0192 153,157,463	2.0692 156,946,339	- -	19.89%
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	54,508,804	2.3230 126,624,141	2.3403 127,566,954	- -	16.17%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.09%
合計	98.09%

（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28年2月29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	117,600	8,051.23 946,824,909	5,897.00 693,487,200	- -	3.22%
2	K D D I 日本	株式 情報・通信業	233,000	2,743.49 639,233,800	2,878.00 670,574,000	- -	3.11%
3	三菱U F Jフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	1,290,000	768.95 991,947,746	486.60 627,714,000	- -	2.91%
4	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	155,000	4,114.93 637,815,350	3,696.00 572,880,000	- -	2.66%
5	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	101,500	6,689.87 679,022,007	5,574.00 565,761,000	- -	2.62%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	113,000	3,787.83 428,025,854	4,806.00 543,078,000	- -	2.52%
7	日本電産 日本	株式 電気機器	67,300	7,667.58 516,028,780	7,567.00 509,259,100	- -	2.36%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	158,000	4,705.50 743,469,094	3,164.00 499,912,000	- -	2.32%
9	三井不動産 日本	株式 不動産業	190,000	3,427.04 651,139,100	2,623.00 498,370,000	- -	2.31%
10	ウエルシアホールディングス 日本	株式 小売業	83,200	4,582.94 381,300,760	5,580.00 464,256,000	- -	2.15%
11	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	21,500	22,046.72 474,004,589	20,215.00 434,622,500	- -	2.02%
12	塩野義製薬 日本	株式 医薬品	88,800	4,044.84 359,182,317	4,835.00 429,348,000	- -	1.99%
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	102,300	4,419.67 452,132,938	3,936.00 402,652,800	- -	1.87%
14	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	95,000	4,492.48 426,786,251	3,953.00 375,535,000	- -	1.74%
15	エムスリー 日本	株式 サービス業	134,800	2,609.85 351,807,940	2,689.00 362,477,200	- -	1.68%
16	日本M & Aセンター 日本	株式 サービス業	67,200	3,966.21 266,529,647	5,340.00 358,848,000	- -	1.66%
17	ニトリホールディングス 日本	株式 小売業	39,600	8,277.34 327,782,664	8,670.00 343,332,000	- -	1.59%
18	小糸製作所 日本	株式 電気機器	68,900	3,932.38 270,941,068	4,975.00 342,777,500	- -	1.59%
19	オリックス 日本	株式 その他金融業	226,000	1,740.67 393,393,409	1,477.00 333,802,000	- -	1.55%
20	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	73,000	3,832.11 279,744,497	4,490.00 327,770,000	- -	1.52%
21	S C S K 日本	株式 情報・通信業	75,200	3,411.44 256,540,369	4,335.00 325,992,000	- -	1.51%



22	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	71,200	4,922.16 350,458,090	4,495.00 320,044,000	- -	1.48%
23	I Tホールディングス 日本	株式 情報・通信業	121,500	2,558.91 310,908,248	2,595.00 315,292,500	- -	1.46%
24	積水ハウス 日本	株式 建設業	169,000	1,820.17 307,608,978	1,839.00 310,791,000	- -	1.44%
25	阪急阪神ホールディングス 日本	株式 陸運業	422,000	731.98 308,898,110	723.00 305,106,000	- -	1.42%
26	東ソー 日本	株式 化学	685,000	592.06 405,561,590	429.00 293,865,000	- -	1.36%
27	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	270,000	1,199.65 323,907,099	1,024.50 276,615,000	- -	1.28%
28	住友大阪セメント 日本	株式 ガラス・土石製品	669,000	363.24 243,011,600	412.00 275,628,000	- -	1.28%
29	キーエンス 日本	株式 電気機器	4,600	64,047.49 294,618,460	58,410.00 268,686,000	- -	1.25%
30	A D E K A 日本	株式 化学	179,000	1,547.59 277,019,460	1,496.00 267,784,000	- -	1.24%

(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28年2月29日現在

種類	投資比率
株式	98.81%
合計	98.81%

(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28年2月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
情報・通信業	国内	15.62%
電気機器		12.18%
輸送用機器		9.13%
小売業		8.25%
医薬品		6.10%
銀行業		5.89%
化学		5.24%
陸運業		4.39%
食料品		4.37%
サービス業		4.31%
卸売業		3.58%
建設業		3.20%
不動産業		2.82%
精密機器		2.63%
ガラス・土石製品		2.18%
保険業		1.87%
ゴム製品		1.74%
その他金融業		1.55%
機械		1.33%
鉄鋼		1.20%
その他製品	0.80%	
金属製品	0.44%	
合計		98.81%

(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28年2月29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	1,332,000,000	113.01 1,505,293,200	127.63 1,700,151,480	2.000000 2040/9/20	5.72%
2	145回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	1,235,000,000	111.59 1,378,240,970	122.42 1,511,911,700	1.700000 2033/6/20	5.09%
3	119回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	628,000,000	119.41 749,908,180	122.92 771,994,120	1.800000 2030/6/20	2.60%
4	473回 東北電力社債 日本	社債券	750,000,000	101.50 761,261,100	102.01 765,105,000	0.597000 2021/4/23	2.58%
5	140回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	612,000,000	112.90 690,986,800	122.36 748,886,040	1.700000 2032/9/20	2.52%
6	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	700,000,000	102.29 716,097,000	105.54 738,780,000	0.500000 2024/9/20	2.49%
7	44回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証券	521,000,000	105.59 550,136,740	121.06 630,722,600	1.700000 2044/9/20	2.12%
8	120回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	600,000,000	100.71 604,260,000	101.61 609,678,000	0.200000 2019/9/20	2.05%
9	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	101.49 608,976,000	0.870000 2025/12/16	2.05%
10	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	543,000,000	103.42 561,606,790	106.34 577,475,070	0.600000 2024/6/20	1.94%
11	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	109.30 546,525,000	1.809000 2022/9/27	1.84%
12	147回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	449,000,000	114.76 515,300,150	120.54 541,242,560	1.600000 2033/12/20	1.82%
13	8回 ジャックス社債 日本	社債券	500,000,000	103.09 515,455,000	103.64 518,235,000	1.130000 2020/6/19	1.74%
14	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	450,000,000	103.93 467,716,500	107.40 483,340,500	0.800000 2023/6/20	1.63%
15	131回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	395,000,000	111.77 441,515,140	122.07 482,188,350	1.700000 2031/9/20	1.62%
16	21回 トピー工業社債 日本	社債券	400,000,000	103.73 414,924,000	103.68 414,732,000	1.260000 2020/6/5	1.40%

17	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	100.80 403,232,000	0.557000 2018/5/22	1.36%
18	104回 丸紅社債 日本	社債券	400,000,000	99.75 399,019,000	100.27 401,084,000	0.227000 2019/12/25	1.35%
19	146回 利付国庫債券（2 0年） 日本	国債証券	327,000,000	110.07 359,928,900	122.32 400,002,750	1.700000 2033/9/20	1.35%
20	118回 利付国庫債券（5 年） 日本	国債証券	360,000,000	100.63 362,268,000	101.51 365,450,400	0.200000 2019/6/20	1.23%
21	76回 伊藤忠商事社債 日本	社債券	320,000,000	100.69 322,227,200	101.92 326,156,800	0.560000 2021/1/29	1.10%
22	17回 東京建物社債 日本	社債券	300,000,000	103.81 311,433,000	104.43 313,299,000	1.300000 2020/3/18	1.05%
23	28回 双日社債 日本	社債券	300,000,000	102.57 307,713,000	103.19 309,573,000	1.230000 2020/10/16	1.04%
24	12回 商船三井社債 日本	社債券	300,000,000	105.09 315,288,000	103.07 309,219,000	1.999000 2019/5/27	1.04%
25	12回 森ビル社債 日本	社債券	300,000,000	101.81 305,430,000	102.71 308,148,000	0.800000 2020/11/5	1.04%
26	66回 アコム社債 日本	社債券	300,000,000	101.08 303,246,000	101.94 305,835,000	0.900000 2021/2/26	1.03%
27	1回 オリエントコーポレー ション社債 日本	社債券	300,000,000	100.08 300,249,000	101.13 303,405,000	0.480000 2019/7/25	1.02%
28	13回 パナソニック社債 日本	社債券	300,000,000	100.24 300,722,000	101.08 303,264,000	0.568000 2022/3/18	1.02%
29	18回 三菱ケミカルホール ディングス社債 日本	社債券	300,000,000	100.00 300,000,000	100.74 302,220,000	0.281000 2020/12/3	1.02%
30	12回 ポスコ円貨社債 韓国	社債券	300,000,000	100.42 301,287,000	100.09 300,285,000	0.930000 2016/12/9	1.01%

（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28年2月29日現在

種類	投資比率
国債証券	43.70%
社債券	52.59%
合計	96.29%

（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28年2月29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	15,847	13,879.85 219,954,100	11,010.91 174,489,957	- -	1.94%
2	ALPHABET 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	1,839	66,852.26 122,941,315	82,358.59 151,457,452	- -	1.68%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	24,405	5,004.15 122,126,389	5,828.70 142,249,569	- -	1.58%
4	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	15,262	9,165.31 139,881,006	9,288.43 141,760,094	- -	1.57%
5	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	9,269	13,262.32 122,928,510	14,345.66 132,969,933	- -	1.48%
6	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	21,258	6,266.02 133,203,073	5,461.71 116,105,103	- -	1.29%
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	9,165	11,286.39 103,439,841	12,018.72 110,151,601	- -	1.22%
8	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	7,803	9,847.35 76,838,881	12,261.87 95,679,374	- -	1.06%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	14,581	6,911.20 100,772,321	6,537.69 95,326,127	- -	1.06%
10	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	8,617	10,207.46 87,957,741	9,583.84 82,584,009	- -	0.92%
11	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	24,698	3,098.02 76,514,929	3,340.42 82,501,890	- -	0.92%
12	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	18,170	3,780.11 68,684,775	4,218.71 76,653,971	- -	0.85%
13	ALTRIA GROUP INC アメリカ	株式 タバコ	10,954	6,210.58 68,030,748	6,992.17 76,592,282	- -	0.85%
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	8,990	8,524.89 76,638,784	8,027.77 72,169,719	- -	0.80%
15	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	1,127	48,113.56 54,223,983	63,085.23 71,097,057	- -	0.79%
16	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	26,133	2,884.60 75,383,275	2,575.45 67,304,287	- -	0.75%

17	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	11,575	5,525.83 63,961,506	5,796.89 67,099,029	- -	0.74%
18	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	7,906	7,638.99 60,393,907	8,263.58 65,331,884	- -	0.73%
19	DIAMONDBACK ENERGY INC アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	7,692	7,639.03 58,759,460	8,248.81 63,449,861	- -	0.70%
20	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	7,900	8,170.47 64,546,714	7,921.58 62,580,532	- -	0.69%
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	17,841	3,842.70 68,557,771	3,434.73 61,279,064	- -	0.68%
22	SYMRISE AG ドイツ	株式 化学	8,017	7,467.30 59,865,411	7,302.63 58,545,203	- -	0.65%
23	LACLEDE GROUP INC/THE アメリカ	株式 ガス	7,868	6,399.63 50,352,302	7,376.21 58,036,023	- -	0.64%
24	HONEYWELL INTERNATIONAL INC アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	4,930	11,719.95 57,779,369	11,706.26 57,711,904	- -	0.64%
25	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	8,707	6,697.61 58,316,110	6,579.73 57,289,745	- -	0.64%
26	ATMOS ENERGY CORP アメリカ	株式 ガス	7,142	6,600.44 47,140,389	7,970.44 56,924,903	- -	0.63%
27	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP アメリカ	株式 保険	11,670	4,921.69 57,436,165	4,866.34 56,790,241	- -	0.63%
28	DEUTSCHE BOERSE AG ドイツ	株式 各種金融サー ビス	5,674	9,946.13 56,434,342	9,709.12 55,089,576	- -	0.61%
29	CVS HEALTH CORP アメリカ	株式 食品・生活必 需品小売り	4,924	11,715.39 57,686,618	11,096.12 54,637,340	- -	0.61%
30	VINCI S.A. フランス	株式 建設・土木	6,904	7,431.22 51,305,208	7,869.81 54,333,203	- -	0.60%

(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28年2月29日現在

種類	投資比率
株式	96.60%
合計	96.60%

(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28年2月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品	外国	6.89%
石油・ガス・消耗燃料		6.54%
商業銀行		5.36%
食品		4.35%
ソフトウェア		4.30%
保険		4.17%
メディア		3.91%
航空宇宙・防衛		3.80%
専門小売り		3.26%
バイオテクノロジー		3.21%
インターネットソフトウェア・サービス		3.07%
半導体・半導体製造装置		3.05%
各種電気通信サービス		3.03%
飲料		2.66%
化学		2.64%
タバコ		2.42%
情報技術サービス		2.41%
食品・生活必需品小売り		2.16%
ヘルスケア機器・用品		2.13%
ガス		2.10%
コンピュータ・周辺機器		1.94%
コングロマリット		1.91%
通信機器		1.84%
各種金融サービス		1.74%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.62%
建設・土木		1.29%
ホテル・レストラン・レジャー		1.26%
総合公益事業		1.24%
家庭用品		1.20%
インターネット販売・カタログ販売		1.15%
建設資材		1.10%
繊維・アパレル・贅沢品		1.02%
電子装置・機器・部品		0.85%
無線通信サービス		0.73%
金属・鉱業		0.66%
電力		0.65%
機械		0.62%
電気設備		0.55%
建設関連製品		0.52%
複合小売り		0.51%
専門サービス		0.48%
家庭用耐久財		0.43%
陸運・鉄道		0.43%
水道		0.30%
自動車		0.25%
資本市場		0.24%
パーソナル用品		0.21%

レジャー用品		0.20%
容器・包装		0.20%
合計		96.60%

(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28年2月29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 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	658,996,000	100.62 663,102,283	101.32 667,747,466	1.375000 2018/9/30	6.35%
2	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	539,695,000	100.93 544,751,942	101.64 548,589,173	1.500000 2018/12/31	5.22%
3	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	486,293,600	101.26 492,446,224	102.84 500,118,927	1.875000 2020/6/30	4.76%
4	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	396,533,800	101.70 403,310,308	105.41 418,002,139	2.375000 2024/8/15	3.97%
5	ITALY BTPS 2.5 12/01/24 イタリア	国債証券	378,535,500	106.44 402,922,804	109.29 413,724,160	2.500000 2024/12/1	3.93%
6	ITALY BTPS 4.5 02/01/20 イタリア	国債証券	310,275,000	117.15 363,503,048	116.40 361,191,127	4.500000 2020/2/1	3.43%
7	EIB 5.125 05/30/17 国際機関	特殊債券	340,860,000	108.50 369,833,100	105.05 358,073,430	5.125000 2017/5/30	3.40%
8	US T N/B 1.375 09/30/20 アメリカ	国債証券	335,179,000	98.76 331,028,540	100.62 337,273,868	1.375000 2020/9/30	3.21%
9	US T N/B 3.125 02/15/42 アメリカ	国債証券	272,688,000	102.64 279,908,778	111.49 304,025,304	3.125000 2042/2/15	2.89%
10	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	272,688,000	98.49 268,573,650	102.00 278,160,848	2.000000 2025/8/15	2.64%
11	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 ドイツ	国債証券	235,809,000	98.89 233,203,931	104.20 245,736,558	0.500000 2025/2/15	2.34%
12	US T N/B 0.625 02/15/17 アメリカ	国債証券	243,146,800	99.82 242,714,185	99.96 243,059,267	0.625000 2017/2/15	2.31%
13	ITALY BTPS 0.75 01/15/18 イタリア	国債証券	235,188,450	101.42 238,539,153	101.42 238,544,589	0.750000 2018/1/15	2.27%
14	FRANCE OAT 4.0 10/25/38 フランス	国債証券	155,758,050	147.95 230,444,754	151.98 236,730,429	4.000000 2038/10/25	2.25%
15	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23 オーストラリア	国債証券	174,852,000	120.42 210,567,479	121.85 213,065,904	5.500000 2023/4/21	2.03%
16	SPAIN 1.6 04/30/25 スペイン	国債証券	207,263,700	98.54 204,248,248	100.78 208,884,502	1.600000 2025/4/30	1.99%
17	FRANCE OAT 1.0 05/25/19 フランス	国債証券	198,576,000	103.37 205,271,982	104.35 207,223,984	1.000000 2019/5/25	1.97%
18	UK TREASURY 3.25 01/22/44 イギリス	国債証券	170,909,200	113.70 194,338,795	118.21 202,048,856	3.250000 2044/1/22	1.92%
19	SPAIN 1.15 07/30/20 スペイン	国債証券	184,303,350	101.68 187,404,722	102.57 189,052,847	1.150000 2020/7/30	1.80%
20	ITALY BTPS 3.75 09/01/24 イタリア	国債証券	152,655,300	116.55 177,929,718	119.35 182,195,627	3.750000 2024/9/1	1.73%



21	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	159,068,000	102.60 163,205,358	104.63 166,448,755	2.250000 2021/3/31	1.58%
22	SPAIN 2.1 04/30/17 スペイン	国債証券	152,655,300	103.96 158,706,556	102.47 156,428,939	2.100000 2017/4/30	1.49%
23	US T N/B 3.0 11/15/44 アメリカ	国債証券	140,320,700	101.44 142,351,045	107.65 151,063,652	3.000000 2044/11/15	1.44%
24	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 オーストラリア	国債証券	134,377,000	106.02 142,477,035	111.79 150,232,142	3.750000 2037/4/21	1.43%
25	UK TREASURY 2.0 07/22/20 イギリス	国債証券	129,166,400	103.60 133,824,234	105.63 136,442,343	2.000000 2020/7/22	1.30%
26	FRANCE OAT 3.75 04/25/21 フランス	国債証券	111,699,000	120.24 134,309,111	120.39 134,480,011	3.750000 2021/4/25	1.28%
27	ITALY BTPS 4.75 09/01/44 イタリア	国債証券	87,497,550	140.85 123,240,516	144.73 126,638,704	4.750000 2044/9/1	1.20%
28	KFW 4.875 06/17/19 ドイツ	特殊債券	113,620,000	113.38 128,822,356	111.43 126,610,174	4.875000 2019/6/17	1.20%
29	US T N/B 4.375 05/15/40 アメリカ	国債証券	90,896,000	125.38 113,974,494	135.03 122,737,777	4.375000 2040/5/15	1.17%
30	FRANCE OAT 0.5 05/25/25 フランス	国債証券	120,386,700	94.63 113,922,840	100.74 121,281,173	0.500000 2025/5/25	1.15%

(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28年2月29日現在

種類	投資比率
国債証券	94.02%
特殊債券	4.61%
合計	98.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資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28年2月29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2016年03月	買建	3,600,000	406,844,640	408,996,000	4.54%
		カナダ・ドル買/円売 2016年03月	買建	90,000	7,514,460	7,542,000	0.08%
		オーストラリア・ドル 買/円売2016年0 3月	買建	30,000	2,456,880	2,427,900	0.03%

（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28年2月29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2016年04月	買建	4,740,000	593,442,699	588,139,200	5.59%
		カナダ・ドル買/円売2016年04月	買建	2,710,000	221,840,600	226,854,100	2.16%
		イギリス・ポンド買/円売2016年04月	買建	695,816	108,495,200	109,486,647	1.04%
		アメリカ・ドル買/円売2016年03月	買建	505,264	57,188,063	57,402,810	0.55%
		スイス・フラン買/円売2016年04月	買建	270,000	30,762,180	30,777,300	0.29%
		ノルウェー・クローネ買/円売2016年04月	買建	2,280,000	29,893,080	29,799,600	0.28%
		ユーロ買/円売2016年03月	買建	95,480	11,884,609	11,849,185	0.11%
		デンマーク・クローネ買/円売2016年03月	買建	331,384	5,528,493	5,510,930	0.05%
		イギリス・ポンド買/円売2016年03月	買建	26,713	4,246,255	4,207,640	0.04%
		オーストラリア・ドル売/円買2016年04月	売建	4,090,000	326,897,340	330,103,900	3.14%
		アメリカ・ドル売/円買2016年04月	売建	2,305,763	259,229,349	261,658,087	2.49%
		イギリス・ポンド売/円買2016年04月	売建	1,360,000	219,645,440	213,996,000	2.03%
		ユーロ売/円買2016年04月	売建	880,000	108,495,200	109,190,400	1.04%
		メキシコ・ペソ売/円買2016年04月	売建	6,270,000	38,403,750	38,811,300	0.37%
オーストラリア・ドル売/円買2016年03月	売建	61,905	5,043,059	5,009,971	0.05%		

(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28年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

バランス物語 3 0（安定型）

	純資産総額 (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
第30計算期間末 (平成28年2月25日)	3,231	3,234	1.1737	1.1747

平成27年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	-
9月末日	3,468	-	1.1755	-
10月末日	3,502	-	1.2018	-
11月末日	3,487	-	1.2093	-
12月末日	3,381	-	1.2059	-
平成28年1月末日	3,313	-	1.1963	-
2月末日	3,238	-	1.1752	-

## 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
第30計算期間末 (平成28年2月25日)	1,408	1,411	1.1965	1.1985
平成27年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	-
9月末日	1,533	-	1.2308	-
10月末日	1,581	-	1.2776	-
11月末日	1,585	-	1.2917	-
12月末日	1,531	-	1.2801	-
平成28年1月末日	1,485	-	1.2495	-
2月末日	1,414	-	1.2003	-

## 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
第30計算期間末 (平成28年2月25日)	783	785	1.1987	1.2017
平成27年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	-
9月末日	842	-	1.2582	-
10月末日	888	-	1.3279	-
11月末日	898	-	1.3497	-
12月末日	870	-	1.3295	-
平成28年1月末日	836	-	1.2789	-
2月末日	789	-	1.2048	-

## 【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
第30計算期間	0.0010



## バランス物語50（安定・成長型）

	1口当たりの分配金(円)
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
第30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
第30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
第30計算期間	0.1

（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
第30計算期間	2.7

（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
第30計算期間	4.7

（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
第30計算期間	10,441,382	224,677,722

（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50（安定・成長型）

	設定口数	解約口数
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
第30計算期間	9,166,656	87,144,799

（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
第30計算期間	11,201,078	45,919,897

（注）本邦外における設定及び解約はございません。

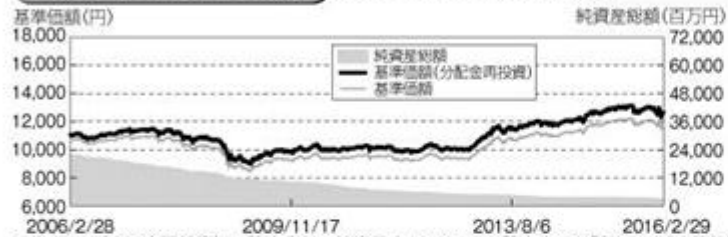


&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2016年2月29日

## バランス物語30(安定型)

## 基準価額・純資産の推移 (2006年2月28日～2016年2月29日)



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

## 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	65.95%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	19.12%
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	5.03%

※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

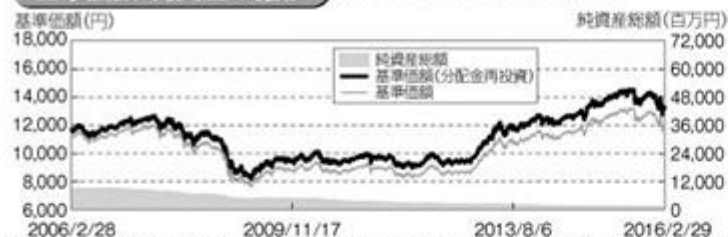


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

※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、2016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 (2006年2月28日～2016年2月29日)



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

## 主要な資産の状況

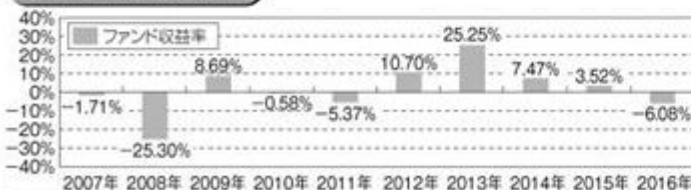
(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	43.43%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	30.26%
3	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	12.50%
4	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	12.13%

※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、2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 分配の推移(税引前)

第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
第30期	(2016.02.25)	10円
設定来累計		755円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 分配の推移(税引前)

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
第30期	(2016.02.25)	20円
設定来累計		1,015円

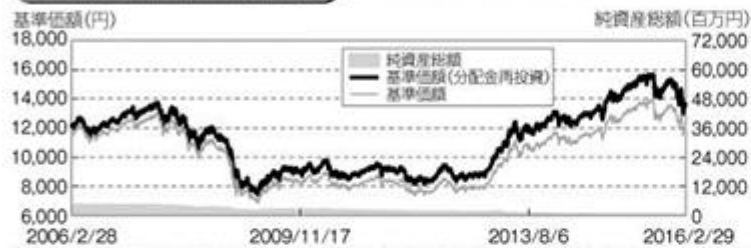
(注)分配金は1万口当たりです。

データの基準日：2016年2月29日

## バランス物語70(成長型)

## 基準価額・純資産の推移

(2006年2月28日～2016年2月29日)



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

## 分配の推移(税引前)

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
第30期	(2016.02.25)	30円
設定来累計		1,240円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	40.01%
2	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	22.02%
3	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	19.89%
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	16.17%

※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、2016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	98.81
内 日本	98.81
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.19
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	3.22%
2	KDDI	株式	日本	情報・通信業	3.11%
3	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.91%
4	富士重工業	株式	日本	輸送用機器	2.66%
5	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.62%
6	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	2.52%
7	日本電産	株式	日本	電気機器	2.36%
8	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.32%
9	三井不動産	株式	日本	不動産業	2.31%
10	ウエルシアホールディングス	株式	日本	小売業	2.15%

## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	情報・通信業	15.62%
2	電気機器	12.18%
3	輸送用機器	9.13%
4	小売業	8.25%
5	医薬品	6.10%

○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：2016年2月29日

## ■DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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	43.70
内 日本	43.70
社債券	52.59
内 日本	49.21
内 アメリカ	1.36
内 韓国	1.01
内 フランス	0.68
内 イギリス	0.34
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.71
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	5.72%
2	145回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.700000	2033/6/20	5.09%
3	119回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.800000	2030/6/20	2.60%
4	473回 東北電力社債	社債券	日本	0.597000	2021/4/23	2.58%
5	140回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.700000	2032/9/20	2.52%
6	335回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.500000	2024/9/20	2.49%
7	44回 利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	1.700000	2044/9/20	2.12%
8	120回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/9/20	2.05%
9	10回 西日本シティ銀行定期償還証券付社債	社債券	日本	0.870000	2025/12/16	2.05%
10	334回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/6/20	1.94%

## ■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	96.60
内 アメリカ	64.04
内 イギリス	7.07
内 ドイツ	4.97
内 フランス	4.87
内 スイス	3.60
内 その他	12.05
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.40
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	1.94%
2	ALPHABET 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	1.68%
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.58%
4	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.57%
5	HOME DEPOT INC	株式	アメリカ	専門小売り	1.48%
6	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	1.29%
7	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.22%
8	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	1.06%
9	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	1.06%
10	CHEVRON CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	0.92%

## 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)	4.65

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	医薬品	6.89%
2	石油・ガス・消耗燃料	6.54%
3	商業銀行	5.36%
4	食品	4.35%
5	ソフトウェア	4.30%

## ■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	94.02
内 アメリカ	38.37
内 イタリア	13.86
内 フランス	9.78
内 イギリス	7.68
内 スペイン	6.81
内 その他	17.52
特殊債券	4.61
内 国際機関	3.40
内 ドイツ	1.20
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.37
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 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	6.35%
2	US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	アメリカ	1.500000	2018/12/31	5.22%
3	US T N/B 1.875 06/30/20	国債証券	アメリカ	1.875000	2020/6/30	4.76%
4	US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	アメリカ	2.375000	2024/8/15	3.97%
5	ITALY BTPTS 2.5 12/01/24	国債証券	イタリア	2.500000	2024/12/1	3.93%
6	ITALY BTPTS 4.5 02/01/20	国債証券	イタリア	4.500000	2020/2/1	3.43%
7	EB 5.125 05/30/17	特殊債券	国際機関	5.125000	2017/5/30	3.40%
8	US T N/B 1.375 09/30/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/9/30	3.21%
9	US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	アメリカ	3.125000	2042/2/15	2.89%
10	US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	アメリカ	2.000000	2025/8/15	2.64%

## 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)	10.12
為替予約取引(売建)	△9.12

○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3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

#### 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30期計算期間（平成27年8月26日から平成28年2月25日まで）の財務諸表について、PwC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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	168,880,674
コール・ローン	121,973,273	-
親投資信託受益証券	3,403,496,729	3,093,355,113
流動資産合計	3,525,470,002	3,262,235,787
資産合計	3,525,470,002	3,262,235,787
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,967,561	2,753,324
未払解約金	4,715,002	-
未払受託者報酬	1,964,839	1,854,879
未払委託者報酬	27,508,282	25,968,869
その他未払費用	93,247	88,013
流動負債合計	37,248,931	30,665,085
負債合計	37,248,931	30,665,085
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,296,561,035	1,275,324,695
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	520,660,036	478,246,007
（分配準備積立金）	563,483,304	518,155,957
元本等合計	3,488,221,071	3,231,570,702
純資産合計	3,488,221,071	3,231,570,702
負債純資産合計	3,525,470,002	3,262,235,787

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第29期		第30期	
	自	平成27年2月26日 平成27年8月25日	自	平成27年8月26日 平成28年2月25日
営業収益				
受取利息		21,318		21,220
有価証券売買等損益		658,988		29,858,384
営業収益合計		680,306		29,879,604
営業費用				
受託者報酬		1,964,839		1,854,879
委託者報酬		27,508,282		25,968,869
その他費用		93,247		88,013
営業費用合計		29,566,368		27,911,761
営業利益又は営業損失（ ）		28,886,062		1,967,843
経常利益又は経常損失（ ）		28,886,062		1,967,843
当期純利益又は当期純損失（ ）		28,886,062		1,967,843
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		3,081,636		4,157,934
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		585,226,130		520,660,036
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,479,701		1,954,421
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,479,701		1,954,421
剰余金減少額又は欠損金増加額		32,110,536		39,425,035
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		32,110,536		39,425,035
分配金		1,296,561		1,275,324
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		520,660,036		478,246,007

## ( 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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	3,126,860,699円	2,967,561,035円
期中追加設定元本額	12,247,243円	10,441,382円
期中一部解約元本額	171,546,907円	224,677,722円
2 . 受益権の総数	2,967,561,035口	2,753,324,695口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	第30期 自 平成27年8月26日 至 平成28年2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(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。	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(36,675,078円)及び分配準備積立金(520,909,281円)より分配対象収益は557,584,359円(1万口当たり2,025.13円)であり、うち2,753,324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29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	第30期 自 平成27年8月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2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	13,066,313	25,426,798
合計	13,066,313	25,426,798

（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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.1755円	1.1737円
（1万口当たり純資産額）	(11,755円)	(11,737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28年2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	295,460,604	565,482,049	
	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	1,393,357,454	2,135,180,962	
	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	144,039,749	
	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	107,080,812	248,652,353	
親投資信託受益証券 合計		1,867,336,528	3,093,355,113	
合計		1,867,336,528	3,093,355,113	

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30期計算期間（平成27年8月26日から平成28年2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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	-	82,848,968
コール・ローン	58,750,991	-
親投資信託受益証券	1,505,339,868	1,340,956,367
流動資産合計	1,564,090,859	1,423,805,335
<b>資産合計</b>	1,564,090,859	1,423,805,335
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	2,510,763	2,354,807
未払解約金	1,651,600	137,488
未払受託者報酬	903,994	831,363
未払委託者報酬	12,656,570	11,639,750
その他未払費用	42,852	39,393
流動負債合計	17,765,779	15,002,801
<b>負債合計</b>	17,765,779	15,002,801
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1,255,381,648	1,177,403,505
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	290,943,432	231,399,029
（分配準備積立金）	316,402,823	292,187,719
元本等合計	1,546,325,080	1,408,802,534
<b>純資産合計</b>	1,546,325,080	1,408,802,534
<b>負債純資産合計</b>	1,564,090,859	1,423,805,335

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第29期		第30期	
	自	平成27年2月26日 平成27年8月25日	自	平成27年8月26日 平成28年2月25日
営業収益				
受取利息		10,421		9,106
有価証券売買等損益		7,974,258		24,383,501
営業収益合計		7,963,837		24,374,395
営業費用				
受託者報酬		903,994		831,363
委託者報酬		12,656,570		11,639,750
その他費用		42,852		39,393
営業費用合計		13,603,416		12,510,506
営業利益又は営業損失（ ）		21,567,253		36,884,901
経常利益又は経常損失（ ）		21,567,253		36,884,901
当期純利益又は当期純損失（ ）		21,567,253		36,884,901
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（ ）		4,221,734		2,400,198
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		350,775,000		290,943,432
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,286,193		2,300,298
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,286,193		2,300,298
剰余金減少額又は欠損金増加額		34,818,011		20,204,795
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		34,818,011		20,204,795
分配金		1 2,510,763		1 2,354,807
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		290,943,432		231,399,029

## ( 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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	1,380,874,045円	1,255,381,648円
期中追加設定元本額	11,523,560円	9,166,656円
期中一部解約元本額	137,015,957円	87,144,799円
2 . 受益権の総数	1,255,381,648口	1,177,403,505口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	第30期 自 平成27年8月26日 至 平成28年2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(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。	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(67,822,668円)及び分配準備積立金(294,542,526円)より分配対象収益は362,365,194円(1万口当たり3,077.66円)であり、うち2,354,807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29期	第30期
	自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	自 平成27年8月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2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	18,788,525	25,511,742
合計	18,788,525	25,511,742

（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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2318円 (12,318円)	1.1965円 (11,965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28年2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	211,060,859	403,949,378	
	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザ ーファンド	400,789,087	614,169,196	
	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	157,569,768	
	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	71,171,795	165,268,025	
親投資信託受益証券 合計		761,169,719	1,340,956,367	
合計		761,169,719	1,340,956,367	

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30期計算期間（平成27年8月26日から平成28年2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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	-	47,527,401
コール・ローン	37,818,263	-
親投資信託受益証券	840,212,945	744,898,346
流動資産合計	878,031,208	792,425,747
<b>資産合計</b>	878,031,208	792,425,747
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	2,064,852	1,960,695
未払解約金	708	-
未払受託者報酬	515,242	466,303
未払委託者報酬	7,213,941	6,528,840
その他未払費用	24,388	22,056
流動負債合計	9,819,131	8,977,894
<b>負債合計</b>	9,819,131	8,977,894
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1,688,284,130	1,653,565,311
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	179,927,947	129,882,542
（分配準備積立金）	207,612,637	191,900,158
元本等合計	868,212,077	783,447,853
<b>純資産合計</b>	868,212,077	783,447,853
<b>負債純資産合計</b>	878,031,208	792,425,747

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第29期		第30期	
	自	平成27年2月26日 平成27年8月25日	自	平成27年8月26日 平成28年2月25日
営業収益				
受取利息		6,026		4,982
有価証券売買等損益		10,691,887		30,314,599
営業収益合計		10,685,861		30,309,617
営業費用				
受託者報酬		515,242		466,303
委託者報酬		7,213,941		6,528,840
その他費用		24,388		22,056
営業費用合計		7,753,571		7,017,199
営業利益又は営業損失（ ）		18,439,432		37,326,816
経常利益又は経常損失（ ）		18,439,432		37,326,816
当期純利益又は当期純損失（ ）		18,439,432		37,326,816
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		3,554,587		2,037,378
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		222,768,872		179,927,947
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,210,860		3,294,635
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,210,860		3,294,635
剰余金減少額又は欠損金増加額		21,992,914		12,015,151
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		21,992,914		12,015,151
分配金		1,206,852		1,960,695
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		179,927,947		129,882,542

## ( 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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1 . 1 期首元本額	753,093,356円	688,284,130円
期中追加設定元本額	9,502,794円	11,201,078円
期中一部解約元本額	74,312,020円	45,919,897円
2 . 受益権の総数	688,284,130口	653,565,311口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第29期 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	第30期 自 平成27年8月26日 至 平成28年2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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（73,767,703円）及び分配準備積立金（193,860,853円）より分配対象収益は267,628,556円（1万口当たり4,094.90円）であり、うち1,960,695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29期	第30期
	自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	自 平成27年8月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2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	17,970,918	33,118,935
合計	17,970,918	33,118,935

（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29期 平成27年8月25日現在	第30期 平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2614円 (12,614円)	1.1987円 (11,987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28年2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	160,068,666	306,355,419	
	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	113,391,623	173,761,323	
	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	143,157,463	
	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	52,376,789	121,624,141	
親投資信託受益証券 合計		396,837,159	744,898,346	
合計		396,837,159	744,898,346	

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8月25日現在	平成28年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		174,487	218,135,029
コール・ローン		225,634,047	-
株式		21,228,732,050	20,240,533,480
未収入金		183,013,102	125,507,229
未収配当金		13,882,430	28,254,350
流動資産合計		21,651,436,116	20,612,430,088
資産合計		21,651,436,116	20,612,430,088
負債の部			
流動負債			
未払金		173,507,429	124,995,813
流動負債合計		173,507,429	124,995,813
負債合計		173,507,429	124,995,813
純資産の部			
元本等			
元本	1	10,591,138,440	10,704,549,483
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		10,886,790,247	9,782,884,792
元本等合計		21,477,928,687	20,487,434,275
純資産合計		21,477,928,687	20,487,434,275
負債純資産合計		21,651,436,116	20,612,430,088

## 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8月25日現在	平成28年2月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,725,225,416円	10,591,138,440円
	同期中追加設定元本額	10,426,659円	704,044,685円
	同期中一部解約元本額	2,144,513,635円	590,633,642円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30（安定型）	290,786,177円	295,460,604円
	バランス物語50（安定・成長型）	208,723,645円	211,060,859円
	バランス物語70（成長型）	160,557,835円	160,068,666円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	721,314,320円	782,852,728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	2,896,457,724円	3,148,233,356円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	3,495,052,688円	3,653,449,760円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	311,674,600円	274,820,172円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	1,254,391,628円	1,075,345,132円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	613,652,684円	537,538,618円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	162,908,930円	148,724,989円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	318,411,737円	272,623,473円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	157,206,472円	144,371,126円
	計	10,591,138,440円	10,704,549,483円
2 .	受益権の総数	10,591,138,440口	10,704,549,483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27年2月26日 至 平成27年8月25日	自 平成27年8月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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



（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年8月25日現在	平成28年2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	1,385,717,230	2,186,815,716
合計	1,385,717,230	2,186,815,716

（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27年3月17日から平成27年8月25日まで及び平成27年3月17日から平成28年2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8月25日現在	平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	2.0279円	1.9139円
（1万口当たり純資産額）	(20,279円)	(19,139円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成28年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
大林組	190,000	1,051.00	199,690,000	
西松建設	355,000	442.00	156,910,000	
積水ハウス	160,000	1,871.50	299,440,000	
日本M&Aセンター	63,600	5,220.00	331,992,000	
江崎グリコ	27,100	6,150.00	166,665,000	
新日鉄住金ソリューションズ	111,200	2,065.00	229,628,000	
エムスリー	127,800	2,757.00	352,344,600	
アサヒグループホールディングス	23,100	3,350.00	77,385,000	
大黒天物産	28,900	4,780.00	138,142,000	
味の素	75,000	2,829.00	212,175,000	
キュービー	52,500	2,566.00	134,715,000	
日本たばこ産業	69,300	4,481.00	310,533,300	
ウエルシアホールディングス	79,000	5,550.00	438,450,000	
セブン&アイ・ホールディングス	67,500	4,502.00	303,885,000	
I Tホールディングス	115,200	2,552.00	293,990,400	
G M Oペイメントゲートウェイ	18,700	6,560.00	122,672,000	
東ソー	650,000	432.00	280,800,000	
信越化学工業	19,900	5,877.00	116,952,300	
三菱ケミカルホールディングス	259,600	588.30	152,722,680	
ダイセル	103,000	1,477.00	152,131,000	
日立化成	70,200	1,857.00	130,361,400	
電通	11,700	5,340.00	62,478,000	
A D E K A	171,000	1,508.00	257,868,000	
武田薬品工業	41,000	5,415.00	222,015,000	
アステラス製薬	117,100	1,597.50	187,067,250	
塩野義製薬	88,800	4,839.00	429,703,200	
ロート製薬	116,300	2,089.00	242,950,700	
大塚ホールディングス	50,200	4,030.00	202,306,000	
アルファシステムズ	91,800	1,744.00	160,099,200	
楽天	123,600	1,028.50	127,122,600	
大塚商会	31,600	5,640.00	178,224,000	
ブリヂストン	90,000	4,044.00	363,960,000	
住友大阪セメント	623,000	423.00	263,529,000	
太平洋セメント	764,000	241.00	184,124,000	
新日鉄住金	64,500	1,969.50	127,032,750	
日立金属	97,700	1,211.00	118,314,700	
東京製綱	641,000	141.00	90,381,000	
富士ダイス	58,400	501.00	29,258,400	
C K D	53,700	803.00	43,121,100	
日本精工	193,600	1,028.00	199,020,800	
日立製作所	263,000	463.30	121,847,900	
日本電産	63,700	7,536.00	480,043,200	
日新電機	167,000	938.00	156,646,000	

富士通	189,000	414.90	78,416,100	
ソニー	74,200	2,383.00	176,818,600	
アルプス電気	117,700	1,807.00	212,683,900	
エスベック	65,500	1,319.00	86,394,500	
キーエンス	4,300	58,020.00	249,486,000	
カシオ計算機	106,500	2,039.00	217,153,500	
村田製作所	18,200	13,180.00	239,876,000	
日産自動車	257,000	968.70	248,955,900	
トヨタ自動車	111,300	5,931.00	660,120,300	
カルソニックカンセイ	154,000	818.00	125,972,000	
アイシン精機	34,600	4,615.00	159,679,000	
富士重工業	147,000	3,669.00	539,343,000	
ヤマハ発動機	70,800	1,670.00	118,236,000	
小糸製作所	65,300	4,970.00	324,541,000	
ガリバーインターナショナル	191,000	1,157.00	220,987,000	
シークス	16,200	2,860.00	46,332,000	
島津製作所	95,000	1,744.00	165,680,000	
スター精密	80,300	1,190.00	95,557,000	
H O Y A	47,600	4,090.00	194,684,000	
朝日インテック	33,000	5,030.00	165,990,000	
ヤマハ	52,000	3,195.00	166,140,000	
伊藤忠商事	85,200	1,384.00	117,916,800	
日立ハイテクノロジーズ	42,500	2,985.00	126,862,500	
三菱商事	75,200	1,880.00	141,376,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	108,800	1,942.00	211,289,600	
イズミ	9,300	4,270.00	39,711,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,222,000	487.40	595,602,800	
三井住友トラスト・ホールディングス	409,000	331.30	135,501,700	
三井住友フィナンシャルグループ	149,400	3,169.00	473,448,600	
オリックス	214,500	1,497.00	321,106,500	
東京海上ホールディングス	97,000	4,003.00	388,291,000	
三井不動産	180,000	2,651.50	477,270,000	
三菱地所	49,000	2,150.00	105,350,000	
東日本旅客鉄道	19,800	10,090.00	199,782,000	
東海旅客鉄道	20,300	20,955.00	425,386,500	
阪急阪神ホールディングス	401,000	744.00	298,344,000	
日本電信電話	107,200	4,678.00	501,481,600	
K D D I	221,000	2,808.50	620,678,500	
カドカワ	118,200	1,917.00	226,589,400	
S C S K	71,300	4,290.00	305,877,000	
ニトリホールディングス	37,500	8,780.00	329,250,000	
ミスミグループ本社	57,500	1,514.00	87,055,000	
ソフトバンクグループ	96,100	5,577.00	535,949,700	
サンドラッグ	31,000	7,570.00	234,670,000	
合計	12,342,600		20,240,533,480	

(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8月25日現在	平成28年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		-	713,169,596
コール・ローン		1,288,787,018	-
国債証券		14,837,106,430	12,934,941,330
社債券		17,191,303,470	15,608,853,200
未収入金		-	453,802,700
未収利息		99,023,856	76,034,063
前払費用		14,835,248	9,833,776
流動資産合計		33,431,056,022	29,796,634,665
資産合計		33,431,056,022	29,796,634,665
負債の部			
流動負債			
流動負債合計		-	-
負債合計		-	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	22,792,349,502	19,444,576,443
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		10,638,706,520	10,352,058,222
元本等合計		33,431,056,022	29,796,634,665
純資産合計		33,431,056,022	29,796,634,665
負債純資産合計		33,431,056,022	29,796,634,665

## 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8月25日現在	平成28年2月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,950,673,340円	22,792,349,502円
	同期中追加設定元本額	709,717,725円	443,379,468円
	同期中一部解約元本額	1,868,041,563円	3,791,152,527円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30（安定型）	1,614,451,783円	1,393,357,454円
	バランス物語50（安定・成長型）	484,375,470円	400,789,087円
	バランス物語70（成長型）	140,131,639円	113,391,623円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	3,984,726,392円	3,767,221,666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	6,615,366,138円	6,024,359,734円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	3,019,091,295円	2,675,631,619円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	1,722,899,911円	1,289,901,572円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	2,930,484,007円	2,084,633,309円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	505,686,498円	384,400,896円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	909,457,110円	707,677,582円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	735,070,470円	499,327,396円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	130,608,789円	103,884,505円
	計	22,792,349,502円	19,444,576,443円
2 .	受益権の総数	22,792,349,502口	19,444,576,443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27年2月26日 至 平成27年8月25日	自 平成27年8月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年8月25日現在	平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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ぬ。 (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つた場合、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8月25日現在	平成28年2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	122,418,540	970,889,710
社債券	17,086,990	110,418,150
合計	139,505,530	1,081,307,860

（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27年5月26日から平成27年8月25日まで及び平成27年5月26日から平成28年2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8月25日現在	平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.4668円	1.5324円
（1万口当たり純資産額）	（14,668円）	（15,324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28年2月25日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	118回 利付国庫債券(5年)	360,000,000	365,094,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	600,000,000	609,036,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	120,000,000	154,850,400	
	7回 利付国庫債券(40年)	18,000,000	22,113,180	
	8回 利付国庫債券(40年)	26,000,000	29,332,680	
	329回 利付国庫債券(10年)	450,000,000	483,007,500	
	332回 利付国庫債券(10年)	75,000,000	79,569,750	
	334回 利付国庫債券(10年)	543,000,000	577,252,440	
	335回 利付国庫債券(10年)	700,000,000	738,486,000	
	340回 利付国庫債券(10年)	277,000,000	289,805,710	
	341回 利付国庫債券(10年)	263,000,000	272,473,260	
	24回 利付国庫債券(30年)	35,000,000	47,826,800	
	33回 利付国庫債券(30年)	1,332,000,000	1,705,599,360	
	35回 利付国庫債券(30年)	33,000,000	42,346,590	
	37回 利付国庫債券(30年)	64,000,000	80,837,120	
	39回 利付国庫債券(30年)	33,000,000	41,743,020	
	40回 利付国庫債券(30年)	84,000,000	104,143,200	
	41回 利付国庫債券(30年)	99,000,000	120,224,610	
	44回 利付国庫債券(30年)	521,000,000	632,947,270	
	45回 利付国庫債券(30年)	144,000,000	167,402,880	
	117回 利付国庫債券(20年)	203,000,000	257,840,450	
	119回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	307,345,000	
	129回 利付国庫債券(20年)	150,000,000	185,368,500	
	131回 利付国庫債券(20年)	395,000,000	482,583,350	
	140回 利付国庫債券(20年)	945,000,000	1,157,350,950	
	141回 利付国庫債券(20年)	227,000,000	277,850,270	
	145回 利付国庫債券(20年)	1,235,000,000	1,511,998,150	
	146回 利付国庫債券(20年)	327,000,000	400,025,640	
	147回 利付国庫債券(20年)	449,000,000	541,269,500	
	148回 利付国庫債券(20年)	222,000,000	263,562,840	
	150回 利付国庫債券(20年)	104,000,000	121,233,840	
	151回 利付国庫債券(20年)	138,000,000	155,676,420	
	152回 利付国庫債券(20年)	71,000,000	79,994,280	
153回 利付国庫債券(20年)	261,000,000	298,286,460		
154回 利付国庫債券(20年)	119,000,000	133,483,490		
155回 利付国庫債券(20年)	182,000,000	196,980,420		
国債証券 合計		11,055,000,000	12,934,941,330	
社債券	1回 パークレイズ・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	99,886,000	
	12回 ポスコ円貨社債	300,000,000	300,249,000	

9回	モルガン・スタンレー円貨債	400,000,000	402,868,000	
16回	ルノー円貨債	200,000,000	201,268,000	
7回	西松建設社債	200,000,000	205,870,000	
1回	戸田建設社債	100,000,000	101,548,000	
2回	戸田建設社債	200,000,000	205,032,000	
3回	五洋建設社債	100,000,000	102,015,000	
28回	双日社債	300,000,000	309,189,000	
29回	双日社債	100,000,000	102,972,000	
31回	双日社債	200,000,000	202,484,000	
37回	東洋紡社債	100,000,000	100,661,000	
11回	森ビル社債	200,000,000	205,124,000	
12回	森ビル社債	300,000,000	307,473,000	
17回	森ビル社債	200,000,000	201,936,000	
10回	日本製紙グループ本社社債	100,000,000	105,513,000	
41回	住友化学社債	100,000,000	105,471,000	
41回	三井化学社債	100,000,000	104,957,000	
42回	三井化学社債	100,000,000	106,088,000	
18回	三菱ケミカルホールディングス社債	300,000,000	301,536,000	
19回	三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,226,000	
4回	東燃ゼネラル石油社債	200,000,000	205,034,000	
3回	JXホールディングス社債	100,000,000	105,636,000	
7回	JXホールディングス社債	100,000,000	100,239,000	
25回	太平洋セメント社債	100,000,000	101,979,000	
56回	神戸製鋼所社債	100,000,000	102,532,000	
62回	神戸製鋼所社債	100,000,000	98,764,000	
13回	三井金属社債	100,000,000	102,576,000	
5回	ブラザー工業社債	100,000,000	100,066,000	
6回	ブラザー工業社債	100,000,000	100,481,000	
28回	富士電機社債	200,000,000	201,238,000	
47回	NEC社債	100,000,000	100,884,000	
48回	NEC社債	200,000,000	203,528,000	
12回	パナソニック社債	200,000,000	201,408,000	
13回	パナソニック社債	300,000,000	303,303,000	
6回	アンリツ社債	100,000,000	100,809,000	
38回	IHI社債	200,000,000	205,454,000	
41回	IHI社債	100,000,000	99,738,000	
21回	トピー工業社債	400,000,000	418,552,000	
23回	トピー工業社債	200,000,000	205,542,000	
76回	伊藤忠商事社債	320,000,000	325,414,400	
104回	丸紅社債	400,000,000	400,608,000	
101回	丸紅社債	100,000,000	100,844,000	
54回	クレディセゾン社債	100,000,000	100,134,000	
57回	クレディセゾン社債	200,000,000	200,066,000	
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	608,988,000	
1回	千葉銀行実質破綻時免除特約付劣後社債	200,000,000	206,246,000	
16回	ポケットカード社債	100,000,000	101,276,000	

17回	ポケットカード社債	100,000,000	100,970,000	
18回	ポケットカード社債	100,000,000	100,636,000	
66回	アコム社債	300,000,000	305,736,000	
68回	アコム社債	100,000,000	102,199,000	
8回	ジャックス社債	500,000,000	517,070,000	
9回	ジャックス社債	100,000,000	101,912,000	
6回	オリエントコーポレーション社債	100,000,000	100,315,000	
1回	オリエントコーポレーション社債	300,000,000	303,036,000	
3回	オリエントコーポレーション社債	200,000,000	203,206,000	
178回	オリックス社債	190,000,000	191,672,000	
1回	あいおいニッセイ同和損害保険劣後社債	500,000,000	545,350,000	
36回	三井不動産社債	100,000,000	105,184,000	
17回	東京建物社債	300,000,000	312,630,000	
20回	東京建物社債	100,000,000	102,058,000	
11回	ダイビル社債	200,000,000	210,306,000	
16回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,384,000	
83回	近畿日本鉄道社債	100,000,000	101,241,000	
36回	南海電気鉄道社債	100,000,000	102,687,000	
38回	南海電気鉄道社債	100,000,000	101,131,000	
1回	神奈川中央交通社債	100,000,000	101,174,000	
37回	日本郵船社債	100,000,000	103,037,000	
12回	商船三井社債	300,000,000	308,640,000	
15回	商船三井社債	100,000,000	98,211,000	
495回	関西電力社債	100,000,000	102,634,000	
382回	中国電力社債	200,000,000	203,764,000	
307回	北陸電力社債	210,000,000	222,669,300	
471回	東北電力社債	200,000,000	213,278,000	
473回	東北電力社債	750,000,000	765,390,000	
316回	北海道電力社債	130,000,000	135,408,000	
317回	北海道電力社債	245,000,000	260,655,500	
11回	コナミ社債	200,000,000	203,590,000	
1回	ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,096,000	
3回	ファーストリテイリング社債	100,000,000	101,878,000	
社債券 合計		15,245,000,000	15,608,853,200	
合計		26,300,000,000	28,543,794,530	

## 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8月25日現在	平成28年2月25日現在
資産の部			
流動資産			

預金		13,935,707	4,003,256
金銭信託		-	96,906,890
コール・ローン		114,632,477	-
株式		8,930,055,815	8,030,519,013
派生商品評価勘定		-	11,000
未収入金		266,177,261	60,949,930
未収配当金		15,229,342	12,823,039
流動資産合計		9,340,030,602	8,205,213,128
資産合計		9,340,030,602	8,205,213,128
負債の部			
流動負債			
未払金		273,423,440	58,544,253
流動負債合計		273,423,440	58,544,253
負債合計		273,423,440	58,544,253
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,077,120,898	4,040,363,698
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		4,989,486,264	4,106,305,177
元本等合計		9,066,607,162	8,146,668,875
純資産合計		9,066,607,162	8,146,668,875
負債純資産合計		9,340,030,602	8,205,213,128

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3 . 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。
4 . 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8月25日現在	平成28年2月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,480,941,253円	4,077,120,898円
	同期中追加設定元本額	7,734,850円	39,707,684円
	同期中一部解約元本額	411,555,205円	76,464,884円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30（安定型）	71,437,658円	71,437,658円
	バランス物語50（安定・成長型）	78,147,978円	78,147,978円
	バランス物語70（成長型）	71,000,081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	1,106,847,776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	1,569,875,733円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	71,371,367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）	468,350,855円	435,677,789円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	270,546,842円	239,295,782円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	38,893,356円	38,893,356円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	117,752,797円	105,212,039円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	68,268,108円	68,268,108円
	計	4,077,120,898円	4,040,363,698円
2 .	受益権の総数	4,077,120,898口	4,040,363,698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27年2月26日 至 平成27年8月25日	自 平成27年8月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年8月25日現在	平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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 該当事項はありませぬ。</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>	<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>
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つた場合、当該価額が異なることもあります。	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つた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27年8月25日現在	平成28年2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	630,582,331	240,479,942
合計	630,582,331	240,479,942

（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27年3月17日から平成27年8月25日まで及び平成27年3月17日から平成28年2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8月25日 現在				平成28年2月25日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	-	-	-	-	5,597,000	-	5,608,000	11,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	5,597,000	-	5,608,000	11,000
合計	-	-	-	-	5,597,000	-	5,608,000	11,000

## （注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。  
・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年8月25日現在	平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	2,2238円	2,0163円
(1万口当たり純資産額)	(22,238円)	(20,163円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成28年2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	1,067	554.040	591,160.680	
	ADOBE SYSTEMS INC	3,820	83.420	318,664.400	
	CHUBB LTD	2,291	116.180	266,168.380	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,375	131.550	180,881.250	
	ORBITAL ATK INC	1,275	85.560	109,089.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,667	103.300	482,101.100	
	AMGEN INC	2,525	147.110	371,452.750	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	6,042	36.210	218,780.820	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	693	141.970	98,385.210	
	TIME WARNER	2,650	67.480	178,822.000	
	VALERO ENERGY CORP	2,506	60.610	151,888.660	
	APPLE INC	15,001	96.100	1,441,596.100	
	ALBEMARLE CORP	3,532	53.310	188,290.920	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	4,332	70.150	303,889.800	
	AUTOZONE INC	516	777.830	401,360.280	
	CR BARD INC	975	193.910	189,062.250	
	VERIZON COMM INC	10,957	50.820	556,834.740	
	BOEING CO	1,390	115.590	160,670.100	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	10,671	17.330	184,928.430	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,581	62.230	285,075.630	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,593	48.660	320,815.380	
	CONSTELLATION BRANDS INC	1,755	139.080	244,085.400	
	CELGENE CORP	2,943	102.080	300,421.440	
	JPMORGAN CHASE & CO	13,803	56.140	774,900.420	
	CHURCHILL DOWNS INC	1,152	130.800	150,681.600	
	CIGNA CORP	1,349	137.240	185,136.760	
	CISCO SYSTEMS INC	14,147	26.320	372,349.040	
	CLOROX COMPANY	1,711	130.240	222,840.640	
	COCA-COLA CO/THE	10,338	43.910	453,941.580	
	CIENA CORP	11,468	20.660	236,928.880	
	COMCAST CORP-CL A	8,242	58.400	481,332.800	
	DR HORTON INC	5,701	26.480	150,962.480	
	THE WALT DISNEY CO	4,225	95.430	403,191.750	
DOLLAR TREE INC	1,912	81.650	156,114.800		
BANK OF AMERICA CORP	42,508	12.130	515,622.040		
EATON CORP PLC	4,044	56.800	229,699.200		
ELECTRONIC ARTS INC	2,084	63.200	131,708.800		

SALESFORCE.COM INC	7,478	62.520	467,524.560	
ATMOS ENERGY CORP	6,761	71.060	480,436.660	
EOG RESOURCES INC	3,568	69.520	248,047.360	
EQUIFAX INC	1,792	104.440	187,156.480	
EQT CORP	1,791	57.160	102,373.560	
EXXON MOBIL CORP	14,447	81.520	1,177,719.440	
ASSURANT INC	4,817	70.610	340,128.370	
FLIR SYSTEMS INC	5,120	31.240	159,948.800	
MACY'S INC	5,287	42.850	226,547.950	
GILEAD SCIENCES INC	4,983	89.360	445,280.880	
NVIDIA CORP	3,591	31.820	114,265.620	
GENERAL ELECTRIC CO	23,380	28.960	677,084.800	
MONSTER BEVERAGE CORP	2,697	132.400	357,082.800	
HASBRO INC	1,931	75.750	146,273.250	
REYNOLDS AMERICAN INC	3,503	50.950	178,477.850	
HOME DEPOT INC	8,774	125.610	1,102,102.140	
HORMEL FOODS CORP	6,714	43.710	293,468.940	
BIOGEN INC	939	257.220	241,529.580	
ILLINOIS TOOL WORKS	1,797	94.210	169,295.370	
INTUIT INC	1,472	98.830	145,477.760	
INTEGRATED DEVICE TECH INC	6,583	19.110	125,801.130	
INTEL CORP	10,036	29.190	292,950.840	
JOHNSON & JOHNSON	8,676	104.960	910,632.960	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,047	41.900	462,869.300	
KIMBERLY-CLARK CORP	2,463	132.350	325,978.050	
HAIN CELESTIAL GROUP INC	3,265	35.450	115,744.250	
KROGER CO	9,664	38.700	373,996.800	
LACLEDE GROUP INC/THE	7,448	65.730	489,557.040	
ELI LILLY & CO	2,674	74.100	198,143.400	
LOCKHEED MARTIN CORP	871	216.630	188,684.730	
LITTELFUSE INC	1,320	114.000	150,480.000	
MCDONALD'S CORPORATION	3,107	117.060	363,705.420	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	3,016	87.790	264,774.640	
MARSH & MCLENNAN COS	4,058	57.450	233,132.100	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,525	33.480	118,017.000	
MEDTRONIC PLC	4,189	76.430	320,165.270	
CVS HEALTH CORP	4,661	96.880	451,557.680	
MERCK & CO. INC.	8,767	50.560	443,259.520	
MICROSOFT CORP	23,102	51.360	1,186,518.720	
3M CO	1,683	157.220	264,601.260	
MYLAN NV	3,051	46.600	142,176.600	
NIKE INC-CL B	4,872	60.400	294,268.800	
NISOURCE INC	14,297	21.750	310,959.750	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,768	190.020	335,955.360	
WELLS FARGO & CO	20,123	47.610	958,056.030	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,273	263.770	335,779.210	
ORACLE CORP	9,214	36.630	337,508.820	
PPL CORPORATION	5,425	35.930	194,920.250	
PEPSICO INC	3,848	99.680	383,568.640	
PFIZER INC	16,889	30.020	507,007.780	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,324	119.330	277,322.920	
ALTRIA GROUP INC	10,369	61.360	636,241.840	
AETNA INC	2,764	106.650	294,780.600	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,058	61.890	189,259.620	
QUALCOMM INC	4,306	51.520	221,845.120	
REGENERON PHARMACEUTICALS	429	393.630	168,867.270	
US BANCORP	8,003	38.440	307,635.320	
RITE AID CORP	31,818	7.950	252,953.100	
RAYTHEON COMPANY	3,522	123.700	435,671.400	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	7,479	40.760	304,844.040	
PRICELINE GROUP INC	133	1,264.210	168,139.930	
ADVANCE AUTO PARTS	1,514	150.420	227,735.880	
AT&T INC	17,200	37.100	638,120.000	
CHEVRON CORP	8,157	85.270	695,547.390	
SYNAPTICS INC	1,356	80.450	109,090.200	
STARBUCKS CORP	7,249	58.110	421,239.390	
STEEL DYNAMICS INC	7,878	17.740	139,755.720	
NETFLIX INC	1,117	91.610	102,328.370	
TELEFLEX INC	1,459	132.460	193,259.140	
TERADYNE INC	7,405	18.960	140,398.800	
UNION PACIFIC CORP	2,251	80.090	180,282.590	
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,428	120.200	291,845.600	
CBS CORP	3,040	47.480	144,339.200	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,368	86.770	118,701.360	
VULCAN MATERIALS CO	3,388	97.350	329,821.800	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,399	79.430	190,552.570	
ALLERGAN PLC	1,451	284.700	413,099.700	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	2,506	127.760	320,166.560	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,180	63.710	138,887.800	
XILINX INC	3,011	47.580	143,263.380	
YAHOO! INC	3,542	30.950	109,624.900	
TJX COMPANIES INC	2,071	74.240	153,751.040	
CABELA'S INC-CL A	2,733	47.810	130,664.730	
LIBERTY GLOBAL PLC	3,725	37.200	138,570.000	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,177	57.290	239,300.330	
T-MOBILE US INC	5,308	36.780	195,228.240	
EXLSERVICE HOLDINGS INC	4,945	47.640	235,579.800	

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	812	244.330	198,395.960	
TRANSDIGM GROUP INC	1,193	214.260	255,612.180	
MASTERCARD INC	3,356	86.420	290,025.520	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	1,726	45.040	77,739.040	
SPECTRA ENERGY CORP	6,173	28.680	177,041.640	
CAVIUM INC	2,548	57.420	146,306.160	
INFINERA CORP	14,910	15.430	230,061.300	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,279	60.810	138,585.990	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	4,112	91.460	376,083.520	
VISA INC	7,484	71.850	537,725.400	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,492	95.330	142,232.360	
XYLEM INC	7,905	37.470	296,200.350	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	3,680	78.250	287,960.000	
HCA HOLDINGS INC	2,183	70.140	153,115.620	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	6,134	59.770	366,629.180	
MA-COM TECHNOLOGY SOLUTIONS HOLDINGS INC	4,977	37.970	188,976.690	
VANTIV INC	6,098	51.450	313,742.100	
FACEBOOK INC	7,386	106.880	789,415.680	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,281	71.720	522,193.320	
WHITEWAVE FOODS CO	8,366	38.180	319,413.880	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,275	127.940	291,063.500	
ABBVIE INC	5,067	54.890	278,127.630	
ZOETIS INC	4,870	42.370	206,341.900	
BROADCOM LTD	1,890	130.340	246,342.600	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5,158	17.900	92,328.200	
ALLEGION PLC	3,140	62.630	196,658.200	
ONE GAS INC	6,989	59.410	415,216.490	
PARSLEY ENERGY INC	13,071	16.550	216,325.050	
CYBERARK SOFTWARE LTD	2,366	35.960	85,081.360	
KRAFT HEINZ CO	1,950	72.990	142,330.500	
ALPHABET INC-CL A	1,741	720.900	1,255,086.900	
PAYPAL HOLDINGS INC	6,036	36.470	220,132.920	
アメリカ・ドル 小計	859,309		49,202,035.820 (5,518,992,358)	
イギリス・ポンド				
BT GROUP PLC	22,022	4.584	100,948.840	
DIAGEO PLC	5,772	18.685	107,849.820	
NATIONAL GRID PLC	13,245	9.553	126,529.480	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	4,258	38.340	163,251.720	
HALMA PLC	16,077	8.670	139,387.590	
IMPERIAL BRANDS PLC	7,513	37.180	279,333.340	
LAIRD PLC	28,232	3.296	93,052.670	



	UNITED UTILITIES GROUP PLC	17,311	9.170	158,741.870	
	PRUDENTIAL PLC	12,232	11.870	145,193.840	
	RIO TINTO PLC	9,006	18.740	168,772.440	
	VODAFONE GROUP PLC	115,362	2.108	243,183.090	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,377	65.200	154,980.400	
	RELX PLC	14,114	12.170	171,767.380	
	BP PLC	62,117	3.350	208,091.950	
	SHIRE PLC	1,553	37.890	58,843.170	
	SAGE GROUP PLC(THE)	20,692	5.680	117,530.560	
	SMITH & NEPHEW PLC	8,880	11.460	101,764.800	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	13,446	13.605	182,932.830	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	10,154	25.320	257,099.280	
	WPP PLC	13,403	14.630	196,085.890	
	ASTRAZENECA PLC	3,526	40.865	144,089.990	
	ITV PLC	82,567	2.475	204,353.320	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	24,749	15.475	382,990.770	
	INMARSAT PLC	11,635	9.670	112,510.450	
	RIGHTMOVE PLC	2,594	37.760	97,949.440	
	WORLDPAY GROUP PLC	34,905	2.915	101,748.070	
イギリス・ポンド	小計	557,742		4,218,983.000 (658,836,385)	
オーストラリア・ドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	17,279	28.490	492,278.710	
オーストラリア・ドル	小計	17,279		492,278.710 (39,643,204)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	9,346	48.210	450,570.660	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	7,610	60.130	457,589.300	
	CCL INDUSTRIES INC	989	196.740	194,575.860	
	OPEN TEXT CORP	3,566	66.890	238,529.740	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,185	164.790	195,276.150	
	PREMIUM BRANDS HOLDINGS CORP	5,797	46.280	268,285.160	
カナダ・ドル	小計	28,493		1,804,826.870 (147,670,935)	
スイス・フラン	SYNGENTA AG	715	391.700	280,065.500	
	NESTLE SA-REGISTERED	8,495	69.400	589,553.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,684	252.100	424,536.400	
	SIKA INHABER	57	3,695.000	210,615.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	5,312	72.250	383,792.000	
	CLARIANT AG-REG	7,750	16.090	124,697.500	
	SWISS LIFE HOLDING AG	803	233.100	187,179.300	
	AUTONEUM HOLDING AG	675	202.800	136,890.000	
	UBS GROUP AG	11,780	14.560	171,516.800	

スイス・フラン 小計		37,271		2,508,845.500 (284,402,726)	
スウェーデン・クローナ	ASSA ABLOY AB-B	7,233	158.900	1,149,323.700	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,962	109.200	1,087,850.400	
スウェーデン・クローナ 小計		17,195		2,237,174.100 (29,553,070)	
デンマーク・クローネ	DANSKE BANK A/S	7,617	181.000	1,378,677.000	
	GENMAB A/S	2,050	779.000	1,596,950.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	2,939	341.000	1,002,199.000	
	TRYG A/S	9,823	122.300	1,201,352.900	
	PANDORA A/S	1,071	828.000	886,788.000	
デンマーク・クローネ 小計		23,500		6,065,966.900 (100,452,412)	
ユーロ	CRH PLC	9,904	22.420	222,047.680	
	KERRY GROUP PLC-A	3,464	76.420	264,718.880	
	AXA	20,099	19.500	391,930.500	
	GLANBIA PLC	19,412	18.440	357,957.280	
	SAFRAN SA	3,175	54.760	173,863.000	
	INTESA SANPAOLO	56,438	2.260	127,549.880	
	BOUYGUES	5,018	34.675	173,999.150	
	THALES SA	3,792	71.310	270,407.520	
	CHRISTIAN DIOR SE	1,029	158.650	163,250.850	
	NATIXIS	33,997	4.521	153,700.430	
	GAMESA	9,739	15.810	153,973.590	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	1,843	103.750	191,211.250	
	SEB SA	1,781	85.250	151,830.250	
	VINCI S.A.	6,536	62.370	407,650.320	
	SAP SE	2,815	68.000	191,420.000	
	TOTAL SA	6,645	39.135	260,052.070	
	SIEMENS AG-REG	3,078	82.490	253,904.220	
	ING GROEP NV-CVA	24,496	10.115	247,777.040	
	BAYER AG	2,374	94.790	225,031.460	
	DAIMLER AG	2,779	60.280	167,518.120	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,329	64.380	214,321.020	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	3,151	73.730	232,323.230	
	ORANGE	15,388	15.555	239,360.340	
	ALLIANZ SE	1,140	132.850	151,449.000	
	PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	8,434	45.065	380,078.210	
	HEINEKEN NV	3,399	73.370	249,384.630	
	ASML HOLDING NV	2,118	79.570	168,529.260	
	AGEAS	4,699	33.570	157,745.430	
	SANOFI	3,135	69.300	217,255.500	
	LINDE AG	1,346	124.900	168,115.400	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	10,872	15.020	163,297.440		
TELEPERFORMANCE	2,195	72.280	158,654.600		

	DEUTSCHE BOERSE AG	5,371	76.140	408,947.940	
	ESSILOR INTL	2,314	105.400	243,895.600	
	HERA SPA	105,139	2.578	271,048.340	
	FERROVIAL SA	13,215	18.020	238,134.300	
	SYMRISE AG	7,589	56.920	431,965.880	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	12,106	16.205	196,177.730	
	STROEER SE	5,871	53.500	314,098.500	
	ONTEX GROUP NV	4,398	32.880	144,606.240	
	EURONEXT NV	8,748	34.300	300,056.400	
	NN GROUP NV	6,526	27.885	181,977.510	
ユーロ	小計	448,897		9,781,215.990 (1,208,664,860)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	37,000	39.150	1,448,550.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	15,500	95.550	1,481,025.000	
香港・ドル	小計	52,500		2,929,575.000 (42,303,063)	
合計		2,042,186		8,030,519,013 (8,030,519,013)	

## (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 156銘柄	67.75%	68.73%
イギリス・ポンド	株式 26銘柄	8.09%	8.20%
オーストラリア・ドル	株式 1銘柄	0.49%	0.49%
カナダ・ドル	株式 6銘柄	1.81%	1.84%
スイス・フラン	株式 9銘柄	3.49%	3.54%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	0.36%	0.37%
デンマーク・クローネ	株式 5銘柄	1.23%	1.25%
ユーロ	株式 42銘柄	14.84%	15.05%
香港・ドル	株式 2銘柄	0.52%	0.53%

(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。

## 「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8月25日現在	平成28年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,848,690	1,159,245
金銭信託		-	58,717,794
コール・ローン		106,403,601	-
国債証券		10,886,200,156	9,747,370,468
特殊債券		517,866,572	479,161,076
派生商品評価勘定		23,359,225	8,452,156
未収入金		215,136,970	31,498,115
未収利息		69,726,372	56,958,077
前払費用		9,202,357	17,134,639
流動資産合計		11,831,743,943	10,400,451,570
資産合計		11,831,743,943	10,400,451,570
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,389,439	10,518,268
未払金		214,930,041	18,673,308
流動負債合計		224,319,480	29,191,576
負債合計		224,319,480	29,191,576
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,679,682,170	4,466,294,972
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		6,927,742,293	5,904,965,022
元本等合計		11,607,424,463	10,371,259,994
純資産合計		11,607,424,463	10,371,259,994
負債純資産合計		11,831,743,943	10,400,451,570

## 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8月25日現在	平成28年2月25日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,650,847,610円	4,679,682,170円
	同期中追加設定元本額	309,826,658円	197,926,684円
	同期中一部解約元本額	280,992,098円	411,313,882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	107,080,812円
	バランス物語50（安定・成長型）	79,745,919円	71,171,795円
	バランス物語70（成長型）	60,950,913円	52,376,789円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	288,881,989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	1,101,940,793円	1,067,644,299円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	1,335,126,501円	1,240,811,144円
	外国債券私募オープン（適格機関投資家向け）	602,243,156円	794,896,861円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	127,631,504円	101,131,249円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	486,894,967円	369,798,940円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	234,235,770円	178,474,051円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	65,731,882円	55,210,807円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	120,428,689円	91,259,864円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	60,215,151円	47,556,372円
	計	4,679,682,170円	4,466,294,972円
2 .	受益権の総数	4,679,682,170口	4,466,294,972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27年2月26日 至 平成27年8月25日	自 平成27年8月26日 至 平成28年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年8月25日現在	平成28年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<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等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左



（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年8月25日現在	平成28年2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	93,766,413	229,191,592
特殊債券	3,961,748	13,130,620
合計	89,804,665	216,060,972

（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27年5月26日から平成27年8月25日まで及び平成27年5月26日から平成28年2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8月25日 現在				平成28年2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	740,721,267	-	717,362,042	23,359,225	850,078,050	-	843,362,700	6,715,350
アメリカ・ドル	285,099,407	-	280,331,842	4,767,565	156,636,320	-	155,721,700	914,620
イギリス・ポンド	341,814,880	-	329,665,600	12,149,280	219,645,440	-	212,160,000	7,485,440
オーストラリア・ドル	113,806,980	-	107,364,600	6,442,380	326,897,340	-	328,304,300	1,406,960
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	38,403,750	-	38,435,100	31,350
ユーロ	-	-	-	-	108,495,200	-	108,741,600	246,400
買 建	744,154,101	-	734,764,662	9,389,439	885,607,232	-	876,825,770	8,781,462
アメリカ・ドル	71,242,488	-	68,286,040	2,956,448	3,269,248	-	3,108,288	160,960
イギリス・ポンド	-	-	-	-	108,992,454	-	109,013,882	21,428
カナダ・ドル	-	-	-	-	221,840,600	-	221,461,200	379,400
シンガポール・ドル	43,749,638	-	43,255,198	494,440	-	-	-	-
スイス・フラン	34,704,180	-	34,454,700	249,480	30,762,180	-	30,626,100	136,080
ノルウェー・クローネ	32,595,960	-	31,579,800	1,016,160	29,893,080	-	29,457,600	435,480
ポーランド・ズロチ	70,557,000	-	69,594,539	962,461	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	112,031,958	-	110,037,918	1,994,040	-	-	-	-
ユーロ	321,453,790	-	320,701,200	752,590	490,849,670	-	483,158,700	7,690,970
南アフリカ・ランド	57,819,087	-	56,855,267	963,820	-	-	-	-
合計	1,484,875,368	-	1,452,126,704	13,969,786	1,735,685,282	-	1,720,188,470	2,066,112

(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8月25日現在	平成28年2月25日現在
1口当たり純資産額	2,4804円	2,3221円
(1万口当たり純資産額)	(24,804円)	(23,221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28年2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 0.625 02/15/17	2,140,000.000	2,140,235.400	
		US T N/B 0.875 01/15/18	580,000.000	581,380.400	
		US T N/B 1.0 09/30/19	800,000.000	799,000.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	5,600,000.000	5,681,760.000	
		US T N/B 1.375 09/30/20	2,950,000.000	2,973,482.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	4,750,000.000	4,833,125.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	4,280,000.000	4,409,555.600	
		US T N/B 2.0 02/15/22	500,000.000	517,850.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	2,240,000.000	2,289,504.000	
		US T N/B 2.25 03/31/21	1,400,000.000	1,467,690.000	
		US T N/B 2.375 08/15/24	3,490,000.000	3,687,394.400	
		US T N/B 2.625 11/15/20	100,000.000	106,375.000	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,135,000.000	1,232,530.550	
		US T N/B 3.125 02/15/42	2,400,000.000	2,695,872.000	
		US T N/B 3.75 11/15/43	500,000.000	626,875.000	
		US T N/B 4.375 05/15/40	800,000.000	1,087,056.000	
アメリカ・ドル 小計			33,665,000.000 (3,776,203,050)	35,129,685.350 (3,940,496,806)	
イギリス・ポンド		UK TREASURY 1.0 09/07/17	385,000.000	389,042.500	
		UK TREASURY 1.75 07/22/19	480,000.000	499,728.000	
		UK TREASURY 2.0 07/22/20	820,000.000	866,904.000	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,065,000.000	1,276,402.500	
		UK TREASURY 4.0 03/07/22	300,000.000	356,130.000	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	480,000.000	636,144.000	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	300,000.000	411,330.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	480,000.000	700,704.000	
イギリス・ポンド 小計			4,310,000.000 (673,049,600)	5,136,385.000 (802,097,882)	
オーストラリア・ドル		AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	325,000.000	322,221.250	
		AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,660,000.000	1,852,659.600	
		AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,210,000.000	2,690,586.600	
オーストラリア・ドル 小計			4,195,000.000 (337,823,350)	4,865,467.450 (391,816,094)	
シンガポール・ドル		SINGAPORE 1.625 10/01/19	200,000.000	202,100.000	
		SINGAPORE 2.75 07/01/23	140,000.000	146,440.000	
		SINGAPORE 3.375 09/01/33	100,000.000	110,676.000	

シンガポール・ドル	小計	440,000.000 (35,164,800)	459,216.000 (36,700,543)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 3.0 07/12/16	1,000,000.000	1,013,300.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	2,200,000.000	2,664,750.000	
スウェーデン・クローナ	小計	3,200,000.000 (42,272,000)	3,678,050.000 (48,587,041)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	1,100,000.000	1,210,000.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	1,400,000.000	1,568,812.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	650,000.000	1,143,025.000	
デンマーク・クローネ	小計	3,150,000.000 (52,164,000)	3,921,837.000 (64,945,621)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.25 07/25/25	400,000.000	417,356.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	1,400,000.000	1,596,700.000	
ポーランド・ズロチ	小計	1,800,000.000 (50,850,000)	2,014,056.000 (56,897,082)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 4.16 07/15/21	1,800,000.000	1,839,420.000	
マレーシア・リンギット	小計	1,800,000.000 (47,952,000)	1,839,420.000 (49,002,149)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	10,450,000.000	13,357,608.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 06/15/17	1,500,000.000	1,516,335.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	4,500,000.000	4,452,975.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	2,500,000.000	2,791,750.000	
メキシコ・ペソ	小計	18,950,000.000 (116,921,500)	22,118,668.000 (136,472,182)	
ユーロ	AUSTRIA 1.65 10/21/24	650,000.000	726,453.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	70,000.000	102,267.200	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	430,000.000	509,034.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	200,000.000	227,274.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	600,000.000	749,904.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	200,000.000	323,580.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	560,000.000	867,608.000	
	BUNDESOBL 0.5 02/23/18	915,000.000	933,711.750	
	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,979,515.000	
	DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	220,000.000	315,623.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	800,000.000	920,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	80,000.000	137,903.200	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/25	970,000.000	976,644.500	
	FRANCE OAT 1.0 05/25/18	590,000.000	608,567.300	
	FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,600,000.000	1,668,880.000	
	FRANCE OAT 1.0 11/25/18	740,000.000	767,594.600	
	FRANCE OAT 1.5 05/25/31	200,000.000	213,486.000	
	FRANCE OAT 1.75 11/25/24	200,000.000	224,488.000	
	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	700,000.000	833,259.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	900,000.000	1,083,069.000		
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,255,000.000	1,914,213.850		

		IRISH 3.4 03/18/24	400,000.000	484,884.000	
		IRISH 5.0 10/18/20	100,000.000	122,470.000	
		IRISH 5.9 10/18/19	70,000.000	84,906.500	
		ITALY BTPS 0.75 01/15/18	1,895,000.000	1,921,454.200	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	700,000.000	729,771.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	3,050,000.000	3,322,243.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	300,000.000	358,005.000	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,150,000.000	1,369,144.000	
		ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,500,000.000	2,907,750.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	705,000.000	1,009,623.450	
		SPAIN 1.15 07/30/20	1,485,000.000	1,523,134.800	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,670,000.000	1,678,583.800	
		SPAIN 2.1 04/30/17	1,230,000.000	1,260,565.500	
		SPAIN 2.75 10/31/24	700,000.000	769,405.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	360,000.000	528,141.600	
	ユーロ 小計		30,095,000.000 (3,718,839,150)	34,153,557.250 (4,220,355,069)	
国債証券 合計			8,851,239,450 (8,851,239,450)	9,747,370,468 (9,747,370,468)	
特殊債券	アメリカ・ドル	EIB 5.125 05/30/17	3,000,000.000	3,156,000.000	
		KFW 4.875 06/17/19	1,000,000.000	1,115,740.000	
	アメリカ・ドル 小計		4,000,000.000 (448,680,000)	4,271,740.000 (479,161,076)	
特殊債券 合計			448,680,000 (448,680,000)	479,161,076 (479,161,076)	
合計			9,299,919,450 (9,299,919,450)	10,226,531,544 (10,226,531,544)	

- (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 16銘柄	37.99%	43.22%
	特殊債券 2銘柄	4.62%	
イギリス・ポンド	国債証券 8銘柄	7.73%	7.84%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	3.78%	3.83%
シンガポール・ドル	国債証券 3銘柄	0.35%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.47%	0.48%
デンマーク・クローネ	国債証券 3銘柄	0.63%	0.64%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	0.55%	0.56%
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	0.47%	0.48%
メキシコ・ペソ	国債証券 4銘柄	1.32%	1.33%
ユーロ	国債証券 36銘柄	40.69%	41.27%

(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28年2月29日現在

資産総額	3,238,588,053円
負債総額	575,167円
純資産総額（ - ）	3,238,012,886円
発行済数量	2,755,231,629口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1752円

## バランス物語50（安定・成長型）

平成28年2月29日現在

資産総額	1,415,393,574円
負債総額	950,393円
純資産総額（ - ）	1,414,443,181円
発行済数量	1,178,417,304口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2003円

## バランス物語70（成長型）

平成28年2月29日現在

資産総額	789,232,565円
負債総額	141,957円
純資産総額（ - ）	789,090,608円
発行済数量	654,943,697口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2048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28年2月29日現在

資産総額	22,662,885,895円
負債総額	1,105,446,088円
純資産総額（ - ）	21,557,439,807円
発行済数量	11,284,704,544口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9103円

## D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産総額	30,267,838,123円
負債総額	560,340,680円
純資産総額（ - ）	29,707,497,443円
発行済数量	19,382,553,852口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5327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28年2月29日現在

資産総額	9,603,323,269円
負債総額	596,034,041円
純資産総額( - )	9,007,289,228円
発行済数量	4,353,106,136口
1口当たり純資産額( / )	2.0692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28年2月29日現在

資産総額	10,623,759,937円
負債総額	106,487,966円
純資産総額( - )	10,517,271,971円
発行済数量	4,494,011,161口
1口当たり純資産額( / )	2.3403円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

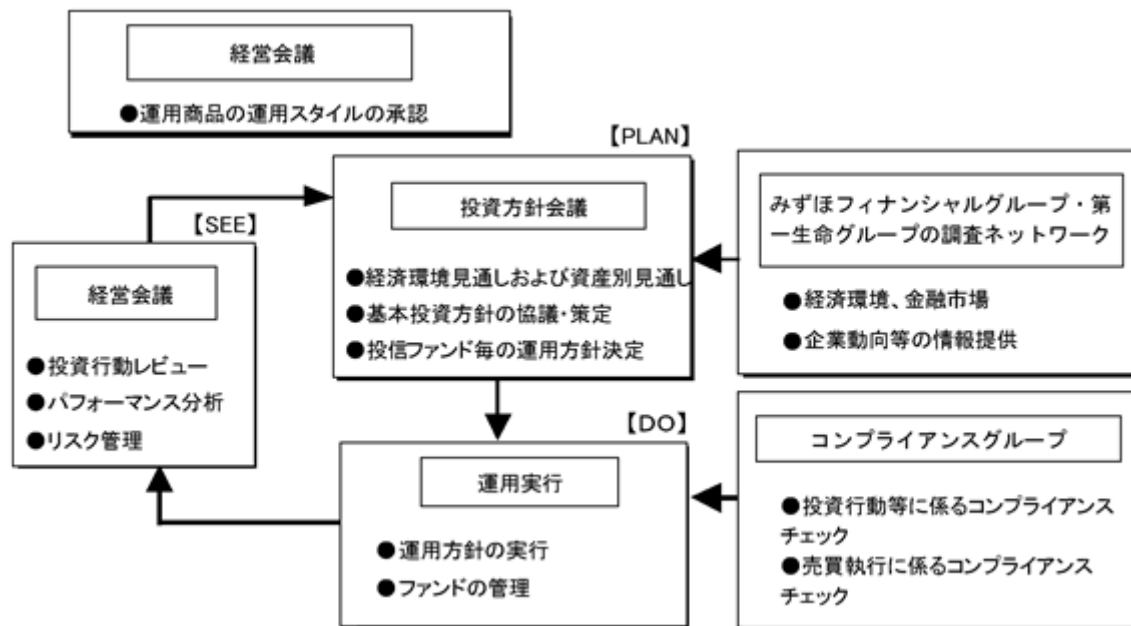
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

平成28年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は415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	23,629,020,732
追加型株式投資信託	370	5,576,357,548,539
単位型公社債投資信託	40	294,039,557,704
追加型公社債投資信託	0	0
合計	415	5,894,026,126,975

### 3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

- 1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	第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	4,178,284	4,343,365
関係会社株式	617,159	613,137
繰延税金資産	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  預金の預入 (純額)  受取利息	1,629,874  775,579  2,073	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	224,525  10,724,847  12
	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料  預金の引出 (純額)	432,201  203,876	-	-
	みずほ第 一ファイ 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  業務委託料 の支払	287,136  11,810	未払 費用  未払金	155,413  2,646
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)  信託報酬の 支払	1,000,000  7,933	金銭の 信託	10,952,459

## 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	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	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	407,531	未払 費用	240,725
	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)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

## 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。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,613,571
金銭の信託		14,000,363
前払費用		141,040
未収委託者報酬		4,528,913
未収運用受託報酬		2,131,544
未収投資助言報酬		268,863
未収収益		240,459
繰延税金資産		392,452
その他		37,555
	流動資産計	32,354,763
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,557
車両運搬具	1	745
器具備品	1	246,491
無形固定資産		
商標権	1	54
ソフトウェア	1	1,688,242
ソフトウェア仮勘定		142,901
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	167
投資その他の資産		
投資有価証券		574,051
関係会社株式		2,316,596
繰延税金資産		600,727
差入保証金		771,427
その他		90,932
	固定資産計	6,640,044
資産合計		38,994,807

（単位：千円）

	第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	956,031
未払金	2,105,195
未払収益分配金	44
未払償還金	49,873
未払手数料	1,770,062
その他未払金	285,213
未払費用	1,927,420
未払法人税等	1,486,583
未払消費税等	289,515
賞与引当金	724,368
その他	20,000
流動負債計	7,509,114
固定負債	
退職給付引当金	920,913
役員退職慰労引当金	137,750
固定負債計	1,058,663
負債合計	8,567,778
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	25,771,823
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	22,030,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	3,118,530
株主資本計	30,200,301
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	226,727
評価・換算差額等計	226,727
純資産合計	30,427,029
負債・純資産合計	38,994,807

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	15,465,477	
運用受託報酬	3,695,539	
投資助言報酬	510,549	
その他営業収益	383,893	
	営業収益計	20,055,459
営業費用		
支払手数料	6,672,717	
広告宣伝費	217,738	
公告費	129	
調査費	3,678,769	
調査費	2,272,268	
委託調査費	1,406,500	
委託計算費	207,057	
営業雑経費	280,193	
通信費	17,208	
印刷費	226,482	
協会費	11,849	
諸会費	17	
支払販売手数料	24,635	
	営業費用計	11,056,605
一般管理費		
給料	2,351,238	
役員報酬	121,094	
給料・手当	2,230,144	
交際費	19,774	
寄付金	2,156	
旅費交通費	119,653	
租税公課	94,838	
不動産賃借料	363,395	
退職給付費用	114,178	
固定資産減価償却費	1 362,235	
福利厚生費	10,385	
修繕費	30,844	
賞与引当金繰入額	724,368	
役員退職慰労引当金繰入額	27,285	
機器リース料	76	
事務委託費	137,814	
事務用消耗品費	33,473	
器具備品費	14,115	
諸経費	84,703	
	一般管理費計	4,490,538
営業利益		4,508,315

(単位:千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	8,323	
受取利息	1,015	
雑収入	5,491	
		営業外収益計 14,830
営業外費用		
為替差損	3,664	
金銭の信託運用損	166,406	
		営業外費用計 170,070
経常利益		4,353,076
特別損失		
固定資産除却損	182	
固定資産売却損	2,654	
ゴルフ会員権評価損	3,806	
		特別損失計 6,642
税引前中間純利益		4,346,433
法人税、住民税及び事業税		1,434,006
法人税等調整額		14,388
法人税等合計		1,448,394
中間純利益		2,898,038

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							2,898,038	2,898,038	2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	2,195,961	354,038	354,038
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	3,118,530	25,771,823	30,200,301

	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	252,905	30,099,168
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	26,178	26,178
当中間期変動額 合計	26,178	327,860
当中間期末残高	226,727	30,427,029



## 重要な会計方針

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 追加情報

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
<p>当社は、平成27年9月30日開催の取締役会の決議に基づき、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」)の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」)、及び新光投信株式会社(以下「新光投信」)の機能統合に向けた具体的な準備を開始すべく、同日付で当社、TB、MHAM及び新光投信の間で「統合基本合意書」を締結いたしました。今後、統合に必要な各社の取締役会決議及び株主総会決議、国内外の関係当局への届出、許認可の取得等を前提として、平成28年度上期中の統合を予定しております。</p>

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 30%; text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 40%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 50%; text-align: right;">68,441千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">293,794千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	68,441千円	無形固定資産	...	293,794千円
有形固定資産	...	68,441千円					
無形固定資産	...	293,794千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通株式	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)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,613,571	10,613,571	-
(2) 金銭の信託	14,000,363	14,000,363	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	493,805	493,805	-
資産計	25,107,739	25,107,739	-
(1) 未払法人税等	1,486,583	1,486,583	-
負債計	1,486,583	1,486,583	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## 負債

### (1) 未払法人税等

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

### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,316,596
差入保証金	771,427

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

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

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

## （有価証券関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）			
1. 満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2. 子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,316,596千円）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。			
3. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	493,805	159,101	334,703
（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

## （金銭の信託関係）

第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
1. 満期保有目的の金銭の信託 該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外） 該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

## 1. セグメント情報

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

## 2. 関連情報

## (1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	15,465,477	4,206,088	383,893	20,055,459

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (1株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,267,792円	89銭
1株当たり中間純利益金額	120,751円	62銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。		

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
中間純利益	2,898,038千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,898,038千円
期中平均株式数	24,000株

## （重要な後発事象）

第31期中間会計期間  
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、平成27年9月25日開催の取締役会において、子会社であるDIAM International Ltdの増資引受を決議いたしました。

## 1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

## 2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

## 3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

### 第3【その他】

<訂正前>

（略）

（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）

<訂正後>

（略）

（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28年4月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 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8月26日から平成28年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 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28年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 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。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年4月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 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8月26日から平成28年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 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28年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 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。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年4月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 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8月26日から平成28年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 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28年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 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。

[次へ](#)

# 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。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25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27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。