

**【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29年5月26日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	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一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【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28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。)について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、あわせて委託会社の統合に伴い一部記載を統一するため、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格」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>

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

各ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。

ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

# 1

#### ●分散投資

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

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

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

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

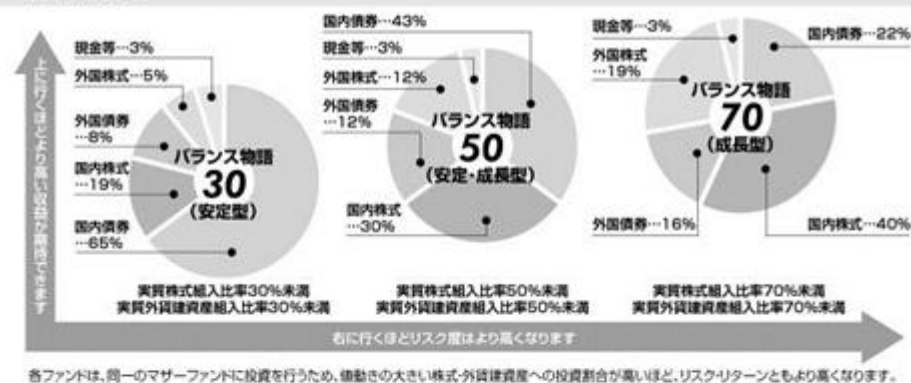
(注)当社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式についてはTOPIX(東証株価指数)、国内債券についてはNOMURA-BPI 総合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース)、外国債券についてはシティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、短期金融資産についてはコール・ローン・オーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

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

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

#### 3ファンドの基本アロケーション

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



# 2

#### ●スイッチング<sup>※</sup>が可能です。

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



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

## 分配方針

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

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

## 商品分類表

バランス物語30(安定型)

バランス物語50(安定・成長型)

バランス物語70(成長型)

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託 財産とともに運用されるファンドをいいます。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資 収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信および その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の 記載があるものをいいます。

## 属性区分表

バランス物語30（安定型）

バランス物語50（安定・成長型）

バランス物語70（成長型）

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券）資産配分 固定型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。  （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））に分類されます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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

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

## （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28年10月1日現在）

（略）

大株主の状況

（平成28年10月1日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
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	28,000株 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%



&lt; 訂正後 &gt;

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成29年2月28日現在）

(略)

大株主の状況

(平成29年2月28日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
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	28,000株 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%



## 2【投資方針】

## (2)【投資対象】

&lt;訂正前&gt;

(略)

(参考)各ファンドが投資対象と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10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
(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28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) 2)当社独自開発の外債分析システム「GLOBAS」を活用し、イールドカーブ分析等の定量分析を行います。 (略) 上記は、平成28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)	

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

(参考)各ファンドが投資対象と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29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29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29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) 2)当社独自開発の外債分析システム「GLOBAS」等を活用し、イールドカーブ分析等の定量分析を行います。 (略) 上記は、平成29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)	

(略)

### (3)【運用体制】

<訂正前>

(略)

運用体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

<訂正後>

(略)

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

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### (4)【分配方針】

<訂正前>

(略)

#### 収益分配金の支払い

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

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

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

<訂正後>

(略)

#### 収益分配金の支払い

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

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

## 3【投資リスク】

<訂正前>

### (1)基準価額の主な変動要因

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

#### 資産配分リスク

(略)

#### (2)分配金に関する留意点

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

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

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

#### (3)その他の留意点

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

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

(略)

#### <リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### <訂正後>

##### <基準価額の主な変動要因>

各ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

(略)

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

（略）

<リスク管理体制>

（略）

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

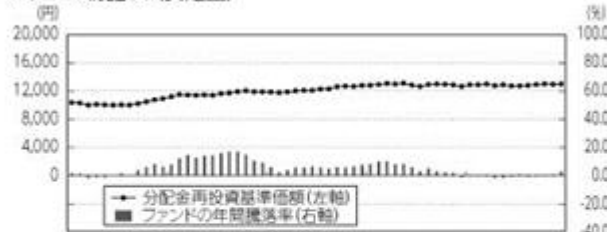
「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## <参考情報>

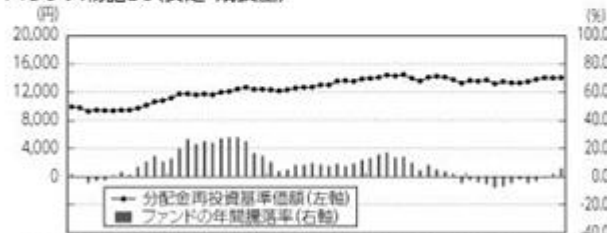
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

### バランス物語30(安定型)



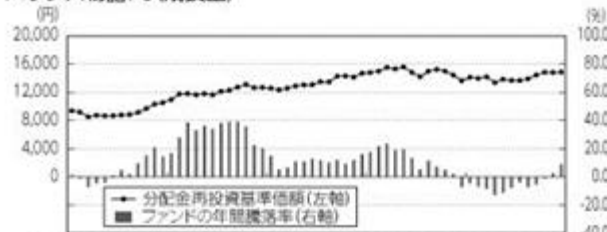
2012年3月 2013年3月 2014年3月 2015年3月 2016年3月 2017年2月

### バランス物語50(安定・成長型)



2012年3月 2013年3月 2014年3月 2015年3月 2016年3月 2017年2月

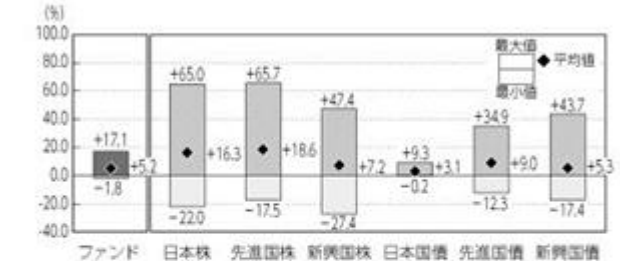
### バランス物語70(成長型)



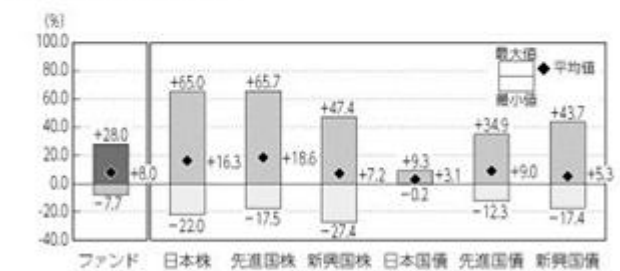
2012年3月 2013年3月 2014年3月 2015年3月 2016年3月 2017年2月

- \*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。

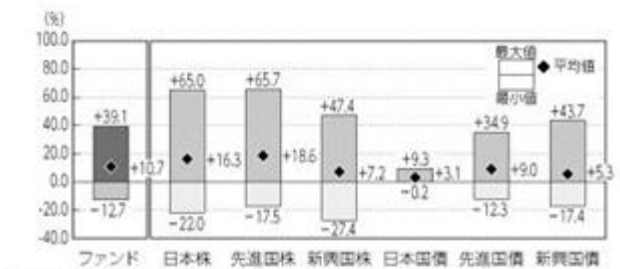
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2012年3月～2017年2月



2012年3月～2017年2月



2012年3月～2017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(配当込み、円ベース)
  - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
  - 日本国債…NOMURA-BPI国債
  - 先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
  - 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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.に帰属します。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。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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.に帰属します。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国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス(除く日本)」は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数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。また、同社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。

## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (3)信託報酬等」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

## &lt;更新・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
委託会社	年率0.75%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.65%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.10%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (5)【課税上の取扱い】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

## &lt;更新・訂正後&gt;

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

## 個人の受益者に対する課税

## 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 解約時および償還時

解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。)を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。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：NISA(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NISA(ジュニアニーサ)」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISA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。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

#### 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29年2月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権



を取得する場合は当該支店等毎に、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

#### <収益分配金の課税について>

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

バランス物語30（安定型）

平成29年2月28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	3,064,416,908	98.53
内 日本	3,064,416,908	98.53
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	45,810,207	1.47
純資産総額	3,110,227,115	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29年2月28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	1,342,799,204	98.46
内 日本	1,342,799,204	98.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	20,995,605	1.54
純資産総額	1,363,794,809	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29年2月28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	764,054,957	98.58
内 日本	764,054,957	98.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,968,160	1.42
純資産総額	775,023,117	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29年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	21,428,865,130	98.28
内 日本	21,428,865,130	98.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	374,303,732	1.72
純資産総額	21,803,168,862	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29年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	10,186,712,130	35.00
内 日本	10,186,712,130	35.00
社債券	18,339,257,800	63.01
内 日本	18,339,257,800	63.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	579,198,704	1.99
純資産総額	29,105,168,634	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29年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	8,937,505,128	98.77
内 アメリカ	6,179,119,069	68.29
内 イギリス	568,049,299	6.28
内 カナダ	435,546,701	4.81
内 フランス	337,499,793	3.73
内 ドイツ	314,966,650	3.48
内 スイス	219,507,976	2.43
内 オランダ	201,823,323	2.23
内 アイルランド	117,960,203	1.30
内 シンガポール	112,480,300	1.24
内 イタリア	87,256,504	0.96
内 ジェージョー	77,050,123	0.85
内 ベルギー	60,207,761	0.67
内 デンマーク	51,238,659	0.57
内 香港	48,403,900	0.53
内 スペイン	40,638,193	0.45
内 オーストラリア	29,178,335	0.32
内 ノルウェー	23,525,347	0.26
内 フィンランド	16,613,116	0.18
内 バミューダ	16,439,876	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	111,099,377	1.23
純資産総額	9,048,604,505	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。

## DL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29年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	10,311,983,857	97.08
内 アメリカ	4,327,770,460	40.74
内 フランス	1,009,390,901	9.50
内 イタリア	980,627,354	9.23
内 ドイツ	976,098,011	9.19
内 スウェーデン	506,507,499	4.77
内 イギリス	483,179,094	4.55
内 スペイン	443,638,225	4.18
内 カナダ	436,804,358	4.11
内 オーストラリア	216,603,194	2.04
内 ベルギー	205,249,672	1.93
内 オーストリア	162,466,356	1.53
内 オランダ	153,770,941	1.45
内 アイルランド	107,018,120	1.01
内 メキシコ	87,251,395	0.82
内 デンマーク	72,421,394	0.68
内 ポーランド	57,592,607	0.54
内 マレーシア	46,433,016	0.44
内 シンガポール	39,161,260	0.37
特殊債券	120,830,908	1.14
内 ドイツ	120,830,908	1.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	189,574,021	1.78
純資産総額	10,622,388,786	100.00

## その他資産の投資状況

平成29年2月28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）	1,201,406,330	11.31
-	1,201,406,330	11.31
為替予約取引（売建）	1,183,575,600	11.14
-	1,183,575,600	11.14

（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29年2月28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	1,339,058,946	1.5373 2,058,669,223	1.5374 2,058,669,223	- -	66.19%
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	255,067,728	2.3060 588,211,687	2.3050 587,931,113	- -	18.90%
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	118,245,835	2.2307 263,782,808	2.2359 264,385,862	- -	8.50%
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	63,756,788	2.3929 152,569,993	2.4065 153,430,710	- -	4.93%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.53%
合計	98.53%

(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29年2月28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	388,293,037	1.5373 596,961,713	1.5374 596,961,715	- -	43.77%
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	179,399,603	2.3060 413,711,036	2.3050 413,516,084	- -	30.32%
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	75,542,349	2.2307 168,519,872	2.2359 168,905,138	- -	12.38%
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	67,906,199	2.3929 162,499,534	2.4065 163,416,267	- -	11.98%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.46%
合計	98.46%

(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29年2月28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・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	135,031,920	2.3060 311,397,110	2.3050 311,248,575	- -	40.16%
2	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	113,467,112	1.5373 174,444,336	1.5374 174,444,337	- -	22.51%
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	62,889,050	2.3934 150,521,543	2.4065 151,342,498	- -	19.53%
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	56,809,136	2.2307 126,729,820	2.2359 127,019,547	- -	16.39%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.58%
合計	98.58%

(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29年2月28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	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	1,146,600	567.54 650,745,820	738.40 846,649,440	- -	3.88%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	82,500	5,929.77 489,206,173	8,362.00 689,865,000	- -	3.16%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	132,800	4,812.46 639,095,334	4,751.00 630,932,800	- -	2.89%
4	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	135,300	3,711.66 502,188,342	4,377.00 592,208,100	- -	2.72%
5	K D D I 日本	株式 情報・通信業	197,600	3,046.98 602,083,738	2,939.00 580,746,400	- -	2.66%
6	ソニー 日本	株式 電気機器	164,400	3,046.24 500,803,272	3,478.00 571,783,200	- -	2.62%
7	アルプス電気 日本	株式 電気機器	167,200	2,279.69 381,164,750	3,345.00 559,284,000	- -	2.57%
8	東ソー 日本	株式 化学	544,000	490.23 266,690,240	977.00 531,488,000	- -	2.44%
9	日本電産 日本	株式 電気機器	46,900	8,250.97 386,970,630	10,490.00 491,981,000	- -	2.26%
10	三菱ケミカルホールディン グス 日本	株式 化学	532,700	564.89 300,918,090	862.70 459,560,290	- -	2.11%
11	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	108,900	4,041.58 440,128,658	4,207.00 458,142,300	- -	2.10%
12	ニトリホールディングス 日本	株式 小売業	34,500	9,543.22 329,241,408	13,080.00 451,260,000	- -	2.07%
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	87,600	3,981.98 348,821,818	4,919.00 430,904,400	- -	1.98%
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	122,300	3,071.04 375,588,887	3,489.00 426,704,700	- -	1.96%
15	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	66,400	6,186.06 410,754,964	6,365.00 422,636,000	- -	1.94%
16	塩野義製薬 日本	株式 医薬品	74,900	5,354.31 401,038,061	5,498.00 411,800,200	- -	1.89%
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	25,300	13,743.04 347,698,915	16,150.00 408,595,000	- -	1.87%
18	日本M&Aセンター 日本	株式 サービス業	111,800	3,079.75 344,316,144	3,445.00 385,151,000	- -	1.77%
19	新日鉄住金ソリューションズ 日本	株式 情報・通信業	161,600	2,009.50 324,736,497	2,273.00 367,316,800	- -	1.68%
20	エムスリー 日本	株式 サービス業	128,600	2,790.43 358,850,305	2,850.00 366,510,000	- -	1.68%

21	ウエルシアホールディングス 日本	株式 小売業	110,400	3,199.36 353,209,744	3,135.00 346,104,000	- -	1.59%
22	三井不動産 日本	株式 不動産業	136,000	2,775.43 377,459,720	2,543.00 345,848,000	- -	1.59%
23	小糸製作所 日本	株式 電気機器	59,300	4,882.04 289,505,128	5,790.00 343,347,000	- -	1.57%
24	オリックス 日本	株式 その他金融業	194,700	1,598.87 311,300,699	1,747.50 340,238,250	- -	1.56%
25	HOYA 日本	株式 精密機器	66,400	4,360.42 289,531,978	5,084.00 337,577,600	- -	1.55%
26	キーエンス 日本	株式 電気機器	7,700	30,125.00 231,962,500	43,460.00 334,642,000	- -	1.53%
27	キリンホールディングス 日本	株式 食料品	172,000	1,725.87 296,851,120	1,934.00 332,648,000	- -	1.53%
28	スズキ 日本	株式 輸送用機器	70,200	4,285.93 300,872,440	4,394.00 308,458,800	- -	1.41%
29	日東電工 日本	株式 化学	32,400	8,994.36 291,417,494	9,460.00 306,504,000	- -	1.41%
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	180,200	1,307.53 235,618,342	1,647.50 296,879,500	- -	1.36%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
株式	98.28%
合計	98.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成29年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
情報・通信業	国内	15.79%
電気機器		15.44%
化学		8.81%
輸送用機器		8.26%
銀行業		7.50%
小売業		6.96%
サービス業		4.65%
食料品		3.78%
卸売業		3.51%
医薬品		3.33%
機械		3.24%
不動産業		2.59%
非鉄金属		2.12%
保険業		1.98%
陸運業		1.72%
建設業		1.71%
その他金融業		1.56%
精密機器		1.55%
水産・農林業		1.10%
その他製品		0.89%
鉄鋼		0.63%
繊維製品		0.60%
金属製品		0.57%
合計	98.28%	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成29年2月28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	1,197,000,000	139.16 1,665,745,200	128.09 1,533,333,060	2.000000 2040/9/20	5.27%
2	333回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	1,048,000,000	104.34 1,093,502,280	104.70 1,097,350,320	0.600000 2024/3/20	3.77%
3	151回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	866,000,000	122.35 1,059,599,990	111.80 968,257,280	1.200000 2034/12/20	3.33%
4	145回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	757,000,000	126.10 954,622,420	120.26 910,383,340	1.700000 2033/6/20	3.13%
5	53回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証券	953,000,000	94.30 898,746,190	95.18 907,122,580	0.600000 2046/12/20	3.12%
6	473回 東北電力社債 日本	社債券	750,000,000	101.95 764,670,000	101.69 762,712,500	0.597000 2021/4/23	2.62%
7	76回 伊藤忠商事社債 日本	社債券	600,000,000	101.81 610,870,000	101.27 607,662,000	0.560000 2021/1/29	2.09%
8	8回 ジャックス社債 日本	社債券	500,000,000	103.39 516,950,000	102.55 512,790,000	1.130000 2020/6/19	1.76%
9	158回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	475,000,000	96.47 458,278,560	97.90 465,058,250	0.500000 2036/9/20	1.60%
10	21回 トピー工業社債 日本	社債券	400,000,000	103.50 414,020,000	103.01 412,060,000	1.260000 2020/6/5	1.42%
11	59回 日産自動車社債 日本	社債券	400,000,000	100.19 400,771,000	99.97 399,900,000	0.150000 2021/3/19	1.37%
12	146回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	327,000,000	126.26 412,899,630	120.27 393,302,520	1.700000 2033/9/20	1.35%
13	156回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	384,000,000	103.28 396,626,760	96.66 371,185,920	0.400000 2036/3/20	1.28%
14	155回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	338,000,000	110.16 372,363,050	107.66 363,917,840	1.000000 2035/12/20	1.25%
15	147回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	293,000,000	124.71 365,403,230	118.70 347,808,580	1.600000 2033/12/20	1.20%
16	44回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証券	277,000,000	136.36 377,719,180	123.52 342,167,020	1.700000 2044/9/20	1.18%
17	3回 野村不動産ホールディングス社債 日本	社債券	300,000,000	107.49 322,476,000	105.98 317,946,000	2.010000 2020/8/12	1.09%

18	11回 日本製紙グループ本社社債 日本	社債券	300,000,000	105.38 316,152,000	104.83 314,493,000	1.495000 2020/12/9	1.08%
19	37回 電源開発社債 日本	社債券	300,000,000	104.43 313,297,000	103.76 311,286,000	1.035000 2021/7/20	1.07%
20	17回 東京建物社債 日本	社債券	300,000,000	103.95 311,874,000	102.96 308,907,000	1.300000 2020/3/18	1.06%
21	12回 森ビル社債 日本	社債券	300,000,000	102.54 307,638,000	102.22 306,681,000	0.800000 2020/11/5	1.05%
22	13回 パナソニック社債 日本	社債券	300,000,000	101.51 304,545,000	101.90 305,718,000	0.568000 2022/3/18	1.05%
23	382回 中国電力社債 日本	社債券	300,000,000	101.64 304,932,000	101.48 304,440,000	0.517000 2021/5/25	1.05%
24	4回 出光興産社債 日本	社債券	300,000,000	102.02 306,083,000	101.35 304,071,000	0.541000 2021/8/4	1.04%
25	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	100.67 302,010,000	100.52 301,569,000	0.281000 2020/12/3	1.04%
26	56回 クレディセゾン社債 日本	社債券	300,000,000	102.43 307,310,000	100.30 300,909,000	0.538000 2022/9/22	1.03%
27	30回 三菱マテリアル社債 日本	社債券	300,000,000	100.00 300,000,000	100.06 300,186,000	0.200000 2021/12/6	1.03%
28	13回 大陽日酸社債 日本	社債券	300,000,000	100.00 300,000,000	100.03 300,117,000	0.140000 2021/12/15	1.03%
29	101回 丸紅社債 日本	社債券	300,000,000	101.13 303,392,000	99.91 299,736,000	0.436000 2021/7/23	1.03%
30	150回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	234,000,000	120.47 281,907,960	115.26 269,724,780	1.400000 2034/9/20	0.93%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	35.00%
社債券	63.01%
合計	98.01%

(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29年2月28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	13,250	11,650.61 154,370,688	15,412.84 204,220,140	- -	2.26%
2	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	65,096	1,702.97 110,857,186	2,765.59 180,029,445	- -	1.99%
3	ALTRIA GROUP INC アメリカ	株式 タバコ	20,129	7,573.46 152,446,321	8,395.85 169,000,072	- -	1.87%
4	IMPERIAL BRANDS PLC イギリス	株式 タバコ	28,486	5,342.11 152,175,503	5,330.25 151,837,679	- -	1.68%
5	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	1,460	74,739.76 109,120,053	95,522.91 139,463,460	- -	1.54%
6	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	1,431	84,447.01 120,843,677	95,638.85 136,859,201	- -	1.51%
7	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	18,611	6,063.84 112,854,141	7,229.72 134,552,482	- -	1.49%
8	NORTHLAND POWER INC カナダ	株式 独立系発電事 業者・エネル ギー販売業者	48,248	2,042.50 98,546,633	2,024.16 97,662,105	- -	1.08%
9	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD シンガポール	株式 不動産管理・ 開発	426,900	185.20 79,066,063	219.33 93,634,965	- -	1.03%
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	6,624	12,292.60 81,426,221	13,777.34 91,261,126	- -	1.01%
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	8,481	7,050.33 59,793,923	10,178.80 86,326,409	- -	0.95%
12	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	8,641	8,451.35 73,028,167	9,905.27 85,591,524	- -	0.95%
13	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	5,560	12,427.89 69,099,089	15,354.30 85,369,961	- -	0.94%
14	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	27,584	2,543.42 70,157,707	3,037.37 83,782,876	- -	0.93%
15	PRUDENTIAL FINANCIAL INC アメリカ	株式 保険	6,142	10,267.82 63,065,000	12,488.53 76,704,563	- -	0.85%
16	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	4,603	14,568.57 67,059,172	16,354.96 75,281,917	- -	0.83%

17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	5,956	10,902.42 64,934,862	12,578.57 74,918,022	- -	0.83%
18	T-MOBILE US INC アメリカ	株式 無線通信サー ビス	10,688	5,250.69 56,119,375	6,997.85 74,793,076	- -	0.83%
19	CHARTER COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 メディア	1,905	35,602.61 67,822,990	36,776.72 70,059,668	- -	0.77%
20	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	5,676	11,232.23 63,754,144	12,235.27 69,447,403	- -	0.77%
21	TESARO INC アメリカ	株式 バイオテクノ ロジー	3,257	16,104.52 52,452,444	21,095.99 68,709,656	- -	0.76%
22	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	16,244	3,601.82 58,508,099	4,224.37 68,620,776	- -	0.76%
23	ATMOS ENERGY CORP アメリカ	株式 ガス	7,691	8,214.08 63,174,537	8,810.07 67,758,257	- -	0.75%
24	CSX CORP アメリカ	株式 陸運・鉄道	12,296	3,324.30 40,875,648	5,482.79 67,416,479	- -	0.75%
25	NXP SEMICONDUCTOR NV オランダ	株式 半導体・半導 体製造装置	5,788	11,538.27 66,783,564	11,572.29 66,980,435	- -	0.74%
26	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	8,031	8,051.55 64,662,002	8,282.22 66,514,516	- -	0.74%
27	RIO TINTO PLC イギリス	株式 金属・鉱業	13,803	4,229.20 58,375,664	4,670.35 64,464,882	- -	0.71%
28	ADOBE SYSTEMS INC アメリカ	株式 ソフトウェア	4,771	9,793.84 46,726,437	13,369.87 63,787,682	- -	0.70%
29	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	13,453	4,508.42 60,651,877	4,707.25 63,326,758	- -	0.70%
30	ING GROEP NV-CVA オランダ	株式 商業銀行	40,920	1,367.59 55,961,887	1,538.41 62,951,794	- -	0.70%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
株式	98.77%
合計	98.77%

(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29年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	10.93%
石油・ガス・消耗燃料		7.62%
半導体・半導体製造装置		5.66%
医薬品		5.32%
タバコ		4.93%
バイオテクノロジー		4.43%
ソフトウェア		3.98%
インターネットソフトウェア・サービス		3.73%
メディア		3.54%
食品		2.96%
コンピュータ・周辺機器		2.94%
化学		2.77%
保険		2.64%
情報技術サービス		2.38%
金属・鉱業		2.37%
不動産管理・開発		2.24%
インターネット販売・通信販売		2.14%
資本市場		1.91%
航空宇宙・防衛		1.73%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		1.63%
コングロマリット		1.53%
ガス		1.49%
飲料		1.48%
建設資材		1.24%
陸運・鉄道		1.24%
無線通信サービス		1.22%
ホテル・レストラン・レジャー		1.18%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.13%
総合公益事業		1.12%
各種電気通信サービス		1.05%
水道		1.02%
専門小売り		1.01%
繊維・アパレル・贅沢品		0.97%
通信機器		0.96%
建設・土木		0.95%
食品・生活必需品小売り		0.81%
機械		0.64%
ヘルスケア機器・用品		0.61%
家庭用品		0.61%
商業サービス・用品		0.40%
電子装置・機器・部品		0.40%
電気設備		0.40%
商社・流通業		0.32%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.27%
運送インフラ		0.26%
パーソナル用品		0.25%
自動車		0.20%



複合小売り	0.15%
合計	98.77%

(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29年2月28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 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	103.12 1,276,894,796	100.53 1,244,734,629	2.000000 2022/2/15	11.72%
2	US T N/B 0.875 04/15/19 アメリカ	国債証券	695,845,920	99.32 691,137,919	99.22 690,487,906	0.875000 2019/4/15	6.50%
3	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	583,060,800	92.89 541,620,726	92.57 539,786,027	1.500000 2026/8/15	5.08%
4	ITALY BTPS 2.5 12/01/24 イタリア	国債証券	362,889,000	109.85 398,666,226	104.65 379,795,998	2.500000 2024/12/1	3.58%
5	US T N/B 1.125 08/31/21 アメリカ	国債証券	366,945,600	99.73 365,955,159	97.00 355,962,918	1.125000 2021/8/31	3.35%
6	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26 ドイツ	国債証券	293,523,660	104.61 307,070,607	104.23 305,966,127	0.500000 2026/2/15	2.88%
7	SWEDEN 5.0 12/01/20 スウェーデン	国債証券	229,400,000	121.22 278,078,680	120.45 276,328,358	5.000000 2020/12/1	2.60%
8	BUNDESOBL 0.5 04/12/19 ドイツ	国債証券	255,807,000	103.03 263,574,549	103.09 263,716,552	0.500000 2019/4/12	2.48%
9	US T N/B 1.375 09/30/20 アメリカ	国債証券	258,888,000	100.26 259,575,451	99.08 256,519,174	1.375000 2020/9/30	2.41%
10	UK TREASURY 3.25 01/22/44 イギリス	国債証券	196,433,050	122.55 240,731,498	130.34 256,050,480	3.250000 2044/1/22	2.41%
11	US T N/B 2.5 05/15/46 アメリカ	国債証券	263,390,400	94.22 248,191,035	90.17 237,501,757	2.500000 2046/5/15	2.24%
12	US T N/B 1.0 09/15/18 アメリカ	国債証券	230,748,000	99.84 230,394,955	99.87 230,450,335	1.000000 2018/9/15	2.17%
13	FRANCE OAT 1.0 05/25/19 フランス	国債証券	216,543,600	104.18 225,596,502	103.36 223,836,788	1.000000 2019/5/25	2.11%
14	CANADA 1.0 06/01/27 カナダ	国債証券	228,604,000	93.59 213,950,688	92.88 212,341,111	1.000000 2027/6/1	2.00%
15	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	205,984,800	101.77 209,632,271	97.43 200,705,409	2.000000 2025/8/15	1.89%
16	US T N/B 3.0 11/15/44 アメリカ	国債証券	195,291,600	107.48 209,904,166	100.13 195,565,008	3.000000 2044/11/15	1.84%
17	ITALY BTPS 0.75 01/15/18 イタリア	国債証券	193,342,500	101.37 195,999,025	100.89 195,069,048	0.750000 2018/1/15	1.84%
18	SPAIN 1.6 04/30/25 スペイン	国債証券	189,178,200	101.97 192,916,551	102.06 193,088,513	1.600000 2025/4/30	1.82%
19	FRANCE OAT 4.0 10/25/38 フランス	国債証券	131,472,900	152.58 200,602,665	144.06 189,401,174	4.000000 2038/10/25	1.78%
20	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	157,584,000	104.01 163,910,997	101.99 160,723,073	2.250000 2021/3/31	1.51%
21	FRANCE OAT 3.75 04/25/21 フランス	国債証券	136,827,000	119.69 163,772,162	116.69 159,674,372	3.750000 2021/4/25	1.50%

22	FRANCE OAT 3.25 10/25/21 フランス	国債証券	135,637,200	118.09 160,179,561	115.75 157,009,553	3.250000 2021/10/25	1.48%
23	NETHERLANDS 3.25 07/15/21 オランダ	国債証券	124,929,000	118.79 148,409,405	117.04 146,229,394	3.250000 2021/7/15	1.38%
24	CANADA 2.75 12/01/48 カナダ	国債証券	124,538,000	110.89 138,109,955	108.63 135,298,083	2.750000 2048/12/1	1.27%
25	SPAIN 0.25 04/30/18 スペイン	国債証券	134,447,400	100.28 134,830,575	100.61 135,268,873	0.250000 2018/4/30	1.27%
26	ITALY BTPS 4.5 02/01/20 イタリア	国債証券	118,980,000	115.90 137,897,820	111.87 133,102,926	4.500000 2020/2/1	1.25%
27	FRANCE OAT 0.5 05/25/25 フランス	国債証券	127,308,600	101.43 129,133,943	99.27 126,380,520	0.500000 2025/5/25	1.19%
28	US T N/B 3.125 02/15/42 アメリカ	国債証券	122,690,400	110.83 135,985,028	102.78 126,112,235	3.125000 2042/2/15	1.19%
29	KFW 4.875 06/17/19 ドイツ	特殊債券	112,560,000	110.64 124,537,509	107.34 120,830,908	4.875000 2019/6/17	1.14%
30	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証券	99,705,240	121.24 120,891,673	110.89 110,572,114	3.500000 2030/3/1	1.04%

(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29年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	97.08%
特殊債券	1.14%
合計	98.22%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資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）

DL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。

DL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。

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

該当事項はありません。

## D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成29年2月28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2017年04月	買建	7,712,000	920,937,734	917,573,760	8.64%
		イギリス・ボンド買/円売2017年04月	買建	1,286,000	180,923,353	179,679,920	1.69%
		南アフリカ・ランド買/円売2017年04月	買建	6,240,000	54,050,880	53,476,800	0.50%
		ノルウェー・クローネ買/円売2017年04月	買建	2,242,000	30,293,904	30,042,800	0.28%
		スイス・フラン買/円売2017年04月	買建	185,000	20,735,595	20,633,050	0.19%
		スウェーデン・クローナ売/円買2017年04月	売建	37,007,000	466,384,418	458,886,800	4.32%
		アメリカ・ドル売/円買2017年04月	売建	3,121,000	352,631,802	350,737,980	3.30%
		カナダ・ドル売/円買2017年04月	売建	2,375,000	204,210,100	202,326,250	1.90%
		オーストラリア・ドル売/円買2017年04月	売建	1,801,000	156,464,936	155,156,150	1.46%
		デンマーク・クローネ売/円買2017年04月	売建	682,000	10,958,239	10,918,820	0.10%
		メキシコ・ペソ売/円買2017年04月	売建	991,000	5,603,064	5,549,600	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29年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

バランス物語30（安定型）

	純資産総額 (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
第31計算期間末 (平成28年8月25日)	3,174	3,177	1.1795	1.1805
第32計算期間末 (平成29年2月27日)	3,107	3,110	1.2059	1.2069

平成28年2月末日	3,238	-	1.1752	-
3月末日	3,283	-	1.1974	-
4月末日	3,260	-	1.1969	-
5月末日	3,282	-	1.2075	-
6月末日	3,219	-	1.1862	-
7月末日	3,236	-	1.1968	-
8月末日	3,182	-	1.1815	-
9月末日	3,163	-	1.1814	-
10月末日	3,165	-	1.1886	-
11月末日	3,186	-	1.2003	-
12月末日	3,167	-	1.2098	-
平成29年1月末日	3,142	-	1.2045	-
2月末日	3,110	-	1.2063	-

## 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
第31計算期間末 (平成28年8月25日)	1,355	1,357	1.1969	1.1989
第32計算期間末 (平成29年2月27日)	1,361	1,363	1.2666	1.2686
平成28年2月末日	1,414	-	1.2003	-
3月末日	1,435	-	1.2336	-
4月末日	1,416	-	1.2266	-
5月末日	1,426	-	1.2419	-
6月末日	1,370	-	1.1937	-
7月末日	1,388	-	1.2205	-
8月末日	1,364	-	1.2040	-
9月末日	1,344	-	1.2033	-
10月末日	1,345	-	1.2181	-
11月末日	1,377	-	1.2472	-
12月末日	1,380	-	1.2699	-
平成29年1月末日	1,370	-	1.2659	-
2月末日	1,363	-	1.2675	-

## 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
第31計算期間末 (平成28年8月25日)	772	774	1.1936	1.1966
第32計算期間末 (平成29年2月27日)	773	775	1.3045	1.3075
平成28年2月末日	789	-	1.2048	-
3月末日	805	-	1.2480	-
4月末日	796	-	1.2345	-
5月末日	809	-	1.2541	-
6月末日	763	-	1.1805	-
7月末日	791	-	1.2230	-
8月末日	781	-	1.2056	-
9月末日	777	-	1.2042	-
10月末日	760	-	1.2263	-
11月末日	786	-	1.2726	-
12月末日	788	-	1.3077	-
平成29年1月末日	783	-	1.3050	-
2月末日	775	-	1.3061	-



## 【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
第31計算期間	0.0010
第32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
第31計算期間	0.0020
第32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
第31計算期間	0.0030
第32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
第31計算期間	0.6
第32計算期間	2.3

（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
第31計算期間	0.2
第32計算期間	6.0

(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
第31計算期間	0.2
第32計算期間	9.5

(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
第31計算期間	9,942,867	72,002,586
第32計算期間	9,698,496	123,820,961

(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
第31計算期間	8,080,417	53,037,312
第32計算期間	7,980,600	65,718,684

(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
第31計算期間	8,864,487	15,108,743
第32計算期間	7,827,006	61,897,020

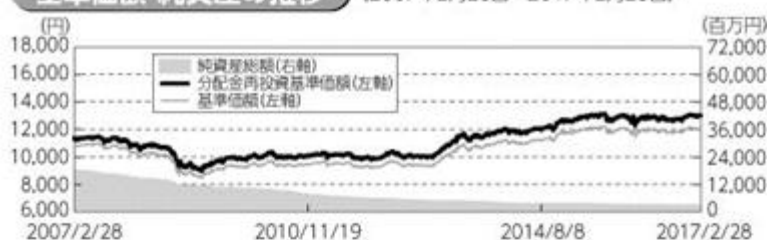
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2017年2月28日

## バランス物語30(安定型)

## 基準価額・純資産の推移 (2007年2月28日～2017年2月28日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2000年12月27日)  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 主要な資産の状況

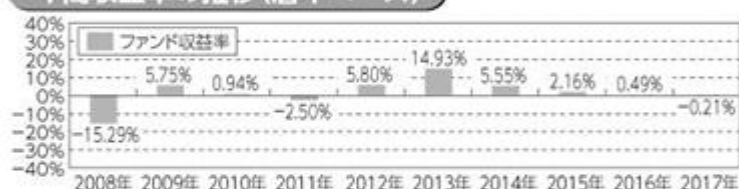
※投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	66.19%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	18.90%
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	8.50%
4	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	4.93%

※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。

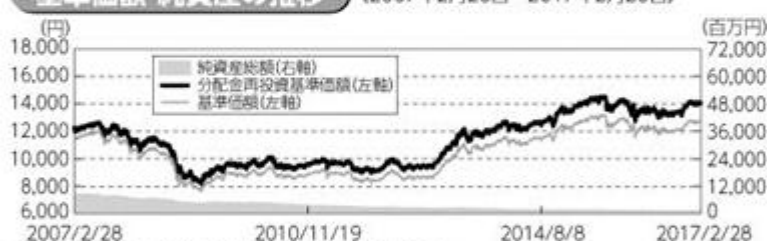
## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2017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 (2007年2月28日～2017年2月28日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2000年12月27日)  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 主要な資産の状況

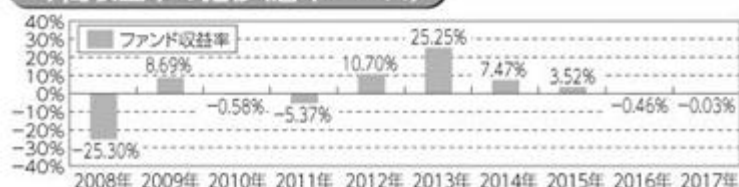
※投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 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	43.77%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	30.32%
3	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	12.38%
4	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	11.98%

※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(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## 分配の推移(税引前)

第28期	(2015.02.25)	10円
第29期	(2015.08.25)	10円
第30期	(2016.02.25)	10円
第31期	(2016.08.25)	10円
第32期	(2017.02.27)	10円
設定来累計		775円

※分配金は1万円当たりです。

## 分配の推移(税引前)

第28期	(2015.02.25)	20円
第29期	(2015.08.25)	20円
第30期	(2016.02.25)	20円
第31期	(2016.08.25)	20円
第32期	(2017.02.27)	20円
設定来累計		1,055円

※分配金は1万円当たりです。

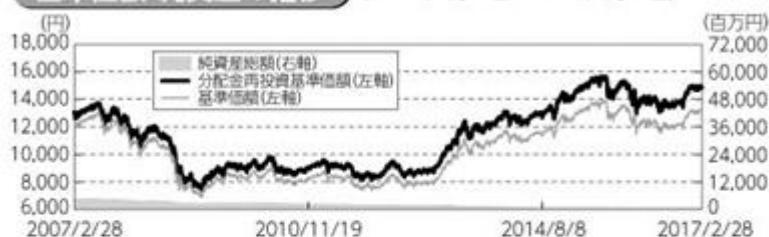
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社の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：2017年2月28日

## バランス物語70(成長型)

## 基準価額・純資産の推移 (2007年2月28日～2017年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2000年12月27日)  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 主要な資産の状況

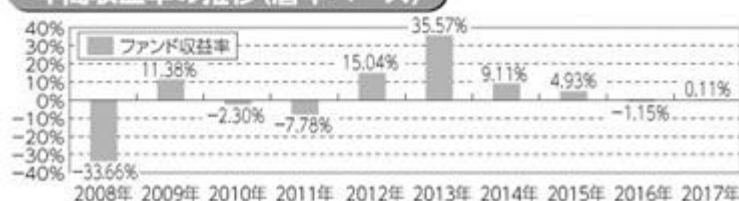
※投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 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	40.16%
2	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	22.51%
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	19.53%
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	16.39%

※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(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## 分配の推移(税引前)

第28期	(2015.02.25)	30円
第29期	(2015.08.25)	30円
第30期	(2016.02.25)	30円
第31期	(2016.08.25)	30円
第32期	(2017.02.27)	30円
設定来累計		1,300円

※分配金は1万口当たりです。

## 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

※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	98.28
内 日本	98.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.72
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	3.88%
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	3.16%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	2.89%
4	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.72%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	2.66%
6	ソニー	株式	日本	電気機器	2.62%
7	アルプス電気	株式	日本	電気機器	2.57%
8	東ソー	株式	日本	化学	2.44%
9	日本電産	株式	日本	電気機器	2.26%
10	三菱ケミカルホールディングス	株式	日本	化学	2.11%

## 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	15.79%
2	電気機器	15.44%
3	化学	8.81%
4	輸送用機器	8.26%
5	銀行業	7.50%

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

○委託会社の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：2017年2月28日

### ■DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

※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	35.00
内 日本	35.00
社債券	63.01
内 日本	63.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.99
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	5.27%
2	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/3/20	3.77%
3	151回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.200000	2034/12/20	3.33%
4	145回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.700000	2033/6/20	3.13%
5	53回 利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	0.600000	2046/12/20	3.12%
6	473回 東北電力社債	社債券	日本	0.597000	2021/4/23	2.62%
7	76回 伊藤忠商事社債	社債券	日本	0.560000	2021/1/29	2.09%
8	8回 ジャックス社債	社債券	日本	1.130000	2020/6/19	1.76%
9	158回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	0.500000	2036/9/20	1.60%
10	21回 トピー工業社債	社債券	日本	1.260000	2020/6/5	1.42%

### ■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

※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	98.77
内 アメリカ	68.29
内 イギリス	6.28
内 カナダ	4.81
内 フランス	3.73
内 ドイツ	3.48
内 その他	12.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.23
純資産総額	100.00

#### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.26%
2	BANK OF AMERICA CORP	株式	アメリカ	商業銀行	1.99%
3	ALTRIA GROUP INC	株式	アメリカ	タバコ	1.87%
4	IMPERIAL BRANDS PLC	株式	イギリス	タバコ	1.68%
5	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.54%
6	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	1.51%
7	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.49%
8	NORLAND POWER INC	株式	カナダ	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	1.08%
9	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	株式	シンガポール	不動産管理・開発	1.03%
10	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.01%

#### 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	10.93%
2	石油・ガス・消耗燃料	7.62%
3	半導体・半導体製造装置	5.66%
4	医薬品	5.32%
5	タバコ	4.93%

### ■DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

※投資比率(%)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	97.08
内 アメリカ	40.74
内 フランス	9.50
内 イタリア	9.23
内 ドイツ	9.19
内 スウェーデン	4.77
内 その他	23.65
特殊債券	1.14
内 ドイツ	1.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.78
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 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	11.72%
2	US T N/B 0.875 04/15/19	国債証券	アメリカ	0.875000	2019/4/15	6.50%
3	US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	アメリカ	1.500000	2026/8/15	5.08%
4	ITALY BTFS 2.5 12/01/24	国債証券	イタリア	2.500000	2024/12/1	3.58%
5	US T N/B 1.125 08/31/21	国債証券	アメリカ	1.125000	2021/8/31	3.35%
6	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	ドイツ	0.500000	2026/2/15	2.88%
7	SWEDEN 5.0 12/01/20	国債証券	スウェーデン	5.000000	2020/12/1	2.60%
8	BUNDESOWL 0.5 04/12/19	国債証券	ドイツ	0.500000	2019/4/12	2.48%
9	US T N/B 1.375 09/30/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/9/30	2.41%
10	UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	イギリス	3.250000	2044/1/22	2.41%

#### 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)	11.31
為替予約取引(売建)	△11.14

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 3 資産管理等の概要 (1)資産の評価」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>

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

##### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日 における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

### 4【受益者の権利等】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 4 受益者の権利等」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)収益分配金請求権

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

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

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

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

## (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

## (3) 一部解約請求権

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

## (4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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32期計算期間(平成28年8月26日から平成29年2月27日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	125,805,141	73,377,185
親投資信託受益証券	3,079,196,564	3,063,233,711
流動資産合計	3,205,001,705	3,136,610,896
資産合計	3,205,001,705	3,136,610,896
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,691,264	2,577,142
未払解約金	1,637,827	-
未払受託者報酬	1,743,137	1,739,572
未払委託者報酬	24,404,499	24,354,744
その他未払費用	79,197	78,194
流動負債合計	30,555,924	28,749,652
負債合計	30,555,924	28,749,652
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,269,126,497	1,257,142,511
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	483,180,805	530,718,733
（分配準備積立金）	510,301,524	534,729,284
元本等合計	3,174,445,781	3,107,861,244
純資産合計	3,174,445,781	3,107,861,244
負債純資産合計	3,205,001,705	3,136,610,896



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第31期		第32期	
	自	平成28年2月26日 平成28年8月25日	自	平成28年8月26日 平成29年2月27日
営業収益				
受取利息		1		-
有価証券売買等損益		45,841,451		99,037,147
営業収益合計		45,841,452		99,037,147
営業費用				
支払利息		15,881		23,084
受託者報酬		1,743,137		1,739,572
委託者報酬		24,404,499		24,354,744
その他費用		79,197		78,194
営業費用合計		26,242,714		26,195,594
営業利益又は営業損失( )		19,598,738		72,841,553
経常利益又は経常損失( )		19,598,738		72,841,553
当期純利益又は当期純損失( )		19,598,738		72,841,553
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( )		1,331,767		2,371,789
期首剰余金又は期首欠損金( )		478,246,007		483,180,805
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,867,498		1,878,229
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,867,498		1,878,229
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,508,407		22,232,923
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,508,407		22,232,923
分配金		1 2,691,264		1 2,577,142
期末剰余金又は期末欠損金( )		483,180,805		530,718,733

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年2月25日及び8月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成29年2月27日としております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1. 1 期首元本額	2,753,324,695円	2,691,264,976円
期中追加設定元本額	9,942,867円	9,698,496円
期中一部解約元本額	72,002,586円	123,820,961円
2. 受益権の総数	2,691,264,976口	2,577,142,511口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第31期 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第32期 自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27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(8,358,736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(37,700,929円)及び分配準備積立金(504,634,052円)より分配対象収益は550,693,717円(1万口当たり2,046.23円)であり、うち2,691,264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(12,962,141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(37,465,933円)、信託約款に規定される収益調整金(37,894,801円)及び分配準備積立金(486,878,352円)より分配対象収益は575,201,227円(1万口当たり2,231.93円)であり、うち2,577,142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31期 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第32期 自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27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	41,847,810	81,045,413
合計	41,847,810	81,045,413

（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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.1795円	1.2059円
（1万口当たり純資産額）	(11,795円)	(12,059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29年2月27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	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	255,067,728	588,211,687	
	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	1,339,058,946	2,058,669,223	
	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	63,756,788	152,569,993	
	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	118,245,835	263,782,808	
親投資信託受益証券 合計		1,776,129,297	3,063,233,711	
合計		1,776,129,297	3,063,233,711	

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50(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32期計算期間(平成28年8月26日から平成29年2月27日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	47,862,471	53,129,049
親投資信託受益証券	1,321,198,324	1,321,692,155
流動資産合計	1,369,060,795	1,374,821,204
資産合計	1,369,060,795	1,374,821,204
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,264,893	2,149,417
未払解約金	-	195,206
未払受託者報酬	753,042	750,478
未払委託者報酬	10,543,228	10,507,444
その他未払費用	34,178	33,685
流動負債合計	13,595,341	13,636,230
負債合計	13,595,341	13,636,230
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,132,446,610	1,107,708,526
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	223,018,844	286,476,448
（分配準備積立金）	278,786,590	280,854,318
元本等合計	1,355,465,454	1,361,184,974
純資産合計	1,355,465,454	1,361,184,974
負債純資産合計	1,369,060,795	1,374,821,204



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第31期		第32期	
	自	平成28年2月26日 平成28年8月25日	自	平成28年8月26日 平成29年2月27日
営業収益				
有価証券売買等損益		15,241,957		90,493,831
営業収益合計		15,241,957		90,493,831
営業費用				
支払利息		7,018		10,581
受託者報酬		753,042		750,478
委託者報酬		10,543,228		10,507,444
その他費用		34,178		33,685
営業費用合計		11,337,466		11,302,188
営業利益又は営業損失( )		3,904,491		79,191,643
経常利益又は経常損失( )		3,904,491		79,191,643
当期純利益又は当期純損失( )		3,904,491		79,191,643
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( )		1,312,897		2,483,352
期首剰余金又は期首欠損金( )		231,399,029		223,018,844
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,719,819		1,845,437
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,719,819		1,845,437
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,426,705		12,946,707
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,426,705		12,946,707
分配金		1,226,893		1,214,417
期末剰余金又は期末欠損金( )		223,018,844		286,476,448

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年2月25日及び8月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成29年2月27日としております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1. 1 期首元本額	1,177,403,505円	1,132,446,610円
期中追加設定元本額	8,080,417円	7,980,600円
期中一部解約元本額	53,037,312円	65,718,684円
2. 受益権の総数	1,132,446,610口	1,074,708,526口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第31期 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第32期 自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27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(1,974,612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(67,197,890円)及び分配準備積立金(279,076,871円)より分配対象収益は348,249,373円(1万口当たり3,075.19円)であり、うち2,264,893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(8,018,252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(12,313,319円)、信託約款に規定される収益調整金(65,681,484円)及び分配準備積立金(262,672,164円)より分配対象収益は348,685,219円(1万口当たり3,244.46円)であり、うち2,149,417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31期 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第32期 自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27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	12,090,596	79,427,086
合計	12,090,596	79,427,086

(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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1969円 (11,969円)	1.2666円 (12,666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29年2月27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	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	177,230,405	408,711,036	
	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	378,536,304	581,961,713	
	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	67,906,199	162,499,534	
	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	75,542,349	168,519,872	
親投資信託受益証券 合計		699,215,257	1,321,692,155	
合計		699,215,257	1,321,692,155	

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32期計算期間(平成28年8月26日から平成29年2月27日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	31,124,428	29,072,359
親投資信託受益証券	750,286,931	753,092,809
流動資産合計	781,411,359	782,165,168
資産合計	781,411,359	782,165,168
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,941,963	1,779,753
未払解約金	481,188	198
未払受託者報酬	423,221	429,997
未払委託者報酬	5,925,657	6,020,572
その他未払費用	19,162	19,259
流動負債合計	8,791,191	8,249,779
負債合計	8,791,191	8,249,779
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,647,321,055	1,593,251,041
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	125,299,113	180,664,348
（分配準備積立金）	186,224,008	178,761,682
元本等合計	772,620,168	773,915,389
純資産合計	772,620,168	773,915,389
負債純資産合計	781,411,359	782,165,168



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第31期		第32期	
	自	平成28年2月26日 平成28年8月25日	自	平成28年8月26日 平成29年2月27日
営業収益				
有価証券売買等損益		5,388,585		77,805,878
営業収益合計		5,388,585		77,805,878
営業費用				
支払利息		3,963		5,522
受託者報酬		423,221		429,997
委託者報酬		5,925,657		6,020,572
その他費用		19,162		19,259
営業費用合計		6,372,003		6,475,350
営業利益又は営業損失( )		983,418		71,330,528
経常利益又は経常損失( )		983,418		71,330,528
当期純利益又は当期純損失( )		983,418		71,330,528
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( )		538,846		4,122,439
期首剰余金又は期首欠損金( )		129,882,542		125,299,113
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,884,395		1,929,882
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,884,395		1,929,882
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,003,597		11,992,983
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,003,597		11,992,983
分配金		1,941,963		1,779,753
期末剰余金又は期末欠損金( )		125,299,113		180,664,348

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年2月25日及び8月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成29年2月27日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1. 1 期首元本額	653,565,311円	647,321,055円
期中追加設定元本額	8,864,487円	7,827,006円
期中一部解約元本額	15,108,743円	61,897,020円
2. 受益権の総数	647,321,055口	593,251,041口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第31期 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第32期 自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27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(680,206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(75,658,280円)及び分配準備積立金(187,485,765円)より分配対象収益は263,824,251円(1万口当たり4,075.63円)であり、うち1,941,963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(5,548,414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(6,447,787円)、信託約款に規定される収益調整金(71,473,712円)及び分配準備積立金(168,545,234円)より分配対象収益は252,015,147円(1万口当たり4,248.04円)であり、うち1,779,753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31期 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日	第32期 自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27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	4,369,487	68,525,856
合計	4,369,487	68,525,856

(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31期 平成28年8月25日現在	第32期 平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.1936円	1.3045円
(1万口当たり純資産額)	(11,936円)	(13,045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29年2月27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	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	135,031,920	311,397,110	
	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	110,214,867	169,444,336	
	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	60,811,343	145,521,543	
	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	56,809,136	126,729,820	
親投資信託受益証券 合計		362,867,266	753,092,809	
合計		362,867,266	753,092,809	

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28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		937,505	4,772
コール・ローン		173,514,638	167,373,227
株式		20,814,251,170	21,441,010,690
未収入金		230,410,543	182,267,731
未収配当金		24,012,600	27,485,700
流動資産合計		21,243,126,456	21,818,142,120
資産合計		21,243,126,456	21,818,142,120
負債の部			
流動負債			
未払金		218,882,973	109,591,647
流動負債合計		218,882,973	109,591,647
負債合計		218,882,973	109,591,647
純資産の部			
元本等			
元本	1	10,686,522,124	9,413,691,155
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		10,337,721,359	12,294,859,318
元本等合計		21,024,243,483	21,708,550,473
純資産合計		21,024,243,483	21,708,550,473
負債純資産合計		21,243,126,456	21,818,142,120

## 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28年8月25日現在	平成29年2月27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	10,704,549,483円	10,686,522,124円
同期中追加設定元本額	800,804,517円	35,745,238円
同期中一部解約元本額	818,831,876円	1,308,576,207円
元本の内訳		
ファンド名		
バランス物語30（安定型）	309,326,624円	255,067,728円
バランス物語50（安定・成長型）	206,668,222円	177,230,405円
バランス物語70（成長型）	157,752,094円	135,031,920円
DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型	879,284,849円	774,891,663円
DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,327,018,138円	3,018,601,084円
DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型	3,802,801,521円	3,549,243,226円
DIAMライフサイクル・ファンドVA1（安定型）	197,779,057円	144,812,972円
DIAMライフサイクル・ファンドVA2（安定・成長型）	896,094,441円	650,926,676円
DIAMライフサイクル・ファンドVA3（成長型）	433,062,770円	345,805,707円
DIAMバランス物語30VA（安定型）	136,646,177円	109,219,889円
DIAMバランス物語50VA（安定・成長型）	210,393,073円	146,415,669円
DIAMバランス物語70VA（成長型）	129,695,158円	106,444,216円
計	10,686,522,124円	9,413,691,155円
2. 受益権の総数	10,686,522,124口	9,413,691,155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28年2月26日 至 平成28年8月25日	自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)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28年8月25日現在	平成29年2月27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	286,122,429	2,784,366,859
合計	286,122,429	2,784,366,859

(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28年3月16日から平成28年8月25日まで及び平成28年3月16日から平成29年2月27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28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.9674円	2.3061円
(1万口当たり純資産額)	(19,674円)	(23,061円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成29年2月27日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	421,300	562.00	236,770,600	
西松建設	304,000	585.00	177,840,000	
積水ハウス	109,100	1,800.50	196,434,550	
日本M&Aセンター	111,800	3,445.00	385,151,000	
江崎グリコ	24,900	5,450.00	135,705,000	
森永乳業	155,000	878.00	136,090,000	
新日鉄住金ソリューションズ	161,600	2,250.00	363,600,000	
エムスリー	128,600	2,864.00	368,310,400	
キリンホールディングス	172,000	1,947.50	334,970,000	
大黒天物産	27,000	5,060.00	136,620,000	
日本たばこ産業	59,400	3,778.00	224,413,200	
J.フロント リテイリング	91,000	1,717.00	156,247,000	
ウエルシアホールディングス	110,400	3,140.00	346,656,000	
セブン&アイ・ホールディングス	39,500	4,407.00	174,076,500	
帝人	61,200	2,151.00	131,641,200	
T I S	106,300	2,717.00	288,817,100	
東ソー	544,000	965.00	524,960,000	
信越化学工業	31,000	9,560.00	296,360,000	
三菱ケミカルホールディングス	532,700	864.00	460,252,800	
住友ベークライト	60,000	665.00	39,900,000	
積水化学工業	86,800	1,847.00	160,319,600	
A D E K A	74,500	1,565.00	116,592,500	
アステラス製薬	108,500	1,523.00	165,245,500	
塩野義製薬	74,900	5,507.00	412,474,300	
中外製薬	10,200	3,720.00	37,944,000	
大塚ホールディングス	22,000	5,141.00	113,102,000	
アルファシステムズ	82,500	1,931.00	159,307,500	
新日鐵住金	49,800	2,763.50	137,622,300	
日本軽金属ホールディングス	466,000	278.00	129,548,000	
三井金属鉱業	626,000	367.00	229,742,000	
U A C J	366,000	309.00	113,094,000	
東京製綱	69,400	1,772.00	122,976,800	
リクルートホールディングス	47,500	5,450.00	258,875,000	
ディスコ	16,600	16,880.00	280,208,000	
富士ダイス	42,000	800.00	33,600,000	
荏原製作所	73,700	3,320.00	244,684,000	
ダイキン工業	14,000	10,590.00	148,260,000	
三菱電機	180,200	1,651.50	297,600,300	
日本電産	46,900	10,480.00	491,512,000	
日新電機	113,500	1,319.00	149,706,500	
ソニー	164,400	3,454.00	567,837,600	
T D K	20,700	7,750.00	160,425,000	
アルプス電気	167,200	3,325.00	555,940,000	

キーエンス	7,700	43,630.00	335,951,000	
シスメックス	8,000	6,500.00	52,000,000	
村田製作所	25,300	16,130.00	408,089,000	
日東電工	32,400	9,455.00	306,342,000	
トヨタ自動車	66,400	6,406.00	425,358,400	
アイシン精機	33,100	5,570.00	184,367,000	
本田技研工業	122,300	3,498.00	427,805,400	
スズキ	70,200	4,407.00	309,371,400	
富士重工業	108,900	4,229.00	460,538,100	
小糸製作所	59,300	5,780.00	342,754,000	
シークス	55,900	4,250.00	237,575,000	
H O Y A	66,400	5,062.00	336,116,800	
ヤマハ	66,200	2,919.00	193,237,800	
伊藤忠商事	69,900	1,625.50	113,622,450	
日立ハイテクノロジーズ	51,300	4,690.00	240,597,000	
三菱商事	68,100	2,543.00	173,178,300	
イズミ	50,100	5,020.00	251,502,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,146,600	738.90	847,222,740	
三井住友トラスト・ホールディングス	48,600	4,051.00	196,878,600	
三井住友フィナンシャルグループ	135,300	4,380.00	592,614,000	
オリックス	194,700	1,742.50	339,264,750	
東京海上ホールディングス	87,600	4,886.00	428,013,600	
三井不動産	136,000	2,542.50	345,780,000	
三菱地所	100,000	2,219.00	221,900,000	
東日本旅客鉄道	18,000	10,175.00	183,150,000	
西日本旅客鉄道	9,400	7,422.00	69,766,800	
名古屋鉄道	236,000	514.00	121,304,000	
日本電信電話	132,800	4,788.00	635,846,400	
K D D I	197,600	2,969.00	586,674,400	
カドカワ	152,700	1,700.00	259,590,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,200	3,440.00	231,168,000	
S C S K	58,200	4,160.00	242,112,000	
ニトリホールディングス	34,500	12,970.00	447,465,000	
ソフトバンクグループ	82,500	8,393.00	692,422,500	
合計	9,973,300		21,441,010,690	

## (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。

## 「DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,136,928,089	317,364,580
国債証券		11,444,228,810	10,051,209,890
社債券		15,646,608,000	18,142,888,500
未収入金		605,293,000	686,654,890
未収利息		60,703,186	58,158,878
前払費用		5,318,325	5,316,293
流動資産合計		28,899,079,410	29,261,593,031
資産合計		28,899,079,410	29,261,593,031
負債の部			
流動負債			
未払金		692,414,000	889,867,250
流動負債合計		692,414,000	889,867,250
負債合計		692,414,000	889,867,250
純資産の部			
元本等			
元本	1	18,034,590,139	18,453,886,910
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		10,172,075,271	9,917,838,871
元本等合計		28,206,665,410	28,371,725,781
純資産合計		28,206,665,410	28,371,725,781
負債純資産合計		28,899,079,410	29,261,593,031

## 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28年8月25日現在	平成29年2月27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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	19,444,576,443円  229,200,921円 1,639,187,225円	18,034,590,139円  859,898,150円 440,601,379円
元本の内訳 ファンド名		
バランス物語30（安定型）	1,323,034,332円	1,339,058,946円
バランス物語50（安定・成長型）	375,292,235円	378,536,304円
バランス物語70（成長型）	110,196,122円	110,214,867円
DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型	3,767,506,701円	3,968,156,781円
DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型	5,977,245,393円	6,394,348,701円
DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型	2,634,947,515円	2,825,670,001円
DIAMライフサイクル・ファンドVA1（安定型）	847,069,177円	749,732,409円
DIAMライフサイクル・ファンドVA2（安定・成長型）	1,626,866,800円	1,422,743,156円
DIAMライフサイクル・ファンドVA3（成長型）	298,025,604円	288,241,231円
DIAMバランス物語30VA（安定型）	601,927,954円	569,590,605円
DIAMバランス物語50VA（安定・成長型）	381,411,638円	319,755,964円
DIAMバランス物語70VA（成長型）	91,066,668円	87,837,945円
計	18,034,590,139円	18,453,886,910円
2. 受益権の総数	18,034,590,139口	18,453,886,910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28年2月26日 至 平成28年8月25日	自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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28年8月25日現在	平成29年2月27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	52,159,390	515,572,790
社債券	76,393,500	80,358,600
合計	128,552,890	595,931,390

(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28年5月26日から平成28年8月25日まで及び平成28年5月26日から平成29年2月27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28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	1.5640円	1.5374円
(1万口当たり純資産額)	(15,640円)	(15,374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29年2月27日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	6回 利付国庫債券(40年)	120,000,000	159,387,600	
	7回 利付国庫債券(40年)	93,000,000	117,932,370	
	8回 利付国庫債券(40年)	26,000,000	30,506,060	
	333回 利付国庫債券(10年)	1,336,000,000	1,398,938,960	
	334回 利付国庫債券(10年)	160,000,000	167,561,600	
	341回 利付国庫債券(10年)	263,000,000	269,590,780	
	24回 利付国庫債券(30年)	35,000,000	47,175,800	
	33回 利付国庫債券(30年)	1,197,000,000	1,533,368,970	
	35回 利付国庫債券(30年)	33,000,000	42,523,800	
	37回 利付国庫債券(30年)	64,000,000	81,443,200	
	39回 利付国庫債券(30年)	33,000,000	42,171,360	
	40回 利付国庫債券(30年)	84,000,000	105,399,000	
	41回 利付国庫債券(30年)	99,000,000	122,032,350	
	44回 利付国庫債券(30年)	277,000,000	341,776,450	
	45回 利付国庫債券(30年)	7,000,000	8,293,740	
	53回 利付国庫債券(30年)	759,000,000	721,596,480	
	119回 利付国庫債券(20年)	45,000,000	54,189,900	
	123回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	224,737,200	
	129回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	72,642,600	
	145回 利付国庫債券(20年)	757,000,000	910,406,050	
	146回 利付国庫債券(20年)	327,000,000	393,312,330	
	147回 利付国庫債券(20年)	293,000,000	347,817,370	
	148回 利付国庫債券(20年)	222,000,000	259,944,240	
	150回 利付国庫債券(20年)	234,000,000	269,729,460	
	151回 利付国庫債券(20年)	866,000,000	968,274,600	
	152回 利付国庫債券(20年)	150,000,000	167,523,000	
153回 利付国庫債券(20年)	215,000,000	243,638,000		
155回 利付国庫債券(20年)	105,000,000	113,052,450		
156回 利付国庫債券(20年)	384,000,000	371,185,920		
158回 利付国庫債券(20年)	475,000,000	465,058,250		
国債証券 合計		8,899,000,000	10,051,209,890	
社債券	43回 鹿島建設社債	200,000,000	197,974,000	
	7回 西松建設社債	200,000,000	202,820,000	
	24回 前田建設工業社債	100,000,000	99,245,000	
	1回 戸田建設社債	100,000,000	99,875,000	
	2回 戸田建設社債	200,000,000	201,006,000	
	3回 五洋建設社債	100,000,000	100,893,000	
	10回 大和ハウス工業社債	100,000,000	100,102,000	
	5回 大和ハウス工業社債	100,000,000	101,192,000	
	19回 積水ハウス社債	200,000,000	198,230,000	

7回 アサヒグループホールディングス社債	100,000,000	100,438,000	
21回 味の素社債	100,000,000	100,322,000	
37回 東洋紡社債	100,000,000	100,835,000	
39回 東洋紡社債	200,000,000	198,924,000	
3回 野村不動産ホールディングス社債	300,000,000	318,072,000	
12回 森ビル社債	300,000,000	306,807,000	
17回 森ビル社債	200,000,000	202,020,000	
5回 東急不動産ホールディングス社債	200,000,000	199,796,000	
8回 東急不動産ホールディングス社債	200,000,000	200,454,000	
9回 東急不動産ホールディングス社債	100,000,000	99,997,000	
11回 日本製紙グループ本社社債	300,000,000	314,571,000	
18回 レンゴー社債	100,000,000	101,289,000	
13回 大陽日酸社債	300,000,000	300,252,000	
41回 三井化学社債	100,000,000	103,937,000	
42回 三井化学社債	100,000,000	105,100,000	
18回 三菱ケミカルホールディングス社債	300,000,000	301,635,000	
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,539,000	
5回 テルモ社債	100,000,000	99,632,000	
3回 富士フイルムホールディングス社債	100,000,000	104,117,000	
4回 富士フイルムホールディングス社債	200,000,000	200,018,000	
5回 富士フイルムホールディングス社債	200,000,000	200,230,000	
9回 資生堂社債	100,000,000	99,995,000	
4回 出光興産社債	300,000,000	304,179,000	
3回 JXホールディングス社債	100,000,000	105,210,000	
10回 JXホールディングス社債	100,000,000	101,145,000	
12回 JXホールディングス社債	200,000,000	199,354,000	
68回 新日本製鐵社債	100,000,000	104,227,000	
56回 神戸製鋼所社債	100,000,000	103,309,000	
62回 神戸製鋼所社債	100,000,000	99,635,000	
17回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	104,778,000	
3回 愛知製鋼社債	100,000,000	100,179,000	
13回 三井金属社債	100,000,000	102,271,000	
30回 三菱マテリアル社債	300,000,000	300,318,000	
27回 住友電気工業社債	200,000,000	200,230,000	
20回 ダイキン工業社債	200,000,000	202,174,000	
6回 ブラザー工業社債	100,000,000	100,445,000	
6回 ジェイテクト社債	100,000,000	100,202,000	
28回 富士電機社債	200,000,000	201,398,000	
29回 富士電機社債	100,000,000	99,844,000	
47回 NEC社債	100,000,000	100,713,000	
48回 NEC社債	200,000,000	203,358,000	
13回 セイコーエプソン社債	200,000,000	199,472,000	
12回 パナソニック社債	200,000,000	201,582,000	
13回 パナソニック社債	300,000,000	305,799,000	
31回 ソニー社債	200,000,000	200,410,000	
32回 三菱重工業社債	200,000,000	199,510,000	

45回	川崎重工業社債	100,000,000	99,507,000	
5回	J A三井リース社債	100,000,000	100,092,000	
59回	日産自動車社債	400,000,000	400,004,000	
21回	トピー工業社債	400,000,000	412,140,000	
23回	トピー工業社債	200,000,000	203,318,000	
1回	アシックス社債	100,000,000	100,202,000	
76回	伊藤忠商事社債	600,000,000	607,806,000	
87回	丸紅社債	100,000,000	103,795,000	
101回	丸紅社債	300,000,000	299,772,000	
1回	ユニー・ファミリーマートHD社債	100,000,000	100,214,000	
28回	阪和興業社債	100,000,000	99,506,000	
56回	クレディセゾン社債	300,000,000	300,930,000	
57回	クレディセゾン社債	200,000,000	200,658,000	
37回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,951,000	
72回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,869,000	
18回	ポケットカード社債	100,000,000	100,291,000	
19回	ポケットカード社債	100,000,000	99,801,000	
8回	ジャックス社債	500,000,000	512,895,000	
9回	ジャックス社債	100,000,000	101,439,000	
54回	三井不動産社債	100,000,000	100,060,000	
104回	三菱地所社債	100,000,000	104,331,000	
115回	三菱地所社債	100,000,000	101,609,000	
17回	東京建物社債	300,000,000	308,961,000	
20回	東京建物社債	100,000,000	100,301,000	
22回	東京建物社債	100,000,000	99,673,000	
11回	ダイビル社債	200,000,000	207,450,000	
12回	ダイビル社債	100,000,000	106,805,000	
79回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,828,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,081,000	
11回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,037,000	
90回	近鉄グループホールディングス社債	100,000,000	101,866,000	
98回	近鉄グループホールディングス社債	90,000,000	90,371,700	
48回	阪急阪神ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,084,000	
36回	南海電気鉄道社債	100,000,000	101,960,000	
38回	南海電気鉄道社債	100,000,000	100,828,000	
10回	日本通運社債	100,000,000	99,499,000	
37回	日本郵船社債	100,000,000	102,269,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,086,000	
379回	中国電力社債	100,000,000	101,783,000	
382回	中国電力社債	300,000,000	304,443,000	
301回	北陸電力社債	220,000,000	232,493,800	
302回	北陸電力社債	100,000,000	103,726,000	
473回	東北電力社債	750,000,000	762,720,000	
489回	東北電力社債	50,000,000	50,028,000	
277回	四国電力社債	160,000,000	168,808,000	
430回	九州電力社債	100,000,000	101,430,000	
35回	電源開発社債	200,000,000	210,382,000	

	37回 電源開発社債	300,000,000	311,394,000	
	16回 北海道瓦斯社債	100,000,000	99,949,000	
	9回 西部瓦斯社債	100,000,000	103,211,000	
	3回 ファーストリテイリング社債	100,000,000	101,172,000	
社債券	合計	17,870,000,000	18,142,888,500	
合計		26,769,000,000	28,194,098,390	

## 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28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
資産の部			
流動資産			
預金		26,971,231	196,965,343
コール・ローン		81,986,431	60,686,249
株式		8,508,081,678	8,886,981,412
派生商品評価勘定		254	-
未収入金		96,644,610	225,806,979
未収配当金		11,517,407	14,134,752
流動資産合計		8,725,201,611	9,384,574,735
資産合計		8,725,201,611	9,384,574,735
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,284	-
未払金		96,892,064	396,689,018
流動負債合計		96,896,348	396,689,018
負債合計		96,896,348	396,689,018
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,263,967,023	3,755,907,238
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		4,364,338,240	5,231,978,479
元本等合計		8,628,305,263	8,987,885,717
純資産合計		8,628,305,263	8,987,885,717
負債純資産合計		8,725,201,611	9,384,574,735



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準  外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目		平成28年8月25日現在	平成29年2月27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	4,040,363,698円	4,263,967,023円
	同期中追加設定元本額	421,192,943円	73,221,711円
	同期中一部解約元本額	197,589,618円	581,281,496円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30(安定型)	78,710,738円	63,756,788円
	バランス物語50(安定・成長型)	80,735,270円	67,906,199円
	バランス物語70(成長型)	73,656,478円	60,811,343円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1 安定型	222,654,827円	195,813,907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	1,281,346,112円	1,166,959,177円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,749,063,799円	1,624,612,462円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1 (安定型)	50,110,068円	36,773,660円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2 (安定・成長型)	350,145,990円	250,440,608円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3 (成長型)	201,092,262円	157,331,062円
	D I A Mバランス物語30 V A (安定型)	36,560,178円	27,662,503円
	D I A Mバランス物語50 V A (安定・成長型)	81,224,449円	55,134,031円
	D I A Mバランス物語70 V A (成長型)	58,666,852円	48,705,498円
	計	4,263,967,023円	3,755,907,238円
2.	受益権の総数	4,263,967,023口	3,755,907,238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28年2月26日 至 平成28年8月25日	自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	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 「(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>	<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>
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。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。	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。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成28年8月25日現在	平成29年2月27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	579,717,185	894,761,431
合計	579,717,185	894,761,431

(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28年3月16日から平成28年8月25日まで及び平成28年3月16日から平成29年2月27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28年8月25日 現在				平成29年2月27日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	9,354,816	-	9,359,100	4,284	-	-	-	-
スイス・フラン	9,354,816	-	9,359,100	4,284	-	-	-	-
買 建	3,500,346	-	3,500,600	254	-	-	-	-
デンマーク・ク ローネ	3,500,346	-	3,500,600	254	-	-	-	-
合計	12,855,162	-	12,859,700	4,030	-	-	-	-

(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28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	2.0235円	2.3930円
( 1万口当たり純資産額 )	(20,235円)	(23,930円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成29年2月27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	1,460	845.240	1,234,050.400	
	ADVANCED MICRO DEVICES	7,440	14.120	105,052.800	
	ADOBE SYSTEMS INC	4,771	119.310	569,228.010	
	AMGEN INC	1,779	174.560	310,542.240	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	818	131.540	107,599.720	
	TIME WARNER	2,465	97.280	239,795.200	
	APPLE INC	13,250	136.660	1,810,745.000	
	APPLIED MATERIALS INC	4,523	36.300	164,184.900	
	ALBEMARLE CORP	2,191	92.930	203,609.630	
	AIR METHODS CORP	4,406	38.100	167,868.600	
	BEST BUY CO INC	3,128	45.560	142,511.680	
	DEPOMED INC	18,440	16.320	300,940.800	
	BOEING CO	1,284	177.440	227,832.960	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,639	56.440	261,825.160	
	UNITED RENTALS INC	2,037	124.150	252,893.550	
	MERCURY SYSTEMS INC	6,576	37.590	247,191.840	
	QUANTA SERVICES INC	4,199	37.760	158,554.240	
	CSX CORP	12,296	48.480	596,110.080	
	CELGENE CORP	2,084	118.230	246,391.320	
	JPMORGAN CHASE & CO	8,481	90.330	766,088.730	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	9,850	49.530	487,870.500	
	CISCO SYSTEMS INC	9,822	34.320	337,091.040	
	COCA-COLA CO/THE	5,480	41.780	228,954.400	
	COHERENT INC	826	187.120	154,561.120	
	COMERICA INC	6,994	71.200	497,972.800	
	COMCAST CORP-CL A	16,244	37.890	615,485.160	
	CORNING INC	5,973	27.730	165,631.290	
	CYPRESS SEMICONDUCTOR CORP	16,088	12.720	204,639.360	
	MORGAN STANLEY	8,918	45.530	406,036.540	
	THE WALT DISNEY CO	3,936	110.320	434,219.520	
	DTE ENERGY CO	4,274	101.090	432,058.660	
	BANK OF AMERICA CORP	65,096	24.230	1,577,276.080	
	CITIGROUP INC	4,874	59.560	290,295.440	
	DISH NETWORK CORP	2,045	62.540	127,894.300	
SALESFORCE.COM INC	2,201	81.780	179,997.780		
ATMOS ENERGY CORP	7,691	78.180	601,282.380		
EXXON MOBIL CORP	4,608	81.080	373,616.640		
MACY'S INC	3,669	33.170	121,700.730		
GILEAD SCIENCES INC	2,809	69.940	196,461.460		
NVIDIA CORP	2,407	101.460	244,214.220		

GENERAL ELECTRIC CO	15,762	30.190	475,854.780	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,590	43.550	199,894.500	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,209	247.350	546,396.150	
HEXCEL CORP	2,495	54.260	135,378.700	
F5 NETWORKS INC	1,202	144.410	173,580.820	
UNUM GROUP	5,019	48.480	243,321.120	
HOME DEPOT INC	4,603	145.950	671,807.850	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,959	87.510	433,962.090	
HORMEL FOODS CORP	4,297	34.660	148,934.020	
HUBBELL INC	1,302	120.320	156,656.640	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	28,179	14.180	399,578.220	
BIOGEN INC	442	285.130	126,027.460	
INGERSOLL-RAND PLC	2,511	81.320	204,194.520	
INTEL CORP	7,372	36.530	269,299.160	
INCYTE CORP	3,648	131.210	478,654.080	
JOHNSON & JOHNSON	6,624	122.730	812,963.520	
DEVON ENERGY CORP	10,096	42.810	432,209.760	
KEYCORP	13,080	18.740	245,119.200	
KULICKE & SOFFA INDUSTRIES	7,563	20.740	156,856.620	
LAM RESEARCH CORP	2,643	118.790	313,961.970	
LEGG MASON INC	4,308	37.150	160,042.200	
KATE SPADE & CO	17,410	23.270	405,130.700	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	2,605	94.760	246,849.800	
SILICON LABORATORIES INC	1,915	72.500	138,837.500	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	1,036	210.050	217,611.800	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,768	45.060	169,786.080	
MEDTRONIC PLC	3,016	81.030	244,386.480	
CVS HEALTH CORP	2,382	81.480	194,085.360	
MERCK & CO. INC.	6,964	66.160	460,738.240	
MICROSEMI CORP	7,841	53.140	416,670.740	
MICROSOFT CORP	18,611	64.620	1,202,642.820	
MICRON TECH INC	15,345	23.240	356,617.800	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,117	16.010	145,963.170	
MEDICINES COMPANY	3,547	52.060	184,656.820	
NAVISTAR INTERNATIONAL CORP	3,748	26.680	99,996.640	
NEW JERSEY RESOURCES CORP	6,162	39.500	243,399.000	
NEWFIELD EXPLORATION CO	5,705	36.740	209,601.700	
NATIONAL BEVERAGE CORP	2,810	58.600	164,666.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,272	120.080	392,901.760	
NISOURCE INC	10,175	24.010	244,301.750	



NUCOR CORP	2,516	60.860	153,123.760	
MONSANTO CO	1,109	112.960	125,272.640	
CHENIERE ENERGY INC	8,113	47.460	385,042.980	
PARKER HANNIFIN CORP	1,309	155.040	202,947.360	
PEGASYS INC	4,998	43.250	216,163.500	
PEPSICO INC	4,390	109.830	482,153.700	
PFIZER INC	15,386	34.260	527,124.360	
CONOCOPHILLIPS	6,598	47.040	310,369.920	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,759	185.360	326,048.240	
BRINK'S CO	3,073	52.000	159,796.000	
ALTRIA GROUP INC	20,129	74.430	1,498,201.470	
COSTCO WHOLESALE CORP	1,185	177.560	210,408.600	
ACADIA PHARMACEUTICALS INC	10,132	38.880	393,932.160	
RITE AID CORP	10,594	5.970	63,246.180	
ROPER TECHNOLOGIES INC	962	209.910	201,933.420	
RAYTHEON COMPANY	2,470	153.480	379,095.600	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	10,686	45.380	484,930.680	
PRICELINE GROUP INC	124	1,631.620	202,320.880	
ANTHEM INC	1,184	163.830	193,974.720	
SEMTECH CORP	3,938	34.400	135,467.200	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,142	109.960	675,374.320	
AT&T INC	13,453	42.360	569,869.080	
CHEVRON CORP	5,956	110.120	655,874.720	
STARBUCKS CORP	2,793	57.480	160,541.640	
NETFLIX INC	1,110	143.250	159,007.500	
SUNTRUST BANKS INC	8,329	59.290	493,826.410	
TYSON FOODS INC	2,582	62.680	161,839.760	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,782	112.460	200,403.720	
UNITEDHEALTH GROUP INC	3,299	163.060	537,934.940	
CBS CORP	3,655	66.970	244,775.350	
VULCAN MATERIALS CO	1,757	117.820	207,009.740	
VAIL RESORTS INC	1,169	182.670	213,541.230	
WESTERN DIGITAL CORP	7,223	74.650	539,196.950	
WILLIAMS COS INC	11,407	27.970	319,053.790	
TEXAS CAPITAL BANCSHARES INC	3,704	89.050	329,841.200	
XILINX INC	2,754	58.990	162,458.460	
YAHOO! INC	7,356	45.550	335,065.800	
CIMAREX ENERGY CO	2,114	126.030	266,427.420	
ZIONS BANCORP	5,563	44.550	247,831.650	
VIAD CORP	3,374	47.900	161,614.600	
DOMINO'S PIZZA INC	1,158	186.280	215,712.240	
OCLARO INC	11,461	9.230	105,785.030	
T-MOBILE US INC	10,688	62.210	664,900.480	
HUNTSMAN CORP	10,432	22.080	230,338.560	
WESTERN ALLIANCE BANCORP	3,995	51.600	206,142.000	

MASTERCARD INC	5,046	111.000	560,106.000	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	2,190	133.280	291,883.200	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	5,676	107.720	611,418.720	
VISA INC	8,641	88.430	764,123.630	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,290	76.300	327,327.000	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	4,456	92.430	411,868.080	
WPX ENERGY INC	14,139	12.810	181,120.590	
HESKA CORP	1,493	81.380	121,500.340	
NXP SEMICONDUCTOR NV	5,788	102.830	595,180.040	
IMPERVA INC	5,989	41.950	251,238.550	
SEMGROUP CORP	5,915	36.250	214,418.750	
TARGA RESOURCES CORP	5,390	56.380	303,888.200	
MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS HOLDINGS INC	3,078	47.470	146,112.660	
FORTINET INC	4,247	37.150	157,776.050	
INPHI	4,216	48.680	205,234.880	
SYNERGY PHARMACEUTICALS INC	13,490	5.490	74,060.100	
PANDORA MEDIA INC	11,490	13.290	152,702.100	
GENERAL MOTORS CO	4,273	36.900	157,673.700	
POST HOLDINGS INC	2,775	82.590	229,187.250	
PROOFPOINT INC	2,387	79.640	190,100.680	
FACEBOOK INC	5,560	135.440	753,046.400	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,679	100.410	268,998.390	
SERVICENOW INC	3,749	91.820	344,233.180	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,056	153.010	161,578.560	
TESARO INC	3,257	186.900	608,733.300	
SPRINT CORP	12,870	8.940	115,057.800	
CLUBCORP HOLDINGS	9,273	16.900	156,713.700	
BROADCOM LTD	785	210.370	165,140.450	
BIOVERATIV INC	2,440	50.960	124,342.400	
TWITTER INC	4,395	15.980	70,232.100	
AERIE PHARMACEUTICALS INC	3,597	44.550	160,246.350	
RSP PERMIAN INC	5,788	39.890	230,883.320	
INTRAWEST RESORTS HOLDINGS INC	8,742	22.960	200,716.320	
FIVE9 INC	16,843	16.360	275,551.480	
TIME INC	9,320	18.300	170,556.000	
PARSLEY ENERGY INC	9,835	29.490	290,034.150	
MOBILEYE NV	2,512	47.080	118,264.960	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	14,869	36.650	544,948.850	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,905	31.080	121,367.400	
INC RESEARCH HOLDINGS	3,777	55.050	207,923.850	

	SHOPIFY INC	3,202	61.750	197,723.500	
	KRAFT HEINZ CO	1,735	93.080	161,493.800	
	ALPHABET INC-CL A	1,431	847.810	1,213,216.110	
	PAYPAL HOLDINGS INC	11,061	43.070	476,397.270	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	1,905	326.750	622,458.750	
アメリカ・ドル 小計		1,051,871		56,736,512.690 (6,364,701,993)	
イギリス・ポンド	BBA AVIATION PLC	55,523	3.025	167,957.070	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	4,637	50.700	235,095.900	
	IMPERIAL BRANDS PLC	28,486	38.365	1,092,865.390	
	UNILEVER PLC	4,302	37.730	162,314.460	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	40,436	9.790	395,868.440	
	RIO TINTO PLC	13,803	33.155	457,638.460	
	VODAFONE GROUP PLC	81,106	2.028	164,482.960	
	SHIRE PLC	2,407	48.440	116,595.080	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	8,151	16.395	133,635.640	
	ASTRAZENECA PLC	2,467	46.090	113,704.030	
	BURBERRY GROUP PLC	8,235	16.610	136,783.350	
	ITV PLC	64,859	2.021	131,080.030	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	27,584	21.660	597,469.440	
GLENCORE PLC	133,194	3.275	436,210.350		
MELROSE INDUSTRIES PLC	60,488	2.107	127,448.210		
イギリス・ポンド 小計		535,678		4,469,148.810 (622,373,664)	
オーストラリア・ ドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	9,992	34.090	340,627.280	
オーストラリア・ドル 小計		9,992		340,627.280 (29,310,977)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	3,937	60.160	236,849.920	
	BARRICK GOLD CORP	10,108	25.590	258,663.720	
	BANK OF MONTREAL	3,759	99.980	375,824.820	
	BORALEX INC	16,029	20.100	322,182.900	
	AGRIUM INC	2,711	130.240	353,080.640	
	MAPLE LEAF FOODS INC	8,078	30.940	249,933.320	
	SUPERIOR PLUS CORP	16,244	12.530	203,537.320	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	15,173	27.160	412,098.680	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	9,289	69.260	643,356.140	
	PREMIUM BRANDS HOLDINGS CORP	3,727	70.300	262,008.100	
	CAPITAL POWER CORP	10,552	25.540	269,498.080	
	DH CORP	6,987	23.080	161,259.960	
NORTHLAND POWER INC	48,248	24.430	1,178,698.640		
カナダ・ドル 小計		154,842		4,926,992.240 (421,454,915)	

シンガポール・ドル	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	426,900	2.750	1,173,975.000	
シンガポール・ドル 小計		426,900		1,173,975.000 (93,683,205)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	8,031	74.500	598,309.500	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	1,567	245.200	384,228.400	
	SIKA INHABER	40	5,605.000	224,200.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	4,475	77.600	347,260.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	792	526.000	416,592.000	
スイス・フラン 小計		14,905		1,970,589.900 (219,366,068)	
デンマーク・ク ローネ	GENMAB A/S	1,334	1,371.000	1,828,914.000	
	SCANDINAVIAN TOBACCO GROUP A/S	11,420	123.200	1,406,944.000	
デンマーク・クローネ 小計		12,754		3,235,858.000 (51,579,577)	
ノルウェー・ク ローネ	BORREGAARD ASA	18,785	94.000	1,765,790.000	
ノルウェー・クローネ 小計		18,785		1,765,790.000 (23,661,585)	
ユーロ	CRH PLC	10,580	31.435	332,582.300	
	AXA	21,919	22.195	486,492.200	
	ASSICURAZIONI GENERALI	20,944	14.100	295,310.400	
	GLANBIA PLC	12,469	18.145	226,250.000	
	INTESA SANPAOLO	32,950	2.076	68,404.200	
	NATIXIS	52,451	5.150	270,122.650	
	KBC GROUPE	6,812	57.020	388,420.240	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	959	190.700	182,881.300	
	OUTOKUMPU OYJ	15,022	9.235	138,728.170	
	RUBIS	2,190	86.610	189,675.900	
	SOCIETE GENERALE-A	9,375	41.430	388,406.250	
	VINCI S.A.	5,590	67.490	377,269.100	
	TOTAL SA	5,474	47.735	261,301.390	
	SIEMENS AG-REG	4,318	121.750	525,716.500	
	ING GROEP NV-CVA	40,920	13.030	533,187.600	
	BAYER AG	2,128	104.250	221,844.000	
	ALLIANZ SE	1,073	163.750	175,703.750	
	SANOFI	1,982	80.580	159,709.560	
	BANCO SANTANDER SA	67,541	5.049	341,014.500	
	LINDE AG	2,658	152.450	405,212.100	
	BUZZI UNICEM	8,165	22.740	185,672.100	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	9,394	16.430	154,343.420	
	LEONARDO SPA	14,220	12.250	174,195.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,680	16.910	231,328.800		
HAVAS ADVERTISING	14,294	8.194	117,125.030		
DIALOG SEMICONDUCTOR PLC	3,336	49.310	164,498.160		

	DEUTSCHE WOHNEN AG	12,079	32.435	391,782.360	
	SUEZ SA	15,020	14.010	210,430.200	
	VONOVIA SE	9,133	33.250	303,672.250	
	ZALANDO SE	3,038	37.795	114,821.210	
	ALTICE NV-A	5,392	19.940	107,516.480	
	COVESTRO AG	1,704	70.340	119,859.360	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,110	102.850	114,163.500	
	SPIE SA	8,614	22.170	190,972.380	
ユーロ 小計		436,534		8,548,612.360 (1,013,267,023)	
香港・ドル	SUN HUNG KAI PROPERTIES	16,000	114.400	1,830,400.000	
	AIA GROUP LTD	30,000	48.750	1,462,500.000	
香港・ドル 小計		46,000		3,292,900.000 (47,582,405)	
合計		2,708,261		8,886,981,412 (8,886,981,412)	

## (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 170銘柄	70.81%	71.62%
イギリス・ポンド	株式 15銘柄	6.92%	7.00%
オーストラリア・ドル	株式 1銘柄	0.33%	0.33%
カナダ・ドル	株式 13銘柄	4.69%	4.74%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	1.04%	1.05%
スイス・フラン	株式 5銘柄	2.44%	2.47%
デンマーク・クローネ	株式 2銘柄	0.57%	0.58%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	0.26%	0.27%
ユーロ	株式 34銘柄	11.27%	11.40%
香港・ドル	株式 2銘柄	0.53%	0.54%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「DL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28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
資産の部			
流動資産			
預金		19,337,457	38,021,181
コール・ローン		67,601,658	24,802,486
国債証券		9,533,007,015	10,291,349,095
特殊債券		421,967,112	120,622,667
派生商品評価勘定		40,790,477	13,613,079
未収入金		-	154,064,143
未収利息		53,852,684	60,604,132
前払費用		19,225,589	13,426,248
流動資産合計		10,155,781,992	10,716,503,031
資産合計		10,155,781,992	10,716,503,031
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		36,463,716	9,564,084
未払金		-	169,574,341
未払解約金		-	4,000,000
流動負債合計		36,463,716	183,138,425
負債合計		36,463,716	183,138,425
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,653,399,110	4,721,850,317
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		5,465,919,166	5,811,514,289
元本等合計		10,119,318,276	10,533,364,606
純資産合計		10,119,318,276	10,533,364,606
負債純資産合計		10,155,781,992	10,716,503,031

## 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28年8月25日現在	平成29年2月27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	4,466,294,972円	4,653,399,110円
	同期中追加設定元本額	293,202,973円	187,630,682円
	同期中一部解約元本額	106,098,835円	119,179,475円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	バランス物語30(安定型)	111,344,841円	118,245,835円
	バランス物語50(安定・成長型)	75,542,349円	75,542,349円
	バランス物語70(成長型)	54,508,804円	56,809,136円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1安定型	330,374,665円	341,883,321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	1,186,180,024円	1,242,111,158円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型	1,358,921,850円	1,467,611,084円
	外国債券私募オープン(適格機関投資家向け)	794,896,861円	785,540,467円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1(安定型)	75,606,391円	62,094,264円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2(安定・成長型)	328,481,869円	276,491,868円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3(成長型)	158,868,655円	143,063,206円
	D I A Mバランス物語30V A(安定型)	53,115,688円	48,586,907円
	D I A Mバランス物語50V A(安定・成長型)	77,963,845円	59,920,929円
	D I A Mバランス物語70V A(成長型)	47,593,268円	43,949,793円
	計	4,653,399,110円	4,721,850,317円
2 .	受益権の総数	4,653,399,110口	4,721,850,317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28年2月26日 至 平成28年8月25日	自 平成28年8月26日 至 平成29年2月27日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成28年8月25日現在	平成29年2月27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	272,944,197	179,688,804
特殊債券	2,980,122	3,494,407
合計	269,964,075	183,183,211

(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28年5月26日から平成28年8月25日まで及び平成28年5月26日から平成29年2月27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28年8月25日 現在				平成29年2月27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	873,826,069	-	833,035,592	40,790,477	1,196,252,559	-	1,182,639,480	13,613,079
アメリカ・ドル	156,374,267	-	149,362,622	7,011,645	352,631,802	-	349,520,790	3,111,012
イギリス・債券	206,008,144	-	194,130,680	11,877,464	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	100,685,340	-	96,490,800	4,194,540	156,464,936	-	154,561,820	1,903,116
カナダ・ドル	214,191,160	-	203,238,500	10,952,660	204,210,100	-	202,872,500	1,337,600
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	466,384,418	-	459,256,870	7,127,548
デンマーク・クローネ	47,945,520	-	45,964,400	1,981,120	10,958,239	-	10,877,900	80,339
ノルウェー・クローネ	98,605,663	-	95,863,680	2,741,983	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	50,015,975	-	47,984,910	2,031,065	5,603,064	-	5,549,600	53,464
買 建	946,969,916	-	910,506,200	36,463,716	1,207,019,769	-	1,197,455,685	9,564,084
イギリス・債券	-	-	-	-	180,923,353	-	178,946,900	1,976,453
スイス・フラン	29,365,470	-	28,082,700	1,282,770	20,735,595	-	20,603,450	132,145
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	30,293,904	-	29,997,960	295,944
ユーロ	871,328,606	-	838,306,700	33,021,906	921,016,037	-	914,180,975	6,835,062
南アフリカ・ランド	46,275,840	-	44,116,800	2,159,040	54,050,880	-	53,726,400	324,480
合計	1,820,795,985	-	1,743,541,792	4,326,761	2,403,272,328	-	2,380,095,165	4,048,995

(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28年8月25日現在	平成29年2月27日現在
1口当たり純資産額	2,1746円	2,2308円
(1万口当たり純資産額)	(21,746円)	(22,308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29年2月27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 0.875 04/15/19	6,182,000.000	6,141,631.540	
		US T N/B 1.0 09/15/18	3,250,000.000	3,247,822.500	
		US T N/B 1.125 08/31/21	3,260,000.000	3,171,849.600	
		US T N/B 1.375 09/30/20	2,300,000.000	2,283,992.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	3,880,000.000	3,608,400.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	11,000,000.000	11,092,290.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	1,830,000.000	1,791,533.400	
		US T N/B 2.25 03/31/21	1,400,000.000	1,431,598.000	
		US T N/B 2.375 08/15/24	785,000.000	796,154.850	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,340,000.000	2,123,550.000	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,735,000.000	1,747,318.500	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,090,000.000	1,126,863.800	
	アメリカ・ドル 小計		39,052,000.000 (4,380,853,360)	38,563,004.190 (4,325,997,810)	
イギリス・債券		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,405,000.000	1,831,136.500	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	325,000.000	445,835.000	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	300,000.000	437,280.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	480,000.000	741,312.000	
	イギリス・債券 小計		2,510,000.000 (349,542,600)	3,455,563.500 (481,221,773)	
オーストラリア・ドル		AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,000,000.000	1,022,450.000	
		AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	550,000.000	576,207.500	
		AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	770,000.000	906,836.700	
	オーストラリア・ドル 小計		2,320,000.000 (199,636,000)	2,505,494.200 (215,597,776)	
カナダ・ドル		CANADA 1.0 06/01/27	2,680,000.000	2,499,260.800	
		CANADA 1.5 06/01/23	370,000.000	374,643.500	
		CANADA 1.5 06/01/26	680,000.000	673,778.000	
		CANADA 2.75 12/01/48	1,460,000.000	1,597,386.000	
	カナダ・ドル 小計		5,190,000.000 (443,952,600)	5,145,068.300 (440,109,142)	
シンガポール・ドル		SINGAPORE 3.0 09/01/24	460,000.000	489,440.000	
	シンガポール・ドル 小計		460,000.000 (36,708,000)	489,440.000 (39,057,312)	
スウェーデン・クローナ		SWEDEN 1.5 11/13/23	1,550,000.000	1,694,134.500	

	SWEDEN 2.25 06/01/32	5,800,000.000	6,645,640.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	1,000,000.000	1,362,430.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	7,400,000.000	8,826,128.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	18,500,000.000	22,287,690.000	
スウェーデン・クローナ	小計	34,250,000.000 (425,042,500)	40,816,022.500 (506,526,839)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	1,400,000.000	1,553,720.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	1,400,000.000	1,589,322.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	800,000.000	1,382,480.000	
デンマーク・クローネ	小計	3,600,000.000 (57,384,000)	4,525,522.000 (72,136,821)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.25 07/25/25	580,000.000	565,378.200	
	POLAND 5.25 10/25/20	1,400,000.000	1,521,100.000	
ポーランド・ズロチ	小計	1,980,000.000 (54,410,400)	2,086,478.200 (57,336,421)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 4.16 07/15/21	1,800,000.000	1,832,436.000	
マレーシア・リングギット	小計	1,800,000.000 (45,432,000)	1,832,436.000 (46,250,685)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	8,250,000.000	9,675,270.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	4,500,000.000	4,294,845.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	1,500,000.000	1,505,925.000	
メキシコ・ペソ	小計	14,250,000.000 (80,512,500)	15,476,040.000 (87,439,626)	
ユーロ	AUSTRIA 1.65 10/21/24	650,000.000	727,317.500	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	140,000.000	199,595.200	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	380,000.000	438,729.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	200,000.000	219,348.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	600,000.000	733,578.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	510,000.000	772,313.400	
	BUNDESOBL 0.5 04/12/19	2,150,000.000	2,217,746.500	
	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	85,000.000	89,473.550	
	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,467,000.000	2,574,092.470	
	DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	670,000.000	752,155.400	
	DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	555,000.000	775,479.300	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	710,000.000	803,386.300	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	453,000.000	697,891.800	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	180,000.000	304,340.400	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/25	1,070,000.000	1,060,680.300	
	FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,820,000.000	1,881,916.400	
	FRANCE OAT 1.5 05/25/31	390,000.000	400,311.600	



		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	450,000.000	492,898.500	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	300,000.000	389,346.000	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	1,140,000.000	1,319,310.600	
		FRANCE OAT 3.75 04/25/21	1,150,000.000	1,341,245.000	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,105,000.000	1,585,520.300	
		IRISH 1.0 05/15/26	100,000.000	100,800.000	
		IRISH 2.0 02/18/45	30,000.000	29,944.800	
		IRISH 3.4 03/18/24	228,000.000	274,614.600	
		IRISH 5.0 10/18/20	100,000.000	119,780.000	
		IRISH 5.9 10/18/19	320,000.000	373,820.800	
		ITALY BTPS 0.75 01/15/18	1,625,000.000	1,639,235.000	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	850,000.000	845,741.500	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	3,050,000.000	3,183,041.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	838,000.000	925,755.360	
		ITALY BTPS 4.5 02/01/20	1,000,000.000	1,117,900.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	405,000.000	510,729.300	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	50,000.000	63,411.500	
		NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,050,000.000	1,229,130.000	
		SPAIN 0.25 04/30/18	1,130,000.000	1,136,893.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,590,000.000	1,619,717.100	
		SPAIN 2.75 10/31/24	700,000.000	776,370.000	
		SPAIN 2.9 10/31/46	190,000.000	189,162.100	
	ユーロ 小計		30,431,000.000 (3,606,986,430)	33,912,721.580 (4,019,674,889)	
国債証券 合計			9,680,460,390 (9,680,460,390)	10,291,349,095 (10,291,349,095)	
特殊債券	アメリカ・ドル	KFW 4.875 06/17/19	1,000,000.000	1,075,260.000	
	アメリカ・ドル 小計		1,000,000.000 (112,180,000)	1,075,260.000 (120,622,667)	
特殊債券 合計			112,180,000 (112,180,000)	120,622,667 (120,622,667)	
合計			9,792,640,390 (9,792,640,390)	10,411,971,762 (10,411,971,762)	

- (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 12銘柄	41.07%	42.71%
	特殊債券 1銘柄	1.15%	
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	4.57%	4.62%

オーストラリア・ドル	国債証券	3銘柄	2.05%	2.07%
カナダ・ドル	国債証券	4銘柄	4.18%	4.23%
シンガポール・ドル	国債証券	1銘柄	0.37%	0.38%
スウェーデン・クローナ	国債証券	5銘柄	4.81%	4.86%
デンマーク・クローネ	国債証券	3銘柄	0.68%	0.69%
ポーランド・ズロチ	国債証券	2銘柄	0.54%	0.55%
マレーシア・リングgit	国債証券	1銘柄	0.44%	0.44%
メキシコ・ペソ	国債証券	3銘柄	0.83%	0.84%
ユーロ	国債証券	39銘柄	38.16%	38.61%

(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29年2月28日現在

資産総額	3,110,998,558円
負債総額	771,443円
純資産総額( - )	3,110,227,115円
発行済数量	2,578,238,099口
1口当たり純資産額( / )	1.2063円

## バランス物語50(安定・成長型)

平成29年2月28日現在

資産総額	1,363,855,404円
負債総額	60,595円
純資産総額( - )	1,363,794,809円
発行済数量	1,075,942,923口
1口当たり純資産額( / )	1.2675円

## バランス物語70(成長型)

平成29年2月28日現在

資産総額	776,198,803円
負債総額	1,175,686円
純資産総額( - )	775,023,117円
発行済数量	593,389,096口
1口当たり純資産額( / )	1.3061円

(参考)

## DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成29年2月28日現在

資産総額	21,841,625,036円
負債総額	38,456,174円
純資産総額( - )	21,803,168,862円
発行済数量	9,459,244,302口
1口当たり純資産額( / )	2.3050円

## DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成29年2月28日現在

資産総額	30,430,541,714円
負債総額	1,325,373,080円
純資産総額( - )	29,105,168,634円
発行済数量	18,931,966,791口
1口当たり純資産額( / )	1.5374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29年2月28日現在

資産総額	9,316,352,744円
負債総額	267,748,239円
純資産総額( - )	9,048,604,505円
発行済数量	3,760,062,652口
1口当たり純資産額( / )	2.4065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29年2月28日現在

資産総額	10,933,880,125円
負債総額	311,491,339円
純資産総額( - )	10,622,388,786円
発行済数量	4,750,921,385口
1口当たり純資産額( / )	2.2359円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第4 内国投資信託受益証券事務の概要」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)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2)受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

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(平成29年2月28日現在)

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構(平成29年2月28日現在)

##### 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。

取締役は株主総会で選任されます。取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役(監査等委員である取締役を除く。)の補欠として選任された取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、現任取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

#### 1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

## 2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

## 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>

「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る委託会社は、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）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

平成29年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,159,521,637,173
追加型株式投資信託	864	11,794,936,154,039
単位型公社債投資信託	56	310,769,912,650
単位型株式投資信託	107	760,943,242,478
合計	1,065	14,026,170,946,340



### 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31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28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32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28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。

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更いたしました。

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,051,921	12,951,736
金銭の信託	14,169,657	13,094,914
前払費用	57,309	44,951
未収委託者報酬	4,622,292	4,460,404
未収運用受託報酬	1,737,052	1,859,778
未収投資助言報酬	2 312,206	2 277,603
未収収益	260,845	205,097
繰延税金資産	411,797	341,078
その他	46,782	40,689
流動資産計	33,669,865	33,276,255
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 138,967	1 29,219
車両運搬具	1 941	1 549
器具備品	1 243,908	1 184,683
建設仮勘定	49,116	444,155
無形固定資産		
商標権	1 101	1 7
ソフトウェア	1 1,702,633	1 1,645,861
ソフトウェア仮勘定	202,399	53,036
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 188	1 146
投資その他の資産		
投資有価証券	4,343,365	6,497,772
関係会社株式	613,137	458,701
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
繰延税金資産	582,861	679,092
差入保証金	733,907	2,040,945
その他	96,862	89,835
固定資産計	6,688,771	8,862,580
資産合計	40,358,637	42,138,836

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,605,579	966,681
未払金	2,515,377	2,055,332
未払償還金	49,873	49,873
未払手数料	1,836,651	1,744,274
その他未払金	628,852	261,185
未払費用	2 2,196,267	2 3,076,566
未払法人税等	1,539,263	1,223,957
未払消費税等	671,243	352,820
賞与引当金	722,343	728,769
その他	30,000	-
流動負債計	9,280,074	8,404,128
固定負債		
退職給付引当金	868,928	997,396
役員退職慰労引当金	110,465	154,535
固定負債計	979,394	1,151,932
負債合計	10,259,468	9,556,060
（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	25,417,784	28,000,340
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	19,480,000	22,030,000
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	5,314,491	5,347,047
株主資本計	29,846,262	32,428,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	252,905	153,956
評価・換算差額等計	252,905	153,956
純資産合計	30,099,168	32,582,775
負債・純資産合計	40,358,637	42,138,836

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	28,170,831		30,188,445	
運用受託報酬	7,064,021		7,595,678	
投資助言報酬	1,032,659		993,027	
その他営業収益	828,240		724,211	
営業収益計		37,095,752		39,501,363
営業費用				
支払手数料	12,416,659		12,946,176	
広告宣伝費	527,620		468,931	
公告費	288		258	
調査費	6,317,052		7,616,390	
調査費	4,129,778		4,969,812	
委託調査費	2,187,273		2,646,578	
委託計算費	385,121		412,257	
営業雑経費	488,963		548,183	
通信費	34,089		34,855	
印刷費	414,215		436,756	
協会費	24,177		23,698	
諸会費	37		40	
支払販売手数料	16,443		52,833	
営業費用計		20,135,705		21,992,198
一般管理費				
給料	5,260,910		5,382,757	
役員報酬	242,666		242,446	
給料・手当	4,378,307		4,431,015	
賞与	639,936		709,295	
交際費	37,625		43,975	
寄付金	2,697		2,628	
旅費交通費	242,164		254,276	
租税公課	127,947		180,892	
不動産賃借料	686,770		1,128,367	
退職給付費用	218,863		226,460	
固定資産減価償却費	628,056		902,248	
福利厚生費	33,310		36,173	
修繕費	13,807		31,617	
賞与引当金繰入額	722,343		728,769	
役員退職慰労引当金繰入額	50,327		49,320	
役員退職慰労金	25,501		5,250	
機器リース料	87		140	
事務委託費	231,303		251,913	
事務用消耗品費	67,208		70,839	
器具備品費	5,869		14,182	
諸経費	135,032		214,532	
一般管理費計		8,489,827		9,524,346
営業利益		8,470,220		7,984,819

(単位:千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		17,346		25,274
受取利息		2,404		2,079
時効成立分配金・償還金		974		-
為替差益		652		3,996
雑収入		1,822		6,693
営業外収益計		23,200		38,044
営業外費用				
金銭の信託運用損		163,033		305,368
時効成立後支払分配金・償還金		65		-
外国税支払損失		47,515		-
営業外費用計		210,614		305,368
経常利益		8,282,806		7,717,494
特別利益				
投資有価証券売却益		-		3,377
特別利益計		-		3,377
特別損失				
固定資産除却損	1	12,988	1	624
固定資産売却損	2	-	2	2,653
ゴルフ会員権売却損		1,080		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,307
関係会社株式評価損		202,477		-
特別損失計		216,547		9,584
税引前当期純利益		8,066,259		7,711,286
法人税、住民税及び事業税		2,969,684		2,557,305
法人税等調整額		29,428		27,424
法人税等合計		2,940,256		2,584,730
当期純利益		5,126,003		5,126,556

## (3) 【株主資本等変動計算書】

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								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	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

第31期(自平成27年4月1日至平成28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				利益剰余金 合計	株主資本 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
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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当期変動額									
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	-	-
当期純利益							5,126,556	5,126,556	5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556	2,582,556	2,582,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818

	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
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	252,905	30,099,168
当期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の積立		-
当期純利益		5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	98,949	98,949
当期変動額合計	98,949	2,483,607
当期末残高	153,956	32,582,775

## 重要な会計方針

項目	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。



**未適用の会計基準等**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

**（1）概要**

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

**（2）適用予定日**

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

**（3）当該会計基準等の適用による影響**

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

**会計上の見積りの変更**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

**追加情報**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne 株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 D I A Mアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 8 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

**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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
建物	582,075	767,802
車両運搬具	3,981	4,374
器具備品	735,461	562,853
商標権	836	930
ソフトウェア	2,015,473	2,613,791
電信電話専用施設利用権	1,408	1,451

## 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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	311,994	276,211
流動負債	未払費用	492,035	622,004

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	0	182
ソフトウェア	12,988	442

## 2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	-	2,653

## (株主資本等変動計算書関係)

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

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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

## (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28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28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28年3月31日	平成28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、本社オフィス等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

ず。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	-

## 第31期(平成28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	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	26,427,656	26,427,656	-
(1) 未払法人税等	1,223,957	1,223,957	-
負債計	1,223,957	1,223,957	-

## (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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
非上場株式	80,246	77,696
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
差入保証金	733,907	2,040,945

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、記載しておりません。

前事業年度において、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、本社オフィス等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	-	-	-

第31期(平成28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	12,951,736	-	-	-
合計	12,951,736	-	-	-

(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30期の貸借対照表計上額2,316,596千円、第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円)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。

第31期（平成28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	365,683	146,101	219,581
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
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	381,005	159,101	221,903

（注）非上場株式（貸借対照表計上額77,696千円）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  
第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)  
該当事項はありません。

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他有価証券	5,927	3,377	-

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

第31期(平成28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	13,094,914	825,986

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30期	第31期
	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035
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	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	49,633	51,531
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

## (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30期	第31期
	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	973,035	1,086,550
未積立退職給付債務	973,035	1,086,550
未認識数理計算上の差異	89,550	79,449
未認識過去勤務費用	14,556	9,704
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396
退職給付引当金	868,928	997,396
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第30期	第31期
	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
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	174,402	179,999

## (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30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
割引率	0.89%	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30期事業年度43,461千円、第31期事業年度44,193千円であります。

## (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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	118,238	79,702
未払事業所税	5,527	5,581
賞与引当金	239,095	224,898
未払法定福利費	30,557	28,395
未払確定拠出年金掛金	2,650	2,500
外国税支払損失	15,727	-
資産除去債務	-	13,244
減価償却超過額（一括償却資産）	2,158	3,389
減価償却超過額	130,844	136,503
繰延資産償却超過額（税法上）	2,710	1,339
退職給付引当金	281,232	305,591
役員退職慰労引当金	35,724	47,318
ゴルフ会員権評価損	1,940	3,768
関係会社株式評価損	176,106	166,740
その他有価証券評価差額金	-	1,196
繰延税金資産合計	1,042,515	1,020,171
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	47,855	-
繰延税金負債合計	47,855	-
差引繰延税金資産の純額	994,659	1,020,171

## 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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28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の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29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30.86%に、平成30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30.62%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53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

#### （資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

#### （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。

## 第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	30,188,445	8,588,706	724,211	39,501,363

(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

## 第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	795,405	未収投資助言報酬	207,235

## 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	-	-

## 第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	9,000 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  増資の引受	800,617  912,600	未払 費用  -	308,974  -
	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	473,948	未払 費用	157,130

## 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
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	6,501
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

## 第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	-	兼務 1名	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	3,023,040	未払 手数料	372,837
								預金の預入 (純額)	879,733	現金・ 預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収 収益	123
その他の 関係会 社の子 会社	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	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	557,013	未払 費用	292,861
	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 払戻 (純額)	700,000	金銭の 信託	13,094,914
								信託報酬の 支払	8,336		

## 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30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,254,132円02銭	1,357,615円66銭
1株当たり当期純利益金額	213,583円46銭	213,606円51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30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

## (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32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,605,537
金銭の信託		11,792,364
前払費用		122,161
未収委託者報酬		4,755,701
未収運用受託報酬		2,465,934
未収投資助言報酬		261,221
未収収益		181,959
繰延税金資産		329,236
その他		122,804
	流動資産計	31,636,922
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	6,517
器具備品	1	152,176
建設仮勘定		1,383,196
無形固定資産		
ソフトウェア		1,421,245
ソフトウェア仮勘定		184,656
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権		124
投資その他の資産		
投資有価証券		441,519
関係会社株式		3,229,196
繰延税金資産		713,716
差入保証金		1,808,323
その他		89,010
	固定資産計	9,436,830
	資産合計	41,073,753

(単位:千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,080,224
未払金	2,651,649
未払償還金	49,873
未払手数料	1,865,871
その他未払金	735,905
未払費用	2,673,720
未払法人税等	907,554
未払消費税等	69,484
賞与引当金	724,711
訴訟損失引当金	30,000
その他	21,000
	流動負債計
	8,158,344
固定負債	
退職給付引当金	1,027,049
	固定負債計
	1,027,049
負債合計	9,185,394
(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	27,317,845
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	24,580,000
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	2,114,551
	株主資本計
	31,746,323
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	142,035
	評価・換算差額等計
	142,035
純資産合計	31,888,358
負債・純資産合計	41,073,753

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	14,454,974	
運用受託報酬	3,732,759	
投資助言報酬	456,986	
その他営業収益	323,793	
	営業収益計	18,968,513
営業費用		
支払手数料	6,111,449	
広告宣伝費	108,789	
公告費	428	
調査費	3,764,163	
調査費	2,639,714	
委託調査費	1,124,449	
委託計算費	216,712	
営業雑経費	278,529	
通信費	17,844	
印刷費	212,004	
協会費	11,277	
諸会費	18	
支払販売手数料	37,384	
	営業費用計	10,480,072
一般管理費		
給料	2,330,263	
役員報酬	124,419	
給料・手当	2,205,843	
交際費	16,973	
寄付金	13,268	
旅費交通費	100,973	
租税公課	148,041	
不動産賃借料	1,329,821	
退職給付費用	121,590	
固定資産減価償却費	1 353,322	
福利厚生費	11,020	
修繕費	10,082	
賞与引当金繰入額	724,711	
役員退職慰労金	63,072	
機器リース料	146	
事務委託費	182,857	
事務用消耗品費	37,442	
器具備品費	236,524	
諸経費	58,359	
	一般管理費計	5,738,473
営業利益		2,749,968

(単位:千円)

	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	7,882	
受取利息	341	
為替差益	32,301	
雑収入	4,836	
	営業外収益計	45,361
営業外費用		
金銭の信託運用損	59,768	
	営業外費用計	59,768
経常利益		2,735,561
特別損失		
固定資産除却損	2,820	
固定資産売却損	1,780	
訴訟損失引当金繰入額	30,000	
	特別損失計	34,601
税引前中間純利益		2,700,960
法人税、住民税及び事業税		856,976
法人税等調整額		17,520
法人税等合計		839,455
中間純利益		1,861,504

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30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	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818
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							1,861,504	1,861,504	1,861,504
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	-	-	3,232,495	682,495	682,495
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	24,580,000	300,000	200,000	2,114,551	27,317,845	31,746,323

	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	153,956	32,582,775
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		1,861,504
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	11,921	11,921
当中間期変動額 合計	11,921	694,416
当中間期末残高	142,035	31,888,358

## 重要な会計方針

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28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 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 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)訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる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。

## 会計方針の変更

<p>第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)</p>
<p>法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。</p>

## 追加情報

<p>第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)</p>
<p>1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。</p> <p>2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。 これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。</p>

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)		
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	790,504千円
	器具備品	...	596,199千円

(中間損益計算書関係)

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
1. 減価償却実施額	有形固定資産	...	57,752千円
	無形固定資産	...	295,570千円



## （中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

## （金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
（1）現金・預金	11,605,537	11,605,537	-
（2）金銭の信託	11,792,364	11,792,364	-
（3）投資有価証券 その他有価証券	363,823	363,823	-
資産計	23,761,725	23,761,725	-
（1）未払法人税等	907,554	907,554	-
負債計	907,554	907,554	-

## （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	77,696
関係会社株式	3,229,196
差入保証金	1,808,323

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、時価開示の対象としておりません。

## (有価証券関係)

第32期中間会計期間末  
(平成28年9月30日現在)

- 満期保有目的の債券  
該当事項はありません。
- 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3,229,196千円)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。
- 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	349,644	146,101	203,542
債券	-	-	-
その他(投資信託)	14,179	13,000	1,179
小計	363,823	159,101	204,721
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	363,823	159,101	204,721

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額77,696千円)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32期中間会計期間末  
(平成28年9月30日現在)

- 満期保有目的の金銭の信託  
該当事項はありません。
- 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。

## (資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28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	14,454,974	4,189,745	323,793	18,968,513

(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

顧客の名称又は氏名	営業収益 (千円)
第一生命グループ	1,928,739

(注) 第一生命グループには、第一生命保険株式会社及び第一フロンティア生命保険株式会社が含まれております。

## (1株当たり情報)

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,328,681円	62銭
1株当たり中間純利益金額	77,562円	67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32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
中間純利益	1,861,504千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,861,504千円
期中平均株式数	24,000株

## （重要な後発事象）

第32期中間会計期間  
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

当社（以下「DIAM」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAM、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

## 1．結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

## 2．企業結合日

平成28年10月1日

## 3．企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

## 4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5．交付した株式数

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）に対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないA種種類株式15,510株を交付しました。

## 6．企業結合の主な目的

当社は、みずほフィナンシャルグループ及び第一生命保険株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、みずほフィナンシャルグループと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

## 7．取得企業を決定するに至った主な根拠

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるみずほフィナンシャルグループが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

## 8．実施予定の会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3．企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理することをそれぞれ予定しております。

(参考)みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「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条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度(自平成27年4月1日至平成28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により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28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により中間監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

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	江見 睦生 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子 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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第53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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28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。

## 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 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、当社が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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28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28年4月1日から平成28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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、みずほ投信投資顧問株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 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。

## (1)貸借対照表

	（単位： 千円）	
	前事業年度 （平成27年 3月31日）	当事業年度 （平成28年 3月31日）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	1,092	1,185
<b>流動資産合計</b>	<b>25,070,606</b>	<b>25,493,940</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>		
建物（純額）	124,850	100,000
工具、器具及び備品（純額）	71,443	90,655
リース資産（純額）	2,140	818
<b>有形固定資産合計</b>	<b>1 198,434</b>	<b>1 191,474</b>
<b>無形固定資産</b>		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
<b>無形固定資産合計</b>	<b>12,812</b>	<b>12,782</b>
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	19,534	19,404
<b>投資その他の資産合計</b>	<b>4,691,245</b>	<b>3,955,916</b>
<b>固定資産合計</b>	<b>4,902,492</b>	<b>4,160,172</b>
<b>資産合計</b>	<b>29,973,099</b>	<b>29,654,112</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
<b>未払金合計</b>	<b>912,009</b>	<b>851,826</b>
未払費用	2,038,097	1,896,033
未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
<b>流動負債合計</b>	<b>4,183,052</b>	<b>3,895,216</b>
<b>固定負債</b>		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
<b>固定負債合計</b>	<b>428,109</b>	<b>194,716</b>
<b>負債合計</b>	<b>4,611,161</b>	<b>4,089,932</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,045,600	2,045,600

資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	<u>4,716,474</u>	<u>4,716,474</u>
利益剰余金		
利益準備金	128,584	128,584
その他利益剰余金		
配当準備積立金	104,600	104,600
退職慰労積立金	100,000	100,000
別途積立金	9,800,000	9,800,000
繰越利益剰余金	7,739,742	8,908,993
利益剰余金合計	<u>17,872,927</u>	<u>19,042,177</u>
自己株式	-	377,863
株主資本合計	<u>24,635,002</u>	<u>25,426,389</u>
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	726,935	137,791
評価・換算差額等合計	<u>726,935</u>	<u>137,791</u>
純資産合計	<u>25,361,937</u>	<u>25,564,180</u>
負債純資産合計	<u>29,973,099</u>	<u>29,654,112</u>

## (2)損益計算書

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	17,538,139	17,358,667
運用受託報酬	4,463,429	5,050,661
営業収益合計	22,001,569	22,409,329
営業費用		
支払手数料	8,480,510	7,999,728
広告宣伝費	247,790	205,521
公告費	1,140	152
調査費		
調査費	1,259,067	1,312,466
委託調査費	4,883,037	5,299,598
図書費	4,308	3,703
調査費合計	6,146,412	6,615,769
委託計算費	101,919	116,405
営業雑経費		
通信費	59,454	46,151
印刷費	128,143	246
協会費	18,777	20,221
諸会費	2,540	2,317
その他	855,319	958,635
営業雑経費合計	1,064,234	1,027,572
営業費用合計	16,042,008	15,965,148
一般管理費		
給料		
役員報酬	142,983	143,812
給料手当	1,832,723	1,905,880
賞与	295,180	304,122
給料合計	2,270,886	2,353,814
交際費	775	775
寄付金	-	221
旅費交通費	91,851	87,228
租税公課	51,783	76,075
不動産賃借料	339,964	305,351
退職給付費用	126,451	119,608
福利厚生費	368,622	370,689
貸倒引当金繰入	-	93
賞与引当金繰入	319,122	301,698
役員退職慰労引当金繰入	27,249	47,768
固定資産減価償却費	31,216	44,257
諸経費	358,817	269,502
一般管理費合計	3,986,740	3,977,085
営業利益	1,972,819	2,467,095
営業外収益		
受取配当金	7,027	4,242
受取利息	7,340	7,633
有価証券解約益	953	50,674
有価証券償還益	-	56,303
時効到来償還金等	21,856	1,962
時効後支払損引当金戻入額	-	1,311
雑収入	51,171	20,993
営業外収益合計	88,349	143,121
営業外費用		
有価証券解約損	-	278
有価証券償還損	2,197	2,641
ヘッジ会計に係る損失	2,240	-
時効後支払損引当金繰入額	17,685	-
雑損失	63,198	6,767

営業外費用合計		85,321	9,688
経常利益		1,975,847	2,600,528
特別利益			
投資有価証券売却益		10,500	-
特別利益合計		10,500	-
特別損失			
減損損失	1	51,292	-
事業再構築費用	2	125,173	-
外国税負担損失	3	53,547	-
貸倒引当金繰入		19,534	-
特別損失合計		249,548	-
税引前当期純利益		1,736,799	2,600,528
法人税、住民税及び事業税		616,760	839,827
法人税等調整額		16,247	40,166
法人税等合計		633,008	879,993
当期純利益		1,103,790	1,720,534

## (3)株主資本等変動計算書

前事業年度(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		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本						株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	
		その他利益剰余金					
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	6,988,395	17,121,579	23,883,654
当期変動額							
剰余金の配当					352,443	352,443	352,443
当期純利益					1,103,790	1,103,790	1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)							
当期変動額合計					751,347	751,347	751,347
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	24,635,002

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	41,248	41,248	23,842,406
当期変動額			
剰余金の配当			352,443
当期純利益			1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	768,183	768,183	768,183
当期変動額合計	768,183	768,183	1,519,530
当期末残高	726,935	726,935	25,361,937

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位： 千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本							自己株式	株主資本合計
	利益剰余金						利益剰余金合計		
	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計			
		配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金				
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	-	24,635,002	
当期変動額									
剰余金の配当					551,284	551,284		551,284	
当期純利益					1,720,534	1,720,534		1,720,534	
自己株式の取得							377,863	377,863	
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計					1,169,250	1,169,250	377,863	791,386	
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177	377,863	25,426,389	

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	726,935	726,935	25,361,937
当期変動額			
剰余金の配当			551,284
当期純利益			1,720,534
自己株式の取得			377,863
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	589,143	589,143	589,143
当期変動額合計	589,143	589,143	202,242
当期末残高	137,791	137,791	25,564,180



## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

### 3. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法（ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。

#### (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

#### (3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

### 4. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。

#### (3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、決算日において発生していると認められる額を計上しております。

#### (4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）

#### (5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

### 5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、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。

### 6. ヘッジ会計の方法

#### (1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

#### (3) ヘッジ方針

当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。

#### (4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

## 7. その他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。

## 未適用の会計基準等

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

## 1. 概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

## 2. 適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

## 3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

## 会計上の見積りの変更に関する注記

当社は、「追加情報」に記載のとおり、当社、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積りの変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、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27,598千円減少しております。

## 追加情報

DIAMアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 西 恵正）、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 - 8 - 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

## 注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1	有形固定資産の減価償却累計額
	建物 111,156千円		建物 136,006千円
	工具、器具及び備品 277,249千円		工具、器具及び備品 226,657千円
	リース資産 16,185千円		リース資産 17,508千円

## (損益計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

## 1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額(千円)
本社(東京都港区)	除却対象資産	建物	23,139
本社(東京都港区)	除却対象資産	工具器具備品	4,253
本社(東京都港区)	除却対象資産	原状回復費用	23,900

レイアウト変更により現行オフィス内部造作等の除却が決定した資産につき、「除却対象資産」としてグルーピングを行い、平成27年3月31日時点の帳簿価額および原状回復費用を減損損失(51,292千円)として特別損失に計上しました。

## 2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

## 3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

該当するものはありません。

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

## 1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

## 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(円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発効日
平成26年6月11日 第51回定時株主総会	普通株式	352,443,450	335	平成26年3月31日	平成26年6月12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	配当金の総額(円)	配当の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	利益剰余金	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

## 2 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	-	13,662	-	13,662

## (変動事由の概要)

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

### 3. 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 (円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

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

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

#### (リース取引関係)

##### 1. ファイナンス・リース取引（借主側）

###### 所有権移転外ファイナンス・リース取引

###### リース資産の内容

###### 有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

###### リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

#### (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

当社は、投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

###### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。

###### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

###### 信用リスクの管理

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を半期ごとに把握する体制としております。

有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

###### 市場リスクの管理

有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的な時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。

###### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,801,864	20,801,864	-
(2) 未収委託者報酬	1,827,951	1,827,951	-
(3) 未収運用受託報酬	1,812,198	1,812,198	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	4,054,289	4,054,289	-
資産計	28,496,304	28,496,304	-
(1) 未払手数料	819,341	819,341	-
負債計	819,341	819,341	-
デリバティブ取引（1）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(3,601)	(3,601)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	327	327	-
デリバティブ取引計	(3,274)	(3,274)	-

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,903,257	20,903,257	-
(2) 未収委託者報酬	2,183,032	2,183,032	-
(3) 未収運用受託報酬	1,713,643	1,713,643	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,282,026	3,282,026	-
資産計	28,081,960	28,081,960	-
(1) 未払手数料	838,064	838,064	-
負債計	838,064	838,064	-
デリバティブ取引（1）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(220)	(220)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1,564)	(1,564)	-
デリバティブ取引計	(1,784)	(1,784)	-

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

## (1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

## (4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

負 債

## (1) 未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	60,720	60,720

上記については、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ため、「(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,800,853	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,827,951	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,812,198	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	127,840	-	-	-	-	3,300,657
合計	24,568,844	-	-	-	-	3,300,657

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,902,546	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	2,183,032	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,713,643	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	82,540	-	-	-	-	2,395,185
合計	24,881,762	-	-	-	-	2,395,185

## (有価証券関係)

## 1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	3,740,183	2,664,442	1,075,740
小計	3,740,183	2,664,442	1,075,740
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	314,105	316,720	2,615
小計	314,105	316,720	2,615
合計	4,054,289	2,981,163	1,073,125

## 当事業年度(平成28年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	2,698,875	2,500,000	198,875
小計	2,698,875	2,500,000	198,875
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	583,151	583,423	271
小計	583,151	583,423	271
合計	3,282,026	3,083,423	198,603

2 当事業年度中に売却したその他有価証券  
該当するものではありません。

3 当事業年度中に解約・償還したその他有価証券  
前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	102,729	953	2,197
合計	102,729	953	2,197

## 当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	738,178	106,977	2,920
合計	738,178	106,977	2,920

(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  
株式関連  
前事業年度(平成27年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	197,054	-	3,601	3,601
	合計	197,054	-	3,601	3,601

## 当事業年度(平成28年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	148,005	-	220	220
	合計	148,005	-	220	220

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 株式関連

前事業年度(平成27年3月31日)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	131,145	-	3,325
	買建	投資有価証券	277,953	-	3,652
合計			409,098	-	327

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度(平成28年3月31日)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	117,467	-	147
	買建	投資有価証券	179,836	-	1,711
合計			297,303	-	1,564

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

## (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、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。

当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	357,258千円	331,766千円
退職給付費用	150,018	51,208
退職給付の支払額	21,349	-
制度への拠出額	103,177	66,102
退職給付引当金の期末残高	331,766	346,659

## (2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	669,318千円	727,842千円
年金資産	1,001,084	1,074,502
貸借対照表に計上された前払年金費用	331,766	346,659



## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度58,362千円 当事業年度51,208千円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

## (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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
有価証券償却超過額	4,795千円	4,551千円
ソフトウェア償却超過額	69,263	52,651
賞与引当金損金算入限度超過額	108,734	98,134
社会保険料損金不算入額	15,665	14,233
役員退職慰労引当金	34,461	45,488
未払事業税	30,421	39,817
その他	93,137	58,782
繰延税金資産小計	356,479	313,659
評価性引当額	24,103	22,331
繰延税金資産合計	332,375	291,328
<b>繰延税金負債</b>		
前払年金費用	107,027	106,147
その他有価証券評価差額金	346,190	60,812
繰延税金負債合計	453,218	166,959
繰延税金資産の純額	120,843	124,368

## 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」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年4月1日から平成30年3月31日までのものは30.86%、平成30年4月1日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。

その結果、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）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

## (資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）及び当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [ 関連情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	2,629,803	資産運用業

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	3,061,207	資産運用業

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,833,692	未払手数料	361,219
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	13,851,610	未収委託者報酬	1,661,682

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,542,264	未払手数料	336,556
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	14,108,529	未収委託者報酬	2,053,638

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	24,106.70円	24,618.62円
1株当たり当期純利益金額	1,049.16円	1,639.16円

(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、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

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。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
普通株式に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
期中平均株式数(株)	1,052,070	1,049,643

## (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54期中間会計期間  
(平成28年9月30日)

資産の部	
流動資産	
現金及び預金	4,120,018
未収委託者報酬	2,064,997
未収運用受託報酬	1,959,028
繰延税金資産	140,728
その他	398,383
貸倒引当金	1,207
流動資産合計	8,681,950
固定資産	
有形固定資産	
工具、器具及び備品（純額）	62,971
有形固定資産合計	1 62,971
無形固定資産	
投資その他の資産	12,767
投資有価証券	815,525
繰延税金資産	73,719
その他	638,830
貸倒引当金	19,404
投資その他の資産合計	1,508,671
固定資産合計	1,584,410
資産合計	10,266,360
負債の部	
流動負債	
未払金	793,859
未払費用	1,675,771
未払法人税等	253,697
賞与引当金	319,200
その他	221,869
流動負債合計	3,264,398
固定負債	
役員退職慰労引当金	57,860
時効後支払損引当金	7,256
固定負債合計	65,116
負債合計	3,329,515
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,045,600
資本剰余金	
資本準備金	2,266,400
その他資本剰余金	1,103,259
資本剰余金合計	3,369,659
利益剰余金	
利益準備金	128,584
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	1,777,567
利益剰余金合計	1,906,152
自己株式	377,863
株主資本合計	6,943,548
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	6,703
評価・換算差額等合計	6,703
純資産合計	6,936,845
負債純資産合計	10,266,360

## (2) 中間損益計算書

(単位: 千円)

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		7,935,613
運用受託報酬		2,105,866
営業収益合計		10,041,479
営業費用及び一般管理費	1	9,415,997
営業利益		625,482
営業外収益		
受取配当金		19,694
受取利息		439
有価証券解約益		76,483
有価証券償還益		3,474
時効到来償還金等		727
雑収入		17,708
営業外収益合計		118,528
営業外費用		
有価証券解約損		96
有価証券償還損		12
雑損失		6,303
営業外費用合計		6,412
経常利益		737,598
特別利益		700
特別損失		11,641
税引前中間純利益		726,657
法人税、住民税及び事業税		236,054
法人税等調整額		26,308
法人税等合計		209,746
中間純利益		516,910

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当中間期変動額				
積立金取崩				
剰余金の配当			1,346,815	1,346,815
中間純利益				
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			1,346,815	1,346,815
当中間期末残高	2,045,600	2,266,400	1,103,259	3,369,659

	株主資本					
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計
		その他利益剰余金				
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177
当中間期変動額						
積立金取崩		104,600	100,000	9,800,000	10,004,600	-
剰余金の配当					17,652,936	17,652,936
中間純利益					516,910	516,910
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		104,600	100,000	9,800,000	7,131,425	17,136,025
当中間期末残高	128,584	-	-	-	1,777,567	1,906,152

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	自己株式	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額 等合計	
当期首残高	377,863	25,426,389	137,791	137,791	25,564,180
当中間期変動額					
積立金取崩		-			-
剰余金の配当		18,999,751			18,999,751
中間純利益		516,910			516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			144,494	144,494	144,494
当中間期変動額合計		18,482,840	144,494	144,494	18,627,334
当中間期末残高	377,863	6,943,548	6,703	6,703	6,936,845

## 重要な会計方針

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、中間決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、中間決算日において発生していると認められる額を計上しております。

## (4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

## (5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

## 4. 外貨建資産・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。

## 5. 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

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

	第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	476,786千円

## （中間損益計算書関係）

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1 減価償却実施額	有形固定資産 114,327千円 無形固定資産 15千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

## 1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

## 2 . 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	13,662	-	-	13,662

## 3 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 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

## （金融商品関係）

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

（単位： 千円）

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	4,120,018	4,120,018	-
(2) 未収委託者報酬	2,064,997	2,064,997	-
(3) 未収運用受託報酬	1,959,028	1,959,028	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	754,805	754,805	-
資産計	8,898,851	8,898,851	-
(1) 未払手数料	785,089	785,089	-
負債計	785,089	785,089	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## 資 産

## (1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。



## (4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

## 負債

## (1) 未払手数料

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の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	60,720

上記については、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ため、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## (有価証券関係)

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

## 1 其他有価証券

種類	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			
証券投資信託	151,830	150,000	1,830
小計	151,830	150,000	1,830
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
証券投資信託	602,975	614,467	11,491
小計	602,975	614,467	11,491
合計	754,805	764,467	9,661

## (資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## 2 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

## 3 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益(千円)	関連するセグメント名
適格機関投資家A	1,177,474	資産運用業

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1株当たり純資産額	6,680.26円

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1株当たり中間純利益金額	497.79円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	516,910
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	516,910
普通株式の期中平均株式数(株)	1,038,408

(注)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。

(重要な後発事象)

当社(以下「MHAM」という)は、平成28年7月13日付で締結した、MHAM、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日  
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

## （参考）新光投信株式会社の経理状況

### 1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第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。

当社の中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条および第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、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。

### 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第57期事業年度（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社  
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 公認会計士 伊藤 志保  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛  
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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56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、新光投信株式会社の平成28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。

## 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の統合基本合意書に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 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

- ( ) 1. 上記は、当社が、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。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	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」に掲げられている新光投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、新光投信株式会社の平成28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28年4月1日から平成28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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、新光投信株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 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。

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160
有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
流動資産合計	20,404,659	21,767,367
固定資産		
有形固定資産		
建物(純額)	2 12,687	2 0
構築物(純額)	2 1,444	2 0
器具・備品(純額)	2 86,688	2 44,868
有形固定資産合計	100,820	44,868
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
無形固定資産合計	86,278	57,152
投資その他の資産		
投資有価証券	5,101,854	2,858,652
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,246	23,339
長期繰延税金資産	-	29,604
前払年金費用	396,211	378,381
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	5,706,044	3,373,710
固定資産合計	5,893,143	3,475,731
資産合計	26,297,802	25,243,098

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	1 1,558,682	1 1,360,372
その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
<b>固定負債</b>		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	4,524,300	4,524,300
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	360,493	360,493
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744



評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	（自	平成26年4月 1日	（自	平成27年4月 1日
	至	平成27年3月31日）	至	平成28年3月31日）
営業収益				
委託者報酬		35,876,795		39,283,623
運用受託報酬		238,412		232,145
営業収益合計		36,115,207		39,515,769
営業費用				
支払手数料	1	18,252,669	1	19,472,734
広告宣伝費		456,430		507,020
公告費		548		469
調査費				
調査費		623,792		841,825
委託調査費		5,966,340		7,419,125
図書費		5,254		4,879
調査費合計		6,595,388		8,265,830
委託計算費		1,352,318		1,711,366
営業雑経費				
通信費		32,335		30,454
印刷費		103,093		1,022
協会費		18,150		19,367
諸会費		3,300		3,117
その他		41,594		44,518
営業雑経費合計		198,475		98,480
営業費用合計		26,855,830		30,055,901
一般管理費				
給料				
役員報酬		96,445		91,205
給料・手当		1,368,552		1,480,875
賞与		336,076		428,776
給料合計		1,801,073		2,000,857
交際費		11,426		10,708
寄付金		3,198		2,346
旅費交通費		100,386		109,240
租税公課		68,508		90,795
不動産賃借料		206,753		205,671
賞与引当金繰入		451,000		547,750
役員賞与引当金繰入		66,000		22,000
役員退職慰労引当金繰入		24,930		22,210
退職給付費用		191,900		169,238
減価償却費		70,676		102,532

諸経費	573,824	647,510
一般管理費合計	3,569,678	3,930,859
営業利益	5,689,698	5,529,008

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		163,006		65,772
有価証券利息		3,853		3,333
受取利息		10,741		10,751
時効成立分配金・償還金		5,080		923
受取保険金		-		10,300
雑益		487		2,845
営業外収益合計		183,170		93,926
営業外費用				
支払利息		26		3
時効成立後支払分配金・償還金		3,083		5,532
雑損		3,261		556
営業外費用合計		6,371		6,092
経常利益		5,866,496		5,616,842
特別利益				
投資有価証券売却益		68,179		225,965
外国税支払損失引当金戻入益		-		43,200
特別利益合計		68,179		269,166
特別損失				
固定資産除却損		3,177		13,017
投資有価証券売却損		54,613		60,150
投資有価証券評価損		10,952		62,800
外国税支払損失引当金繰入額		184,111		-
訴訟損失引当金繰入額		30,000		10,000
合併関連費用	2	-	2	164,657
その他特別損失		22,227		-
特別損失合計		305,082		310,625
税引前当期純利益		5,629,593		5,575,383
法人税、住民税及び事業税		2,111,379		1,832,729
法人税等調整額		66,999		19,773
法人税等合計		2,044,380		1,852,503
当期純利益		3,585,212		3,722,880

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（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	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165
会計方針の変更による累積 的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した当期 首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当期変動額					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自 己 株 式	株 主 資 本 合 計	その他有価証 券評価差額金	
	利 益 剰余金 合 計				
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による累積 的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当期 首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28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	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金 別途積立金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益						
自己株式の消却			72,415	72,415		
利益剰余金から 資本剰余金への振替			72,415	72,415		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-
当期末残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000

	株主資本				評価・換算 差額等	純資産合計
	利益剰余金		自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
当期首残高	3,981,245	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当期変動額						
剰余金の配当	3,446,341	3,446,341		3,446,341		3,446,341
当期純利益	3,722,880	3,722,880		3,722,880		3,722,880
自己株式の消却			72,415	-		-
利益剰余金から資本剰余金への振替	72,415	72,415		-		-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				-	187,941	187,941
当期変動額合計	204,122	204,122	72,415	276,538	187,941	88,597
当期末残高	4,185,368	13,445,861	-	20,731,861	94,744	20,826,605

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 関連会社株式

総平均法による原価法

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20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）に基づく定額法により償却しております。

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

#### (2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

#### (3) 外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

#### (4) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

#### (5) 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及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

過去勤務費用は、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

#### （6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

#### （7）執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

#### 4．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、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。

#### 5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### （1）消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

#### （未適用の会計基準）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

##### （1）概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

##### （2）適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

##### （3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

#### （追加情報）

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日に、新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

- 1．商号 アセットマネジメントOne株式会社
- 2．代表者 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
- 3．本店所在地 東京都千代田区丸の内1-8-2
- 4．統合日 平成28年10月1日



## 注記事項

## （貸借対照表関係）

1．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払手数料	777,631千円	570,839千円

2．資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	573,602千円	657,201千円

## （損益計算書関係）

1．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
支払手数料	9,189,399千円	8,452,937千円

2．特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
固定資産・敷金の償却	-千円	140,257千円
その他	-千円	24,400千円
合計	-千円	164,657千円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	-	1,823,250

## 2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	9,386	-	-	9,386

## 3. 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12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	9,386	1,813,864

(変動事由の概要)

自己株式の消却

## 2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	9,386	-	9,386	-

(変動事由の概要)

自己株式の消却

## 3. 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27年11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17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

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行ってまいります。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

##### 信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

##### 市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

##### 流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上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ることがあります。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、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

## 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）。

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金及び預金	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金及び預金	14,861,160	14,861,160	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,159,600	6,159,600	-
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	2,884,368	-

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

(3) 未収委託者報酬

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（単位：千円）

区分	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
非上場株式	276,151	276,151

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

## (注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 前事業年度(平成27年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

## 当事業年度(平成28年3月31日)

	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	14,861,112	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	-	-	-

## (有価証券関係)

## 1. 関連会社株式

関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円)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。

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)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。

当事業年度(平成28年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,119,150	869,274	249,875
	小計	1,119,150	869,274	249,875
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,040,450	5,153,936	113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	113,485
	合計	6,159,600	6,023,210	136,389

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)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。

### 3.売却したその他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	503,565	68,179	54,613
合計	503,565	68,179	54,613

当事業年度（平成28年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	2,209,763	225,965	60,150
合計	2,209,763	225,965	60,150

## 4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円（その他有価証券）減損処理を行っております。  
当事業年度において、有価証券について62,800千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

## （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、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

## 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

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,424,739	1,348,083
会計方針の変更による累積的影響額	71,902	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,352,836	1,348,083
勤務費用	90,967	91,804
利息費用	9,476	6,074
数理計算上の差異の発生額	31,927	53,747
退職給付の支払額	73,269	60,817
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,348,083	1,438,892



## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
年金資産の期首残高	1,157,054	1,329,170
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の発生額	108,961	128,633
事業主からの拠出額	78,464	77,164
退職給付の支払額	38,450	28,253
年金資産の期末残高	1,329,170	1,282,678

## (3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成27年3月31日)	(平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,111,797	1,185,792
年金資産	1,329,170	1,282,678
	217,373	96,885
非積立型制度の退職給付債務	236,285	253,099
未積立退職給付債務	18,912	156,213
未認識数理計算上の差異	270,020	387,977
未認識過去勤務費用	10,703	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764
退職給付引当金	155,806	146,617
前払年金費用	396,211	378,381
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用(注1)	119,135	124,139
利息費用	9,476	6,074
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の費用処理額	85,138	64,424
過去勤務費用の費用処理額	16,055	10,703
確定給付制度に係る退職給付費用	174,553	150,705

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額(前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円)については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

## (5)年金資産に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%
現金及び預金	1.4%	3.2%
合計	100%	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6)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

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
割引率	0.0720% ~ 1.625%	0.0120% ~ 0.8060%
長期期待運用収益率	2.0%	2.5%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

## （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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	170,920千円	182,614千円
減価償却超過額	896	25,871
退職給付引当金	70,882	71,201
役員退職慰労引当金	12,688	14,799
投資有価証券評価損	15,033	19,229
非上場株式評価損	25,733	24,425
未払事業税	90,342	57,445
外国税支払損失引当金	60,867	-
訴訟損失引当金	9,918	12,344
その他	87,621	120,305
繰延税金資産小計	544,905	528,236
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	544,905	528,236
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	134,624	56,708
前払年金費用	127,817	115,860
繰延税金負債合計	262,442	172,568
繰延税金資産の純額	282,463	355,668

（注）繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産 - 繰延税金資産	372,215千円	326,063千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	-	29,604
固定負債 - 長期繰延税金負債	89,752	-

## 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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。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の32.26%から、平成28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等については30.86%に、平成30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等については30.62%となります。

その結果、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）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

### (資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

### (セグメント情報等)

#### セグメント情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### 関連情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

##### 1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

##### 2. 地域ごとの情報

###### (1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

###### (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 関連当事者情報

## 1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る)等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	9,189,399	未払手数料	777,631

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.98 間接 7.73	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,452,937	未払手数料	570,839

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	16,314
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	96,300	その他未払金	8,725
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,163	その他未払金	1,728

(注) 1. 上記(ア)~(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。  
なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## 親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
1株当たり純資産額	11,433円05銭	11,481円90銭
1株当たり当期純利益金額	1,976円56銭	2,052円45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、潜在株式が存在しないため記載していません。

（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。

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
期中平均株式数（千株）	1,813	1,813

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	7,314,360
有価証券	101,520
未収委託者報酬	3,004,856
未収運用受託報酬	74,687
繰延税金資産	281,201
その他	334,195
流動資産合計	11,110,820
固定資産	
有形固定資産	
器具・備品(純額)	31,241
建設仮勘定	3,819
有形固定資産合計	35,061
無形固定資産	
ソフトウェア	52,424
ソフトウェア仮勘定	20,936
その他	91
無形固定資産合計	73,452
投資その他の資産	
投資有価証券	2,589,863
長期繰延税金資産	22,056
前払年金費用	352,195
その他	29,332
投資その他の資産合計	2,993,448
固定資産合計	3,101,961
資産合計	14,212,782



(単位：千円)

当中間会計期間  
(平成28年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	
未払収益分配金	153
未払償還金	4,216
未払手数料	1,406,798
その他未払金	284,198
未払金合計	1,695,367
未払費用	801,111
未払法人税等	850,492
未払消費税等	2 113,638
賞与引当金	382,000
訴訟損失引当金	70,000
流動負債合計	3,912,609
固定負債	
退職給付引当金	160,185
固定負債合計	160,185
負債合計	4,072,794
純資産の部	
株主資本	
資本金	4,524,300
資本剰余金	
資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	2,473,372
利益剰余金合計	2,833,866
株主資本合計	10,119,866
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	20,122
評価・換算差額等合計	20,122
純資産合計	10,139,988
負債純資産合計	14,212,782

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間	
	(自	平成28年4月 1日
	至	平成28年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		19,468,460
運用受託報酬		95,090
営業収益合計		19,563,551
営業費用及び一般管理費	1	16,721,767
営業利益		2,841,783
営業外収益		
受取配当金		32,758
有価証券利息		522
受取利息		2,296
時効成立分配金・償還金		10
その他		531
営業外収益合計		36,119
営業外費用		
その他		34
営業外費用合計		34
経常利益		2,877,868
特別利益		
固定資産売却益		1,354
投資有価証券売却益		9,179
特別利益合計		10,533
特別損失		
固定資産売却損		3,996
投資有価証券評価損		58,055
固定資産除却損		50
訴訟損失引当金繰入額		30,000
合併関連費用		11,926
特別損失合計		104,028
税引前中間純利益		2,784,373
法人税、住民税及び事業税		795,495
法人税等調整額		85,212
法人税等合計		880,707
中間純利益		1,903,666

## (3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別途 積立金	繰越 利益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	4,185,368
当中間期変動額					
別途積立金取崩				8,900,000	8,900,000
剰余金の配当					12,515,661
中間純利益					1,903,666
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	-	-	-	8,900,000	1,711,995
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	-	2,473,372

	株主資本		評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	株主 資本 合計	その他有価証 券評価差額金	
	利益 剰余金 合計			
当期首残高	13,445,861	20,731,861	94,744	20,826,605
当中間期変動額				
別途積立金取崩	-	-		-
剰余金の配当	12,515,661	12,515,661		12,515,661
中間純利益	1,903,666	1,903,666		1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			74,622	74,622
当中間期変動額合計	10,611,995	10,611,995	74,622	10,686,617
当中間期末残高	2,833,866	10,119,866	20,122	10,139,988

## [ 注記事項 ]

## （重要な会計方針）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

## (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）に基づく定額法により償却しております。

## 3．引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

## (2) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる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及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

過去勤務費用については、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、そ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（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

## 4. 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

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

## (中間貸借対照表関係)

## 1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	498,091千円

## 2. 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

## (中間損益計算書関係)

## 1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
有形固定資産	9,695千円
無形固定資産	9,425千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,813,864	-	-	1,813,864

## 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28年6月15日 取締役会	普通 株式	12,515,661	6,900	平成28年7月5日	平成28年7月27日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの該当事項はありません。

## （金融商品関係）

## 金融商品の時価等に関する事項

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）。

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	7,314,360	7,314,360	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,415,231	2,415,231	-
(3) 未収委託者報酬	3,004,856	3,004,856	-
(4) 未払手数料	1,406,798	1,406,798	-

（注）1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## (1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## (3) 未収委託者報酬

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。

## (4) 未払手数料

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	276,151

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## （有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

## 1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 77,100千円）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。

## 2. その他有価証券

	種類	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	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	921,189	730,244	190,944
	小計	921,189	730,244	190,944
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,494,041	1,656,021	161,979
	小計	1,494,041	1,656,021	161,979
	合計	2,415,231	2,386,265	28,965

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額199,051千円)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。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	5,590円26銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	10,139,988
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	10,139,988
普通株式の発行済株式数(株)	1,813,864
普通株式の自己株式数(株)	-
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	1,049円50銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株式の期中平均株式数(株)	1,813,864

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載していません。

## （追加情報）

## 役員賞与引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

## 役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全取締役及び全監査役に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。



これに伴い、当中間会計期間において74,853千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

#### 執行役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月14日開催の取締役会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全執行役員に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において101,916千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

#### 繰延税金資産

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。

#### (重要な後発事象)

当社(以下「新光投信」という)は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及びみずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日  
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1名称、資本金の額及び事業の内容」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) 受託会社

## a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

## b. 資本金の額

平成28年3月末日現在 324,279百万円

## c. 事業の内容

日本において信託業務および銀行業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行(1)	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
高木証券株式会社	11,069	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB Cフレンド証券株式会社(1)	27,270	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

(1) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年4月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 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、「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28年8月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語30（安定型）の平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

アセットマネジメントOne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。

XBR 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29年4月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 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、「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28年8月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語50（安定・成長型）の平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

アセットマネジメントOne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。

XBR 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29年4月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 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、「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28年8月26日から平成29年2月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語70（成長型）の平成29年2月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

アセットマネジメントOne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5月31日

DIAM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DIAM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、DIAMアセットマネジメント株式会社の平成28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。

### 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 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) XBR 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28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚 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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28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28年4月1日から平成28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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。



## 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。