

【表紙】
【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成21年5月25日
【計算期間】 第16期（自 平成20年8月26日 至 平成21年2月25日）
【ファンド名】 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）
【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 長浜 力雄
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】 大楽 信雄
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【電話番号】 03-3287-3110
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【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】

当ファンドは、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。

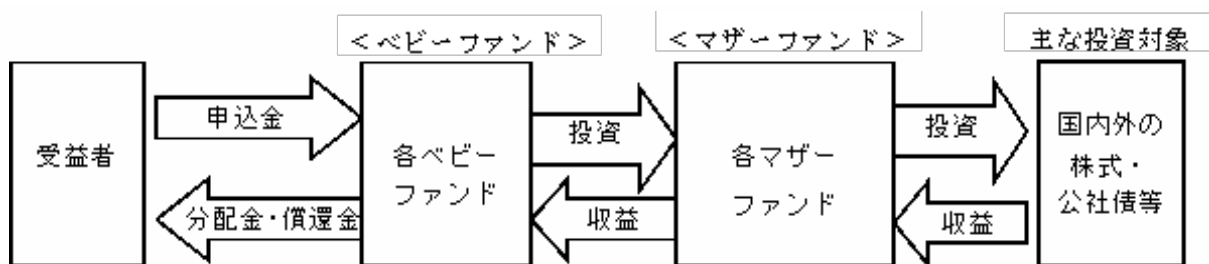
当ファンドは契約型の追加型株式投資信託に属し、原則としていつでも買付け、解約のお申込みができます。

当ファンドは、追加型株式投資信託のうちバランス型 に属します。

「バランス型」とは、社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において「約款上の株式組入限度70%未満のファンドで、株式・公社債等のバランス運用、あるいは公社債中心の運用を行うもの。」として分類されるファンドをいいます。

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資家からの資金をまとめてベビーファンド（「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）」）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド（「DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」「DL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」）に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。当ファンドは、「ベビーファンド」に当たります。

「ファミリーファンド方式」の仕組み



ベビーファンドはマザーファンドのほか、株式、公社債等に直接投資を行うこともあります。

マザーファンドの運用方針等は、「第1ファンドの状況 2.投資方針（参考）「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」」の概要をご参照ください。

各ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。

(2)【ファンドの仕組み】

ファンドの関係法人は次の通りです。

委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

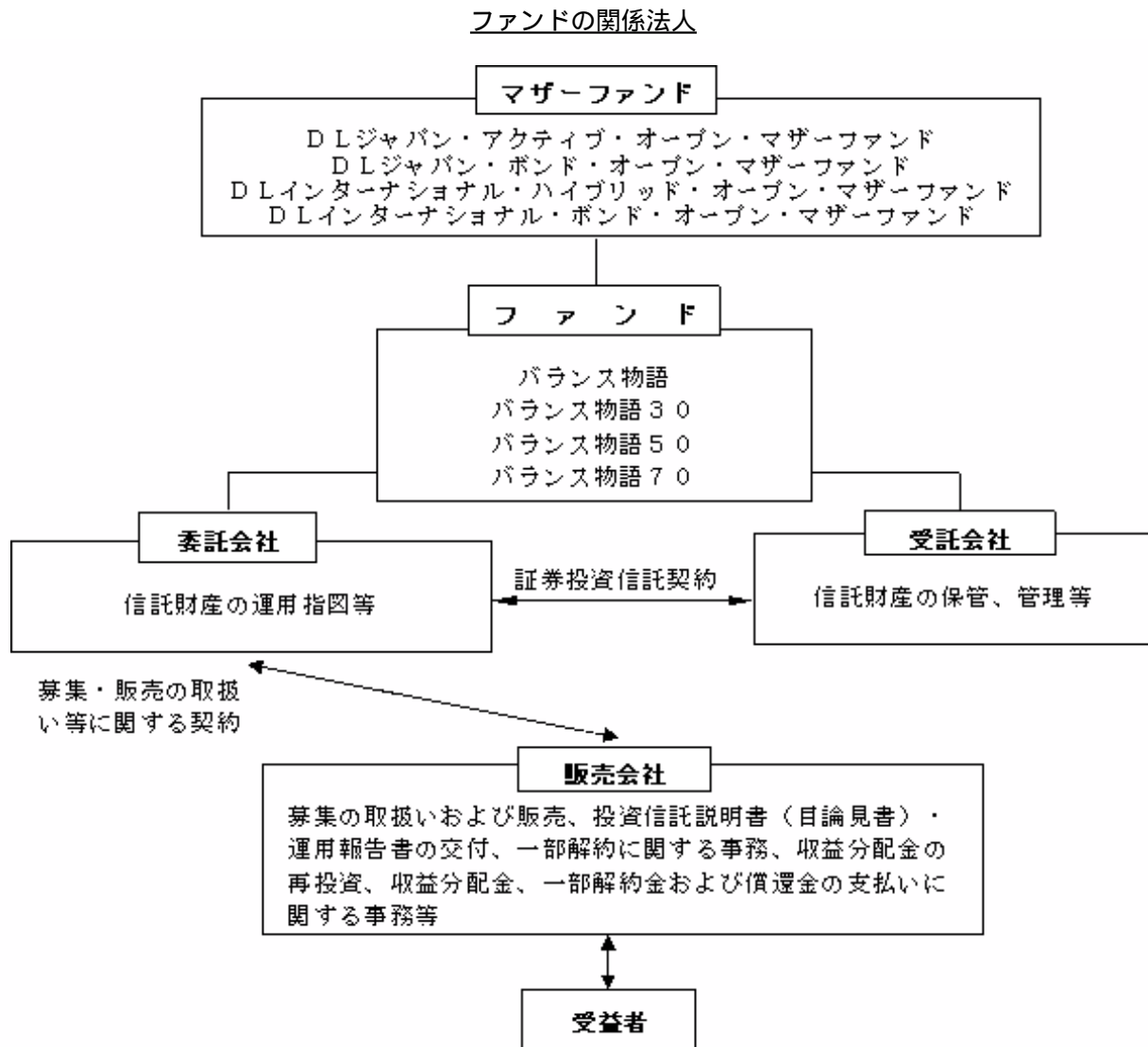
当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。また、販売会社として募集等の業務を行います。

受託会社：三菱UFJ信託銀行株式会社

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

販売会社

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



・「証券投資信託契約」の概要

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

委託会社の概況

資本金の額

20億円（平成20年9月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（平成20年9月30日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- 「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）」

基本方針

これらの投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として、ファミリーファンド方式で、安定的な運用を行うことを基本方針とします。



投資態度

個々のアセット（資産）において、数多くの銘柄に分散して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。

- (1) 主として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および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への投資を通して、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ中長期的に安定した収益の積み上げを目指します。
- (2) 「バランス物語30（安定型）」
（比較的リスクの低い資産（国内債券）を中心に組入れ、安定運用を行います。）

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

「バランス物語 50（安定・成長型）」

（各資産をバランスよく組入れ、ミドルリスク・ミドルリターンを目指します。）

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

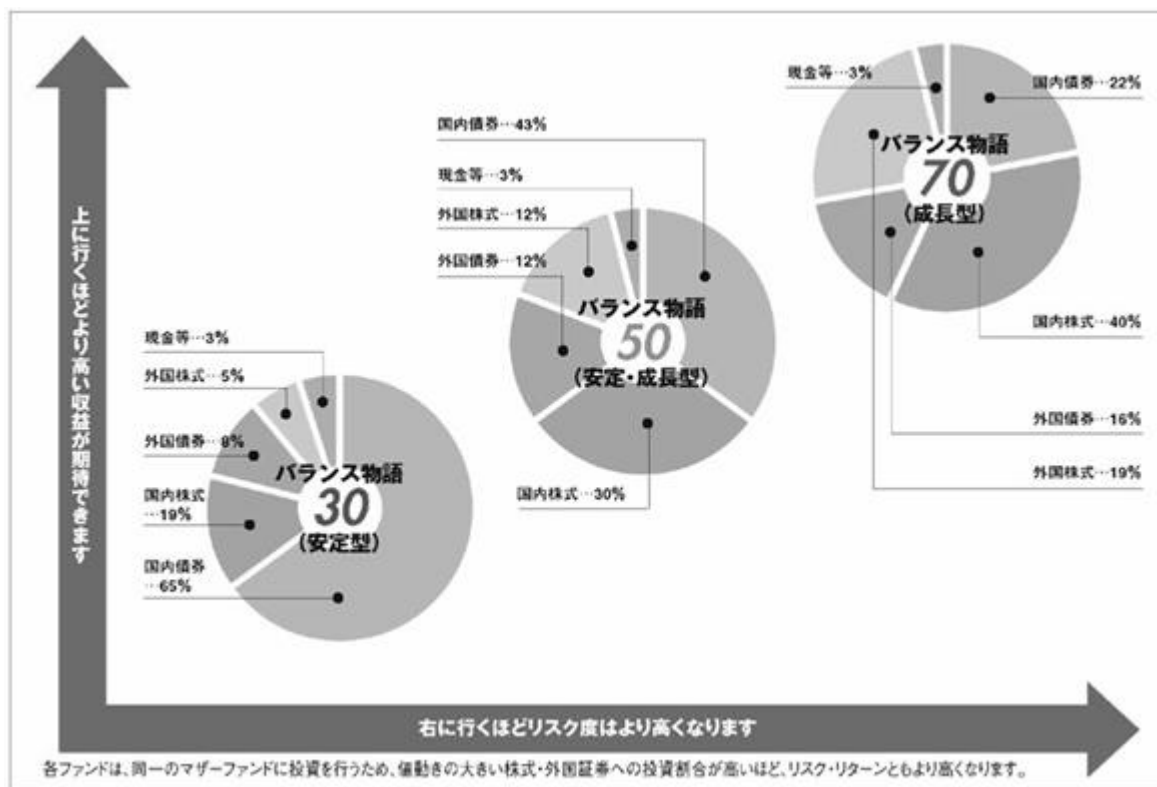
「バランス物語 70（成長型）」

（株式・外国証券等リスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益を目指します。）

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が70%未満、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が70%未満の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックス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。

ご投資家の皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じて、3種類の組み合わせ（資産配分）からご選択いただけます。

各ファンドの基本アロケーションは、以下の比率となります。



（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。

共通

（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グループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

- (注) T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「(株)東京証券取引所」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の停止又はT O P I Xの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- (株)東京証券取引所は、T O P I Xの商標の使用もしくはT O P I Xの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- (株)東京証券取引所は、T O P I Xの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンドはT O P I Xの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、同マザーファンドの基準価額とT O P I Xの指数値の動向が乖離することがあります。
- 同マザーファンド及び同マザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- (株)東京証券取引所は、同マザーファンドおよび同マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、同マザーファンドおよび同マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- (株)東京証券取引所は、当社又は同マザーファンドおよび同マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、T O P I Xの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は同マザーファンドおよび同マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- (注) N O M U R A - B P I総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- (注) M S C Iコクサイ・インデックスは、M S C Iコクサイ・インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に円換算したものです。
- M S C Iコクサイ・インデックスは、M S C I I n c . が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I I n c . に属しており、また、M S C I I n c . 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。
- (注) シティグループ世界国債インデックスとは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した債券指数で、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均し、指数化したものです。
- シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。

- (3)各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から±5%以内の範囲で配分比率の変動を抑えます。ただし、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- (4)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を行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、エクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- (5)ポートフォリオ構築プロセス
委託会社は、原則として以下のプロセスにより運用の意志決定を行います。
- 1) 原則として毎月1回、投資方針会議を開催し、各種経済指標・金融指標の分析結果に基づき、世界・国内の経済環境見直しならびに各資産別市場見直しを協議・策定します。
 - 2) 運用部担当取締役より任命された各資産毎の運用担当者は、運用担当者自身の調査分析活動・企業訪問活動・その他の活動によって得られた当該担当資産に関する情報に基づき、運用計画を策定し、有価証券等への運用指図を行います。
 - 3) 各運用担当者は、日次・週次のペースで、各運用資産のリスクをウオッチし、必要に応じてリスクのコントロールを行い、適宜ポートフォリオの見直しを行います。
 - 4) 各トレーダーは、最良の執行ができるように、ブローカーを選別します。選別にあたっては、手数料、売買執行のスピード、業界での評価、財務内容および調査またはブローカーのサービス内容等多数の要素を勘案し、決定します。
 - 5) 原則として毎月1回開催される運用評価会議において、各資産毎のパフォーマンス評価・分析を行い、リスク管理を行います。修正が必要であると判断される場合れば、速やかにポートフォリオの見直しを各運用担当者へ指示します。
 - 6) 運用部担当取締役より任命されたポートフォリオ・マネジャーは、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、各資産配分の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)【投資対象】

1．有価証券の指図範囲（約款第14条第1項）

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

- (1)DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド
- (2)DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド
- (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
- (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
- (5)株券または新株引受権証券
- (6)国債証券
- (7)地方債証券
- (8)特別の法律により法人の発行する債券
- (9)社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- (10)特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- (11)特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- (12)協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- (13)特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- (14)コマーシャル・ペーパー
- (15)新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- (16)外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- (17)証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）、振替投資信託受益権を含みます。）

- (18)投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- (19)外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- (20)オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- (21)預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- (22)外国法人が発行する譲渡性預金証書
- (23)指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- (24)抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- (25)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- (26)外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
なお、(5)の証券または証書、(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(5)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(6)から(10)までの証券および(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(6)から(10)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(17)の証券および(18)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

2. 金融商品の指図範囲(約款第14条第2項)

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

- (1)預金
- (2)指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- (3)コール・ローン
- (4)手形割引市場において売買される手形
- (5)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- (6)外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（参考）「DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

<主な投資対象>

日本の株式（全上場銘柄）を主要な投資対象とします。

<投資態度>

(1)日本の株式（全上場銘柄）を主要な投資対象とし、T O P I X（東証株価指数）を中長期的に上回ることを目標に運用します。

(2)企業のファンダメンタルズ分析を重視したボトムアップによる銘柄選択を行うことを原則とします。

(3)株式の組入比率は、原則として100%に近い状態を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

(4)特定の銘柄や業種に対し、過度の集中がないように配慮します。

(5)ポートフォリオ構築プロセス

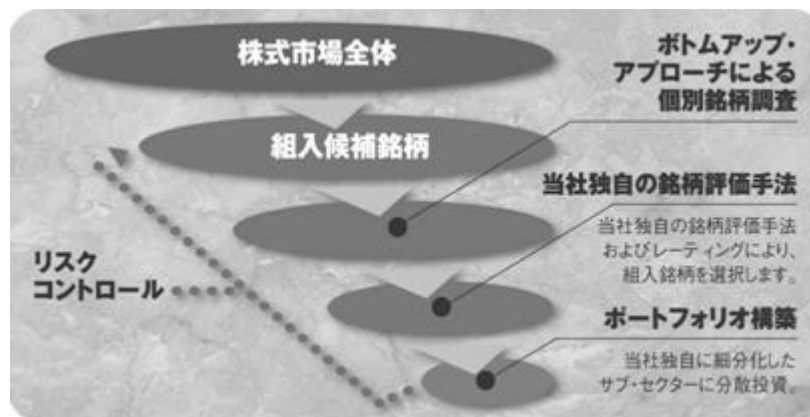
委託会社は、原則として以下のプロセスによりポートフォリオの構築を行います。

1)全上場銘柄の中から、大型株と中小型株をセクター間の偏りを調整しつつ約600銘柄組入候補銘柄群として選出します。

2)株式運用・調査グループのアナリスト・ファンドマネジャーは、1)の組入候補銘柄について、企業訪問等を中心とした積極的な調査活動により個別銘柄の調査・分析を行います。

3)2)により得られた企業業績予測を、短期的・中長期的な視点で株価への折り込み度合い等から独自にレーティングし、バリュエーション評価を行ったうえ、組入銘柄を選出します。

4)3)により選出された組入銘柄を、当社独自に細分化したサブ・セクターに分散して投資を行います



<主な投資制限>

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます）への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

（参考）「DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。

<主な投資対象>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

<投資態度>

- (1)わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA - B P I 総合を中長期的に上回ることを目標に運用を行います。
- (2)マクロ経済分析をベースとしたファンダメンタルズ分析等に基づき、金利の方向性予測、イールドカーブ戦略、セクター戦略により超過収益を積み上げることを目指します。
- (3)ポートフォリオ構築プロセス
委託会社は、原則として以下のプロセスによりポートフォリオの構築を行います。
 - 1)マクロ経済分析をベースとしたファンダメンタルズ分析等に基づき、短中期金利の方向性、イールドカーブ、セクターブレッドの予測を行います。
 - 2)1)により得られた分析に基づき、デュレーション戦略、イールドカーブ戦略および定性・定量分析に基づいた個別銘柄の決定を行い、ポートフォリオを構築します。
 - 3)当社独自の円債分析システム「Y B A S」を活用することで、きめ細かい定量分析・リスク分析を行い、ポートフォリオを構築します。

**<主な投資制限>**

- (1)同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (2)投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (3)外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

（参考）「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」の投資方針

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

<主な投資対象>

日本を除く世界主要先進国の株式を主要な投資対象とします。

<投資態度>

(1)積極的な企業調査訪問を基にしたボトムアップ・アプローチと各国のマクロ経済分析等によるトップダウン・アプローチを併用することによりポートフォリオを構築します。

(2)MSCIコクサイ・インデックスを長期的に上回ることを目指して運用を行います。

(3)株式の組入比率は、原則として100%に近い状態を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

(4)外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

(5)ポートフォリオ構築プロセス

委託会社は、原則として以下のプロセスによりポートフォリオの構築を行います。

1)グローバルセクター別に調査・運用チームを編成し、ファンドマネジャーが主に直接現地へ訪問、個別企業およびマクロ経済の調査を行います。

2)1)の調査活動を基に、ボトムアップ企業調査に基づくミクロ分析とマクロ分析を相互補完的にを行います。

3)2)の分析を基に、当社独自のグローバルな視点からの総合的な銘柄評価手法を用い、地域配分・セクター配分を加味したうえでポートフォリオを構築します。



<主な投資制限>

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます）への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（参考）「DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

<主な投資対象>

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

<投資態度>

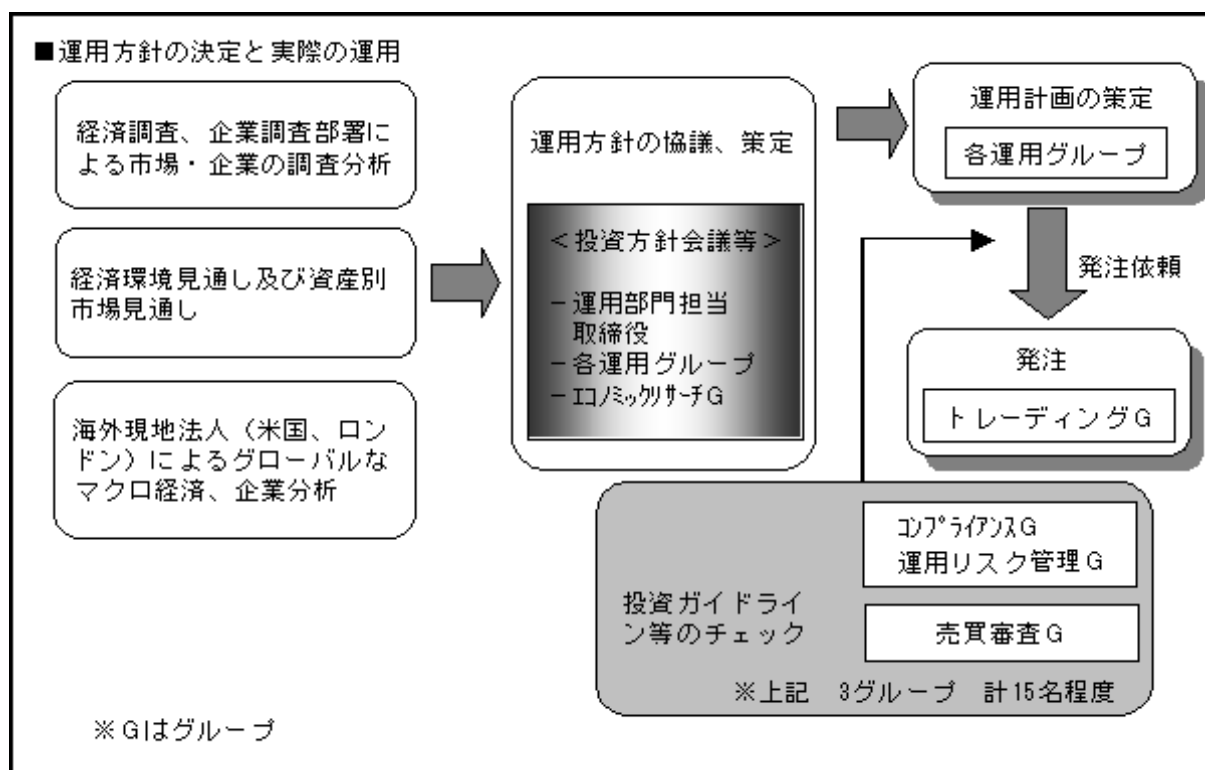
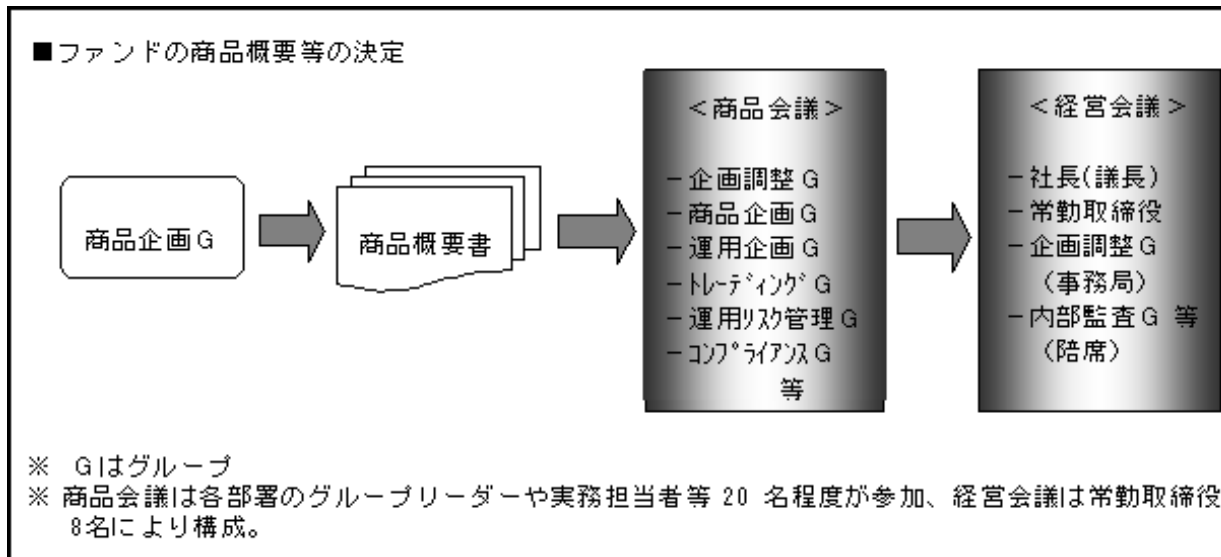
- (1)日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とし、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）を中長期的に上回ることを目標に運用を行います。
- (2)当社が独自に開発した外債分析システム「GLOBAS」を活用して運用を行います。
- (3)金利見通しに基づく各国市場配分に加え、各国ポートフォリオにおけるデュレーション、償還構成をコントロールすることにより超過収益を獲得することを目指します。
- (4)為替については、金利とは独立した投資対象と考え、エクスポージャーのコントロールを行うことにより、運用効率の向上を図ります。ただし、為替エクスポージャーは原則として信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (5)ポートフォリオ構築プロセス
委託会社は、原則として以下のプロセスによりポートフォリオの構築を行います。
 - 1)世界主要国のファンダメンタルズ分析・テクニカル分析等に基づき、主要国の金利トレンド・イールドカーブの形状・通貨別為替相場の見通しを策定します。
 - 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。
 - 3)「GLOBAS」を活用し、為替・金利見通しに基づく市場配分・通貨配分戦略、デュレーション・償還構成戦略より、ポートフォリオ属性を決定・構築します。



<主な投資制限>

- (1)同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (2)投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (3)外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(3)【運用体制】



<ファンドの商品概要等の決定>

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

<運用方針の決定と実際の運用>

経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。運用担当者は、「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等によって得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用担当者の発注依頼に基づき、運用部門から独立したトレーディンググループでその

大半が執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループ、運用リスク管理グループにて行われ、有価証券の売買執行等については売買審査グループにてチェックが行われます。

前記体制は平成20年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

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

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

収益の分配方式

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

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

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

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

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

(5)【投資制限】

「バランス物語30（安定型）」

(1) 株式への実質投資割合（約款第14条第4項）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%未満とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合（約款第26条）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%未満とします。

「バランス物語50（安定・成長型）」

(1) 株式への実質投資割合（約款第14条第4項）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合（約款第26条）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。

「バランス物語70（成長型）」

(1) 株式への実質投資割合（約款第14条第4項）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合（約款第26条）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

共通

(3) 投資信託証券への実質投資割合（以下に定義されます。）（約款第14条第5項）

投資信託証券への実質投資割合（信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額、以下「実質投資割合」といいます。）は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(4) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（約款第14条第6項）

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

(5) 投資する株式等の範囲（約款第16条）

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

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

(6) 同一銘柄の株式への実質投資制限（約款第17条第1項）

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

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

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

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

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

(8)同一銘柄の転換社債等への実質投資制限(約款第18条)

- (a)委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- (b)前(a)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(9)信用取引の指図範囲(約款第19条)

- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (b)前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- 1)信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2)株式分割により取得する株券
 - 3)有償増資により取得する株券
 - 4)売出しにより取得する株券
 - 5)信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
 - 6)信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権(前号に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(10)先物取引等の運用指図(約款第20条)

- (a)委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
- 1)先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 - 2)先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象2.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等な

らびに前記(2)投資対象2.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象2.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

(11)スワップ取引の運用指図(約款第21条)

(a)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

(b)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

- (e)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- (f)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (12)金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第22条)
- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (d)前(c)においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (f)前(e)においてマザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (g)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (h)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (13)有価証券の貸付の指図および範囲(約款第23条)
- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
- 1)株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価総額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2)公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b)前(a)各号で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- (14)公社債の空売りの指図範囲(約款第24条)

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

(15) 公社債の借入れ（約款第25条）

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

(16) 特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第27条）

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

(17) 外国為替予約の指図（約款第28条）

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

(18) 資金の借入れ（約款第35条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (b) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (c) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

(20)デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令 第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

(1)基準価額の主な変動要因

資産配分リスク

当ファンドで行われる各資産毎（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産）の資産配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、 $\pm 5\%$ 以内の変動に抑えます。

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

国別配分リスク

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

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

株式投資リスク

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

1) 株価変動リスク

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

2) 信用リスク

株式の発行者が経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。また、こうした状況に陥ると予想される場合、当該株式の価格は下落し、当ファンドの基準価額は下がる要因となります。

債券投資リスク

当ファンドでは公社債に投資します。公社債では、一般に次に掲げるリスクがあります。

1) 金利リスク

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

2) 信用リスク

信用リスクとは、公社債、コマーシャルペーパーおよび短期金融商品の発行者が、経営不振、その他の理由により利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リス

クをいいます。一般に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、当該公社債等の価格は下落（価格がゼロになることもあります。）し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。当ファンドでは、格付機関（格付投資情報センター、日本格付研究所、Moody's、S&P等）により投資適格（「BBB-」格以上）と格付けされた公社債等へ投資し、ファンドの信用リスクの低減を図ります。

為替リスク

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

カントリーリスク

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

(2)その他の留意点

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当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、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

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

当ファンドの収益分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります。

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

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

各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合等、当初定められていた信託期間の途中で信託の終了（繰上償還）させる場合があります。

注記事項

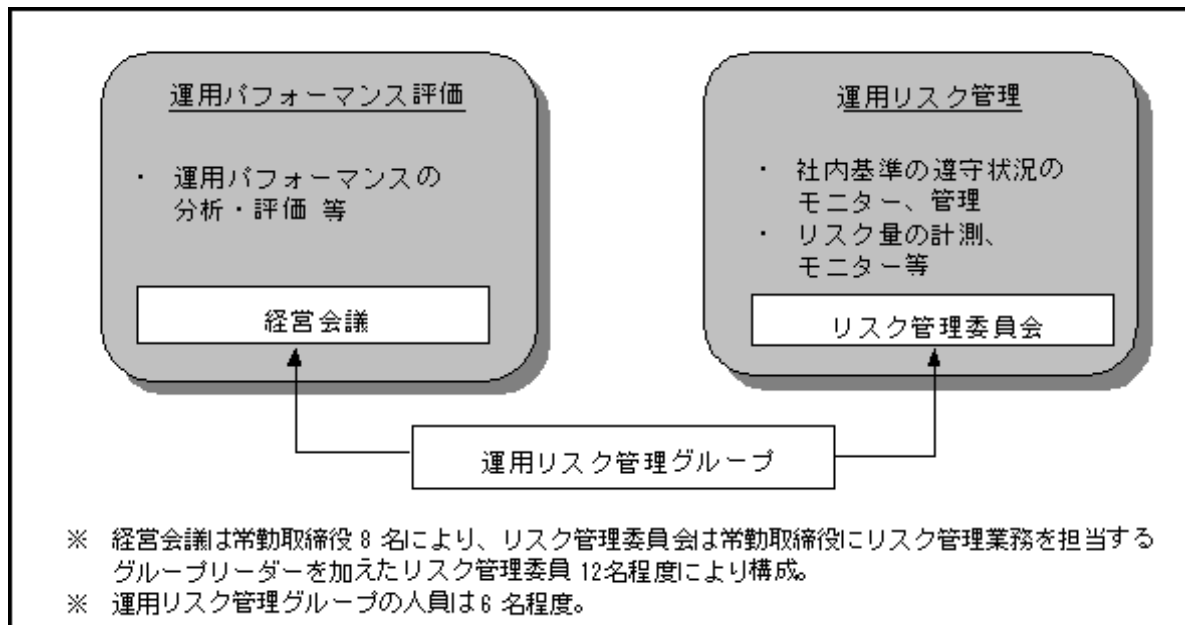
イ. 当ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって元本が保証されているものではありません。

ロ. 証券投資信託は、預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機

構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

- 八. 証券投資信託は、金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- 二. 証券投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< 運用評価・運用リスク管理体制 >



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

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

前記体制は平成20年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等による取得申込みについては、販売会社により申込手数料が優遇される場合があります（償還乗換え優遇措置）。

・償還乗換えによる取得申込みの取扱いは次に従って行われます。

- 1) 償還日・買取請求日・解約請求日が属する月の翌月の初日から起算して3ヵ月以内に次のイ. からハ.（「償還金等」といいます。）の支払いを受けた販売会社で取得の申込みが行われる場合が対象となります。
 - イ. 証券投資信託の償還金
 - ロ. 信託期間を延長した単位型証券投資信託にあっては延長前の信託終了日以降の売却代金および一部解約金
 - ハ. 信託期間を延長した追加型証券投資信託のうち、延長前の信託終了日以降において収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託の延長前の信託終了日以降の売却代金および一部解約金
- 2) 優遇の対象となるのは、単位型証券投資信託の支払を受けた場合には、その元本額と償還金等のいずれ

か大きい額の範囲内で取得する口数とし、追加型証券投資信託の支払いを受けた場合には、償還金等の範囲内で取得する口数とします。

3)なお、償還乗換えの際に償還金等の支払いを受けたことを証する書類を提示いただくことがあります。スイッチングの場合にはお申込手数料はかかりません。ただし、解約と同様の税金がかかりますのでご注意ください。

「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(2)【換金(解約)手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

時期	項目	費用		
		総額	信託財産の純資産総額に対して年率1.575% (税抜1.5%)	
毎日	信託報酬	配分	委託会社	年率0.7875%(税抜0.75%)
			販売会社	年率0.6825%(税抜0.65%)
			受託会社	年率0.105%(税抜0.10%)

信託報酬の総額は、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、前記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

信託財産留保額

ありません。

その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

- 1) 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息ならびに借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎計算期末または信託終了のとき当該監査費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。
- 3) 有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 4) マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。
税法が改正された場合等は、前記内容が変更になることがあります。
上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

(5)【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

収益分配時

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で、原則として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、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

一部解約時および償還時

平成23年12月31日までの間は、一部解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率により源泉徴収が行われ、原則として申告は不要です。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

一部解約時、償還時および買取請求時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成24年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われず、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を取得する場合は当該支店毎に、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コース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。（「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>

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「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特別分配金となり、当該収益分配金から当該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特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

バランス物語30（安定型）

平成21年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	11,474,341,205	98.57
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		166,108,279	1.43
合 計（純資産総額）		11,640,449,484	100.00

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

バランス物語50（安定・成長型）

平成21年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	4,818,197,601	98.84
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		56,789,116	1.16
合 計（純資産総額）		4,874,986,717	100.00

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

バランス物語70（成長型）

平成21年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,588,842,387	98.42
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		41,654,020	1.58
合 計（純資産総額）		2,630,496,407	100.00

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

(参考) マザーファンドの投資状況

D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成21年3月25日現在

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

株式	米国	5,996,263,338	57.62
	英国	1,003,326,326	9.64
	カナダ	520,241,585	5.00
	スイス	493,242,399	4.74
	スウェーデン	74,083,444	0.71
	デンマーク	59,921,341	0.58
	ノルウェー	61,719,883	0.59
	オランダ	123,168,372	1.18
	ベルギー	19,654,876	0.19
	ルクセンブルク	19,256,446	0.19
	フランス	608,356,149	5.85
	ドイツ	419,788,369	4.03
	スペイン	182,929,384	1.76
	イタリア	90,416,336	0.87
	フィンランド	32,655,951	0.31
	香港	136,144,580	1.31
	オーストラリア	210,790,373	2.03
	バミューダ諸島	53,199,306	0.51
	オランダ領アンティル	77,266,955	0.74
	ジャージー・チャンネル諸島	17,269,074	0.17
小計	10,199,694,486	98.02	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	206,246,229	1.98	
合計(純資産総額)	10,405,940,715	100.00	

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

D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成21年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	28,998,623,900	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		436,503,201	1.48
合計(純資産総額)		29,435,127,101	100.00

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

D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成21年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	米国	4,238,077,969	30.66
	英国	1,225,341,366	8.87
	カナダ	320,678,460	2.32
	スウェーデン	110,575,541	0.80
	オランダ	810,024,960	5.86
	フランス	295,710,528	2.14
	ドイツ	3,306,121,489	23.92
	スペイン	403,636,334	2.92
	イタリア	1,210,160,415	8.76
	フィンランド	538,188,019	3.89
	オーストリア	316,673,088	2.29
	小計	12,775,188,169	92.43
	特殊債券	オーストラリア	63,055,083
国際機関		627,583,774	4.54
小計		690,638,857	5.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		355,366,103	2.57

合 計 (純資産総額)	13,821,193,128	100.00
-------------	----------------	--------

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

D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成21年3月25日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	25,214,346,720	49.93
地方債証券	日本	168,438,445	0.33
社債券	日本	24,083,322,500	47.69
	米国	388,970,000	0.77
	小計	24,472,292,500	48.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		645,212,633	1.28
合 計 (純資産総額)		50,500,290,298	100.00

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

(2)【投資資産】

バランス物語30(安定型)

【投資有価証券の主要銘柄】

平成21年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	6,418,940,539	11,760.00	7,548,674,073	11,786.00	7,565,363,319	64.99
2	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2,520,209,921	8,635.23	2,176,258,210	9,344.00	2,354,884,150	20.23
3	D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	590,051,323	16,080.00	948,802,527	16,718.00	986,447,801	8.47
4	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	710,890,339	7,542.00	536,153,795	7,985.00	567,645,935	4.88

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成21年3月25日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.57
合計	98.57

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

バランス物語50（安定・成長型）

投資有価証券の主要銘柄

平成21年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,750,281,238	11,760.00	2,058,330,735	11,786.00	2,062,881,467	42.32
2	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,657,368,341	8,634.82	1,431,108,221	9,344.00	1,548,644,977	31.77
3	D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	369,644,161	16,080.00	594,387,810	16,718.00	617,971,108	12.68
4	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	737,257,419	7,542.69	556,090,351	7,985.00	588,700,049	12.08

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成21年3月25日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.84
合計	98.84

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

バランス物語70（成長型）

投資有価証券の主要銘柄

平成21年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,171,014,806	8,635.29	1,011,204,782	9,344.00	1,094,196,234	41.60

2	D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	470,153,726	11,760.00	552,900,781	11,786.00	554,123,181	21.07
3	D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	623,886,663	7,543.29	470,616,004	7,985.00	498,173,500	18.94
4	D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	264,594,732	16,080.00	425,468,329	16,718.00	442,349,472	16.82

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成21年3月25日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.42
合計	98.42

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	43,520	6,576.86	286,225,121	6,787.28	295,382,621	2.84
2	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	コン ピュー タ・周 辺機器	15,954	8,843.53	141,089,729	9,626.49	153,581,073	1.48
3	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	80,174	1,629.54	130,646,379	1,754.81	140,690,065	1.35
4	AT&T INC	株式	米国	各種電 気通信 サービ ス	52,101	2,375.30	123,755,761	2,568.11	133,801,037	1.29
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	19,042	6,157.00	117,241,626	6,738.35	128,311,651	1.23

6	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	55,906	2,243.59	125,430,254	2,204.76	123,259,346	1.18
7	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	53,045	2,160.80	114,619,371	2,306.85	122,366,858	1.18
8	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	24,067	4,994.10	120,192,985	5,036.29	121,208,343	1.16
9	WAL-MART STORES INC	株式	米国	食品・生活必需品小売り	23,877	4,814.23	114,949,257	4,996.26	119,295,784	1.15
10	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	173,483	648.20	112,451,115	678.40	117,690,683	1.13
11	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	35,068	3,225.36	113,106,798	3,247.88	113,896,481	1.09
12	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	22,156	4,956.14	109,808,167	5,129.37	113,646,249	1.09
13	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	42,307	2,341.96	99,081,467	2,566.15	108,566,167	1.04
14	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	23,390	4,595.00	107,476,968	4,595.00	107,476,968	1.03
15	CISCO SYSTEMS INC	株式	米国	通信機器	56,173	1,517.96	85,268,575	1,632.47	91,700,827	0.88
16	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	株式	米国	タバコ	22,848	3,524.30	80,523,177	3,797.36	86,761,990	0.83
17	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	495,705	166.69	82,627,767	172.58	85,550,752	0.82
18	TELEFONICA S.A	株式	スペイン	各種電気通信サービス	42,627	1,935.41	82,500,773	1,998.69	85,198,346	0.82
19	VERIZON COMM INC	株式	米国	各種電気通信サービス	27,050	2,779.51	75,185,691	2,987.97	80,824,618	0.78
20	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	54,161	1,438.69	77,920,835	1,468.05	79,511,056	0.76
21	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロメリット	77,409	941.51	72,881,301	1,014.91	78,563,315	0.75
22	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	2,298	31,750.99	72,963,764	33,947.19	78,010,638	0.75

23	SCHLUMBERGER LTD	株式	オランダ 領アン ティル	エネルギー 設備・サ ービス	17,159	3,846.29	65,998,507	4,503.00	77,266,955	0.74
24	BG GROUP PLC	株式	英国	石油・ガ ス・消費 燃料	48,681	1,469.84	71,553,301	1,574.83	76,664,251	0.74
25	APPLE INC	株式	米国	コンピ ュータ・ 周辺機 器	7,318	9,388.67	68,706,280	10,425.11	76,290,973	0.73
26	HEWLETT-PACKARD CO	株式	米国	コンピ ュータ・ 周辺機 器	24,742	2,882.27	71,313,161	3,000.69	74,243,176	0.71
27	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイ ス	医薬品	5,754	13,034.81	75,002,268	12,783.64	73,557,042	0.71
28	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	株式	米国	石油・ガ ス・消費 燃料	12,432	5,352.51	66,542,408	5,743.01	71,397,120	0.69
29	GOLDMAN SACHS GROUP INC	株式	米国	資本市 場	6,602	9,669.56	63,838,409	10,798.00	71,288,377	0.69
30	BAXTER INTERNATIONAL INC	株式	米国	ヘルス ケア機 器・用 品	14,337	5,007.03	71,785,778	4,943.41	70,873,722	0.68

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

種類別業種別投資比率

平成21年3月25日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	13.31
	医薬品	7.87
	商業銀行	4.87
	各種電気通信サービス	4.47
	保険	4.42
	金属・鉱業	3.64
	コンピュータ・周辺機器	3.08
	食品・生活必需品小売り	2.93
	化学	2.89
	食品	2.72
	電力	2.56
	通信機器	2.48
	メディア	2.40
	ソフトウェア	2.37
	資本市場	2.37
	バイオテクノロジー	2.34
	タバコ	2.20
	家庭用品	2.06
	半導体・半導体製造装置	1.73
	飲料	1.72
各種金融サービス	1.67	
ヘルスケア機器・用品	1.61	
航空宇宙・防衛	1.57	

ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	1.55
エネルギー設備・サービス	1.47
無線通信サービス	1.31
コングロマリット	1.31
総合公益事業	1.29
情報技術サービス	1.23
建設・土木	1.14
陸運・鉄道	1.08
機械	1.02
複合小売り	0.95
インターネットソフトウェア・サービス	0.95
商業サービス・用品	0.89
不動産管理・開発	0.87
ホテル・レストラン・レジャー	0.85
専門小売り	0.81
専門サービス	0.79
電気設備	0.75
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.63
貯蓄・抵当・不動産金融	0.55
インターネット販売・カタログ販売	0.45
繊維・アパレル・贅沢品	0.26
航空貨物・物流サービス	0.24
ガス	0.21
各種消費者サービス	0.16
合計	98.02

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2,530,000	441.00	1,115,730,000	532.00	1,345,960,000	4.57
2	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	372,200	2,940.00	1,094,268,000	3,200.00	1,191,040,000	4.05
3	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	285,000	3,608.01	1,028,283,496	3,880.00	1,105,800,000	3.76
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	261,400	3,020.00	789,428,000	3,880.00	1,014,232,000	3.45
5	日本電産	株式	日本	電気機 器	180,000	4,300.00	774,000,000	4,420.00	795,600,000	2.70
6	信越化学	株式	日本	化学	156,200	4,660.00	727,892,000	4,930.00	770,066,000	2.62
7	三井物産	株式	日本	卸売業	710,000	850.00	603,500,000	1,071.00	760,410,000	2.58

8	本田技研	株式	日本	輸送用機器	324,800	2,245.00	729,176,000	2,335.00	758,408,000	2.58
9	富士フイルムHLDGS	株式	日本	化学	322,000	2,015.90	649,121,097	2,250.00	724,500,000	2.46
10	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	3,040,000	189.00	574,560,000	233.00	708,320,000	2.41
11	メガチップス	株式	日本	電気機器	409,000	1,728.00	706,752,000	1,682.00	687,938,000	2.34
12	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	日本	情報・通信業	4,696	137,100.00	643,821,600	143,300.00	672,936,800	2.29
13	三菱商事	株式	日本	卸売業	444,000	1,175.00	521,700,000	1,393.00	618,492,000	2.10
14	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	251,700	1,992.00	501,386,400	2,200.00	553,740,000	1.88
15	三井不動産	株式	日本	不動産業	458,000	1,012.00	463,496,000	1,159.00	530,822,000	1.80
16	もしもしホットライン	株式	日本	サービス業	295,400	1,846.00	545,308,400	1,794.00	529,947,600	1.80
17	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	1,815,000	250.00	453,750,000	284.00	515,460,000	1.75
18	野村ホールディングス	株式	日本	証券、商品先物取引業	930,000	487.96	453,801,413	537.00	499,410,000	1.70
19	日本セラミック	株式	日本	電気機器	453,000	971.00	439,863,000	1,100.00	498,300,000	1.69
20	小松製作所	株式	日本	機械	416,100	1,078.00	448,555,800	1,192.00	495,991,200	1.69
21	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1,003	435,000.00	436,305,000	478,000.00	479,434,000	1.63
22	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	122,000	3,550.00	433,100,000	3,780.00	461,160,000	1.57
23	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	82,000	4,870.00	399,340,000	5,490.00	450,180,000	1.53
24	三菱マテリアル	株式	日本	非鉄金属	1,600,000	237.00	379,200,000	281.00	449,600,000	1.53
25	HOYA	株式	日本	精密機器	210,000	1,925.00	404,250,000	2,050.00	430,500,000	1.46
26	新日本石油	株式	日本	石油・石炭製品	795,000	447.00	355,365,000	530.00	421,350,000	1.43
27	デンソー	株式	日本	輸送用機器	210,000	2,040.00	428,400,000	1,993.00	418,530,000	1.42
28	スクウェア・エニックス・HD	株式	日本	情報・通信業	230,000	1,582.00	363,860,000	1,807.00	415,610,000	1.41
29	武田薬品	株式	日本	医薬品	107,500	3,310.00	355,825,000	3,770.00	405,275,000	1.38
30	商船三井	株式	日本	海運業	710,000	485.00	344,350,000	558.00	396,180,000	1.35

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

種類別業種別投資比率

平成21年3月25日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	17.57
	情報・通信業	12.87
	銀行業	10.73
	輸送用機器	9.18

卸売業	6.42
化学	5.92
医薬品	4.77
小売業	4.64
サービス業	3.07
機械	2.83
非鉄金属	2.65
鉄鋼	2.07
陸運業	2.00
その他製品	1.80
不動産業	1.80
証券、商品先物取引業	1.70
精密機器	1.46
石油・石炭製品	1.43
海運業	1.35
パルプ・紙	1.23
食料品	1.01
ガラス・土石製品	0.92
倉庫・運輸関連業	0.63
ゴム製品	0.47
合計	98.52

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債 証券	オラ ンダ	791,040,000	100.06	791,514,624	102.40	810,024,960	4.00	2018/7/15	5.86
2	US T N/B 5.0 08/15/11	国債 証券	米国	734,025,000	107.85	791,622,749	109.70	805,188,724	5.00	2011/8/15	5.83
3	US T N/B 4.0 11/15/12	国債 証券	米国	616,581,000	106.72	658,029,584	109.38	674,385,469	4.00	2012/11/15	4.88
4	BUNDESUBL 4.0 04/13/12	国債 証券	ドイ ツ	606,464,000	106.68	646,975,795	106.54	646,096,422	4.00	2012/4/13	4.67
5	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	国債 証券	イタ リア	606,464,000	98.88	599,671,603	103.40	627,083,776	4.50	2018/2/1	4.54
6	BUNDESUBL 3.5 04/08/11	国債 証券	ドイ ツ	566,912,000	104.50	592,423,040	104.04	589,815,245	3.50	2011/4/8	4.27
7	EIB 4.0 04/15/09	特殊 債券	国際 機関	527,360,000	99.70	525,777,920	100.00	527,360,000	4.00	2009/4/15	3.82
8	FINLAND 4.25 07/04/15	国債 証券	フィン ランド	474,624,000	99.52	472,345,805	104.91	497,928,038	4.25	2015/7/4	3.60

9	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	ドイツ	474,624,000	90.69	430,440,724	98.09	465,539,697	4.00	2037/1/4	3.37
10	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	国債証券	イタリア	421,888,000	101.42	427,878,810	106.33	448,593,510	4.75	2013/2/1	3.25
11	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	国債証券	ドイツ	382,336,000	99.77	381,455,309	109.21	417,549,146	4.25	2017/7/4	3.02
12	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	ドイツ	375,744,000	100.24	376,645,786	108.14	406,329,562	4.75	2034/7/4	2.94
13	US TREASURY N/B 4.25 11/15/17	国債証券	米国	342,545,000	103.17	353,407,102	113.72	389,535,323	4.25	2017/11/15	2.82
14	US TREASURY N/B 4.5 05/15/17	国債証券	米国	293,610,000	105.14	308,701,554	115.44	338,934,576	4.50	2017/5/15	2.45
15	US T N/B 3.5 05/31/13	国債証券	米国	303,397,000	102.17	309,967,288	108.15	328,129,923	3.50	2013/5/31	2.37
16	US T N/B 4.5 02/15/16	国債証券	米国	283,823,000	105.95	300,718,983	115.54	327,926,256	4.50	2016/2/15	2.37
17	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	国債証券	ドイツ	276,864,000	96.42	266,952,269	105.70	292,645,248	3.75	2017/1/4	2.12
18	AUSTRIA 3.5 07/15/15	国債証券	オーストリア	276,864,000	95.10	263,297,664	100.00	276,864,000	3.50	2015/7/15	2.00
19	UK TREASURY 4.0 09/07/16	国債証券	英国	244,494,000	96.60	236,188,395	107.87	263,735,678	4.00	2016/9/7	1.91
20	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	国債証券	ドイツ	243,904,000	95.36	232,586,854	104.31	254,416,262	3.50	2016/1/4	1.84
21	SPAIN 4.2 07/30/13	国債証券	スペイン	230,720,000	99.59	229,780,970	104.94	242,126,797	4.20	2013/7/30	1.75
22	UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	英国	143,820,000	127.80	183,801,960	144.08	207,215,856	8.00	2021/6/7	1.50
23	UK TREASURY 5.0 03/07/12	国債証券	英国	186,966,000	100.62	188,125,189	108.22	202,334,605	5.00	2012/3/7	1.46
24	US T N/B 4.25 08/15/15	国債証券	米国	176,166,000	103.82	182,897,132	113.68	200,263,747	4.25	2015/8/15	1.45
25	UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	英国	179,775,000	94.74	170,318,835	99.45	178,786,238	4.25	2036/3/7	1.29
26	US T N/B 4.0 02/15/15	国債証券	米国	156,592,000	103.38	161,876,980	111.80	175,076,120	4.00	2015/2/15	1.27
27	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	国債証券	ドイツ	145,024,000	110.45	160,183,622	109.75	159,163,840	4.25	2018/7/4	1.15
28	US T N/B 4.5 11/15/15	国債証券	米国	137,018,000	106.02	145,259,633	115.76	158,607,926	4.50	2015/11/15	1.15
29	US T N/B 3.125 09/30/13	国債証券	米国	146,805,000	103.26	151,587,632	106.79	156,771,591	3.13	2013/9/30	1.13
30	US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	米国	122,337,500	108.80	133,098,307	122.69	150,092,209	5.25	2028/11/15	1.09

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

種類別業種別投資比率

平成21年3月25日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	92.43
特殊債券	5.00
合計	97.43

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年3月25日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	288回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,400,000,000	99.84	4,392,916,000	104.73	4,608,252,000	1.70	2017/9/20	9.13
2	296回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,825,000,000	100.25	2,831,997,500	102.08	2,883,618,750	1.50	2018/9/20	5.71
3	84回利付 国庫債券 (20年)	国債 証券	日本	2,254,000,000	96.19	2,168,054,980	102.57	2,311,950,340	2.00	2025/12/20	4.58
4	73回利付 国庫債券 (20年)	国債 証券	日本	1,527,000,000	96.93	1,480,044,750	103.27	1,576,993,980	2.00	2024/12/20	3.12
5	280回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	1,380,000,000	102.58	1,415,616,800	107.26	1,480,132,800	1.90	2016/6/20	2.93
6	12回物価 連動国債 (10年)	国債 証券	日本	1,560,000,000	99.73	1,555,764,400	87.49	1,364,803,440	1.20	2017/6/10	2.70
7	8回物価連 動国債(1 0年)	国債 証券	日本	1,470,000,000	98.33	1,445,407,635	88.06	1,294,454,070	1.00	2016/6/10	2.56
8	14回ポ ケットカ ード社債	社債 券	日本	1,200,000,000	94.25	1,131,000,000	91.33	1,095,984,000	2.42	2010/7/9	2.17
9	2回ドン・ キホーテ 社債	社債 券	日本	1,100,000,000	99.11	1,090,166,000	97.12	1,068,265,000	1.67	2011/2/18	2.12
10	19回GE キャピタル 円貨債	社債 券	日本	1,200,000,000	99.79	1,197,420,000	87.95	1,055,376,000	1.95	2011/5/27	2.09
11	267回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	950,000,000	99.04	940,888,500	102.85	977,075,000	1.30	2014/12/20	1.93
12	33回石川 島播磨重 工業社債	社債 券	日本	1,000,000,000	98.20	982,039,000	96.54	965,390,000	1.30	2010/2/19	1.91
13	287回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	900,000,000	101.72	915,480,000	106.72	960,462,000	1.90	2017/6/20	1.90
14	5回愛知製 鋼転換社債	社債 券	日本	1,000,000,000	95.05	950,491,500	94.30	943,000,000	-	2011/3/31	1.87
15	4回セント ラル硝子 転換社債	社債 券	日本	873,000,000	97.11	847,734,500	97.00	846,810,000	-	2010/3/31	1.68
16	10回NE C転換社債	社債 券	日本	889,000,000	97.26	864,641,400	95.25	846,772,500	1.00	2011/9/30	1.68

17	60回 利付 国庫債券 (20年)	国債 証券	日本	825,000,000	90.78	748,902,000	97.20	801,916,500	1.40	2022/12/20	1.59
18	1回 コバレ ントマテリ アル社債	社債 券	日本	1,000,000,000	95.93	959,260,000	76.42	764,240,000	2.87	2013/2/18	1.51
19	96回 利付 国庫債券 (20年)	国債 証券	日本	682,000,000	97.46	664,697,200	103.41	705,235,740	2.10	2027/6/20	1.40
20	1回 アプ ラス社債	社債 券	日本	800,000,000	95.32	762,552,000	86.74	693,888,000	1.85	2010/6/25	1.37
21	4回 三愛石 油社債	社債 券	日本	700,000,000	99.38	695,674,000	98.60	690,172,000	1.66	2011/12/20	1.37
22	10回 双日 社債	社債 券	日本	700,000,000	101.37	709,569,000	96.93	678,517,000	2.38	2011/12/11	1.34
23	1回 野村不 動産ホール ディングス 社債	社債 券	日本	700,000,000	97.14	679,987,000	96.21	673,477,000	1.74	2014/10/31	1.33
24	4回 コスモ 石油転換社 債型新株予 約権付社債	社債 券	日本	701,000,000	95.42	668,861,140	94.90	665,249,000	-	2010/9/30	1.32
25	7回 物価連 動国債(1 0年)	国債 証券	日本	750,000,000	97.13	728,438,625	87.38	655,345,500	0.80	2016/3/10	1.30
26	5回 エル ピーダメモ リ社債	社債 券	日本	1,200,000,000	95.98	1,151,796,000	52.34	628,116,000	2.09	2012/1/24	1.24
27	7回 ルノー 円貨債	社債 券	日本	700,000,000	98.41	688,884,000	88.76	621,327,000	1.70	2011/1/24	1.23
28	9回 三洋電 機社債	社債 券	日本	600,000,000	101.10	606,582,000	100.27	601,620,000	3.35	2009/5/20	1.19
29	11回 東急 不動産社債	社債 券	日本	600,000,000	100.61	603,642,000	98.00	587,982,000	1.97	2011/6/13	1.16
30	7回 平和不 動産社債	社債 券	日本	600,000,000	98.60	591,600,000	93.09	558,528,000	1.91	2013/9/12	1.11

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

種類別業種別投資比率

平成21年3月25日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	49.93
地方債証券	0.33
社債券	48.46
合計	98.72

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成21年3月25日）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

バランス物語30（安定型）

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成13年8月27日現在）	34,460	34,478	0.9838	0.9843
第2期末（平成14年2月25日現在）	40,619	40,683	0.9566	0.9581
第3期末（平成14年8月26日現在）	41,571	41,637	0.9483	0.9498
第4期末（平成15年2月25日現在）	38,406	38,468	0.9291	0.9306
第5期末（平成15年8月25日現在）	36,149	36,414	0.9532	0.9602
第6期末（平成16年2月25日現在）	33,685	33,842	0.9703	0.9748
第7期末（平成16年8月25日現在）	31,104	31,120	0.9710	0.9715
第8期末（平成17年2月25日現在）	28,979	29,095	0.9924	0.9964
第9期末（平成17年8月25日現在）	25,656	25,795	1.0132	1.0187
第10期末（平成18年2月27日現在）	22,170	22,294	1.0708	1.0768
第11期末（平成18年8月25日現在）	20,592	20,708	1.0622	1.0682
第12期末（平成19年2月26日現在）	18,857	18,960	1.0994	1.1054
第13期末（平成19年8月27日現在）	16,750	16,844	1.0697	1.0757
第14期末（平成20年2月25日現在）	15,184	15,272	1.0295	1.0355
第15期末（平成20年8月25日現在）	13,906	13,961	1.0035	1.0075
第16期末（平成21年2月25日現在）	11,428	11,441	0.8588	0.8598
平成20年3月末	14,660		1.0069	
4月末	14,755		1.0260	
5月末	14,717		1.0312	
6月末	14,366		1.0184	
7月末	14,170		1.0161	
8月末	13,852		1.0057	
9月末	13,038		0.9574	
10月末	11,929		0.8934	
11月末	11,773		0.8837	
12月末	11,926		0.8962	
平成21年1月末	11,516		0.8693	
2月末	11,450		0.8605	
3月25日	11,640		0.8777	

バランス物語50（安定・成長型）

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成13年8月27日現在）	9,031	9,031	0.9586	0.9586
第2期末（平成14年2月25日現在）	10,133	10,149	0.9234	0.9249
第3期末（平成14年8月26日現在）	10,253	10,270	0.8932	0.8947
第4期末（平成15年2月25日現在）	9,283	9,294	0.8493	0.8503
第5期末（平成15年8月25日現在）	9,794	9,874	0.9106	0.9181
第6期末（平成16年2月25日現在）	9,791	9,843	0.9346	0.9396
第7期末（平成16年8月25日現在）	9,334	9,364	0.9415	0.9445
第8期末（平成17年2月25日現在）	9,076	9,122	0.9728	0.9777
第9期末（平成17年8月25日現在）	8,684	8,744	1.0112	1.0182
第10期末（平成18年2月27日現在）	9,054	9,110	1.1230	1.1300
第11期末（平成18年8月25日現在）	9,314	9,372	1.1172	1.1242
第12期末（平成19年2月26日現在）	9,012	9,065	1.1880	1.1950
第13期末（平成19年8月27日現在）	7,870	7,918	1.1381	1.1451

第14期末(平成20年2月25日現在)	6,850	6,895	1.0631	1.0701
第15期末(平成20年8月25日現在)	6,362	6,393	1.0226	1.0276
第16期末(平成21年2月25日現在)	4,723	4,735	0.7845	0.7865
平成20年3月末	6,559		1.0194	
4月末	6,806		1.0634	
5月末	6,893		1.0789	
6月末	6,633		1.0506	
7月末	6,528		1.0458	
8月末	6,404		1.0254	
9月末	5,819		0.9459	
10月末	5,162		0.8438	
11月末	5,060		0.8260	
12月末	5,066		0.8355	
平成21年1月末	4,819		0.7966	
2月末	4,749		0.7870	
3月25日	4,874		0.8132	

バランス物語70(成長型)

	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末(平成13年8月27日現在)	3,476	3,476	0.9369	0.9369
第2期末(平成14年2月25日現在)	3,993	3,996	0.8963	0.8968
第3期末(平成14年8月26日現在)	4,023	4,030	0.8463	0.8478
第4期末(平成15年2月25日現在)	3,307	3,309	0.7794	0.7799
第5期末(平成15年8月25日現在)	3,620	3,652	0.8676	0.8751
第6期末(平成16年2月25日現在)	4,326	4,350	0.8981	0.9031
第7期末(平成16年8月25日現在)	4,285	4,304	0.9111	0.9151
第8期末(平成17年2月25日現在)	4,210	4,236	0.9508	0.9566
第9期末(平成17年8月25日現在)	4,058	4,090	1.0050	1.0130
第10期末(平成18年2月27日現在)	4,753	4,786	1.1689	1.1769
第11期末(平成18年8月25日現在)	4,749	4,782	1.1655	1.1735
第12期末(平成19年2月26日現在)	4,844	4,875	1.2714	1.2794
第13期末(平成19年8月27日現在)	4,392	4,421	1.1990	1.2070
第14期末(平成20年2月25日現在)	3,802	3,830	1.0882	1.0962
第15期末(平成20年8月25日現在)	3,542	3,562	1.0347	1.0407
第16期末(平成21年2月25日現在)	2,496	2,506	0.7158	0.7188
平成20年3月末	3,593		1.0238	
4月末	3,797		1.0923	
5月末	3,878		1.1179	
6月末	3,689		1.0747	
7月末	3,658		1.0677	
8月末	3,571		1.0381	
9月末	3,182		0.9297	
10月末	2,756		0.7949	
11月末	2,681		0.7707	
12月末	2,715		0.7768	
平成21年1月末	2,549		0.7291	
2月末	2,517		0.7188	
3月25日	2,630		0.7517	

【分配の推移】

バランス物語30(安定型)

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

バランス物語50（安定・成長型）

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

バランス物語70（成長型）

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	0.0005
第3期	0.0015
第4期	0.0005
第5期	0.0075
第6期	0.0050
第7期	0.0040
第8期	0.0060
第9期	0.0080
第10期	0.0080
第11期	0.0080
第12期	0.0080
第13期	0.0080
第14期	0.0080

第15期	0.0060
第16期	0.0030

【収益率の推移】

バランス物語30（安定型）

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

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

バランス物語50（安定・成長型）

	収益率（％）
第1期	4.14
第2期	3.52
第3期	3.11
第4期	4.80
第5期	8.10
第6期	3.18
第7期	1.06
第8期	3.84
第9期	4.67
第10期	11.75
第11期	0.11
第12期	6.96
第13期	3.61
第14期	5.97
第15期	3.34
第16期	23.09

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

バランス物語70（成長型）

	収益率（％）
第1期	6.31
第2期	4.28
第3期	5.41
第4期	7.85
第5期	12.28

第6期	4.09
第7期	1.89
第8期	4.99
第9期	6.54
第10期	17.10
第11期	0.39
第12期	9.77
第13期	5.07
第14期	8.57
第15期	4.37
第16期	30.53

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

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成12年12月27日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時（年末年始などわが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前11時）までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

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

- ・お申込価額（発行価格）は、お申込日の翌営業日の基準価額とします。
「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は各計算期間終了日の基準価額とします。
「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（但し、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）
スイッチングによりお申込みをする場合の取得価額は、お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

- ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

- ・お申込手数料は、お申込日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時（年末年始などわが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前11時）までに解約の請求が行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。
- ・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ・解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の中止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとし、

・解約価額の照会方法等

解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03 - 3287 - 3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

(2)【保管】

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。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

(3)【信託期間】

信託期間は平成12年12月27日から原則として無期限ですが、下記（5）イ.の場合には信託を終了する場合があります。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、各ファンドにつき、信託契約を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- c. 委託会社は、前記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は前記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 前記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、前記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理

由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

- g. 前記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、後記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 前記d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面にて付記します。

ロ. 信託約款の変更

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

ハ. 関係法人との契約の更改

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

二. 公 告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

ホ. 運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（原則として2月25日および8月25日、休業日の場合は翌営業日。）及び償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。

運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示しております。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

2【受益者の権利等】

（1）収益分配金受領権

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

受益者は、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、委託会社に帰属するものとします。

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

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

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

（2）償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

（3）一部解約請求権

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

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

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

（4）帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第4【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（平成20年2月26日から平成20年8月25日まで）及び第16期計算期間（平成20年8月26日から平成21年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】
【バランス物語30（安定型）】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 平成20年8月25日現在	第16期 平成21年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	451,468,994	451,661,739
親投資信託受益証券	13,525,784,806	11,089,888,605
未収入金	100,000,000	-
流動資産合計	14,077,253,800	11,541,550,344
資産合計		
	14,077,253,800	11,541,550,344
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	54,307,945	13,306,966
未払解約金	2,311,764	3,444,152
未払受託者報酬	7,597,602	6,430,379
未払委託者報酬	106,366,958	90,025,732
その他未払費用	379,789	321,422
流動負債合計	170,964,058	113,528,651
負債合計		
	170,964,058	113,528,651
純資産の部		
元本等		
元本	13,857,196,971	13,306,966,238
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* ₃ 49,092,771	* ₃ 1,878,944,545
（分配準備積立金）	1,223,265,164	1,162,235,078
元本等合計	13,906,289,742	11,428,021,693
純資産合計		
	13,906,289,742	11,428,021,693
負債純資産合計		
	14,077,253,800	11,541,550,344

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期		第16期	
	自 平成20年 2月26日	至 平成20年 8月25日	自 平成20年 8月26日	至 平成21年 2月25日
営業収益				
受取利息		396,257		311,137
有価証券売買等損益		202,758,362		1,848,896,201
営業収益合計		202,362,105		1,848,585,064
営業費用				
受託者報酬		7,597,602		6,430,379
委託者報酬		106,366,958		90,025,732
その他費用		379,789		321,422
営業費用合計		114,344,349		96,777,533
営業損失()		316,706,454		1,945,362,597
経常損失()		316,706,454		1,945,362,597
当期純損失()		316,706,454		1,945,362,597
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		11,930,338		56,257,420
期首剰余金又は期首欠損金()		435,185,595		49,092,771
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,363,874		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,363,874		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		30,372,637		25,625,173
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		30,372,637		2,666,923
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		22,958,250
分配金		* ₁ 54,307,945		* ₁ 13,306,966
期末剰余金又は期末欠損金()		49,092,771		1,878,944,545

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 15 期 平成20年8月25日現在	第 16 期 平成21年2月25日現在
*1 期首元本額	14,748,888,848円	13,857,196,971円
期中追加設定元本額	138,415,414円	231,258,044円
期中解約元本額	1,030,107,291円	781,488,777円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	13,857,196,971口	13,306,966,238口
*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 1,878,944,545円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
*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（19,957,452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 （65,363,363円）及び分配準備積 立金（1,257,615,657円）より分 配対象収益は1,342,936,472円（1 万口当たり969.12円）であり、う ち54,307,945円（1万口当たり 39.19円）を分配金額としており ます。外国所得税控除額1,120,842 円が含まれた分配金額は 55,428,787円（1万口当たり40 円）となります。	計算期間末における費用控除後の 配当等収益（20,960,208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 （83,110,000円）及び分配準備積 立金（1,154,581,836円）より分 配対象収益は1,258,652,044円（1 万口当たり945.85円）であり、う ち13,306,966円（1万口当たり10 円）を分配金額としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日

種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	13,525,784,806	207,135,115	11,089,888,605	1,827,328,301
合計	13,525,784,806	207,135,115	11,089,888,605	1,827,328,301

(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 15 期 平成20年8月25日現在	第 16 期 平成21年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0035円 (10,035円)	0.8588円 (8,588円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	2,438,927,988	2,106,258,210	
親投資信託受益証券	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	6,418,940,539	7,548,674,073	
親投資信託受益証券	D L インターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	644,339,027	486,153,795	
親投資信託受益証券	D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	590,051,323	948,802,527	
合計		10,092,258,877	11,089,888,605	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【バランス物語50（安定・成長型）】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 平成20年8月25日現在	第16期 平成21年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	245,614,060	248,159,198
親投資信託受益証券	6,205,865,873	4,529,917,117
流動資産合計	6,451,479,933	4,778,076,315
資産合計	6,451,479,933	4,778,076,315
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	29,917,818	12,042,654
未払解約金	6,773,192	507,879
未払受託者報酬	3,479,813	2,781,036
未払委託者報酬	48,717,835	38,934,987
その他未払費用	173,904	138,957
流動負債合計	89,062,562	54,405,513
負債合計	89,062,562	54,405,513
純資産の部		
元本等		
元本	6,222,004,216	6,021,336,339
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* ₃ 140,413,155	* ₃ 1,297,665,537
（分配準備積立金）	1,032,994,341	986,527,912
元本等合計	6,362,417,371	4,723,670,802
純資産合計	6,362,417,371	4,723,670,802
負債純資産合計	6,451,479,933	4,778,076,315

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期	第16期
	自 平成20年 2月26日 至 平成20年 8月25日	自 平成20年 8月26日 至 平成21年 2月25日
営業収益		
受取利息	194,402	131,036
有価証券売買等損益	174,314,777	1,407,948,756
営業収益合計	174,120,375	1,407,817,720
営業費用		
受託者報酬	3,479,813	2,781,036
委託者報酬	48,717,835	38,934,987
その他費用	173,904	138,957
営業費用合計	52,371,552	41,854,980
営業損失()	226,491,927	1,449,672,700
経常損失()	226,491,927	1,449,672,700
当期純損失()	226,491,927	1,449,672,700
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	4,853,053	39,750,451
期首剰余金又は期首欠損金()	406,861,128	140,413,155
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,846,628	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,846,628	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,737,909	16,113,789
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,737,909	6,475,265
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	9,638,524
分配金	*1 29,917,818	*1 12,042,654
期末剰余金又は期末欠損金()	140,413,155	1,297,665,537

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 15 期 平成20年8月25日現在	第 16 期 平成21年2月25日現在
*1 期首元本額	6,443,317,041円	6,222,004,216円
期中追加設定元本額	107,427,913円	94,289,964円
期中解約元本額	328,740,738円	294,957,841円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	6,222,004,216口	6,021,336,339口
*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 1,297,665,537円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
*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（15,835,498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 （189,408,944円）及び分配準備 積立金（1,047,076,661円）より 分配対象収益は1,252,321,103円 （1万口当たり2,012.72円）であ り、うち29,917,818円（1万口当 り48.08円）を分配金額としてお ります。外国所得税控除額 1,192,203円が含まれた分配金額 は31,110,021円（1万口当たり50 円）となります。	計算期間末における費用控除後の 配当等収益（14,128,587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 （198,638,354円）及び分配準備 積立金（984,441,979円）より分 配対象収益は1,197,208,920円（1 万口当たり1,988.27円）であり、 うち12,042,654円（1万口当 り19.99円）を分配金額としてお ります。外国所得税控除額18円が 含まれた分配金額は12,042,672円 （1万口当たり20円）となります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日		第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(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	6,205,865,873	177,600,247	4,529,917,117	1,386,138,408
合計	6,205,865,873	177,600,247	4,529,917,117	1,386,138,408

(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 15 期 平成20年8月25日現在	第 16 期 平成21年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0226円 (10,226円)	0.7845円 (7,845円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	1,576,086,408	1,361,108,221	
親投資信託受益証券	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	1,750,281,238	2,058,330,735	
親投資信託受益証券	D L インターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	684,016,370	516,090,351	
親投資信託受益証券	D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	369,644,161	594,387,810	
合計		4,380,028,177	4,529,917,117	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【バランス物語70（成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 平成20年8月25日現在	第16期 平成21年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	187,394,853	130,793,297
親投資信託受益証券	3,415,313,448	2,405,189,896
流動資産合計	3,602,708,301	2,535,983,193
資産合計	3,602,708,301	2,535,983,193
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	19,745,562	10,462,654
未払解約金	11,443,795	6,512,962
未払受託者報酬	1,937,010	1,493,701
未払委託者報酬	27,118,896	20,912,328
その他未払費用	96,757	74,593
流動負債合計	60,342,020	39,456,238
負債合計	60,342,020	39,456,238
純資産の部		
元本等		
元本	3,423,665,216	3,487,551,364
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	* ₃ 118,701,065	* ₃ 991,024,409
（分配準備積立金）	837,540,977	820,528,367
元本等合計	3,542,366,281	2,496,526,955
純資産合計	3,542,366,281	2,496,526,955
負債純資産合計	3,602,708,301	2,535,983,193

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第15期 自 平成20年 2月26日 至 平成20年 8月25日	第16期 自 平成20年 8月26日 至 平成21年 2月25日
営業収益		
受取利息	111,268	81,101
有価証券売買等損益	135,123,183	1,066,123,552
営業収益合計	135,011,915	1,066,042,451
営業費用		
受託者報酬	1,937,010	1,493,701
委託者報酬	27,118,896	20,912,328
その他費用	96,757	74,593
営業費用合計	29,152,663	22,480,622
営業損失()	164,164,578	1,088,523,073
経常損失()	164,164,578	1,088,523,073
当期純損失()	164,164,578	1,088,523,073
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	2,051,864	13,774,076
期首剰余金又は期首欠損金()	308,291,708	118,701,065
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,407,858	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,407,858	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,140,225	24,513,823
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,140,225	2,301,793
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	22,212,030
分配金	* ₁ 19,745,562	* ₁ 10,462,654
期末剰余金又は期末欠損金()	118,701,065	991,024,409

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 15 期 平成20年8月25日現在	第 16 期 平成21年2月25日現在
*1 期首元本額	3,494,144,981円	3,423,665,216円
期中追加設定元本額	78,749,603円	137,057,880円
期中解約元本額	149,229,368円	73,171,732円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	3,423,665,216口	3,487,551,364口
*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 991,024,409円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
*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（12,708,149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 （209,249,977円）及び分配準備 積立金（844,578,390円）より分 配対象収益は1,066,536,516円（1 万口当たり3,115.18円）であり、 うち19,745,562円（1万口当たり 57.67円）を分配金額としており ます。外国所得税控除額796,429円 が含まれた分配金額は20,541,991 円（1万口当たり60円）となりま す。	計算期間末における費用控除後の 配当等収益（10,980,958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 （246,461,954円）及び分配準備 積立金（820,010,063円）より分 配対象収益は1,077,452,975円（1 万口当たり3,089.42円）であり、 うち10,462,654円（1万口当たり 30円）を分配金額としておりま す。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第 15 期 自平成20年2月26日 至平成20年8月25日		第 16 期 自平成20年8月26日 至平成21年2月25日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(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	3,415,313,448	138,062,777	2,405,189,896	1,048,185,548
合計	3,415,313,448	138,062,777	2,405,189,896	1,048,185,548

(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 15 期 平成20年8月25日現在	第 16 期 平成21年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0347円 (10,347円)	0.7158円 (7,158円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	1,136,179,692	981,204,782	
親投資信託受益証券	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	470,153,726	552,900,781	
親投資信託受益証券	D L インターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	590,611,007	445,616,004	
親投資信託受益証券	D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	264,594,732	425,468,329	
合計		2,461,539,157	2,405,189,896	

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、「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」、「D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」、「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」、「D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「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

科目	注記 番号	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		35,523,071	60,372,057
コール・ローン		139,610,262	279,280,342
株式		14,171,060,012	9,398,055,043
派生商品評価勘定		-	5,206,650
未収入金		-	155,133,594
未収配当金		21,332,419	25,668,182
流動資産合計		14,367,525,764	9,923,715,868
資産合計		14,367,525,764	9,923,715,868
負債の部			
流動負債			
未払金		-	422,738,127
流動負債合計		-	422,738,127
負債合計		-	422,738,127
純資産の部			
元本等			
元本		10,180,648,721	12,592,226,424
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	4,186,877,043	3,091,248,683
元本等合計		14,367,525,764	9,500,977,741
純資産合計		14,367,525,764	9,500,977,741
負債純資産合計		14,367,525,764	9,923,715,868

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所等が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <p>(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年3月18日から平成21年3月16日までとなっております。</p>	<p>(1)外貨建取引等の処理基準 同左</p> <p>(2)計算期間の取扱い 同左</p>
----------------------------	--	--

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中解約元本額	10,237,905,351円 511,809,517円 569,066,147円	10,180,648,721円 2,423,889,274円 12,311,571円
同期末における元本の内訳		
ライフサイクル・ファンド1(安定型)	11,476,630円	14,351,037円
ライフサイクル・ファンド2(安定・成長型)	17,465,821円	21,945,702円
ライフサイクル・ファンド3(成長型)	34,005,476円	41,439,482円
バランス物語30(安定型)	476,665,341円	644,339,027円
バランス物語50(安定・成長型)	546,115,238円	684,016,370円
バランス物語70(成長型)	486,221,115円	590,611,007円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型	153,872,739円	227,233,313円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型	848,830,491円	1,249,076,898円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型	1,125,523,649円	1,539,714,345円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA1(安定型)	778,693,788円	923,611,760円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA2(安定・成長型)	2,704,707,248円	3,212,533,173円
D I A Mライフサイクル・ファンドVA3(成長型)	1,381,046,726円	1,512,455,458円
D I A Mバランス物語30VA(安定型)	449,990,377円	545,803,912円
D I A Mバランス物語50VA(安定・成長型)	855,139,053円	1,032,910,018円
D I A Mバランス物語70VA(成長型)	310,895,029円	352,184,922円
(合計)	10,180,648,721円	12,592,226,424円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	10,180,648,721口	12,592,226,424口

*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,091,248,683円であります。
----------	--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日		自平成20年8月26日 至平成21年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	14,171,060,012	98,999,018	9,398,055,043	2,935,211,561
合計	14,171,060,012	98,999,018	9,398,055,043	2,935,211,561

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
1. 取引の内容	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。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	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、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、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

取引の時価等に関する事項

(平成20年8月25日現在)

該当事項はありません。

(通貨関連)

平成21年2月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	カナダドル	5,303,900	-	5,441,800	137,900
	デンマーククローネ	19,388,400	-	20,016,000	627,600
	ノルウェークローネ	13,112,850	-	13,490,000	377,150
	ユーロ	10,835,100	-	11,187,900	352,800
	英ポンド	19,293,400	-	19,689,600	396,200
	米ドル	161,092,000	-	164,407,000	3,315,000
	合計	229,025,650	-	234,232,300	5,206,650

(注) 時価の算定方法

- 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もっと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。
- 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。
- 換算において円未満の端数は切捨てております。

(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20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.4113円	0.7545円
(1万口当たり純資産額)	(14,113円)	(7,545円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	SCHLUMBERGER LTD	14,604	38.050	555,682.200	
	ACCENTURE LTD-CL A	11,186	29.290	327,637.940	
	COVIDIEN LTD	9,308	35.950	334,622.600	
	AMAZON.COM INC	2,338	65.600	153,372.800	
	ABBOTT LABORATORIES	13,831	54.740	757,108.940	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	15,175	86.400	1,311,120.000	
	ADOBE SYSTEMS INC	14,781	18.170	268,570.770	
	ALLIANT TECHSYSTEMS INC	2,273	73.020	165,974.460	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	10,330	28.750	296,987.500	
	AMGEN INC	13,808	56.800	784,294.400	
	HESS CORP	7,784	52.350	407,492.400	

AFLAC INC	4,463	16.640	74,264.320
WYETH	10,204	42.380	432,445.520
TIME WARNER	38,339	7.880	302,111.320
APOLLO GROUP INC	3,975	77.010	306,114.750
APACHE CORP	2,442	60.520	147,789.840
APPLE INC	6,432	90.250	580,488.000
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,069	35.300	178,935.700
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	157	2,552.500	400,742.500
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,009	24.370	195,179.330
BAXTER INTERNATIONAL INC	14,337	58.270	835,416.990
BECTON DICKINSON & CO	5,004	68.640	343,474.560
VERIZON COMM INC	23,720	28.570	677,680.400
YUM! BRANDS INC	8,667	28.100	243,542.700
FIRSTENERGY CORP	4,235	48.020	203,364.700
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22,238	20.360	452,765.680
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE	2,891	62.540	180,803.140
CSX CORP	9,350	26.730	249,925.500
CAMPBELL SOUP CO	7,555	28.650	216,450.750
CELGENE CORP	8,568	52.790	452,304.720
CEPHALON INC	2,606	72.110	187,918.660
JPMORGAN CHASE & CO	27,930	21.020	587,088.600
CHUBB CORP	6,142	40.480	248,628.160
CISCO SYSTEMS INC	49,953	14.990	748,795.470
CLEAN HARBORS INC	4,070	48.990	199,389.300
COCA-COLA CO/THE	15,767	43.060	678,927.020
COLGATE-PALMOLIVE CO	10,822	59.520	644,125.440
AON CORP	6,325	39.710	251,165.750
COMCAST CORP-CL A	20,730	13.880	287,732.400
DIRECTV GROUP INC	27,436	21.870	600,025.320
BROADCOM CORP-CL A	11,217	16.130	180,930.210
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,506	74.090	333,849.540
AMERICAN TOWER CORP	7,691	27.250	209,579.750
TARGET CORP	6,094	27.830	169,596.020
REPUBLIC SERVICES INC	7,913	22.730	179,862.490
KNIGHT CAPITAL GROUP INC-A	8,439	18.290	154,349.310
THE WALT DISNEY CO	12,714	17.920	227,834.880
DOLLAR TREE INC	7,342	36.060	264,752.520
DUKE ENERGY CORP	14,219	14.310	203,473.890
EMC CORP/MASS	13,778	10.820	149,077.960
BANK OF AMERICA CORP	17,899	4.730	84,662.270
EMERSON ELECTRIC CO	8,446	28.990	244,849.540
EOG RESOURCES INC	3,016	53.330	160,843.280
EXPRESS SCRIPTS INC	6,875	57.400	394,625.000
EXXON MOBIL CORP	43,520	72.090	3,137,356.800
FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD	5,924	27.990	165,812.760
GENERAL DYNAMICS CORP	3,802	49.020	186,374.040
GENERAL MILLS INC	6,329	55.500	351,259.500
GENZYME CORP-GENL DIVISION	6,275	70.420	441,885.500
GILEAD SCIENCES INC	16,516	50.340	831,415.440
MCKESSON CORP	6,649	44.920	298,673.080
GENERAL ELECTRIC CO	64,694	9.080	587,421.520
HALLIBURTON CO	23,322	17.030	397,173.660
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,538	92.980	235,983.240
HJ HEINZ CO	7,476	33.770	252,464.520

HEWLETT-PACKARD CO	24,742	29.620	732,858.040
JUNIPER NETWORKS INC	8,810	14.950	131,709.500
HOME DEPOT INC	18,448	20.670	381,320.160
HUDSON CITY BANCORP INC	17,785	10.760	191,366.600
GENENTECH INC	7,199	85.520	615,658.480
INTEL CORP	54,161	12.730	689,469.530
ITT CORP	6,808	39.740	270,549.920
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,347	35.510	118,851.970
JOHNSON & JOHNSON	22,156	54.540	1,208,388.240
DEVON ENERGY CORP	7,386	46.710	345,000.060
KOHL'S CORP	5,425	35.520	192,696.000
KROGER CO	9,262	21.320	197,465.840
ELI LILLY & CO	8,148	32.910	268,150.680
LINEAR TECH CORP	8,610	22.220	191,314.200
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	5,476	43.170	236,398.920
LOCKHEED MARTIN CORP	3,604	74.440	268,281.760
LOWE'S COS INC	19,854	15.610	309,920.940
DOMINION RESOURCES INC/VA	8,147	31.650	257,852.550
MCDONALD'S CORPORATION	14,277	54.760	781,808.520
METLIFE INC	11,053	23.300	257,534.900
MEDTRONIC INC	11,709	34.520	404,194.680
CVS CAREMARK CORP	20,639	26.960	556,427.440
MERCK & CO. INC.	17,374	28.530	495,680.220
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,346	61.150	265,757.900
MICROSOFT CORP	80,174	17.170	1,376,587.580
3M CO	3,920	47.400	185,808.000
PROGRESS ENERGY INC	8,070	37.550	303,028.500
XCEL ENERGY INC	11,085	18.040	199,973.400
DUN & BRADSTREET CORP	3,327	73.980	246,131.460
NIKE INC-CL B	6,007	42.940	257,940.580
NOBLE ENERGY INC	6,249	47.100	294,327.900
WATSON WYATT WORLDWIDE INC-A	4,075	48.790	198,819.250
NORTHERN TRUST CORP	7,928	60.790	481,943.120
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,263	43.080	183,650.040
WELLS FARGO & CO	12,945	13.050	168,932.250
NUCOR CORP	8,713	37.750	328,915.750
MONSANTO CO	8,119	77.400	628,410.600
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,279	50.470	518,781.130
ORACLE CORP	31,547	16.440	518,632.680
EXELON CORP	8,131	48.700	395,979.700
PEPSICO INC	13,875	51.680	717,060.000
PFIZER INC	52,048	13.590	707,332.320
CONOCOPHILLIPS	13,041	39.250	511,859.250
ALTRIA GROUP INC	28,952	15.370	444,992.240
AETNA INC	7,949	29.350	233,303.150
PRAXAIR INC	8,921	60.920	543,467.320
T ROWE PRICE GROUP INC	6,144	25.000	153,600.000
PROCTER & GAMBLE CO	23,390	49.770	1,164,120.300
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	13,412	28.540	382,778.480
QUALCOMM INC	15,632	34.490	539,147.680
US BANCORP	22,090	12.540	277,008.600
RAYTHEON COMPANY	6,513	44.860	292,173.180
KRAFT FOODS INC-A	12,700	23.720	301,244.000
THE TRAVELERS COMPANIES INC	11,516	39.240	451,887.840

	SCHERING-PLOUGH CORP	19,428	17.930	348,344.040	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	8,165	13.300	108,594.500	
	WELLPOINT INC	7,203	40.840	294,170.520	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	7,221	20.400	147,308.400	
	EDISON INTERNATIONAL	6,847	27.820	190,483.540	
	SOUTHERN CO	6,279	30.970	194,460.630	
	AT&T INC	48,101	23.250	1,118,348.250	
	CHEVRON CORP	19,042	65.280	1,243,061.760	
	STATE STREET CORP	2,898	26.490	76,768.020	
	STERICYCLE INC	5,146	47.360	243,714.560	
	SYSCO CORP	12,765	22.410	286,063.650	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7,402	37.920	280,683.840	
	URS CORP	8,176	32.430	265,147.680	
	UNION PACIFIC CORP	8,758	39.890	349,356.620	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	10,552	43.000	453,736.000	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	15,637	24.210	378,571.770	
	WAL-MART STORES INC	23,877	50.010	1,194,088.770	
	WASTE MANAGEMENT INC	10,602	28.410	301,202.820	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	9,090	45.560	414,140.400	
	WABTEC CORP	6,663	29.020	193,360.260	
	XILINX INC	14,819	17.130	253,849.470	
	YAHOO! INC	8,613	12.750	109,815.750	
	GOOGLE INC	2,298	345.450	793,844.100	
	MASTERCARD INC	1,645	161.270	265,289.150	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	22,848	34.900	797,395.200	
	VISA INC	7,833	56.350	441,389.550	
	LORILLARD INC	3,933	61.380	241,407.540	
米ドル小計	銘柄数 : 146	1,865,670		59,475,657.410	
	組入時価比率 : 60.55%			(5,752,485,585)	
	合計時価比率 : 61.21%				
英ポンド	AUTONOMY CORP PLC	10,308	12.000	123,696.000	
	AGGREKO PLC	46,858	3.532	165,502.450	
	CAPITA GROUP PLC	17,827	6.710	119,619.170	
	DIAGEO PLC	19,292	8.300	160,123.600	
	NATIONAL GRID PLC	32,532	6.190	201,373.080	
	BAE SYSTEMS PLC	67,689	3.850	260,602.650	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	21,776	16.990	369,974.240	
	ANGLO AMERICAN PLC	13,347	10.330	137,874.510	
	HSBC HOLDINGS PLC	93,343	4.720	440,578.960	
	PRUDENTIAL PLC	54,641	2.667	145,727.540	
	RIO TINTO PLC	13,075	17.870	233,650.250	
	VODAFONE GROUP PLC	452,428	1.226	554,676.720	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12,143	26.400	320,575.200	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	17,618	11.270	198,554.860	
	BP PLC	157,313	4.547	715,302.210	
	STANDARD CHARTERED PLC	12,387	6.535	80,949.040	
	BG GROUP PLC	48,681	9.910	482,428.710	
	TESCO PLC	84,214	3.318	279,422.050	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	35,992	11.060	398,071.520	
	DE LA RUE PLC	8,599	10.000	85,990.000	
	ASTRAZENECA PLC	10,110	24.150	244,156.500	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	55,906	15.490	865,983.940	
	SHIRE PLC	14,679	9.070	133,138.530	

英ポンド小計	銘柄数 : 23	1,300,758		6,717,971.730
	組入時価比率 : 9.95%			(944,882,724)
	合計時価比率 : 10.05%			
カナダドル	BARRICK GOLD CORP	15,750	39.250	618,187.500
	RESEARCH IN MOTION LTD	3,680	50.560	186,060.800
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,745	41.800	365,541.000
	ENBRIDGE INC	13,329	38.280	510,234.120
	MANULIFE FINANCIAL CORP	19,346	13.500	261,171.000
	GOLDCORP INC	15,834	35.030	554,665.020
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	5,324	102.490	545,656.760
	ROYAL BANK OF CANADA	10,520	28.480	299,609.600
	SHAW COMM INC-B	21,524	18.490	397,978.760
	SHOPPERS DRUG MART CORP	7,559	43.500	328,816.500
	SUNCOR ENERGY INC	16,388	22.760	372,990.880
	ENCANA CORP	12,243	46.110	564,524.730
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	7,021	35.250	247,490.250
カナダドル小計	銘柄数 : 13	157,263		5,252,926.920
	組入時価比率 : 4.30%			(408,415,068)
	合計時価比率 : 4.35%			
スイスフラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	18,326	25.140	460,715.640
	SYNGENTA AG	1,059	231.000	244,629.000
	SYNTHES INC	1,836	144.900	266,036.400
	NESTLE SA-REGISTERED	35,068	38.420	1,347,312.560
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	5,754	137.800	792,901.200
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	196	1,082.000	212,072.000
	NOVARTIS AG-REG SHS	19,769	47.000	929,143.000
	SWISSCOM AG-REG	1,757	354.000	621,978.000
	ABB LTD	19,500	13.320	259,740.000
	UBS AG-REGISTERED	18,762	9.850	184,805.700
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	2,373	160.000	379,680.000
スイスフラン小計	銘柄数 : 11	124,400		5,699,013.500
	組入時価比率 : 5.00%			(475,411,706)
	合計時価比率 : 5.06%			
スウェーデンクローネ	ATLAS COPCO AB-A SHS	23,837	59.000	1,406,383.000
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	12,694	104.250	1,323,349.500
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 2	36,531		2,729,732.500
	組入時価比率 : 0.32%			(30,054,355)
	合計時価比率 : 0.32%			
ユーロ	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	7,484	20.860	156,116.240
	MAN AG	3,585	31.540	113,070.900
	RWE AG	7,987	53.880	430,339.560
	E.ON AG	22,029	21.640	476,707.560
	SIEMENS AG-REG	6,414	41.120	263,743.680
	BAYER AG	10,264	39.880	409,328.320
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	8,281	34.610	286,605.410
	ALLIANZ SE	7,530	49.310	371,304.300
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,679	92.070	338,725.530
	LINDE AG	3,651	51.580	188,318.580
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	27,017	9.190	248,286.230
	IBERDROLA SA	34,578	5.270	182,226.060
	TELEFONICA S.A	35,654	13.920	496,303.680
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	26,194	5.570	145,900.580
	BANCO SANTANDER SA	51,314	4.700	241,175.800

	GRIFOLS SA	12,476	12.820	159,942.320	
	NOKIA OYJ	27,988	7.790	218,026.520	
	AIR LIQUIDE	3,703	58.830	217,847.490	
	AXA	23,269	7.650	178,007.850	
	GROUPE DANONE	6,867	36.515	250,748.500	
	BOUYGUES	6,163	22.140	136,448.820	
	BNP PARIBAS	5,888	23.050	135,718.400	
	SOCIETE GENERALE-A	7,779	23.760	184,829.040	
	VINCI S.A.	10,799	26.160	282,501.840	
	VIVENDI SA	19,271	18.980	365,763.580	
	TOTAL SA	21,508	37.810	813,217.480	
	FRANCE TELECOM SA	24,875	17.310	430,586.250	
	SANOFI-AVENTIS	8,954	44.205	395,811.570	
	GDF SUEZ	12,873	25.850	332,767.050	
	ALSTOM	3,308	36.500	120,742.000	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,342	16.400	153,208.800	
	INTESA SANPAOLO	65,024	1.866	121,334.780	
	ENI SPA	26,556	15.750	418,257.000	
	SNAM RETE GAS	42,326	3.967	167,907.240	
	ARCELOR MITTAL (NL)	13,351	15.795	210,879.040	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	21,658	8.390	181,710.620	
	UNILEVER NV-CVA	30,851	15.230	469,860.730	
	WOLTERS KLUWER-CVA	10,761	12.780	137,525.580	
	KONINKLIJKE KPN NV	45,362	10.520	477,208.240	
ユーロ小計	銘柄数 : 39	716,613		10,909,003.170	
	組入時価比率 : 14.27%			(1,356,207,274)	
	合計時価比率 : 14.43%				
デンマーククローネ	NOVOZYMES-B SHS	2,572	433.000	1,113,676.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	9,343	299.000	2,793,557.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	3,948	269.500	1,063,986.000	
デンマーククローネ 小計	銘柄数 : 3	15,863		4,971,219.000	
	組入時価比率 : 0.87%			(82,969,645)	
	合計時価比率 : 0.88%				
ノルウェークローネ	STATOILHYDRO ASA	26,832	113.000	3,032,016.000	
ノルウェークローネ 小計	銘柄数 : 1	26,832		3,032,016.000	
	組入時価比率 : 0.45%			(43,084,947)	
	合計時価比率 : 0.46%				
香港ドル	CHINA MOBILE LIMITED	21,000	69.600	1,461,600.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	76,000	64.400	4,894,400.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	142,000	10.920	1,550,640.000	
	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	47,000	48.500	2,279,500.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 4	286,000		10,186,140.000	
	組入時価比率 : 1.34%			(127,123,027)	
	合計時価比率 : 1.35%				
シンガポール・ドル	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	107,000	4.780	511,460.000	
シンガポール・ドル 小計	銘柄数 : 1	107,000		511,460.000	
	組入時価比率 : 0.34%			(32,472,595)	
	合計時価比率 : 0.35%				
オーストラリアドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	34,245	16.250	556,481.250	
	BHP BILLITON LTD	53,045	28.970	1,536,713.650	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	10,177	20.360	207,203.720	

オーストラリアドル 小計	銘柄数 : 3	97,467	2,300,398.620
	組入時価比率 : 1.53%		(144,948,117)
	合計時価比率 : 1.54%		
合計			9,398,055,043
			(9,398,055,043)

- (注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 146銘柄	60.55%	61.21%
英ポンド	株式 23銘柄	9.95%	10.05%
カナダドル	株式 13銘柄	4.30%	4.35%
スイスフラン	株式 11銘柄	5.00%	5.06%
スウェーデンクローネ	株式 2銘柄	0.32%	0.32%
ユーロ	株式 39銘柄	14.27%	14.43%
デンマーククローネ	株式 3銘柄	0.87%	0.88%
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	0.45%	0.46%
香港ドル	株式 4銘柄	1.34%	1.35%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	0.34%	0.35%
オーストラリアドル	株式 3銘柄	1.53%	1.54%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「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

科目	注記 番号	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
		金額(円)	金額(円)

資産の部			
流動資産			
金銭信託		418,215	924,956
コール・ローン		796,809,286	1,250,210,593
株式		34,374,350,850	25,379,408,400
未収入金		251,862,908	112,287,371
未収配当金		23,644,450	40,559,700
流動資産合計		35,447,085,709	26,783,391,020
資産合計		35,447,085,709	26,783,391,020
負債の部			
流動負債			
未払金		257,029,777	955,477,608
流動負債合計		257,029,777	955,477,608
負債合計		257,029,777	955,477,608
純資産の部			
元本等			
元本		23,236,110,526	29,907,320,654
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	11,953,945,406	4,079,407,242
元本等合計		35,190,055,932	25,827,913,412
純資産合計		35,190,055,932	25,827,913,412
負債純資産合計		35,447,085,709	26,783,391,020

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所等が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年3月18日から平成21年3月16日までとなっております。	計算期間の取扱い 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	22,644,381,055円	23,236,110,526円
同期中追加設定元本額	1,607,935,134円	6,671,210,128円
同期中解約元本額	1,016,205,663円	円
同期末における元本の内訳		
ライフサイクル・ファンド1（安定型）	37,816,094円	57,730,278円
ライフサイクル・ファンド2（安定・成長型）	39,433,501円	50,988,606円

ライフサイクル・ファンド3(成長型)	61,775,707円	79,309,169円
バランス物語30(安定型)	1,680,303,341円	2,438,927,988円
バランス物語50(安定・成長型)	1,230,033,863円	1,576,086,408円
バランス物語70(成長型)	897,672,405円	1,136,179,692円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型	517,835,519円	810,524,095円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,871,282,237円	2,602,331,609円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型	2,084,683,556円	2,708,476,591円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A1(安定型)	2,494,366,151円	3,425,246,178円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A2(安定・成長型)	5,807,248,823円	7,284,250,200円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A3(成長型)	2,565,787,656円	2,767,821,646円
D I A Mバランス物語30 V A(安定型)	1,514,953,737円	2,003,374,464円
D I A Mバランス物語50 V A(安定・成長型)	1,864,442,692円	2,306,511,112円
D I A Mバランス物語70 V A(成長型)	568,475,244円	659,562,618円
(合計)	23,236,110,526円	29,907,320,654円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	23,236,110,526口	29,907,320,654口
*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,079,407,242円であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日		自平成20年8月26日 至平成21年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	34,374,350,850	1,291,294,631	25,379,408,400	10,091,872,978
合計	34,374,350,850	1,291,294,631	25,379,408,400	10,091,872,978

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5145円 (15,145円)	0.8636円 (8,636円)
---------------------------	----------------------	---------------------

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日 揮	157,000	1,115	175,055,000	
ディー・エヌ・エー	300	290,100	87,030,000	
キリンHD	268,000	929	248,972,000	
ローソン	60,000	4,030	241,800,000	
日本たばこ産業	593	233,900	138,702,700	
グローウェルHD	113,500	1,575	178,762,500	
セブン&アイ・HLDS	219,700	2,010	441,597,000	
ITホールディングス	422,000	1,161	489,942,000	
グリーン	10,000	4,630	46,300,000	
ソネットエンタテインメント	1,016	191,300	194,360,800	
王子製紙	434,000	349	151,466,000	
日本製紙G本社	66,300	2,145	142,213,500	
イビデン	50,000	1,977	98,850,000	
信越化学	150,200	4,280	642,856,000	
協和発酵キリン	171,000	741	126,711,000	
花 王	75,000	1,810	135,750,000	
武田薬品	102,500	3,970	406,925,000	
塩野義製薬	196,000	1,524	298,704,000	
田辺三菱製薬	159,000	1,139	181,101,000	
エーザイ	82,000	2,960	242,720,000	
ツムラ	69,200	2,660	184,072,000	
ヤフー	7,900	26,260	207,454,000	
もしもしホットライン	292,500	1,898	555,165,000	
アルファシステムズ	139,000	1,789	248,671,000	
ジュビターテレコム	1,905	69,100	131,635,500	
コーセー	96,000	1,997	191,712,000	
新日本石油	890,000	450	400,500,000	
ブリヂストン	92,000	1,416	130,272,000	
日本電気硝子	189,000	652	123,228,000	
新日本製鐵	1,775,000	246	436,650,000	
三菱マテリアル	820,000	229	187,780,000	
住友鉱山	88,000	1,018	89,584,000	
住友電工	207,000	802	166,014,000	
小松製作所	396,100	1,037	410,755,700	
栗田工業	167,000	1,910	318,970,000	
ミネベア	436,000	329	143,444,000	
日 立	383,000	249	95,367,000	
東 芝	473,000	232	109,736,000	
三菱電機	378,000	384	145,152,000	
日本電産	172,000	4,020	691,440,000	
富 士 通	268,000	337	90,316,000	
パナソニック	296,000	1,153	341,288,000	
ソ ニ ー	96,000	1,681	161,376,000	
メガチップス	380,000	1,674	636,120,000	

デンソー	252,600	1,902	480,445,200
スタンレー電気	167,000	1,000	167,000,000
日本セラミック	439,000	904	396,856,000
ファナック	26,800	6,410	171,788,000
ローム	15,000	4,570	68,550,000
パナソニック電工	233,000	588	137,004,000
三菱重工業	373,000	282	105,186,000
トヨタ自動車	355,200	3,220	1,143,744,000
本田技研	311,800	2,395	746,761,000
シークス	604,900	423	255,872,700
HOYA	258,000	1,735	447,630,000
キヤノン	108,000	2,505	270,540,000
日本写真印刷	91,000	2,450	222,950,000
任天堂	4,700	27,570	129,579,000
丸紅	900,000	307	276,300,000
三井物産	787,000	887	698,069,000
東京エレクトロン	114,000	3,380	385,320,000
住友商事	271,000	822	222,762,000
三菱商事	571,000	1,213	692,623,000
コメリ	91,000	1,611	146,601,000
ユニー	38,000	694	26,372,000
三菱UFJフィナンシャルG	2,209,000	445	983,005,000
三井住友フィナンシャルG	248,400	3,120	775,008,000
みずほフィナンシャルG	2,760,000	192	529,920,000
オリックス	65,900	1,893	124,748,700
野村ホールディングス	290,500	415	120,557,500
三井不動産	428,000	1,007	430,996,000
東日本旅客鉄道	117,200	5,490	643,428,000
日本通運	415,000	292	121,180,000
商船三井	810,000	494	400,140,000
三菱倉庫	115,000	774	89,010,000
日本電信電話	251,200	4,090	1,027,408,000
KDDI	956	486,000	464,616,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	4,456	150,700	671,519,200
スクウェア・エニックス・HD	224,000	1,813	406,112,000
セコム	65,000	3,320	215,800,000
ニトリ	51,500	4,800	247,200,000
サンドラッグ	43,200	1,627	70,286,400
合計	24,962,026		25,379,408,400

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。

[次へ](#)

「D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		8,098,576	8,046,751
コール・ローン		313,575,370	150,302,040
国債証券		16,805,080,611	12,211,910,149
特殊債券		841,016,271	656,019,952
派生商品評価勘定		23,004,217	33,280,917
未収入金		101,742,291	10,692,046
未収利息		185,580,251	151,743,316
前払費用		8,522,732	37,476,222
流動資産合計		18,286,620,319	13,259,471,393
資産合計		18,286,620,319	13,259,471,393
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		13,137,937	30,297,804
未払金		295,015,085	17,800,888
流動負債合計		308,153,022	48,098,692
負債合計		308,153,022	48,098,692
純資産の部			
元本等			
元本		9,641,510,896	8,216,207,005
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		8,336,956,401	4,995,165,696
元本等合計		17,978,467,297	13,211,372,701
純資産合計		17,978,467,297	13,211,372,701
負債純資産合計		18,286,620,319	13,259,471,393

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で 評価しております。時価評価にあ たっては、金融商品取引業者、銀行等 の提示する価額（但し、売気配相場 は使用しない）、価格情報会社の提 供する価額又は日本証券業協会発表 の売買参考統計値（平均値）等で評 価しております。	国債証券及び特殊債券 同左
2. デリバティブ等の評価基準 及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期 間末日の対顧客先物売買相場の仲値 によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対 顧客電信売買相場の仲値により円貨 に換算するほか、「投資信託財産の 計算に関する規則」（平成12年総理 府令第133号）第60条及び同第61条 にしたがって換算しております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左

	(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年5月27日から平成21年5月25日までとなっております。	(2)計算期間の取扱い 同左
--	--	-------------------

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	10,452,810,186円	9,641,510,896円
同期中追加設定元本額	388,992,563円	258,995,864円
同期中解約元本額	1,200,291,853円	1,684,299,755円
同期末における元本の内訳		
ライフサイクル・ファンド1(安定型)	14,546,545円	14,546,545円
ライフサイクル・ファンド2(安定・成長型)	13,699,711円	12,584,295円
ライフサイクル・ファンド3(成長型)	21,729,544円	19,174,439円
バランス物語30(安定型)	590,051,323円	590,051,323円
バランス物語50(安定・成長型)	408,557,191円	369,644,161円
バランス物語70(成長型)	307,072,482円	264,594,732円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型	185,342,898円	193,510,164円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型	643,282,796円	634,394,002円
D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型	712,420,682円	661,098,603円
外国債券私募オープン(適格機関投資家向け)	1,535,715,612円	754,143,443円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A1(安定型)	923,777,100円	923,777,100円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A2(安定・成長型)	2,031,820,641円	1,835,109,051円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A3(成長型)	876,099,593円	688,048,025円
D I A Mバランス物語30V A(安定型)	537,756,442円	518,299,927円
D I A Mバランス物語50V A(安定・成長型)	641,168,665円	575,884,326円
D I A Mバランス物語70V A(成長型)	198,469,671円	161,346,869円
(合計)	9,641,510,896円	8,216,207,005円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	9,641,510,896口	8,216,207,005口

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日		自平成20年8月26日 至平成21年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)

国債証券	16,805,080,611	82,822,937	12,211,910,149	719,463,256
特殊債券	841,016,271	733,341	656,019,952	9,199,943
合計	17,646,096,882	83,556,278	12,867,930,101	728,663,199

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
1. 取引の内容	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。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	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、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、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

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

平成20年8月25日現在					
区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	スイスフラン	64,455,191	-	65,468,452	1,013,261
	ユーロ	1,453,433,000	-	1,456,470,000	3,037,000
	英ポンド	732,758,400	-	728,676,000	4,082,400
	米ドル	1,361,885,735	-	1,368,354,375	6,468,640
	買建				
	シンガポール・ドル	92,304,400	-	92,665,300	360,900
	スイスフラン	1,305,116,050	-	1,306,261,395	1,145,345
	スウェーデンクローネ	11,821,578	-	11,384,080	437,498
	ノルウェークローネ	82,380,870	-	82,783,800	402,930
	ポーランドズロチ	238,081,200	-	240,541,000	2,459,800
	ユーロ	480,980,940	-	482,253,400	1,272,460
	米ドル	1,641,822,483	-	1,652,921,327	11,098,844
合 計	7,465,039,847	-	7,487,779,129	9,866,280	

平成21年2月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	ユーロ	293,224,560	-	303,072,400	9,847,840
	米ドル	574,238,702	-	594,688,666	20,449,964
	買建				
	カナダドル	262,957,503	-	273,732,971	10,775,468
	シンガポール・ドル	72,541,213	-	75,469,800	2,928,587
	スイスフラン	117,460,150	-	120,973,500	3,513,350
	ノルウェークローネ	40,491,700	-	41,801,500	1,309,800
	ポーランドズロチ	113,245,440	-	118,272,000	5,026,560
	ユーロ	239,401,121	-	248,420,000	9,018,879
	米ドル	18,682,311	-	19,390,584	708,273
	合 計	1,732,242,700	-	1,795,821,421	2,983,113

(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もっと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。

(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20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
--	--------------	--------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8647円 (18,647円)	1.6080円 (16,080円)
---------------------------	----------------------	----------------------

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 3.875 07/15/10	400,000.00	417,312.000	
	US T N/B 2.375 08/31/10	100,000.00	102,312.000	
	US T N/B 5.0 08/15/11	4,500,000.00	4,944,015.000	
	US T N/B 4.0 11/15/12	2,600,000.00	2,833,792.000	
	US T N/B 3.5 05/31/13	3,100,000.00	3,335,631.000	
	US T N/B 3.125 09/30/13	1,500,000.00	1,587,060.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	1,600,000.00	1,766,992.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	1,800,000.00	2,011,212.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	1,400,000.00	1,594,250.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	3,900,000.00	4,417,647.000	
	US TREASURY N/B 4.625 02/15/17	1,000,000.00	1,142,500.000	
	US TREASURY N/B 4.5 05/15/17	3,000,000.00	3,405,690.000	
	US TREASURY N/B 4.25 11/15/17	3,500,000.00	3,916,150.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	400,000.00	424,656.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	100,000.00	109,398.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	100,000.00	110,203.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	4,600,000.00	4,979,132.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	1,600,000.00	1,593,248.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	900,000.00	1,159,308.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,250,000.00	1,503,900.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	300,000.00	360,984.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	200,000.00	247,296.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	500,000.00	591,130.000	
米ドル小計	銘柄数 : 23	38,350,000.00	42,553,818.000	
	組入時価比率 : 31.15%		(4,115,805,277)	
	合計時価比率 : 31.98%			
	UK TREASURY 5.0 03/07/12	1,300,000.00	1,418,820.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	700,000.00	788,900.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	1,700,000.00	1,817,470.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	300,000.00	343,050.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,000,000.00	1,440,800.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	900,000.00	897,480.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,250,000.00	1,262,500.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	500,000.00	552,350.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 8	7,650,000.00	8,521,370.000	
	組入時価比率 : 9.07%		(1,198,530,691)	
	合計時価比率 : 9.31%			
	CANADA 4.25 09/01/09	1,000,000.00	1,017,970.000	
	CANADA 5.25 06/01/12	200,000.00	222,886.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	400,000.00	459,232.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	600,000.00	661,866.000	

	CANADA 8.0 06/01/27	600,000.00	938,058.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	600,000.00	751,200.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 6	3,400,000.00	4,051,212.000	
	組入時価比率 : 2.38%		(314,981,733)	
	合計時価比率 : 2.45%			
	SWEDEN 5.5 10/08/12	1,000,000.00	1,136,290.000	
	SWEDEN 6.75 05/05/14	2,500,000.00	3,083,000.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	1,800,000.00	2,041,758.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	3,000,000.00	3,114,870.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 4	8,300,000.00	9,375,918.000	
	組入時価比率 : 0.78%		(103,228,857)	
	合計時価比率 : 0.80%			
	AUSTRIA 4.0 07/15/09	300,000.00	302,550.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	2,100,000.00	2,094,750.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/09	100,000.00	100,950.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	100,000.00	109,310.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	1,850,000.00	1,949,900.000	
	DEUTSCHLAND 6.0 06/20/16	300,000.00	361,500.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	2,100,000.00	2,238,810.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	5,400,000.00	5,963,760.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	4,700,000.00	5,212,770.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,850,000.00	4,331,250.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,600,000.00	4,755,204.000	
	SPAIN 5.0 07/30/12	200,000.00	214,790.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	1,750,000.00	1,828,662.500	
	SPAIN 4.75 07/30/14	550,000.00	586,767.500	
	SPAIN 4.4 01/31/15	400,000.00	416,400.000	
	FINLAND 2.75 09/15/10	300,000.00	306,000.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	3,600,000.00	3,792,960.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/11	240,000.00	259,656.000	
	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	300,000.00	326,160.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	600,000.00	619,800.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	1,000,000.00	1,055,200.000	
	ITALY BTPS 4.25 11/01/09	200,000.00	203,882.000	
	ITALY BTPS 3.0 01/15/10	100,000.00	101,441.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	3,200,000.00	3,387,200.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	4,600,000.00	4,715,460.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	700,000.00	710,500.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	6,000,000.00	6,172,800.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 27	49,140,000.00	52,118,433.000	
	組入時価比率 : 49.04%		(6,479,363,591)	
	合計時価比率 : 50.35%			
国債証券計			12,211,910,149	
			(12,211,910,149)	
特殊債券	IADB 3.5 03/15/13	1,000,000.00	1,025,300.000	
米ドル小計	銘柄数 : 1	1,000,000.00	1,025,300.000	
	組入時価比率 : 0.75%		(99,167,016)	
	合計時価比率 : 0.77%			
	EIB 4.0 04/15/09	4,000,000.00	4,004,000.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 1	4,000,000.00	4,004,000.000	
	組入時価比率 : 3.77%		(497,777,280)	
	合計時価比率 : 3.87%			

	NEW S WALES 6.0 10/01/09	400,000.00	406,620.000	
	QUEENSLAND 6.0 10/14/15	500,000.00	530,940.000	
オーストラリアドル 小計	銘柄数 : 2	900,000.00	937,560.000	
	組入時価比率 : 0.45%		(59,075,656)	
	合計時価比率 : 0.46%			
特殊債券計			656,019,952	
			(656,019,952)	
合計			12,867,930,101	
			(12,867,930,101)	

- (注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 23銘柄	31.15%	31.98%
米ドル	特殊債券 1銘柄	0.75%	0.77%
英ポンド	国債証券 8銘柄	9.07%	9.31%
カナダドル	国債証券 6銘柄	2.38%	2.45%
スウェーデンクローネ	国債証券 4銘柄	0.78%	0.80%
ユーロ	国債証券 27銘柄	49.04%	50.35%
ユーロ	特殊債券 1銘柄	3.77%	3.87%
オーストラリアドル	特殊債券 2銘柄	0.45%	0.46%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		525,327,144	439,880,648
国債証券		38,558,310,545	25,018,337,520
地方債証券		167,587,148	168,394,443
社債券		25,119,412,160	24,563,874,000
未収入金		3,361,403,000	-
未収利息		243,123,039	200,280,737
前払費用		20,152,174	3,436,068
流動資産合計		67,995,315,210	50,394,203,416

資産合計		67,995,315,210	50,394,203,416
負債の部			
流動負債			
未払金		3,180,250,500	-
未払解約金		121,500,000	-
流動負債合計		3,301,750,500	-
負債合計		3,301,750,500	-
純資産の部			
元本等			
元本		54,094,127,754	42,852,167,763
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		10,599,436,956	7,542,035,653
元本等合計		64,693,564,710	50,394,203,416
純資産合計		64,693,564,710	50,394,203,416
負債純資産合計		67,995,315,210	50,394,203,416

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日	自平成20年8月26日 至平成21年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊 債券及び社債券 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。 (2)社債券（転換社債及び新株 予約権付社債） 移動平均法（買付約定後、最初 の利払日までは個別法）に基 づき、原則として時価で評価し ております。時価評価にあつて は、金融商品取引所等における 最終相場（最終相場のないもの については、それに準ずる価 額）、金融商品取引所等が発表 する基準値段、金融商品取引業 者、銀行等の提示する価額（但 し、売気配相場は使用しない）、 価格情報会社の提供する価額又 は日本証券業協会発表の売買参 考統計値(平均値)等で評価し ております。	(1)国債証券、地方債証券及び社債券 同左 (2)社債券（転換社債及び新株予約権 付社債） 同左
2. その他財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 有価証券報告書における開示対 象ファンドと異なり、平成20年5 月27日から平成21年5月25日ま でとなっております。	計算期間の取扱い 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
*1 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの期首における		

当該親投資信託の元本額	57,227,979,436円	54,094,127,754円
同期中追加設定元本額	1,331,240,406円	50,426,596円
同期中解約元本額	4,465,092,088円	11,292,386,587円
同期末における元本の内訳		
ライフサイクル・ファンド1（安定型）	185,945,140円	154,890,094円
ライフサイクル・ファンド2（安定・成長型）	75,437,071円	58,422,227円
ライフサイクル・ファンド3（成長型）	47,771,439円	33,761,146円
バランス物語30（安定型）	7,699,622,796円	6,418,940,539円
バランス物語50（安定・成長型）	2,350,038,096円	1,750,281,238円
バランス物語70（成長型）	666,432,541円	470,153,726円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金>1安定型	2,387,920,267円	2,224,728,556円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金>2安定・成長型	3,617,038,796円	3,046,813,358円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金>3成長型	1,538,178,217円	1,172,707,082円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A1（安定型）	11,700,836,319円	9,606,804,698円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A2（安定・成長型）	11,348,318,771円	8,375,361,138円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A3（成長型）	1,742,654,926円	1,145,349,754円
D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	6,751,118,269円	5,476,425,015円
D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	3,574,453,809円	2,637,235,355円
D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	408,361,297円	280,293,837円
（合計）	54,094,127,754円	42,852,167,763円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	54,094,127,754口	42,852,167,763口

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	自平成20年2月26日 至平成20年8月25日		自平成20年8月26日 至平成21年2月25日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	38,558,310,545	943,970,539	25,018,337,520	420,364,200
地方債証券	167,587,148	726,210	168,394,443	1,533,505
社債券	25,119,412,160	146,819,100	24,563,874,000	1,509,458,040
合計	63,845,309,853	797,877,649	49,750,605,963	1,087,560,335

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成20年8月25日現在	平成21年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1959円 (11,959円)	1.1760円 (11,760円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	264回 利付国庫債券（10年）	100,000,000	103,832,000	
	265回 利付国庫債券（10年）	325,000,000	337,613,250	
	267回 利付国庫債券（10年）	950,000,000	976,068,000	
	269回 利付国庫債券（10年）	20,000,000	20,553,200	
	270回 利付国庫債券（10年）	58,000,000	59,614,140	
	280回 利付国庫債券（10年）	1,380,000,000	1,481,650,800	
	281回 利付国庫債券（10年）	140,000,000	151,484,200	
	282回 利付国庫債券（10年）	300,000,000	317,085,000	
	286回 利付国庫債券（10年）	105,000,000	110,970,300	
	287回 利付国庫債券（10年）	900,000,000	959,508,000	
	288回 利付国庫債券（10年）	4,400,000,000	4,600,992,000	
	294回 利付国庫債券（10年）	300,000,000	311,898,000	
	296回 利付国庫債券（10年）	2,825,000,000	2,879,127,000	
	2回 利付国庫債券（30年）	379,000,000	408,641,590	
	10回 利付国庫債券（30年）	260,000,000	216,208,200	
	21回 利付国庫債券（30年）	200,000,000	212,320,000	
	28回 利付国庫債券（20年）	80,000,000	99,703,200	
	30回 利付国庫債券（20年）	110,000,000	129,830,800	
	33回 利付国庫債券（20年）	100,000,000	120,510,000	
	34回 利付国庫債券（20年）	160,000,000	189,798,400	
	36回 利付国庫債券（20年）	60,000,000	68,885,400	
	39回 利付国庫債券（20年）	50,000,000	55,759,500	
	40回 利付国庫債券（20年）	100,000,000	108,914,000	
	41回 利付国庫債券（20年）	160,000,000	162,409,600	
	42回 利付国庫債券（20年）	25,000,000	27,938,250	
	43回 利付国庫債券（20年）	80,000,000	91,836,000	
	44回 利付国庫債券（20年）	340,000,000	377,230,000	
	45回 利付国庫債券（20年）	150,000,000	164,905,500	
	46回 利付国庫債券（20年）	320,000,000	344,988,800	
	57回 利付国庫債券（20年）	108,000,000	111,431,160	
	60回 利付国庫債券（20年）	825,000,000	795,993,000	
	65回 利付国庫債券（20年）	455,000,000	463,294,650	
	70回 利付国庫債券（20年）	406,000,000	439,174,260	
	73回 利付国庫債券（20年）	1,527,000,000	1,566,488,220	
	84回 利付国庫債券（20年）	2,254,000,000	2,298,809,520	
	90回 利付国庫債券（20年）	230,000,000	240,665,100	

	9 1回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	137,933,900
	9 6回 利付国庫債券(20年)	682,000,000	701,948,500
	7回 物価連動国債(10年)	750,000,000	625,131,000
	8回 物価連動国債(10年)	1,470,000,000	1,235,141,040
	1 2回 物価連動国債(10年)	1,560,000,000	1,312,052,040
国債証券計			25,018,337,520
地方債証券	3回 京都府京都みらい債	39,880,000	39,749,193
	1 6年度1回 あいち県民債	39,600,000	39,640,392
	1 6年度2回 あいち県民債	23,500,000	23,505,875
	1 7年度1回 あいち県民債	25,600,000	25,577,472
	1 6年度2回 大阪市みおつくし債	22,400,000	22,407,840
	1 7年度1回 大阪市みおつくし債	17,550,000	17,513,671
地方債証券計			168,394,443
社債券	1 9回 GEキャピタル円貨債	1,200,000,000	1,105,056,000
	5回 ルノー円貨債	300,000,000	241,938,000
	7回 ルノー円貨債	700,000,000	620,893,000
	8回 ルノー円貨債	300,000,000	249,612,000
	1 0回 前田建設工業社債	400,000,000	388,876,000
	1回 アコーディア・ゴルフ無担保社債	500,000,000	415,970,000
	2 1回 サッポロホールディングス社債	100,000,000	98,774,000
	1 0回 双日社債	700,000,000	682,612,000
	1 5回 双日社債	500,000,000	457,985,000
	1回 野村不動産ホールディングス社債	700,000,000	674,009,000
	4回 セントラル硝子 転換社債	873,000,000	851,175,000
	4回 コスモ石油転換社債型新株予約権付社債	701,000,000	669,455,000
	7回 日本板硝子社債	200,000,000	190,474,000
	1回 コバレントマテリアル社債	1,000,000,000	826,700,000
	1 6回 太平洋セメント社債	100,000,000	90,127,000
	1 7回 太平洋セメント社債	200,000,000	188,302,000
	1 8回 太平洋セメント社債	200,000,000	186,706,000
	5回 愛知製鋼転換社債	1,000,000,000	915,500,000
	1回 大豊工業転換社債型新株予約権付社債	120,000,000	108,000,000
	5回 エルピーダメモリ社債	1,200,000,000	679,332,000
	1 0回 NEC 転換社債	889,000,000	831,215,000
	2 0 シャープ C B	41,000,000	34,645,000
	4回 アンリツ社債	200,000,000	177,146,000
	9回 三洋電機社債	600,000,000	602,268,000
	1 6回 三洋電機社債	100,000,000	99,887,000
	3 3回 石川島播磨重工業社債	1,000,000,000	971,850,000
	1 4回 トピー工業社債	400,000,000	403,368,000
	2回 ドン・キホーテ社債	1,100,000,000	1,069,266,000
	1 2回 大日本スクリーン社債	300,000,000	256,425,000
	4回 三愛石油社債	700,000,000	692,972,000
	9回 丸井転換社債	140,000,000	129,360,000
	5回 イズミ転換社債	186,000,000	182,838,000
	5回 平和堂 転換社債	205,000,000	181,937,500
	1回 東京スター銀行社債	400,000,000	384,548,000
	1 4回 ポケットカード社債	1,200,000,000	1,081,968,000
	1 4回 アコム社債	300,000,000	298,332,000
	3 7回 アコム社債	100,000,000	96,206,000
	3 8回 アコム社債	100,000,000	98,642,000
	1回 アプラス社債	800,000,000	696,560,000

	6回 平和不動産社債	500,000,000	493,425,000	
	7回 平和不動産社債	600,000,000	558,414,000	
	7回 平和不動産転換社債	37,000,000	30,155,000	
	6回 東京建物社債	100,000,000	92,357,000	
	8回 東京建物社債	400,000,000	328,108,000	
	11回 東急不動産社債	600,000,000	587,712,000	
	51回 住友不動産社債	100,000,000	99,190,000	
	54回 住友不動産社債	100,000,000	96,009,000	
	56回 住友不動産社債	200,000,000	190,782,000	
	57回 住友不動産社債	100,000,000	95,062,000	
	59回 住友不動産社債	100,000,000	89,972,000	
	74回 東武鉄道社債	200,000,000	199,402,000	
	18回 山陽電鉄社債	100,000,000	99,087,000	
	4回 丸全昭和運輸転換社債	240,000,000	219,600,000	
	19回 全日本空輸社債	200,000,000	188,270,000	
	6回 澁澤倉庫社債	400,000,000	404,756,000	
	25回 ソフトバンク社債	400,000,000	349,644,000	
	ホシデンJPY建てCB 3/31/09	146,000,000	145,781,000	
	東芝JPY建て転換制限条項付CB 7/21/09	50,000,000	49,687,500	
	高島屋JPY建てCB 2/26/10	150,000,000	145,200,000	
	トヨタモータークレジット0.55% 6/30/10	100,000,000	98,490,000	
	日本特殊陶業JPY建てCB 3/31/11	68,000,000	68,136,000	
	商船三井JPY建てCB 3/29/11	85,000,000	81,472,500	
	イー・アクセスJPY建てCB 6/28/11	500,000,000	465,000,000	
	リコーJPY建てCB 12/7/11	85,000,000	81,897,500	
	東洋紡績JPY建てCB 3/23/12	450,000,000	431,325,000	
	トヨタモータークレジット1.3% 3/16/12	250,000,000	245,600,000	
	ヤマダ電機JPY建て転換制限条項付CB 3/28/13	220,000,000	180,400,000	
	太平洋セメントJPY建てCB 5/11/14	400,000,000	344,000,000	
	富士電機ホールディングスJPY建てCB 6/1/16	100,000,000	97,950,000	
	凸版印刷JPY建て転換制限条項付CB 6/12/18	30,000,000	28,935,000	
	日立金属JPY建て取得条項付CB 9/13/19	50,000,000	47,125,000	
	社債券計		24,563,874,000	
	合計		49,750,605,963	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

バランス物語30(安定型)

平成21年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	11,655,416,970円
負債総額	14,967,486円
純資産総額(-)	11,640,449,484円
発行済数量	13,261,990,219口
1口当たり純資産額(/)	0.8777円

バランス物語50(安定・成長型)

平成21年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	4,895,307,742円
負債総額	20,321,025円
純資産総額(-)	4,874,986,717円
発行済数量	5,994,567,233口
1口当たり純資産額(/)	0.8132円

バランス物語70(成長型)

平成21年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	2,634,039,501円
負債総額	3,543,094円
純資産総額(-)	2,630,496,407円
発行済数量	3,499,195,480口
1口当たり純資産額(/)	0.7517円

(参考)マザーファンドの現況

D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成21年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	10,405,940,715円
負債総額	- 円
純資産総額(-)	10,405,940,715円
発行済数量	13,031,465,083口
1口当たり純資産額(/)	0.7985円

D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成21年3月25日現在

項目	金額又は口数
資産総額	29,697,781,027円
負債総額	262,653,926円
純資産総額(-)	29,435,127,101円

発行済数量	31,499,994,830口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9344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21年3月25日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	13,977,696,418円
負債総額	156,503,290円
純資産総額（ - ）	13,821,193,128円
発行済数量	8,267,076,088口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6718円

D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成21年3月25日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	50,500,290,298円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	50,500,290,298円
発行済数量	42,847,920,035口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1786円

第5【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

バランス物語30（安定型）

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

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

バランス物語50（安定・成長型）

	設定口数	解約口数
第1期	9,757,408,415	336,218,737
第2期	2,222,012,375	669,464,883

第3期	1,082,252,628	576,566,653
第4期	271,787,655	819,878,871
第5期	524,918,461	700,011,219
第6期	394,096,699	674,492,749
第7期	352,730,223	913,236,306
第8期	312,319,365	897,957,058
第9期	310,444,579	1,052,016,315
第10期	851,740,445	1,377,642,526
第11期	971,313,753	696,726,325
第12期	172,072,707	922,846,422
第13期	113,906,019	784,590,427
第14期	95,691,183	567,728,975
第15期	107,427,913	328,740,738
第16期	94,289,964	294,957,841

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

バランス物語70（成長型）

	設定口数	解約口数
第1期	3,799,711,848	89,227,158
第2期	918,973,663	173,358,243
第3期	512,171,751	213,875,512
第4期	295,927,734	806,980,299
第5期	235,318,904	305,250,213
第6期	1,070,495,885	427,193,903
第7期	335,104,416	448,393,791
第8期	130,943,623	406,111,910
第9期	246,537,732	636,486,882
第10期	653,691,053	625,361,209
第11期	375,837,525	367,115,061
第12期	173,524,207	438,344,538
第13期	149,589,640	296,962,322
第14期	90,562,299	259,584,258
第15期	78,749,603	149,229,368
第16期	137,057,880	73,171,732

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

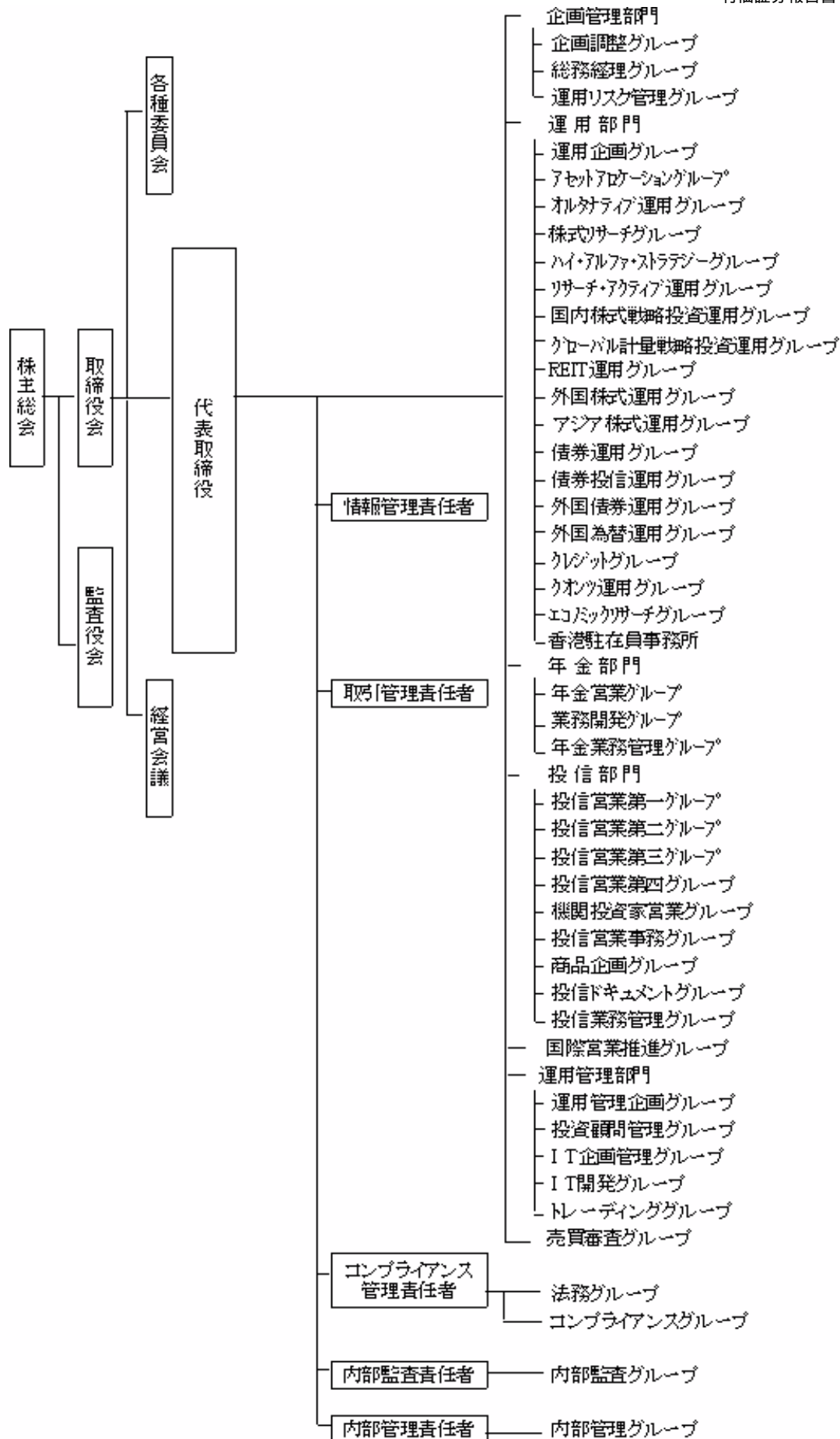
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成21年5月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

会社の意思決定機構

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

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

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

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決します。

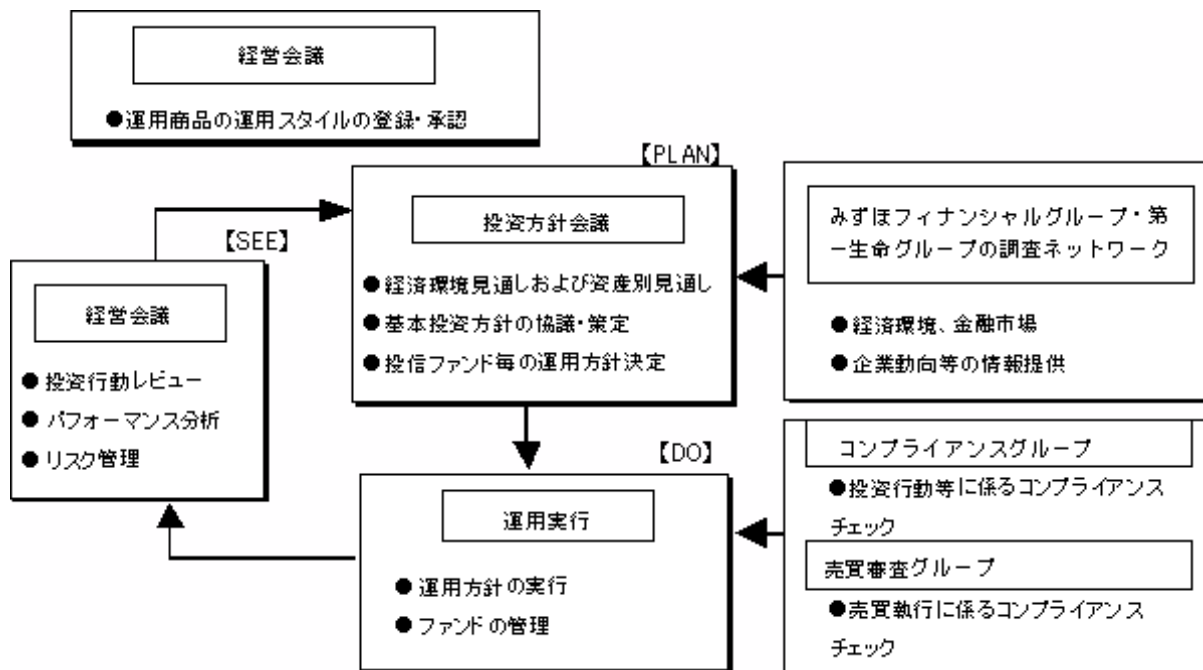
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成21年3月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成21年3月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は249本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	19	74,087,963,498
追加型株式投資信託	217	2,793,404,587,029
単位型公社債投資信託	13	105,985,839,128
追加型公社債投資信託	0	0
合計	249	2,973,478,389,655

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）または「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

なお、第24期中間会計期間（自平成20年4月1日至平成20年9月30日）は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成20年8月7日内閣府令第50号）附則第4条により改正前の中間財務諸表等規則に基づき作成しております。

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

3．委託会社は、証券取引法第193条の2の規定に基づき第22期事業年度（自平成18年4月1日至平成19年3月31日）の財務諸表について、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23期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）の財務諸表について、新日本監査法人の監査を受け、第24期中間会計期間（自平成20年4月1日至平成20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。

なお、新日本有限責任監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成20年7月1日をもって新日本監査法人から名称変更しております。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	第22期（平成19年3月31日現在）			第23期（平成20年3月31日現在）		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)
（資産の部）							
流動資産							
現金・預金			-		13,267,152		
現金			1,087		-		
預金			11,618,410		-		
支払委託金			5,262		-		
収益分配金		2,122			-		
償還金		3,139			-		
前払費用			52,870			64,301	
未収委託者報酬			3,305,752			3,423,783	
未収収益	2		1,989,832			1,933,135	
繰延税金資産			463,175			553,910	
その他			27,610			43,115	
流動資産計			17,464,001	81.0		19,285,400	73.5
固定資産							
有形固定資産			566,274	2.6		488,486	1.9
建物	1	385,746			335,163		
器具備品	1	180,528			153,323		
無形固定資産			621,524	2.9		616,621	2.3
商標権	1	2,872			2,104		
ソフトウェア	1	610,731			606,677		
電話加入権		7,148			7,148		
電話施設利用権	1	771			691		
投資その他の資産			2,897,263	13.5		5,842,772	22.3
投資有価証券		127,525			3,097,362		
関係会社株式		1,410,844			1,261,144		
繰延税金資産		144,409			233,849		
長期差入保証金		1,143,241			1,194,310		
預託金		1,000			-		
その他		97,471			83,032		
貸倒引当金		27,228			26,925		
固定資産計			4,085,063	19.0		6,947,880	26.5
資産合計			21,549,064	100.0		26,233,280	100.0

区分	注記 番号	第22期（平成19年3月31日現在）			第23期（平成20年3月31日現在）		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)
（負債の部）							
流動負債							
預り金			173,471		162,809		
未払金			1,775,461		2,186,170		
未払収益分配金		8,569		8,470			
未払償還金		53,576		50,930			
未払手数料		1,464,902		1,527,000			
その他未払金		248,414		599,769			
未払費用	2		1,656,967		1,653,424		
未払法人税等			2,262,679		2,575,999		
未払消費税等			279,396		316,821		
前受収益			3,433		-		
賞与引当金			557,836		687,832		
流動負債計			6,709,246	31.1	7,583,058	28.9	
固定負債							
役員退職慰労引当金			121,274		179,237		
退職給付引当金			182,197		334,280		
固定負債計			303,471	1.4	513,518	1.9	
負債合計			7,012,717	32.5	8,096,577	30.8	
（純資産の部）							
株主資本							
資本金			2,000,000	9.3	2,000,000	7.6	
資本剰余金			2,428,478	11.3	2,428,478	9.3	
資本準備金		2,428,478		2,428,478			
利益剰余金			10,106,875	46.9	13,718,238	52.3	
利益準備金		123,293		123,293			
その他利益剰余金							
別途積立金		4,640,000		7,040,000			
研究開発積立金		300,000		300,000			
運用責任準備積立金		200,000		200,000			
繰越利益剰余金		4,843,582		6,054,944			
株主資本合計			14,535,353	67.5	18,146,716	69.2	
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金			992		10,012		
評価・換算差額等合計			992	0.0	10,012	0.0	
純資産合計			14,536,346	67.5	18,136,703	69.2	
負債・純資産合計			21,549,064	100.0	26,233,280	100.0	

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)			第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
営業収益			32,125,919	100.0		40,502,581	100.0
委託者報酬		25,222,520			32,833,957		
販売手数料		2,990			-		
顧問料		6,207,737			6,804,888		
その他営業収益		692,671			863,734		
営業費用							
支払手数料			11,361,954			14,748,737	
広告宣伝費			539,570			830,858	
公告費			11,612			3,293	
受益証券発行費			51,476			2,167	
調査費			4,740,502			6,268,709	
調査費		2,194,949			2,415,829		
委託調査費		2,545,553			3,852,880		
委託計算費			383,253			345,695	
営業雑経費			690,767			1,143,457	
通信費		23,506			33,290		
印刷費		600,301			1,041,499		
協会費		18,099			22,173		
諸会費		38			41		
支払販売手数料		48,822			46,452		
営業費用計			17,779,137	55.3		23,342,919	57.6
一般管理費							
給料			3,631,878			4,082,147	
役員報酬	1	205,347			223,147		
給料・手当		2,916,607			3,258,097		
賞与		509,924			600,902		
交際費			43,931			44,264	
寄付金			20			4,010	
旅費交通費			249,538			309,129	
租税公課			85,465			103,549	
不動産賃借料			702,262			754,728	
退職給付費用			73,952			88,449	
固定資産減価償却費			357,945			337,808	
福利厚生費			19,772			23,757	
修繕費			65,984			16,394	
賞与引当金繰入			557,836			687,832	
役員退職慰労引当金繰入			53,548			60,123	
役員退職金			528			528	
機器リース料			9,688			1,207	
事務委託費			188,274			279,797	
消耗品費			46,333			76,448	
器具備品費			63,518			10,563	
諸経費			200,560			204,099	
一般管理費計			6,351,042	19.8		7,084,837	17.5
営業利益			7,995,739	24.9		10,074,823	24.9

区分	注記 番号	第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)			第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
営業外収益							
受取配当金		6,575			92,575		
受取利息		16,790			59,127		
時効成立分配金		306			298		
投資信託解約益		138,631			-		
為替差益		-			14,223		
雑収入		3,092			7,064		
営業外収益計			165,395	0.5		173,289	0.4
営業外費用							
為替差損		36,555			-		
時効成立後支払分配金		672			557		
投資信託解約損		-			109,677		
営業外費用計			37,227	0.1		110,234	0.3
経常利益			8,123,907	25.3		10,137,878	25.0
特別利益							
関係会社株式売却益		-			39,215		
貸倒引当金戻入益		-			123		
特別利益計			-	-		39,338	0.1
特別損失							
固定資産除却損	2	11,778			10,466		
貯蔵品処分損		84,277			-		
ゴルフ会員権売却損		-			5,200		
退職給付費用		-			106,395		
特別損失計			96,055	0.3		122,062	0.3
税引前当期純利益			8,027,852	25.0		10,055,154	24.8
法人税、住民税及び事業税					4,252,414		
法人税等	3	3,397,409			-		
法人税等調整額		115,869	3,281,540	10.2	172,622	4,079,792	10.0
当期純利益			4,746,311	14.8		5,975,362	14.8

（３）【株主資本等変動計算書】

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本 剰余金	利益 準備金	利益剰余金				
		資本 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	
平成18年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	3,240,000	300,000	200,000	3,297,270	11,589,042
事業年度中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							1,800,000	1,800,000
別途積立金の 積立（千円）				1,400,000			1,400,000	-
当期純利益 （千円）							4,746,311	4,746,311
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）								
事業年度中の 変動額合計（千円）	-	-	-	1,400,000	-	-	1,546,311	2,946,311
平成19年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	4,640,000	300,000	200,000	4,843,582	14,535,353

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成18年3月31日 残高（千円）	-	11,589,042
事業年度中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		1,800,000
別途積立金の 積立（千円）		-
当期純利益 （千円）		4,746,311
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）	992	992
事業年度中の 変動額合計（千円）	992	2,947,304
平成19年3月31日 残高（千円）	992	14,536,346

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本 剰余金	利益 準備金	利益剰余金				
		資本 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	
平成19年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	4,640,000	300,000	200,000	4,843,582	14,535,353
事業年度中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							2,364,000	2,364,000
別途積立金の 積立（千円）				2,400,000			2,400,000	-
当期純利益 （千円）							5,975,362	5,975,362
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）								
事業年度中の 変動額合計（千円）	-	-	-	2,400,000	-	-	1,211,362	3,611,362
平成20年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	7,040,000	300,000	200,000	6,054,944	18,146,716

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成19年3月31日 残高（千円）	992	14,536,346
事業年度中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		2,364,000
別途積立金の 積立（千円）		-
当期純利益 （千円）		5,975,362
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）	11,004	11,004
事業年度中の 変動額合計（千円）	11,004	3,600,357
平成20年3月31日 残高（千円）	10,012	18,136,703

[次へ](#)

重要な会計方針

第22期 (自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日)	第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 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> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>5. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上してしております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上してしております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 同左</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度より、法人税法の改正(「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」)に伴い、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正法人税法に規定する方法により減価償却費を計上してしております。 なお、この変更による営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(追加情報) 当事業年度より、法人税法の改正(「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」)に伴い、平成19年3月31日以前に取得した有形固定資産については、償却可能限度額まで償却が終了した翌事業年度から、残存簿価を5年間で均等償却してしております。 なお、これにより営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 同左</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>5. 引当金の計上基準 (1) 同左 (2) 同左</p>

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職給付会計に関する実務指針（中間報告）（日本公認会計士協会会計制度委員会報告第13号）に定める簡便法（期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法）により、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>6. リース取引の処理方法 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更) 従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用しておりましたが、当事業年度末から原則法に変更いたしました。 この変更は、従業員数の増加に伴い、退職給付債務の数理計算に用いられる基礎率の推定について一定の有効性が確保されることによって、原則法による計算の結果に一定の高い水準の信頼性が得られたことから、退職給付費用の期間損益計算をより適正化するために行ったものであります。 この変更に伴い、当事業年度末における簡便法と原則法により計算した退職給付債務の差額106,395千円を特別損失に計上しております。この結果、従来と同一の方法によった場合と比較して、税引前当期純利益は106,395千円減少しております。 なお、上記に記載の通り退職給付債務の算定方法の変更が当事業年度末に行われたため、当中間会計期間は従来の方法によっております。したがって、当中間会計期間は、当事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。</p> <p>(4) 同左</p> <p>6. リース取引の処理方法 同左</p> <p>7. 消費税等の処理方法 同左</p>

会計方針の変更

第22期（平成19年3月31日現在）	第23期（平成20年3月31日現在）
<p>(貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準) 当事業年度より、貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等（「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準委員会平成17年12月9日企業会計基準第5号）および「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（企業会計基準委員会平成17年12月9日企業会計基準適用指針第8号））を適用しております。従来の「資本の部」の合計に相当する金額は14,536,346千円であります。 なお、当事業年度における貸借対照表の純資産の部については、財務諸表等規則および「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」の改正に伴い、改正後の財務諸表等規則および「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」により作成しております。</p>	

表示方法の変更

第22期（平成19年3月31日現在）	第23期（平成20年3月31日現在）

	<p>金融商品取引業等に関する内閣府令が制定されたことに伴い、以下のとおり表示方法を変更しております。</p> <p>（貸借対照表）</p> <p>前事業年度において区分掲記していた「現金」および「預金」は、当事業年度から「現金・預金」として表示しております。なお、当事業年度末における「現金」および「預金」の金額はそれぞれ1,205千円、13,265,946千円であります。</p> <p>（損益計算書）</p> <p>前事業年度において区分掲記していた「法人税等」は当事業年度から「法人税、住民税及び事業税」として表示しております。</p>
--	--

注記事項

（貸借対照表関係）

第22期（平成19年3月31日現在）	第23期（平成20年3月31日現在）																																
<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <table border="1"> <tr><td>建物</td><td>310,209千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>169,451千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td>4,814千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>677,186千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td>825千円</td></tr> </table> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。</p> <table border="1"> <tr><td>流動資産</td><td>未収収益</td><td>367,395千円</td></tr> <tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td>694,532千円</td></tr> </table>	建物	310,209千円	器具備品	169,451千円	商標権	4,814千円	ソフトウェア	677,186千円	電話施設利用権	825千円	流動資産	未収収益	367,395千円	流動負債	未払費用	694,532千円	<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <table border="1"> <tr><td>建物</td><td>373,021千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>229,532千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td>5,582千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>653,371千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td>905千円</td></tr> </table> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。</p> <table border="1"> <tr><td>流動資産</td><td>未収収益</td><td>379,257千円</td></tr> <tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td>641,087千円</td></tr> </table>	建物	373,021千円	器具備品	229,532千円	商標権	5,582千円	ソフトウェア	653,371千円	電話施設利用権	905千円	流動資産	未収収益	379,257千円	流動負債	未払費用	641,087千円
建物	310,209千円																																
器具備品	169,451千円																																
商標権	4,814千円																																
ソフトウェア	677,186千円																																
電話施設利用権	825千円																																
流動資産	未収収益	367,395千円																															
流動負債	未払費用	694,532千円																															
建物	373,021千円																																
器具備品	229,532千円																																
商標権	5,582千円																																
ソフトウェア	653,371千円																																
電話施設利用権	905千円																																
流動資産	未収収益	379,257千円																															
流動負債	未払費用	641,087千円																															

（損益計算書関係）

第22期 （自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）	第23期 （自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）																
<p>1. 役員報酬の限度額</p> <table border="1"> <tr><td>取締役</td><td>年額250,000千円</td></tr> <tr><td>監査役</td><td>年額 50,000千円</td></tr> </table> <p>2. 固定資産除却損の内訳</p> <table border="1"> <tr><td>建物</td><td>4,738千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>5,960千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>1,079千円</td></tr> </table> <p>3. 法人税等には、法人住民税および事業税が含まれております。</p>	取締役	年額250,000千円	監査役	年額 50,000千円	建物	4,738千円	器具備品	5,960千円	ソフトウェア	1,079千円	<p>1. 役員報酬の限度額</p> <p>同左</p> <p>2. 固定資産除却損の内訳</p> <table border="1"> <tr><td>建物</td><td>3,634千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>5,271千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>1,560千円</td></tr> </table> <p>3.</p>	建物	3,634千円	器具備品	5,271千円	ソフトウェア	1,560千円
取締役	年額250,000千円																
監査役	年額 50,000千円																
建物	4,738千円																
器具備品	5,960千円																
ソフトウェア	1,079千円																
建物	3,634千円																
器具備品	5,271千円																
ソフトウェア	1,560千円																

（株主資本等変動計算書関係）

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成18年6月28日 定時株主総会	普通 株式	1,800,000	75,000	平成18年3月31日	平成18年6月29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19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29日

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29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20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

(リース取引関係)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)				第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)			
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	91,585千円	-	91,585千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額相当額	39,283千円	-	39,283千円	減価償却累計額相当額	29,608千円	-	29,608千円
期末残高相当額	52,301千円	-	52,301千円	期末残高相当額	60,993千円	-	60,993千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料	18,391千円			未経過リース料	22,595千円		
期末残高相当額		38,155千円	56,546千円	期末残高相当額		39,602千円	62,197千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額			
支払リース料		20,361千円		支払リース料		25,173千円	
減価償却費相当額		16,593千円		減価償却費相当額		20,191千円	
支払利息相当額		1,717千円		支払利息相当額		1,754千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2.オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。				2.オペレーティング・リース取引 同左			

（有価証券関係）

第22期（平成19年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	60,000	61,674	1,674
小計	60,000	61,674	1,674
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	60,000	61,674	1,674

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
1,661,631	138,848	217

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 65,851千円

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

該当事項はありません。

第23期（平成20年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,031,000	3,014,115	16,884
小計	3,031,000	3,014,115	16,884
合計	3,031,000	3,014,115	16,884

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
574,322	3,196	112,873

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 83,246千円

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

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第22期（平成19年3月31日現在）

1．取引の状況に関する事項

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替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。
(5)取引に係るリスク管理体制	取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2．取引の時価等に関する事項

区分	種類	第22期(平成19年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	59,269	-	59,231	38
合計		59,269	-	59,231	38

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

第23期（平成20年3月31日現在）

1. 取引の状況に関する事項

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替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。
(5)取引に係るリスク管理体制	取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2. 取引の時価等に関する事項

区分	種類	第23期(平成20年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	523,028	-	508,267	14,760
	合計	523,028	-	508,267	14,760

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

（退職給付関係）

第22期（平成19年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

当社は、簡便法（退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法）を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成19年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務	(期末自己都合要支給額)	182,197
	退職給付引当金		182,197
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		48,032
	確定拠出年金	拠出額	25,920
	退職給付費用		73,952

第23期（平成20年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

当社は、当事業年度末から原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成20年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		334,280
	退職給付引当金		334,280
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		165,213
	確定拠出年金	拠出額	29,631
	退職給付費用		194,844

3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第23期 (平成20年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第22期	第23期
	(平成19年3月31日現在)	(平成20年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	172,434	197,866
未払事業所税	5,303	5,714
賞与引当金	227,039	279,947
未払法定福利費	24,208	27,884
未払確定拠出年金掛金	1,506	2,610
減価償却超過額（一括償却資産）	12,020	10,139
繰延資産償却超過額（税法上）	20,071	27,940
その他（未払金等）	590	1,807
退職給付引当金	74,154	136,052
役員退職慰労引当金	49,358	72,949
ゴルフ会員権評価損	3,135	3,135
貸倒引当金繰入額	18,442	14,840
其他有価証券評価差額金	-	6,871
繰延税金資産合計	608,266	787,759
繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	681	-
繰延税金負債合計	681	-
差引繰延税金資産の純額	607,584	787,759

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

第22期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第23期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（持分法損益等）

第22期(平成19年3月31日現在)	第23期(平成20年3月31日現在)
関連会社に関する投資の金額 149,700千円	
持分法を適用した場合の投資の金額 329,065千円	
持分法を適用した場合の投資利益の金額 75,398千円	

(関連当事者との取引)

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名，出向3名，転籍2名	資産の運用および助言、当社設定投信の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	841,610	未収収益	240,078
								販売手数料の支払	48,822	-	-
								保険料の支払	5,031	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DLIBJ Asset Management 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	875,761	未払費用	447,362
	DLIBJ Asset Management 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	461,432	未払費用	246,903

取引条件および取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を含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) 上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業 の 内容 又は 職業	議決権 等の 所有（被 所有） 割合	関係内容		取引の 内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員 の 兼任 等	事業上 の 関係				
兄弟 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	6,500 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投信 の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	1,987,532	未払 手 数 料	198,163
	株式会社 みずほコーポレート銀行	東京都 千代田 区	10,709 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投信 の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	576,293	未払 手 数 料	97,572
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究 等	-	-	当社預 り資産 の 運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払 業務委託 料の支払	355,655 21,239	未払 費用 -	161,101 -

取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を含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）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を含めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注3）業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の 名称	住所	資本金又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関係内容		取引の 内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員 の 兼任 等	事業上 の 関係				
法人 主 要 株 主	第一生命 保険相互 会社	東京都 千代田 区	4,200億円 （基金およ び基金償却 積立金）	生命保 険業	（被所有） 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産の運 用および 助言、当社 設定投信 の販売	資産運用 の 助言の顧 問料の受 入	833,702	未収 収益	219,740
								販売手 数 料 の 支 払	46,452	-	-
								保険料の 支払	5,707	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注2）支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業 の内容 又は 職業	議決権 等の所 有（被 所有） 割合	関係内容		取引の内 容	取引 金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産 の運 用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運 用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	1,096,514	未払 費用	456,913
	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	466,450	未払 費用	184,052

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業 の内容 又は 職業	議決権 等の所 有（被 所有） 割合	関係内容		取引の内 容	取引 金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
兄 弟 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	6,500 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	2,104,660	未払 手数料	145,839
	株式会社 みずほコーポレート銀行	東京都 千代田 区	10,709 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	739,368	未払 手数料	137,112
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究 等	-	-	当社預 り資産 の 運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払 業務委託 料の支払	340,983 16,800	未払 費用 -	153,240 -

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(1株当たり情報)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
1株当たり純資産額 605,681円10銭 1株当たり当期純利益金額 197,762円99銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 755,695円99銭 1株当たり当期純利益金額 248,973円42銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
当期純利益	4,746,311千円	5,975,362千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,746,311千円	5,975,362千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
	平成20年3月28日開催の取締役会の決議により、平成20年4月1日付にて100%出資の子会社DIAM SINGAPORE PTE.LTD.を設立し、その後、平成20年4月14日付にて株主割当増資を実施いたしました。(出資の総額400,000千円、資本金400,000千円)

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

区分	注記番号	第24期中間会計期間末（平成20年9月30日現在）		
		内訳（千円）	金額（千円）	構成比（％）
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金			12,331,764	
前払費用			113,461	
未収委託者報酬			3,183,483	
未収運用受託報酬			1,545,690	
未収投資助言報酬			377,271	
未収収益			258,713	
繰延税金資産			502,506	
その他			55,461	
流動資産合計			18,368,353	77.6
固定資産				
有形固定資産			510,393	2.1
建物	1	310,866		
器具備品	1	146,942		
建設仮勘定		52,584		
無形固定資産			708,817	3.0
商標権	1	1,719		
ソフトウェア	1	561,075		
ソフトウェア仮勘定		138,221		
電話加入権		7,148		
電話施設利用権	1	651		
投資その他の資産			4,096,042	17.3
投資有価証券		766,642		
関係会社株式		1,661,144		
繰延税金資産		317,458		
長期差入保証金		1,169,961		
その他		207,761		
貸倒引当金		26,925		
固定資産合計			5,315,252	22.4
資産合計			23,683,606	100.0

区分	注記番号	第24期中間会計期間末（平成20年9月30日現在）		
		内訳（千円）	金額（千円）	構成比（％）
（負債の部）				
流動負債				
預り金			38,403	
未払金			1,779,310	
未払収益分配金		8,311		
未払償還金		50,646		
未払手数料		1,373,667		
その他未払金		346,684		
未払費用			1,572,614	
未払法人税等			1,594,756	
未払消費税等			91,285	
前受収益			12,580	
賞与引当金			715,530	
その他			365	
流動負債合計			5,804,848	24.5
固定負債				
退職給付引当金			369,364	
役員退職慰労引当金			147,947	
固定負債合計			517,311	2.2
負債合計			6,322,159	26.7
（純資産の部）				
株主資本				
資本金			2,000,000	8.4
資本剰余金			2,428,478	10.2
資本準備金		2,428,478		
利益剰余金			13,062,550	55.2
利益準備金		123,293		
その他利益剰余金				
別途積立金		10,040,000		
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		2,399,256		
株主資本合計			17,491,028	73.8
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金			129,581	
評価・換算差額等合計			129,581	0.5
純資産合計			17,361,446	73.3
負債・純資産合計			23,683,606	100.0

区分	注記番号	第24期中間会計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)		
		内訳(千円)	金額(千円)	百分比(%)
営業外収益				
受取配当金		1,575		
受取利息		30,350		
先物利益		97,476		
雑収入		3,796		
営業外収益合計			133,198	0.7
営業外費用				
為替差損		39,429		
時効成立後支払分配金		198		
投資信託解約損		38,254		
営業外費用合計			77,882	0.4
経常利益			3,981,874	21.9
特別損失				
固定資産除却損		2,315		
特別損失合計			2,315	0.0
税引前中間純利益			3,979,559	21.9
法人税、住民税及び事業税		1,585,387		
法人税等調整額		49,860	1,635,247	9.0
中間純利益			2,344,311	12.9

(3) 中間株主資本等変動計算書

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本 剰余金	利益 準備金	利益剰余金				
				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	
平成20年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	7,040,000	300,000	200,000	6,054,944	18,146,716
中間会計期間中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							3,000,000	3,000,000
別途積立金の 積立（千円）				3,000,000			3,000,000	-
中間純利益（千円）							2,344,311	2,344,311
株主資本以外の 項目の中間会計 期間中の変動額 （純額）（千円）								
中間会計期間中の 変動額合計（千円）	-	-	-	3,000,000	-	-	3,655,688	655,688
平成20年9月30日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	10,040,000	300,000	200,000	2,399,256	17,491,028

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成20年3月31日 残高（千円）	10,012	18,136,703
中間会計期間中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		3,000,000
別途積立金の 積立（千円）		-
中間純利益（千円）		2,344,311
株主資本以外の 項目の中間会計 期間中の変動額 （純額）（千円）	119,568	119,568
中間会計期間中の 変動額合計（千円）	119,568	775,257
平成20年9月30日 残高（千円）	129,581	17,361,446

[前へ](#) [次へ](#)

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

項目	第24期中間会計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)
1. 有価証券の評価基準および評価方法	(1)子会社株式および関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)其他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
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 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 …… 10～15年 器具備品 …… 2～15年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
4. 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。 (追加情報) 従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用していましたが、前事業年度末から原則法に変更いたしました。 なお、上記の通り退職給付債務の算定方法の変更が前事業年度末に行われたため、前中間会計期間は従来の方によっております。したがって、前中間会計期間は、前事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
5. 外貨建ての資産および負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
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：消費税および地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

会計方針の変更	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間会計期間から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当中間会計期間における中間貸借対照表および中間損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>
表示方法の変更	<p>（中間貸借対照表）</p> <p>1．前中間会計期間において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当中間会計期間から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前中間会計期間末における「未収運用受託報酬」の金額は1,600,614千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は410,692千円であります。</p> <p>2．前中間会計期間において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間から区分掲記しております。なお、前中間会計期間末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は27,931千円であります。</p> <p>（中間損益計算書）</p> <p>前中間会計期間において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当中間会計期間から区分掲記しております。なお、前中間会計期間における「運用受託報酬」の金額は2,551,064千円であり、「投資助言報酬」の金額は735,233千円であります。</p>

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第24期中間会計期間末 （平成20年9月30日現在）	
1．固定資産の減価償却累計額	建物	... 401,730千円
	器具備品	... 261,226千円
	商標権	... 5,967千円
	ソフトウェア	... 549,824千円
	電話施設利用権	... 945千円

（中間損益計算書関係）

項目	第24期中間会計期間 （自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）	
1．減価償却実施額	有形固定資産	... 62,606千円
	無形固定資産	... 103,590千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(リース取引関係)

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

1. ファイナンス・リース取引

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

リース資産の内容
該当事項はありません。

リース資産の減価償却の方法

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および中間期末残高相当額

	器具備品
取得価額相当額	90,601千円
減価償却累計額相当額	40,972千円
中間期末残高相当額	49,629千円

未経過リース料中間期末残高相当額

	1年以内	1年超	合計
	22,920千円	28,059千円	50,980千円

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額

支払リース料	12,048千円
減価償却費相当額	11,363千円
支払利息相当額	831千円

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

(有価証券関係)

第24期中間会計期間末（平成20年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券で時価のあるもの
該当事項はありません。
2. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの
該当事項はありません。
3. その他有価証券で時価のあるもの

区分	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額(千円)	差額 (千円)
株式	371,914	304,829	67,084
債券	-	-	-
その他(投資信託)	529,999	378,566	151,433
合計	901,914	683,396	218,518

4. 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

非上場株式(店頭売買株式を除く)

中間貸借対照表計上額

83,246千円

(デリバティブ取引関係)

デリバティブ取引の契約額等、時価および評価損益の状況

1. 通貨関連

対象物の種類	取引の種類	第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
通貨	為替予約取引 売建				
	米ドル	26,961	-	26,289	672
	香港ドル	33,800	-	34,075	275
	豪ドル	91,717	-	87,387	4,329
	シンガポールドル	16,233	-	16,323	89
	合計	168,712	-	164,076	4,636

2. 株式関連

対象物の種類	取引の種類	第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
株式	株価指数先物取引 売建	358,295	-	333,026	25,268
	合計	358,295	-	333,026	25,268

(持分法損益等)

第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第24期中間会計期間(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)

1株当たり純資産額 723,393円61銭
1株当たり中間純利益金額 97,679円66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24期中間会計期間
(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)

中間純利益	2,344,311千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,344,311千円
期中平均株式数	24,000株

(重要な後発事象)

第24期中間会計期間(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)
該当事項はありません。

[前](#)△

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己又はその取締役若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、若しくは取引の公正を害し、又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、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の実取引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。）又は子法人等（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又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又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、運用財産の額若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又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、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更
当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1) 受託会社****a. 名称**

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成20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。

(平成20年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほコーポレート銀行	1,070,965	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社みずほ銀行	650,000	日本において銀行業務を営んでおります。
日興コーディアル証券株式会社	100,000	「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。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間の間に、次の書類を提出いたしました。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成20年11月25日
有価証券報告書	平成20年11月25日

独立監査人の監査報告書

平成21年4月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

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20年8月26日から平成21年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語30（安定型）の平成21年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年4月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

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20年8月26日から平成21年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語50（安定・成長型）の平成21年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年4月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

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20年8月26日から平成21年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語70（成長型）の平成21年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

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

独立監査人の監査報告書

平成20年6月13日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[ファンド監査報告書3へ](#) [委託会社の監査報告書（中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成20年12月12日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 山本 禎良 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 山内 正彦 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20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20年4月1日から平成20年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

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20年2月26日から平成20年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語30（安定型）の平成20年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

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20年2月26日から平成20年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語50（安定・成長型）の平成20年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

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20年2月26日から平成20年8月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語70（成長型）の平成20年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

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

独立監査人の監査報告書

平成19年6月28日

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本監査法人

代表社員	公認会計士	山本 禎良	印
業務執行社員	公認会計士	山内 正彦	印

当監査法人は、証券取引法第193条の2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」に掲げられている興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社の平成18年4月1日から平成19年3月31日までの第22期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社の平成19年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[ファンド監査報告書3へ](#)