【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26年5月23日
【計算期間】	第26期（自　平成25年8月27日　至　平成26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】	ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　中島　敬雄
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目３番１号
【事務連絡者氏名】	上野　圭子
【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】

①各ファンドは、スイッチングの可能な3本のファンドから構成され、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

②各ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。
ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 ●分散投資

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

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

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

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

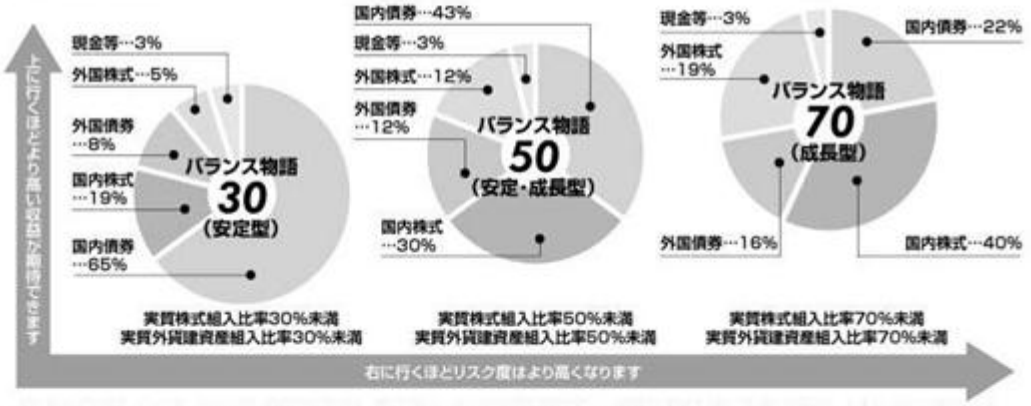
（注）当社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式についてはTOPIX（東証株価指数）、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース）、外国債券についてはシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

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

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

3ファンドの基本アロケーション

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



各ファンドは、同一のマザーファンドに投資を行うため、値動きの大きい株式・外貨建資産への投資割合が高いほど、リスク・リターンともより高くなります。

2 ●スイッチング※が可能です。

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

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

分配方針

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

・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

○商品分類表

バランス物語30（安定型）

バランス物語50（安定・成長型）

バランス物語70（成長型）

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

※単位型投信・追加型投信

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

※投資対象地域

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

※投資対象資産

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

○属性区分表

バランス物語30（安定型）

バランス物語50（安定・成長型）

バランス物語70（成長型）

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

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

（注）各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

※投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

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

※決算頻度

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

※投資対象地域

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

※投資形態

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

※為替ヘッジ

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

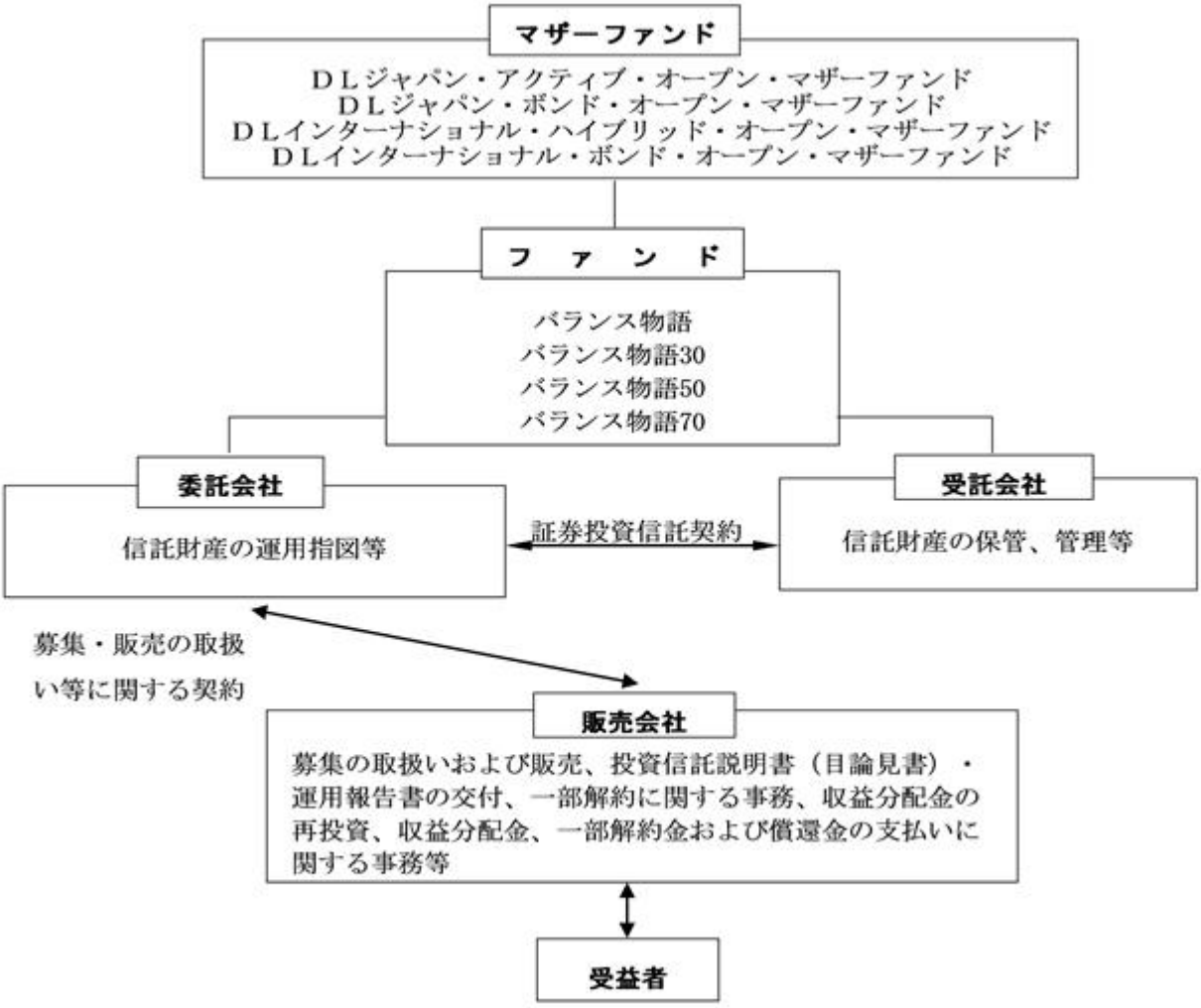
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（http：//www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

（２）【ファンドの沿革】

平成12年12月27日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



①委託会社：ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社

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

②受託会社：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

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

③販売会社

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

・「証券投資信託契約」の概要

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

●ファミリーファンド方式とは●

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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

○委託会社の概況

名称：ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

①資本金の額

20億円（平成26年2月28日現在）

②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「ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社」に商号変更

③大株主の状況

（平成26年2月28日現在）

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

・各ファンド

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

＜投資対象＞

・各ファンド

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を主要投資対象とします。

＜投資態度＞

・各ファンド

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めざします。

②各資産につき、基本アロケーションにおける資産毎の比率から±5%以内の範囲で配分比率の変動を抑えます。ただし、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

③実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、エクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

・バランス物語30（安定型）

④国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への投資割合の上限が30%未満、かつ外貨建資産への投資割合の上限が30%未満の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックス(注)をベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

・バランス物語50（安定・成長型）

④国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への投資割合の上限が50%未満、かつ外貨建資産への投資割合の上限が50%未満の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックス(注)をベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

・バランス物語70（成長型）

④国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への投資割合の上限が70%未満、かつ外貨建資産への投資割合の上限が70%未満の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックス(注)をベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

（注）当社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式についてはTOPIX（東証株価指数）※、国内債券についてはNOMURA‐BPI総合※、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース）※、外国債券についてはシティ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。

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

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

※ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース）は、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(米ドルベース)をもとに委託会社が独自に円換算したものです。
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスは、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．に属しており、また、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

※シティ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・マーケッツ・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・マーケッツ・インクに帰属します。

（２）【投資対象】

1.有価証券の指図範囲（約款第14条第1項）

委託会社は、信託金を、主として(1)から(4)までのＤＩＡＭ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書

(6)国債証券
(7)地方債証券
(8)特別の法律により法人の発行する債券
(9)社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
(10)特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
(11)特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
(12)協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
(13)特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
(14)コマーシャル・ペーパー
(15)新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
(16)外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)～(15)の証券または証書の性質を有するもの
(17)証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
(18)投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
(19)外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
(20)オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
(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上記(25)の有価証券の性質を有するもの

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

2.金融商品の指図範囲（約款第14条第2項）

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

(1)預金

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

(3)コール・ローン

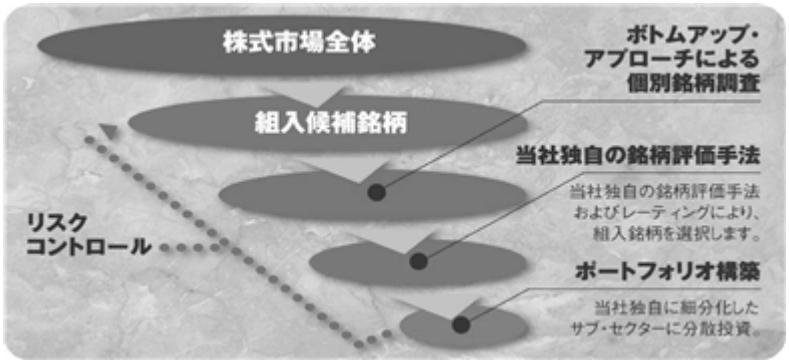
(4)手形割引市場において売買される手形

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

(6)外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

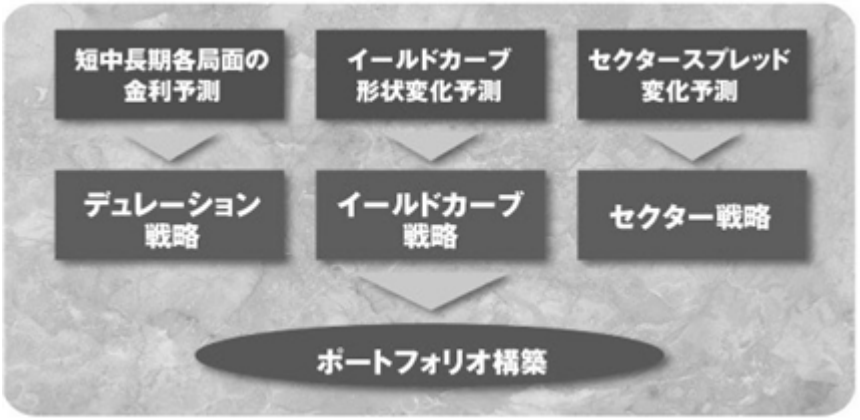
3.上記1.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記2.の(1)から(4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第14条第3項）

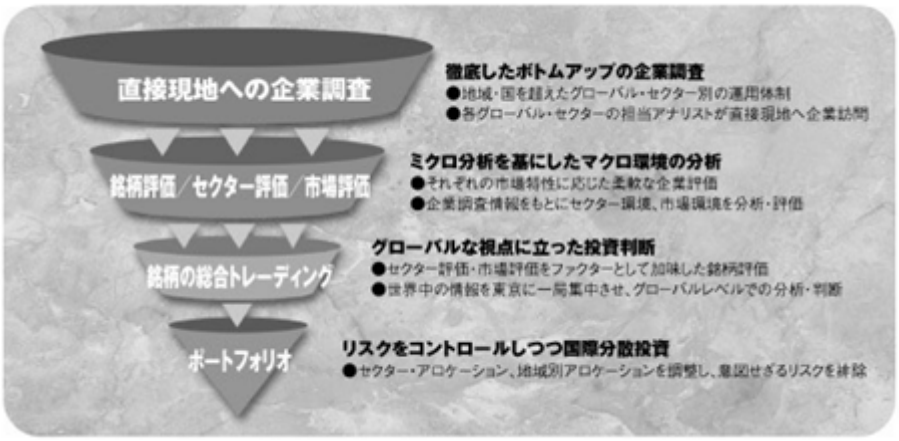
（参考）各ファンドが投資するマザーファンドの概要

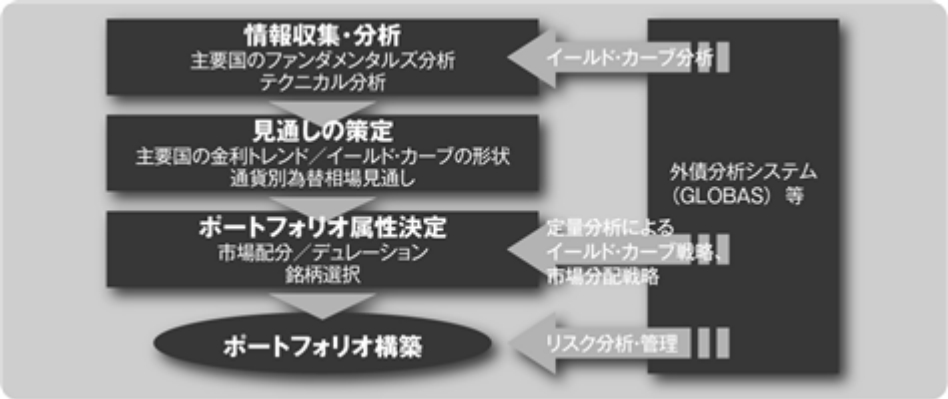
ファンド名	ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	日本の株式（全上場銘柄）を主要な投資対象とします。
投資態度	①ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）を中長期的に上回ることを目標に運用します。 ②企業のファンダメンタルズ分析を重視したボトムアップによる銘柄選択を行うことを原則とします。 ③銘柄選択はファンドマネージャーが自ら会社訪問を行い、企業の成長性と投資価値を総合的に判断し、組入銘柄を決定します。 ④株式の組入比率は、原則として100%に近い状態を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 ⑤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。
ポートフォリオ構築プロセス	1)全銘柄の中から、大型株と中小型株をセクター間の偏りを調整しつつ約600銘柄を組入候補銘柄群として選出します。 2)株式運用本部のアナリストおよびファンドマネージャーは、1)の組入候補銘柄について、企業訪問等を中心にした積極的な調査活動により個別銘柄の調査・分析を行います。 3)2)により得られた企業業績予測を、短期的・中長期的な視点で株価への織り込み度合い等から独自にレーティングし、バリュエーション評価を行ったうえ、組入銘柄を選出します。 4)3)により選出された組入銘柄を、委託会社独自に細分化したサブ・セクターに分散して投資を行います。  ※上記は、平成26年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

主な投資制限	①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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。 ⑥同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑦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。

ファンド名	ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることをめざ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	①ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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めざします。

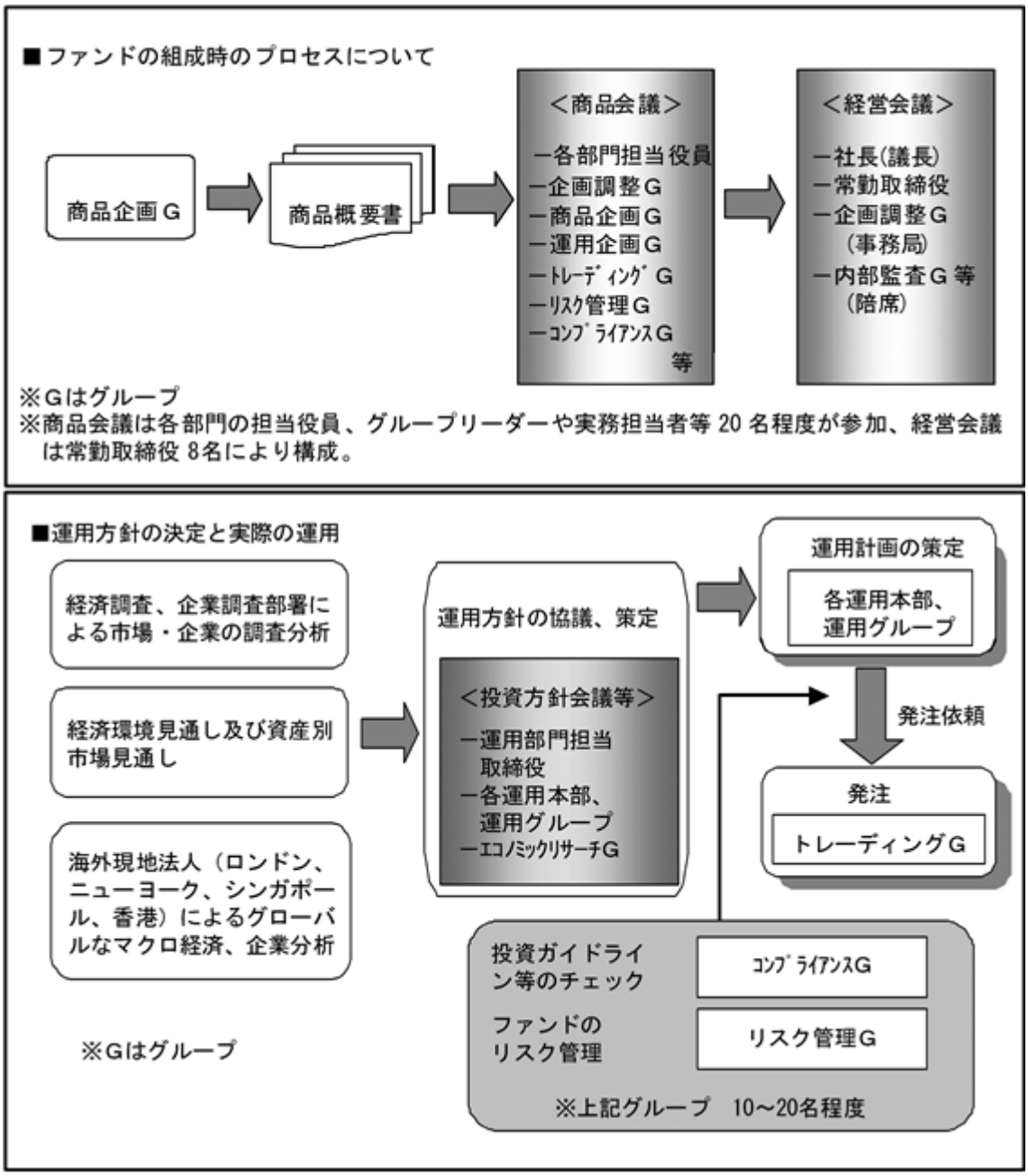
ポートフォリオ構築プロセス	1)マクロ経済分析をベースとしたファンダメンタルズ分析等に基づき、短中長期金利の方向性、イールドカーブ、セクタースプレッドの予測を行います。 2)1)により得られた分析に基づき、デュレーション戦略、イールドカーブ戦略および定性・定量分析に基づいた個別銘柄の決定を行い、ポートフォリオを構築します。 3)委託会社独自の円債分析システム「ＹＢＡＳ」を活用することで、きめ細かい定量分析・リスク分析を行い、ポートフォリオを構築します。  ※上記は、平成26年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
主な投資制限	①同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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。

ファンド名	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
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積極的な企業調査活動を基にしたボトムアップ・アプローチと各国のマクロ経済分析等によるトップダウン・アプローチを併用することによりポートフォリオを構築します。 ②ＭＳＣＩコクサイ・インデックスを長期的に上回ることをめざして運用を行います。 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。
ポートフォリオ構築プロセス	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。  ※上記は、平成26年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
主な投資制限	①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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。 ⑥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。 ⑦外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド名	ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	①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委託会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めざします。 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。
ポートフォリオ構築プロセス	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」等を活用し、為替・金利見通しに基づく市場配分・通貨配分戦略、デュレーション・償還構成戦略より、ポートフォリオ属性を決定・構築します。  ※上記は、平成26年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
主な投資制限	①同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】



※運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

＜ファンドの組成時のプロセスについて＞

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、各運用本部、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。
「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等から得られた情報も参考にされます。
個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。
なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

※上記体制は平成26年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

①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。

②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。

③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】

①「バランス物語30（安定型）」

(1)株式への実質投資割合（運用の基本方針　2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30％未満とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30％未満とします。

②「バランス物語50（安定・成長型）」

(1)株式への実質投資割合（運用の基本方針　2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％未満とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％未満とします。

③「バランス物語70（成長型）」

(1)株式への実質投資割合（運用の基本方針　2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70％未満とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70％未満とします。

①②③共通

(3)マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合（運用の基本方針　2.運用方法（3）投資制限）

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

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

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

(5)投資する株式等の範囲（約款第16条）

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

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

(6)同一銘柄の株式への実質投資制限（約款第17条第1項および第3項）

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

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

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

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

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

(8)同一銘柄の転換社債等への実質投資制限（約款第18条）

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

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

(9)信用取引の指図範囲（約款第19条）

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

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

1)信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2)株式分割により取得する株券

3)有償増資により取得する株券

4)売出しにより取得する株券

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

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

(10)先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第20条）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(11)スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第21条）

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

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

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

(d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元

本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(e)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

(f)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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

(a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(b)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

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

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

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

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

(13)有価証券の貸付の指図および範囲（約款第23条）

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

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

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

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

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

(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)上記(a)の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(c)信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(b)上記(a)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(c)信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(d)上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

(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)上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

(c)上記(b)においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(d)上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(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

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

○資産配分リスク

各資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産）の資産配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、±5%以内の変動に抑えます。
この資産配分が各ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、各ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

○国別配分リスク

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

○株式投資リスク

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

1)価格変動リスク

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

2)信用リスク

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

○債券投資リスク

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

1)金利リスク

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

2)信用リスク

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

○為替リスク

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

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

○カントリーリスク

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

(2)分配金に関する留意点

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

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

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

(3)その他の留意点

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

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

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

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

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

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

○注記事項

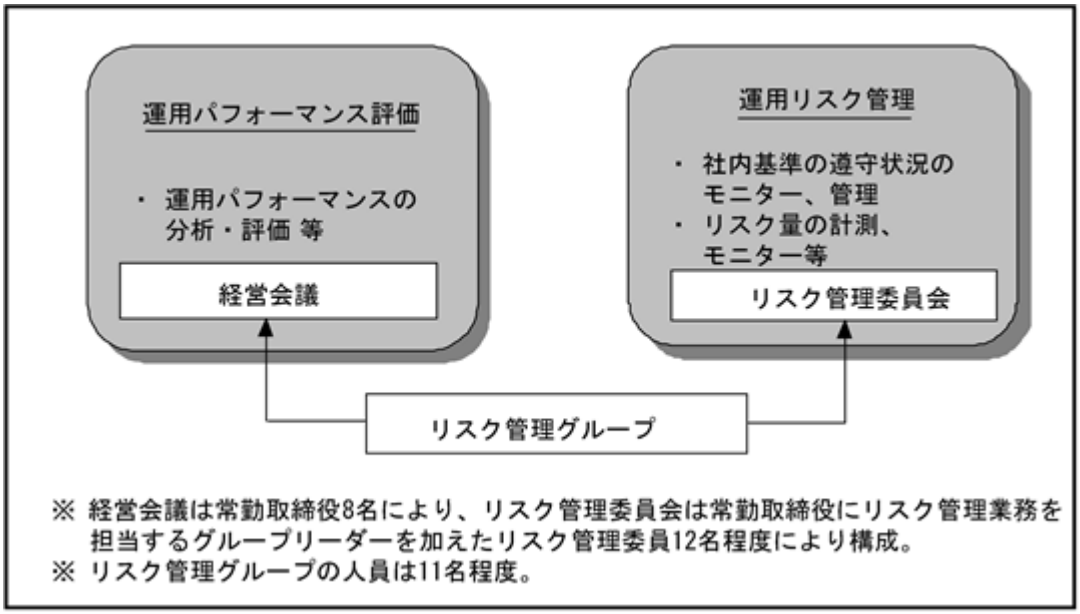
イ.各ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

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

ハ.投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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

＜運用評価・運用リスク管理体制＞



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

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

※上記体制は平成26年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

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

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

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

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

※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】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.62%（税抜1.50%）

信託報酬の配分（税抜）	
委託会社	年率0.75%
販売会社	年率0.65%
受託会社	年率0.10%

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

①信託財産留保額

ありません。

②その他の費用

各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ならびに受託会社の立替えた立替金の利息およ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、受益者の負担とし、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、間接的に各ファンドで負担することになります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

※上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

◇ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

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

②換金（解約）時および償還時

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

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

※少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」がご利用になれます。ＮＩＳＡをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

※上記は、平成26年2月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となりま

す。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞
収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
収益分配の際、①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、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

バランス物語３０（安定型）

平成26年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		3,818,343,345	98.24
	内　日本	3,818,343,345	98.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		68,277,941	1.76
純資産総額		3,886,621,286	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

バランス物語５０（安定・成長型）

平成26年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		1,851,243,022	98.05
	内　日本	1,851,243,022	98.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		36,793,865	1.95
純資産総額		1,888,036,887	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

バランス物語７０（成長型）

平成26年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		1,002,779,521	97.65
	内　日本	1,002,779,521	97.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		24,122,572	2.35
純資産総額		1,026,902,093	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		26,791,578,100	98.81
	内　日本	26,791,578,100	98.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		321,980,757	1.19
純資産総額		27,113,558,857	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		13,892,294,660	35.74
	内　日本	13,892,294,660	35.74
特殊債券		199,948,000	0.51
	内　韓国	199,948,000	0.51
社債券		24,343,428,860	62.63
	内　日本	23,744,700,860	61.09
	内　韓国	598,728,000	1.54
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		430,807,941	1.11
純資産総額		38,866,479,461	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		11,186,842,513	98.74
	内　アメリカ	6,295,484,694	55.57
	内　イギリス	1,143,648,633	10.09
	内　ドイツ	705,018,656	6.22
	内　フランス	591,441,107	5.22
	内　スイス	571,494,004	5.04
	内　カナダ	346,377,884	3.06
	内　オランダ	314,518,513	2.78
	内　アイルランド	211,488,846	1.87
	内　香港	173,217,393	1.53
	内　ジャージィー	140,687,242	1.24
	内　イタリア	136,867,639	1.21
	内　オーストラリア	93,612,186	0.83
	内　フィンランド	79,465,150	0.70
	内　スペイン	72,666,996	0.64
	内　オランダ領キュラソー	71,227,349	0.63
	内　デンマーク	69,902,766	0.62
	内　スウェーデン	69,351,509	0.61
	内　シンガポール	36,347,361	0.32
	内　ベルギー	33,874,916	0.30
	内　バミューダ	30,149,669	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		142,402,455	1.26
純資産総額		11,329,244,968	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		11,464,254,322	94.11
	内　アメリカ	4,373,362,744	35.90
	内　フランス	3,446,058,355	28.29
	内　ドイツ	1,135,247,664	9.32
	内　イギリス	923,967,215	7.58
	内　オランダ	575,345,160	4.72
	内　オーストリア	306,828,112	2.52
	内　カナダ	284,162,470	2.33
	内　オーストラリア	187,839,758	1.54
	内　フィンランド	117,910,988	0.97
	内　スウェーデン	70,517,850	0.58
	内　シンガポール	43,014,006	0.35
特殊債券		463,742,389	3.81
	内　国際機関	345,882,420	2.84
	内　ドイツ	117,859,969	0.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		253,988,448	2.08
純資産総額		12,181,985,159	100.00

その他資産の投資状況

平成26年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(％)
為替予約取引（買建）		883,064,555	7.25
	－	883,064,555	7.25
為替予約取引（売建）		998,153,476	△8.19
	－	998,153,476	△8.19

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

バランス物語３０（安定型）

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 (%) 償還日	投資比率
1	ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,795,571,796	1.4131 2,537,502,062	1.4136 2,538,220,290	－ －	65.31%
2	ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	443,763,544	1.7318 768,513,682	1.6965 752,844,852	－ －	19.37%
3	ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	149,085,429	2.1479 320,235,501	2.1465 320,011,873	－ －	8.23%
4	ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	107,203,026	1.9418 208,177,556	1.9334 207,266,330	－ －	5.33%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.24%
合計	98.24%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

バランス物語５０（安定・成長型）

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 (%) 償還日	投資比率
1	ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	570,556,100	1.4131 806,309,880	1.4136 806,538,102	－ －	42.72%
2	ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	337,948,083	1.7319 585,306,904	1.6965 573,328,922	－ －	30.37%
3	ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	110,314,983	2.1479 236,956,583	2.1465 236,791,111	－ －	12.54%
4	ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	121,332,827	1.9418 235,616,216	1.9334 234,584,887	－ －	12.42%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.05%
合計	98.05%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

バランス物語７０（成長型）

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 (%) 償還日	投資比率
1	ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	245,923,434	1.7320 425,945,188	1.6965 417,209,105	－ －	40.63%
2	ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	154,045,619	1.4131 217,697,268	1.4136 217,758,887	－ －	21.21%
3	ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	103,192,562	1.9418 200,389,636	1.9334 199,512,499	－ －	19.43%
4	ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	78,406,257	2.1479 168,416,640	2.1465 168,299,030	－ －	16.39%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.65%
合計	97.65%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）

ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	251,300	5,075.57 1,275,492,217	5,839.00 1,467,340,700	－ －	5.41%
2	三井住友フィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	256,100	4,160.34 1,065,464,715	4,540.00 1,162,694,000	－ －	4.29%
3	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	1,834,000	578.04 1,060,130,758	587.00 1,076,558,000	－ －	3.97%
4	日本電産 日本	株式 電気機器	67,600	6,673.97 451,161,030	12,490.00 844,324,000	－ －	3.11%
5	エンプラス 日本	株式 電気機器	122,000	3,770.00 459,940,000	6,650.00 811,300,000	－ －	2.99%
6	三井不動産 日本	株式 不動産業	265,000	2,733.23 724,307,540	3,027.00 802,155,000	－ －	2.96%
7	日　立 日本	株式 電気機器	958,000	582.17 557,724,442	803.00 769,274,000	－ －	2.84%
8	本田技研 日本	株式 輸送用機器	206,500	3,893.39 803,986,418	3,647.00 753,105,500	－ －	2.78%
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	112,700	4,602.18 518,666,066	5,701.00 642,502,700	－ －	2.37%
10	オリックス 日本	株式 その他金融業	425,400	1,202.28 511,451,961	1,500.00 638,100,000	－ －	2.35%
11	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	100,100	4,370.70 437,507,559	6,201.00 620,720,100	－ －	2.29%
12	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	77,500	4,075.83 315,877,360	7,668.00 594,270,000	－ －	2.19%
13	ヤフー 日本	株式 情報・通信業	866,000	430.14 372,509,342	645.00 558,570,000	－ －	2.06%
14	東京海上ＨＤ 日本	株式 保険業	183,200	2,915.32 534,087,568	3,012.00 551,798,400	－ －	2.04%
15	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	199,000	1,800.64 358,328,536	2,753.00 547,847,000	－ －	2.02%
16	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	1,637,000	274.29 449,028,598	297.00 486,189,000	－ －	1.79%
17	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	144,200	3,186.62 459,511,187	3,232.00 466,054,400	－ －	1.72%
18	ＳＭＣ 日本	株式 機械	17,700	23,485.35 415,690,812	25,815.00 456,925,500	－ －	1.69%
19	ウエルシアＨＤ 日本	株式 小売業	79,000	4,596.58 363,129,989	5,700.00 450,300,000	－ －	1.66%
20	伊　藤　忠 日本	株式 卸売業	344,000	1,215.17 418,021,456	1,264.00 434,816,000	－ －	1.60%
21	マ　ツ　ダ 日本	株式 輸送用機器	882,000	440.02 388,104,647	489.00 431,298,000	－ －	1.59%
22	みずほフィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	2,012,000	214.10 430,780,090	209.00 420,508,000	－ －	1.55%

23	エムスリー 日本	株式 サービス業	1,211	182,604.45 221,133,997	338,500.00 409,923,500	－ －	1.51%
24	ＪＸホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	772,000	530.51 409,554,871	527.00 406,844,000	－ －	1.50%
25	三菱地所 日本	株式 不動産業	169,000	2,786.92 470,991,000	2,403.00 406,107,000	－ －	1.50%
26	荏原製作所 日本	株式 機械	546,000	413.95 226,017,816	688.00 375,648,000	－ －	1.39%
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	310,000	842.37 261,137,335	1,205.00 373,550,000	－ －	1.38%
28	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	97,400	3,466.93 337,679,734	3,667.00 357,165,800	－ －	1.32%
29	コナミ 日本	株式 情報・通信業	132,500	2,446.72 324,191,595	2,556.00 338,670,000	－ －	1.25%
30	武田薬品 日本	株式 医薬品	68,100	5,200.55 354,157,650	4,872.00 331,783,200	－ －	1.22%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
株式	98.81%
合計	98.81%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	15.11%
情報・通信業		14.83%
輸送用機器		14.72%
銀行業		9.81%
機械		4.76%
不動産業		4.46%
小売業		4.25%
サービス業		3.79%
化学		3.58%
卸売業		2.85%
医薬品		2.84%
その他金融業		2.35%
保険業		2.04%
鉄鋼		1.79%
食料品		1.72%
陸運業		1.57%
石油・石炭製品		1.50%
建設業		1.49%
ゴム製品		1.32%
ガラス・土石製品		1.15%
非鉄金属		0.97%
海運業		0.70%
金属製品		0.67%
倉庫・運輸関連業		0.57%
合計		98.81%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	１２１回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	2,879,000,000	105.94 3,050,072,190	111.27 3,203,664,830	1.900000 2030/9/20	8.24%
2	３３回　利付国庫債券（３０年） 日本	国債証券	2,549,000,000	104.52 2,664,291,270	108.36 2,762,121,890	2.000000 2040/9/20	7.11%
3	３１３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	1,565,000,000	106.44 1,665,911,550	106.67 1,669,495,050	1.300000 2021/3/20	4.30%
4	１３０回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	1,090,000,000	103.41 1,127,217,800	108.69 1,184,797,300	1.800000 2031/9/20	3.05%
5	３２４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	1,055,000,000	100.04 1,055,442,500	102.79 1,084,529,450	0.800000 2022/6/20	2.79%
6	３２２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	825,000,000	102.38 844,717,150	103.69 855,475,500	0.900000 2022/3/20	2.20%
7	１２３回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	720,000,000	112.53 810,223,200	114.09 821,491,200	2.100000 2030/12/20	2.11%
8	２回　あいおいニッセイ同和損害保険期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	800,000,000	99.74 797,944,000	100.82 806,608,000	1.270000 2022/9/27	2.08%
9	１０６回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	680,000,000	112.06 762,025,500	117.02 795,756,400	2.200000 2028/9/20	2.05%
10	３回　十六銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	700,000,000	99.14 693,980,000	100.54 703,836,000	1.010000 2022/12/21	1.81%
11	３回　武蔵野銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	700,000,000	100.00 700,000,000	100.54 703,794,000	0.610000 2023/12/18	1.81%
12	１０８回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	600,000,000	107.69 646,176,000	112.83 677,022,000	1.900000 2028/12/20	1.74%
13	４回　りそな銀行劣後社債 日本	社債券	600,000,000	112.48 674,908,000	111.86 671,166,000	2.766000 2019/6/20	1.73%
14	２７回　富士電機社債 日本	社債券	600,000,000	100.00 600,000,000	101.58 609,522,000	0.900000 2018/6/6	1.57%
15	１０回　西日本シティ銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	600,000,000	100.00 600,000,000	100.85 605,142,000	0.870000 2025/12/16	1.56%

16	５回　ほくほくフィナンシャルグループ期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	600,000,000	100.00 600,000,000	100.85 605,118,000	0.750000 2023/10/23	1.56%
17	１回　あいおいニッセイ同和損害保険劣後社債 日本	社債券	500,000,000	100.27 501,390,000	103.67 518,380,000	1.809000 2022/9/27	1.33%
18	１４回　東京建物社債 日本	社債券	500,000,000	101.94 509,705,000	103.47 517,390,000	1.440000 2017/7/14	1.33%
19	８回　ジャックス社債 日本	社債券	500,000,000	100.35 501,791,000	102.53 512,695,000	1.130000 2020/6/19	1.32%
20	１５７回　オリックス社債 日本	社債券	500,000,000	102.05 510,265,000	102.40 512,030,000	1.110000 2017/3/13	1.32%
21	２回　清水銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	500,000,000	100.00 500,000,000	100.98 504,900,000	0.880000 2023/9/4	1.30%
22	４８９回　関西電力社債 日本	社債券	500,000,000	100.08 500,440,000	100.86 504,345,000	0.792000 2016/4/25	1.30%
23	２１回　トピー工業社債 日本	社債券	400,000,000	100.88 403,547,000	102.71 410,876,000	1.260000 2020/6/5	1.06%
24	１回　京阪神不動産社債 日本	社債券	400,000,000	100.93 403,736,000	101.48 405,936,000	0.970000 2016/7/22	1.04%
25	１１回　森ビル社債 日本	社債券	400,000,000	100.00 400,000,000	101.42 405,704,000	0.910000 2019/8/14	1.04%
26	２８回　双日社債 日本	社債券	400,000,000	101.77 407,093,000	101.15 404,612,000	1.230000 2020/10/16	1.04%
27	３回　紀陽銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	400,000,000	100.00 400,000,000	100.64 402,580,000	0.740000 2023/12/20	1.04%
28	１１４回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	332,000,000	109.55 363,732,560	114.92 381,557,640	2.100000 2029/12/20	0.98%
29	４２５回　九州電力社債 日本	社債券	376,000,000	100.00 376,000,000	100.00 376,003,760	0.281000 2017/2/24	0.97%
30	４４５回　東北電力社債 日本	社債券	330,000,000	104.47 344,751,000	105.99 349,790,100	1.792000 2018/11/22	0.90%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	35.74%
特殊債券	0.51%
社債券	62.63%
合計	98.89%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	3,319	44,600.13 148,027,858	53,790.67 178,531,266	－ －	1.58%
2	GOOGLE INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	1,365	85,684.62 116,959,508	124,286.26 169,650,755	－ －	1.50%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	14,840	9,217.54 136,788,324	9,769.92 144,985,755	－ －	1.28%
4	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	24,857	3,781.17 93,988,601	4,694.33 116,687,134	－ －	1.03%
5	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	15,239	7,724.63 117,715,638	7,631.53 116,297,038	－ －	1.03%
6	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	29,885	2,868.59 85,727,859	3,859.44 115,339,615	－ －	1.02%
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	11,784	8,073.21 95,134,806	9,313.23 109,747,201	－ －	0.97%
8	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	12,467	4,935.38 61,529,450	8,527.28 106,309,612	－ －	0.94%
9	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	31,438	2,908.09 91,424,597	3,285.52 103,290,372	－ －	0.91%
10	ING GROEP NV-CVA オランダ	株式 各種金融サービス	69,485	1,061.13 73,732,689	1,468.07 102,009,103	－ －	0.90%
11	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD 香港	株式 ホテル・レストラン・レジャー	93,000	453.18 42,146,307	1,028.20 95,623,065	－ －	0.84%
12	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	3,045	24,840.62 75,639,703	31,295.05 95,293,433	－ －	0.84%
13	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	41,373	1,958.04 81,010,340	2,301.99 95,240,406	－ －	0.84%
14	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	11,316	6,589.16 74,563,002	8,204.13 92,837,948	－ －	0.82%
15	SOCIETE GENERALE-A フランス	株式 商業銀行	13,702	4,629.08 63,427,677	6,735.94 92,295,986	－ －	0.81%
16	RIO TINTO PLC イギリス	株式 金属・鉱業	15,641	5,533.40 86,548,040	5,885.14 92,049,515	－ －	0.81%
17	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	35,087	2,472.56 86,754,906	2,599.46 91,207,603	－ －	0.81%
18	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	3,121	18,601.18 58,054,308	28,978.48 90,441,847	－ －	0.80%
19	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	15,497	5,257.54 81,476,245	5,778.97 89,556,831	－ －	0.79%
20	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	15,432	4,746.15 73,242,674	5,775.92 89,134,003	－ －	0.79%

21	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融サービス	50,694	1,290.94 65,443,159	1,680.99 85,216,137	－ －	0.75%
22	EOG RESOURCES INC アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	4,318	14,204.09 61,333,274	19,110.69 82,519,967	－ －	0.73%
23	DAIMLER AG ドイツ	株式 自動車	8,731	7,181.23 62,699,364	9,368.83 81,799,342	－ －	0.72%
24	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	9,635	7,511.04 72,368,889	8,423.38 81,159,304	－ －	0.72%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	74,550	1,259.03 93,861,133	1,081.92 80,657,155	－ －	0.71%
26	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	10,036	7,907.44 79,359,104	7,970.68 79,993,830	－ －	0.71%
27	BT GROUP PLC イギリス	株式 各種電気通信サービス	111,053	523.10 58,092,914	699.78 77,713,313	－ －	0.69%
28	HUTCHISON WHAMPOA LTD 香港	株式 コングロマリット	57,000	1,149.12 65,500,372	1,361.30 77,594,328	－ －	0.68%
29	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	9,440	5,459.41 51,536,841	7,926.85 74,829,505	－ －	0.66%
30	ACTAVIS PLC アイルランド	株式 医薬品	3,176	14,078.65 44,713,810	23,155.67 73,542,411	－ －	0.65%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
株式	98.74%
合計	98.74%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
医薬品	外国	10.86%
商業銀行		6.62%
メディア		5.13%
石油・ガス・消耗燃料		4.73%
バイオテクノロジー		4.50%
保険		4.23%
各種電気通信サービス		3.96%
インターネットソフトウェア・サービス		3.87%
航空宇宙・防衛		3.07%
ソフトウェア		3.06%
食品		2.97%
各種金融サービス		2.84%
機械		2.59%
情報技術サービス		2.48%
ホテル・レストラン・レジャー		2.38%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.15%
コングロマリット		2.14%
コンピュータ・周辺機器		1.79%

食品・生活必需品小売り	1.64%
家庭用品	1.53%
自動車部品	1.53%
インターネット販売・カタログ販売	1.53%
専門小売り	1.48%
通信機器	1.46%
無線通信サービス	1.45%
飲料	1.44%
タバコ	1.38%
金属・鉱業	1.20%
陸運・鉄道	1.19%
半導体・半導体製造装置	1.14%
化学	1.13%
資本市場	1.10%
容器・包装	1.01%
自動車	0.97%
総合公益事業	0.80%
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.76%
家庭用耐久財	0.73%
エネルギー設備・サービス	0.63%
電気設備	0.59%
旅客航空輸送業	0.57%
航空貨物・物流サービス	0.57%
繊維・アパレル・贅沢品	0.45%
ヘルスケア機器・用品	0.40%
専門サービス	0.38%
消費者金融	0.38%
水道	0.37%
商社・流通業	0.34%
建設関連製品	0.30%
電力	0.26%
建設・土木	0.24%
電子装置・機器・部品	0.22%
各種消費者サービス	0.18%
合計	98.74%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ＤＬ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26年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	FRANCE OAT 3.25 10/25/21 フランス	国債証券	866,450,000	113.17 980,604,787	112.38 973,759,832	3.250000 2021/10/25	7.99%
2	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	805,326,000	103.93 836,999,471	103.01 829,574,365	1.750000 2016/5/31	6.81%
3	US T N/B 1.0 08/31/16 アメリカ	国債証券	728,871,000	101.47 739,603,602	101.25 738,032,908	1.000000 2016/8/31	6.06%
4	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 ドイツ	国債証券	524,062,500	136.06 713,077,170	138.78 727,346,343	4.750000 2034/7/4	5.97%
5	FR TREASURY 2.5 07/25/16 フランス	国債証券	670,800,000	106.55 714,781,002	105.41 707,110,404	2.500000 2016/7/25	5.80%
6	NETHERLANDS 4.0 07/15/18 オランダ	国債証券	503,100,000	116.56 586,413,360	114.36 575,345,160	4.000000 2018/7/15	4.72%
7	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	560,670,000	99.37 557,157,396	100.29 562,329,583	1.500000 2018/12/31	4.62%
8	FRANCE OAT 1.0 11/25/18 フランス	国債証券	519,870,000	99.19 515,684,822	100.85 524,314,888	1.000000 2018/11/25	4.30%
9	US T N/B 1.375 11/30/15 アメリカ	国債証券	438,342,000	102.61 449,795,876	101.94 446,885,285	1.375000 2015/11/30	3.67%
10	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	372,081,000	98.90 368,017,934	101.16 376,412,022	2.750000 2023/11/15	3.09%
11	US T N/B 1.875 09/30/17 アメリカ	国債証券	346,596,000	104.77 363,139,027	103.25 357,860,370	1.875000 2017/9/30	2.94%
12	EIB 5.125 05/30/17 国際機関	特殊債券	305,820,000	116.50 356,280,300	113.10 345,882,420	5.125000 2017/5/30	2.84%
13	FRANCE OAT 4.25 04/25/19 フランス	国債証券	279,500,000	118.94 332,440,095	116.84 326,584,570	4.250000 2019/4/25	2.68%
14	FRANCE OAT 3.75 04/25/21 フランス	国債証券	279,500,000	117.13 327,378,350	115.89 323,929,320	3.750000 2021/4/25	2.66%
15	UK TREASURY 4.75 12/07/30 イギリス	国債証券	263,717,000	128.60 339,140,062	119.94 316,328,541	4.750000 2030/12/7	2.60%
16	AUSTRIA 3.5 07/15/15 オーストリア	国債証券	293,475,000	107.18 314,575,852	104.54 306,828,112	3.500000 2015/7/15	2.52%
17	FRANCE OAT 4.0 10/25/38 フランス	国債証券	251,550,000	119.14 299,699,185	117.46 295,470,630	4.000000 2038/10/25	2.43%
18	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	265,044,000	100.01 265,094,358	100.10 265,332,897	1.375000 2018/9/30	2.18%
19	BUNDESOBL 0.5 04/07/17 ドイツ	国債証券	223,600,000	101.02 225,880,720	100.97 225,780,100	0.500000 2017/4/7	1.85%
20	US T N/B 3.125 02/15/42 アメリカ	国債証券	244,656,000	93.20 228,024,138	91.99 225,063,947	3.125000 2042/2/15	1.85%
21	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	195,650,000	112.39 219,900,817	110.55 216,298,901	3.750000 2017/4/25	1.78%
22	US T N/B 1.0 09/30/19 アメリカ	国債証券	183,492,000	95.94 176,051,399	96.21 176,544,992	1.000000 2019/9/30	1.45%
23	UK TREASURY 5.0 09/07/14 イギリス	国債証券	165,035,800	105.95 174,871,933	102.41 169,029,666	5.000000 2014/9/7	1.39%

24	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19 オーストラリア	国債証券	146,240,000	109.08 159,530,291	108.89 159,246,585	5.250000 2019/3/15	1.31%
25	US T N/B 4.375 05/15/40 アメリカ	国債証券	132,522,000	124.31 164,740,748	115.08 152,512,943	4.375000 2040/5/15	1.25%
26	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	152,910,000	99.07 151,494,053	98.71 150,943,577	0.500000 2017/7/31	1.24%
27	UK TREASURY 4.75 12/07/38 イギリス	国債証券	102,084,000	129.63 132,341,697	122.58 125,144,775	4.750000 2038/12/7	1.03%
28	UK TREASURY 4.0 03/07/22 イギリス	国債証券	110,591,000	118.27 130,807,034	111.71 123,552,265	4.000000 2022/3/7	1.01%
29	FINLAND 4.25 07/04/15 フィンランド	国債証券	111,800,000	108.74 121,571,320	105.46 117,910,988	4.250000 2015/7/4	0.97%
30	KFW 4.875 06/17/19 ドイツ	特殊債券	101,940,000	120.25 122,582,850	115.61 117,859,969	4.875000 2019/6/17	0.97%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年2月28日現在

種類	投資比率
国債証券	94.11%
特殊債券	3.81%
合計	97.92%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

バランス物語３０（安定型）
該当事項はありません。

バランス物語５０（安定・成長型）
該当事項はありません。

バランス物語７０（成長型）
該当事項はありません。

（参考）

ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド
該当事項はありません。

ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド
該当事項はありません。

ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド
該当事項はありません。

ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
為替予約取引	―	ユーロ買／円売 ２０１４年０４月	買建	4,060,000	572,029,035	567,182,000	4.66%
		ポーランド・ズロチ買／円売 ２０１４年０４月	買建	3,130,000	105,499,780	104,917,600	0.86%
		シンガポール・ドル買／円売 ２０１４年０４月	買建	770,000	62,106,275	62,015,800	0.51%
		スイス・フラン買／円売 ２０１４年０４月	買建	390,000	44,936,970	44,752,500	0.37%
		アメリカ・ドル買／円売 ２０１４年０４月	買建	430,000	43,946,344	43,821,300	0.36%
		ノルウェー・クローネ 買／円売２０１４年０４月	買建	2,430,000	40,826,187	40,921,200	0.34%
		イギリス・ポンド買／円売 ２０１４年０４月	買建	100,000	17,006,130	17,004,000	0.14%
		アメリカ・ドル買／円売 ２０１４年０３月	買建	24,037	2,450,400	2,450,155	0.02%
		アメリカ・ドル売／円買 ２０１４年０４月	売建	5,577,506	572,029,035	568,403,656	△4.67%
		ユーロ売／円買 ２０１４年０４月	売建	3,000,000	421,197,000	419,100,000	△3.44%
		オーストラリア・ドル 売／円買２０１４年０４月	売建	90,000	8,229,105	8,203,500	△0.07%
		アメリカ・ドル売／円買 ２０１４年０３月	売建	24,000	2,457,984	2,446,320	△0.02%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（平成26年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

バランス物語３０（安定型）

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	１口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	１口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第7計算期間末 (平成16年8月25日)	31,104	31,120	0.9710	0.9715
第8計算期間末 (平成17年2月25日)	28,979	29,095	0.9924	0.9964
第9計算期間末 (平成17年8月25日)	25,656	25,795	1.0132	1.0187
第10計算期間末 (平成18年2月27日)	22,170	22,294	1.0708	1.0768
第11計算期間末 (平成18年8月25日)	20,592	20,708	1.0622	1.0682
第12計算期間末 (平成19年2月26日)	18,857	18,960	1.0994	1.1054
第13計算期間末 (平成19年8月27日)	16,750	16,844	1.0697	1.0757
第14計算期間末 (平成20年2月25日)	15,184	15,272	1.0295	1.0355
第15計算期間末 (平成20年8月25日)	13,906	13,961	1.0035	1.0075
第16計算期間末 (平成21年2月25日)	11,428	11,441	0.8588	0.8598
第17計算期間末 (平成21年8月25日)	10,889	10,901	0.9380	0.9390
第18計算期間末 (平成22年2月25日)	10,074	10,084	0.9354	0.9364
第19計算期間末 (平成22年8月25日)	8,832	8,841	0.9315	0.9325
第20計算期間末 (平成23年2月25日)	7,211	7,218	0.9601	0.9611
第21計算期間末 (平成23年8月25日)	6,340	6,347	0.9270	0.9280
第22計算期間末 (平成24年2月27日)	5,980	5,986	0.9614	0.9624
第23計算期間末 (平成24年8月27日)	5,280	5,286	0.9404	0.9414
第24計算期間末 (平成25年2月25日)	5,010	5,015	1.0201	1.0211
第25計算期間末 (平成25年8月26日)	4,567	4,571	1.0685	1.0695

第26計算期間末 (平成26年2月25日)	3,912	3,916	1.1143	1.1153
平成25年2月末日	4,980	－	1.0196	－
3月末日	4,965	－	1.0441	－
4月末日	4,984	－	1.0753	－
5月末日	4,812	－	1.0684	－
6月末日	4,725	－	1.0630	－
7月末日	4,639	－	1.0690	－
8月末日	4,538	－	1.0633	－
9月末日	4,420	－	1.0856	－
10月末日	4,358	－	1.0942	－
11月末日	4,260	－	1.1117	－
12月末日	4,045	－	1.1222	－
平成26年1月末日	3,936	－	1.1096	－
2月末日	3,886	－	1.1096	－

バランス物語５０（安定・成長型）

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	１口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	１口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第7計算期間末 (平成16年8月25日)	9,334	9,364	0.9415	0.9445
第8計算期間末 (平成17年2月25日)	9,076	9,122	0.9728	0.9778
第9計算期間末 (平成17年8月25日)	8,684	8,744	1.0112	1.0182
第10計算期間末 (平成18年2月27日)	9,054	9,110	1.1230	1.1300
第11計算期間末 (平成18年8月25日)	9,314	9,372	1.1172	1.1242
第12計算期間末 (平成19年2月26日)	9,012	9,065	1.1880	1.1950
第13計算期間末 (平成19年8月27日)	7,870	7,918	1.1381	1.1451
第14計算期間末 (平成20年2月25日)	6,850	6,895	1.0631	1.0701
第15計算期間末 (平成20年8月25日)	6,362	6,393	1.0226	1.0276
第16計算期間末 (平成21年2月25日)	4,723	4,735	0.7845	0.7865
第17計算期間末 (平成21年8月25日)	5,027	5,038	0.8965	0.8985
第18計算期間末 (平成22年2月25日)	4,809	4,820	0.8820	0.8840
第19計算期間末 (平成22年8月25日)	4,115	4,125	0.8526	0.8546
第20計算期間末 (平成23年2月25日)	3,636	3,644	0.9085	0.9105
第21計算期間末 (平成23年8月25日)	3,049	3,056	0.8443	0.8463
第22計算期間末 (平成24年2月27日)	2,986	2,993	0.8972	0.8992
第23計算期間末 (平成24年8月27日)	2,631	2,637	0.8663	0.8683
第24計算期間末 (平成25年2月25日)	2,595	2,601	0.9926	0.9946
第25計算期間末 (平成25年8月26日)	2,333	2,338	1.0718	1.0738
第26計算期間末 (平成26年2月25日)	1,899	1,903	1.1386	1.1406
平成25年2月末日	2,572	－	0.9887	－
3月末日	2,586	－	1.0211	－
4月末日	2,626	－	1.0738	－
5月末日	2,537	－	1.0731	－

6月末日	2,483	－	1.0622	－
7月末日	2,374	－	1.0728	－
8月末日	2,303	－	1.0602	－
9月末日	2,321	－	1.0940	－
10月末日	2,293	－	1.1056	－
11月末日	2,213	－	1.1350	－
12月末日	1,987	－	1.1583	－
平成26年1月末日	1,896	－	1.1308	－
2月末日	1,888	－	1.1307	－

バランス物語７０（成長型）

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	１口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	１口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第7計算期間末 (平成16年8月25日)	4,285	4,304	0.9111	0.9151
第8計算期間末 (平成17年2月25日)	4,210	4,236	0.9508	0.9568
第9計算期間末 (平成17年8月25日)	4,058	4,090	1.0050	1.0130
第10計算期間末 (平成18年2月27日)	4,753	4,786	1.1689	1.1769
第11計算期間末 (平成18年8月25日)	4,749	4,782	1.1655	1.1735
第12計算期間末 (平成19年2月26日)	4,844	4,875	1.2714	1.2794
第13計算期間末 (平成19年8月27日)	4,392	4,421	1.1990	1.2070
第14計算期間末 (平成20年2月25日)	3,802	3,830	1.0882	1.0962
第15計算期間末 (平成20年8月25日)	3,542	3,562	1.0347	1.0407
第16計算期間末 (平成21年2月25日)	2,496	2,506	0.7158	0.7188
第17計算期間末 (平成21年8月25日)	2,887	2,897	0.8525	0.8555
第18計算期間末 (平成22年2月25日)	2,753	2,763	0.8267	0.8297
第19計算期間末 (平成22年8月25日)	2,485	2,495	0.7747	0.7777
第20計算期間末 (平成23年2月25日)	2,330	2,338	0.8523	0.8553
第21計算期間末 (平成23年8月25日)	1,995	2,003	0.7644	0.7674
第22計算期間末 (平成24年2月27日)	2,038	2,045	0.8309	0.8339
第23計算期間末 (平成24年8月27日)	1,834	1,841	0.7908	0.7938
第24計算期間末 (平成25年2月25日)	1,971	1,977	0.9512	0.9542
第25計算期間末 (平成25年8月26日)	1,245	1,248	1.0559	1.0589
第26計算期間末 (平成26年2月25日)	1,033	1,036	1.1418	1.1448
平成25年2月末日	1,951	－	0.9444	－
3月末日	1,360	－	0.9828	－
4月末日	1,386	－	1.0543	－
5月末日	1,339	－	1.0589	－

6月末日	1,304	－	1.0426	－
7月末日	1,269	－	1.0573	－
8月末日	1,227	－	1.0385	－
9月末日	1,229	－	1.0826	－
10月末日	1,225	－	1.0972	－
11月末日	1,224	－	1.1376	－
12月末日	1,072	－	1.1728	－
平成26年1月末日	1,028	－	1.1309	－
2月末日	1,026	－	1.1310	－

②【分配の推移】

バランス物語３０（安定型）

	１口当たりの分配金(円)
第7計算期間	0.0005
第8計算期間	0.0040
第9計算期間	0.0055
第10計算期間	0.0060
第11計算期間	0.0060
第12計算期間	0.0060
第13計算期間	0.0060
第14計算期間	0.0060
第15計算期間	0.0040
第16計算期間	0.0010
第17計算期間	0.0010
第18計算期間	0.0010
第19計算期間	0.0010
第20計算期間	0.0010
第21計算期間	0.0010
第22計算期間	0.0010
第23計算期間	0.0010
第24計算期間	0.0010
第25計算期間	0.0010
第26計算期間	0.0010

バランス物語５０（安定・成長型）

	１口当たりの分配金(円)
第7計算期間	0.0030
第8計算期間	0.0050
第9計算期間	0.0070
第10計算期間	0.0070
第11計算期間	0.0070
第12計算期間	0.0070
第13計算期間	0.0070
第14計算期間	0.0070
第15計算期間	0.0050
第16計算期間	0.0020
第17計算期間	0.0020
第18計算期間	0.0020
第19計算期間	0.0020
第20計算期間	0.0020
第21計算期間	0.0020
第22計算期間	0.0020
第23計算期間	0.0020
第24計算期間	0.0020
第25計算期間	0.0020
第26計算期間	0.0020

バランス物語７０（成長型）

	１口当たりの分配金(円)
第7計算期間	0.0040
第8計算期間	0.0060
第9計算期間	0.0080
第10計算期間	0.0080
第11計算期間	0.0080
第12計算期間	0.0080
第13計算期間	0.0080
第14計算期間	0.0080
第15計算期間	0.0060
第16計算期間	0.0030
第17計算期間	0.0030
第18計算期間	0.0030
第19計算期間	0.0030
第20計算期間	0.0030
第21計算期間	0.0030
第22計算期間	0.0030
第23計算期間	0.0030
第24計算期間	0.0030
第25計算期間	0.0030
第26計算期間	0.0030

③【収益率の推移】

バランス物語３０（安定型）

	収益率(%)
第7計算期間	0.1
第8計算期間	2.6
第9計算期間	2.7
第10計算期間	6.3
第11計算期間	△0.2
第12計算期間	4.1
第13計算期間	△2.2
第14計算期間	△3.2
第15計算期間	△2.1
第16計算期間	△14.3
第17計算期間	9.3
第18計算期間	△0.2
第19計算期間	△0.3
第20計算期間	3.2
第21計算期間	△3.3
第22計算期間	3.8
第23計算期間	△2.1
第24計算期間	8.6
第25計算期間	4.8
第26計算期間	4.4

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

バランス物語５０（安定・成長型）

	収益率(%)
第7計算期間	1.1
第8計算期間	3.9
第9計算期間	4.7
第10計算期間	11.7
第11計算期間	0.1
第12計算期間	7.0
第13計算期間	△3.6
第14計算期間	△6.0
第15計算期間	△3.3
第16計算期間	△23.1
第17計算期間	14.5
第18計算期間	△1.4
第19計算期間	△3.1
第20計算期間	6.8
第21計算期間	△6.8
第22計算期間	6.5
第23計算期間	△3.2
第24計算期間	14.8
第25計算期間	8.2
第26計算期間	6.4

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

バランス物語７０（成長型）

	収益率(%)
第7計算期間	1.9
第8計算期間	5.0
第9計算期間	6.5
第10計算期間	17.1
第11計算期間	0.4
第12計算期間	9.8
第13計算期間	△5.1
第14計算期間	△8.6
第15計算期間	△4.4
第16計算期間	△30.5
第17計算期間	19.5
第18計算期間	△2.7
第19計算期間	△5.9
第20計算期間	10.4
第21計算期間	△10.0
第22計算期間	9.1
第23計算期間	△4.5
第24計算期間	20.7
第25計算期間	11.3
第26計算期間	8.4

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

（４）【設定及び解約の実績】

バランス物語３０（安定型）

	設定口数	解約口数
第7計算期間	494,903,539	3,177,829,514
第8計算期間	257,808,111	3,091,014,076
第9計算期間	346,297,021	4,224,704,681
第10計算期間	644,216,372	5,260,340,384
第11計算期間	738,045,702	2,057,461,774
第12計算期間	279,381,369	2,512,700,038
第13計算期間	155,935,941	1,648,789,107
第14計算期間	142,082,604	1,052,615,028
第15計算期間	138,415,414	1,030,107,291
第16計算期間	231,258,044	781,488,777
第17計算期間	70,069,607	1,766,755,361
第18計算期間	60,516,732	900,614,199
第19計算期間	60,131,552	1,349,162,006
第20計算期間	38,549,347	2,008,857,995
第21計算期間	28,937,127	700,046,673
第22計算期間	27,420,253	646,314,385
第23計算期間	25,984,817	631,414,837
第24計算期間	20,892,800	724,245,387
第25計算期間	18,759,515	656,132,537
第26計算期間	28,695,833	792,024,838

（注）　本邦外における設定及び解約はございません。

バランス物語５０（安定・成長型）

	設定口数	解約口数
第7計算期間	352,730,223	913,236,306
第8計算期間	312,319,365	897,957,058
第9計算期間	310,444,579	1,052,016,315
第10計算期間	851,740,445	1,377,642,526
第11計算期間	971,313,753	696,726,325
第12計算期間	172,072,707	922,846,422
第13計算期間	113,906,019	784,590,427
第14計算期間	95,691,183	567,728,975
第15計算期間	107,427,913	328,740,738
第16計算期間	94,289,964	294,957,841
第17計算期間	109,618,982	522,721,252
第18計算期間	81,961,999	236,943,277
第19計算期間	62,517,775	688,403,720
第20計算期間	42,464,037	866,831,805
第21計算期間	34,627,815	426,048,103
第22計算期間	31,971,253	314,338,852
第23計算期間	25,870,800	317,812,501
第24計算期間	23,083,720	445,107,452
第25計算期間	19,890,013	457,524,002
第26計算期間	15,171,242	524,354,069

（注）　本邦外における設定及び解約はございません。

バランス物語７０（成長型）

	設定口数	解約口数
第7計算期間	335,104,416	448,393,791
第8計算期間	130,943,623	406,111,910
第9計算期間	246,537,732	636,486,882
第10計算期間	653,691,053	625,361,209
第11計算期間	375,837,525	367,115,061
第12計算期間	173,524,207	438,344,538
第13計算期間	149,589,640	296,962,322
第14計算期間	90,562,299	259,584,258
第15計算期間	78,749,603	149,229,368
第16計算期間	137,057,880	73,171,732
第17計算期間	78,670,303	179,724,398
第18計算期間	59,084,628	114,373,354
第19計算期間	46,077,702	168,297,278
第20計算期間	30,671,736	505,121,198
第21計算期間	24,455,175	148,410,519
第22計算期間	25,225,172	182,736,740
第23計算期間	22,061,855	154,634,692
第24計算期間	20,138,195	267,939,921
第25計算期間	14,067,699	907,462,285
第26計算期間	10,878,686	284,917,088

（注）　本邦外における設定及び解約はございません。

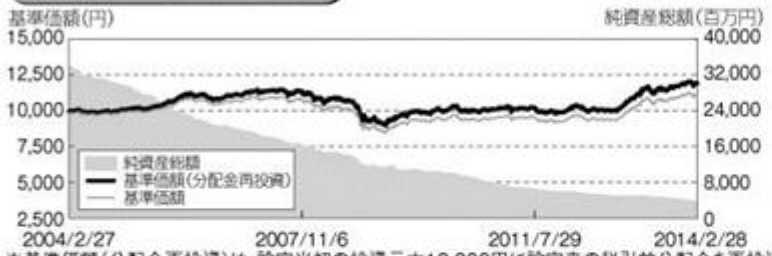
＜＜参考情報＞＞

データの基準日：2014年2月28日

バランス物語30（安定型）

基準価額・純資産の推移

（2004年2月27日～2014年2月28日）



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

分配の推移（税引前）

第22期	(2012.02.27)	10円
第23期	(2012.08.27)	10円
第24期	(2013.02.25)	10円
第25期	(2013.08.26)	10円
第26期	(2014.02.25)	10円
設定来累計		715円

（注）分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

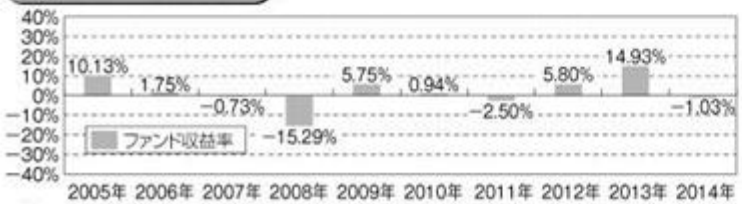
（注）投資比率（%）は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	65.31%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	19.37%
3	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	8.23%
4	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	5.33%

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

年間収益率の推移

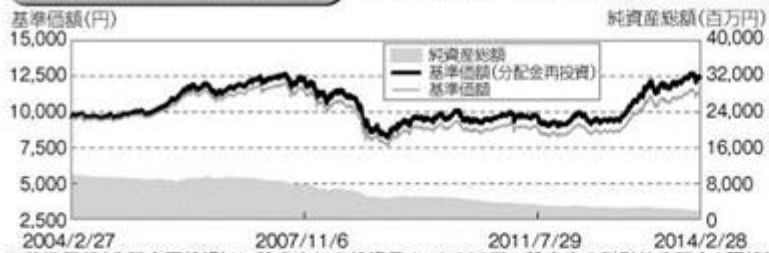


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものとして算出しております。
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

バランス物語50（安定・成長型）

基準価額・純資産の推移

（2004年2月27日～2014年2月28日）



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

分配の推移（税引前）

第22期	(2012.02.27)	20円
第23期	(2012.08.27)	20円
第24期	(2013.02.25)	20円
第25期	(2013.08.26)	20円
第26期	(2014.02.25)	20円
設定来累計		935 円

（注）分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

（注）投資比率（%）は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	42.72%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	30.37%
3	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	12.54%
4	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	12.42%

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

年間収益率の推移

※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものとして算出しております。
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

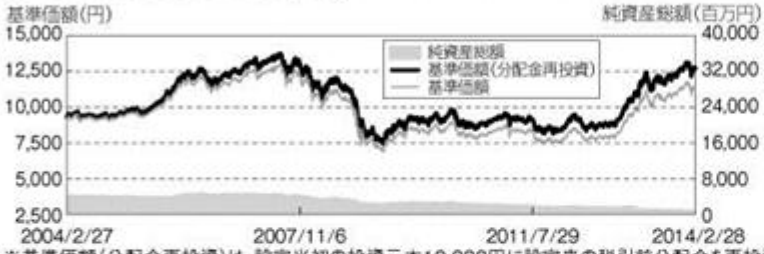
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2014年2月28日

バランス物語70（成長型）

基準価額・純資産の推移

（2004年2月27日～2014年2月28日）



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

分配の推移（税引前）

第22期	(2012.02.27)	30円
第23期	(2012.08.27)	30円
第24期	(2013.02.25)	30円
第25期	(2013.08.26)	30円
第26期	(2014.02.25)	30円
設定来累計		1,120円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

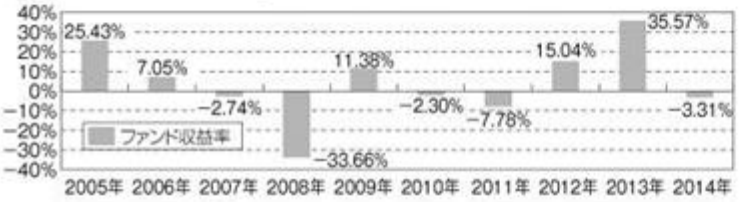
(注)投資比率(%)は純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	40.63%
2	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	21.21%
3	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド	19.43%
4	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	16.39%

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものとして算出しております。
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

各マザーファンドの主要な資産の状況

■DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類		投資比率(%)
株式		98.81
	内　日本	98.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1.19
純資産総額		100.00

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	15.11%
2	情報・通信業	14.83%
3	輸送用機器	14.72%
4	銀行業	9.81%
5	機械	4.76%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	5.41%
2	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	4.29%
3	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	3.97%
4	日本電産	株式	日本	電気機器	3.11%
5	エンプラス	株式	日本	電気機器	2.99%
6	三井不動産	株式	日本	不動産業	2.96%
7	日　立	株式	日本	電気機器	2.84%
8	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2.78%
9	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	2.37%
10	オリックス	株式	日本	その他金融業	2.35%

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2014年2月28日

■DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類		投資比率(%)
国債証券		35.74
	内　日本	35.74
特殊債券		0.51
	内　韓国	0.51
社債券		62.63
	内　日本	61.09
	内　韓国	1.54
コールローン、その他の資産(負債控除後)		1.11
純資産総額		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	121回　利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.900000	2030/9/20	8.24%
2	33回　利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	2.000000	2040/9/20	7.11%
3	313回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.300000	2021/3/20	4.30%
4	130回　利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.800000	2031/9/20	3.05%
5	324回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2022/6/20	2.79%
6	322回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.900000	2022/3/20	2.20%
7	123回　利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2.100000	2030/12/20	2.11%
8	2回　あいおいニッセイ同和損害保険期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	1.270000	2022/9/27	2.08%
9	106回　利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2.200000	2028/9/20	2.05%
10	3回　十六銀行期限前償還条項付劣後社債	社債券	日本	1.010000	2022/12/21	1.81%

■DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類		投資比率(%)
株式		98.74
	内　アメリカ	55.57
	内　イギリス	10.09
	内　ドイツ	6.22
	内　フランス	5.22
	内　スイス	5.04
	内　その他	16.60
コールローン、その他の資産(負債控除後)		1.26
純資産総額		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	1.58%
2	GOOGLE INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	1.50%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.28%
4	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	1.03%
5	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	1.03%
6	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.02%
7	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.97%
8	GILEAD SCIENCES INC	株式	アメリカ	バイオテクノロジー	0.94%
9	PFIZER INC	株式	アメリカ	医薬品	0.91%
10	ING GROEP NV-CVA	株式	オランダ	各種金融サービス	0.90%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	医薬品	10.86%
2	商業銀行	6.62%
3	メディア	5.13%
4	石油・ガス・消耗燃料	4.73%
5	バイオテクノロジー	4.50%

■DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類		投資比率(%)
国債証券		94.11
	内　アメリカ	35.90
	内　フランス	28.29
	内　ドイツ	9.32
	内　イギリス	7.58
	内　オランダ	4.72
	内　その他	8.30
特殊債券		3.81
	内　国際機関	2.84
	内　ドイツ	0.97
コールローン、その他の資産(負債控除後)		2.08
純資産総額		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国／地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	フランス	3.250000	2021/10/25	7.99%
2	US T N/B 1.75 05/31/16	国債証券	アメリカ	1.750000	2016/5/31	6.81%
3	US T N/B 1.0 08/31/16	国債証券	アメリカ	1.000000	2016/8/31	6.06%
4	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	ドイツ	4.750000	2034/7/4	5.97%
5	FR TREASURY 2.5 07/25/16	国債証券	フランス	2.500000	2016/7/25	5.80%
6	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債証券	オランダ	4.000000	2018/7/15	4.72%
7	US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	アメリカ	1.500000	2018/12/31	4.62%
8	FRANCE OAT 1.0 11/25/18	国債証券	フランス	1.000000	2018/11/25	4.30%
9	US T N/B 1.375 11/30/15	国債証券	アメリカ	1.375000	2015/11/30	3.67%
10	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.750000	2023/11/15	3.09%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	7.25
為替予約取引(売建)	△8.19

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額（発行価格）は、お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

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

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

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.diam.co.jp/
コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・お申込単位
各販売会社が定める単位とします。
「一般コース」および「自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。
※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。
※「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合およびスイッチングによるお申込みの場合には、1口単位となります。
※当初元本は1口当たり1円です。

・お申込手数料は、お申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。
※償還乗換え等によるお申込みの場合には、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。
※「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。
※スイッチングによるお申込みの場合には、お申込手数料はかかりません。ただし、解約と同様の税金がかかる場合がありますのでご留意ください。
※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

2【換金（解約）手続等】

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、各販売会社が定める単位をもって解約の請求をすることができます。
受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
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。

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

・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

・解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

・解約価額の照会方法等
解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.diam.co.jp/
コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。
なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。
※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　　URL http://www.diam.co.jp/
コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

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

（４）【計算期間】

a．計算期間は原則として毎年2月26日から8月25日まで、8月26日から翌年2月25日とします。

b．上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

イ．償還規定

a.委託会社は、各ファンドにつき、信託契約を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

b.委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

c.委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

d.委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

e.上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。

f.委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

g.上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

h.委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

i.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

j.受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記 「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

k.上記d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

a.委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

b.委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

c.委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる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.上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは信託約款の変更をしません。

e.委託会社は、上記d.の規定により、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

f.委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a.からe.の規定に従い信託約款を変更します。

g.上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

h.上記b.に該当しない場合の約款変更のお知らせは「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

ニ. 公告

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

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

ホ．運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（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/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金受領権

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

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

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

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

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

(2)償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

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

数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
なお、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
受益証券をお手許で保有されている方は、解約のお申込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご留意ください。

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

バランス物語３０（安定型）

（１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
（２）当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間（平成25年8月27日から平成26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25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	113,863,241	137,413,538
親投資信託受益証券	4,508,033,483	3,814,428,801
流動資産合計	4,621,896,724	3,951,842,339
資産合計	4,621,896,724	3,951,842,339
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,274,684	3,511,355
未払解約金	11,700,183	1,954,570
未払受託者報酬	2,540,225	2,229,634
未払委託者報酬	35,563,677	31,215,583
その他未払費用	120,566	105,822
流動負債合計	54,199,335	39,016,964
負債合計	54,199,335	39,016,964
純資産の部		
元本等		
元本	※1 4,274,684,608	※1 3,511,355,603
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	293,012,781	401,469,772
（分配準備積立金）	461,396,163	420,469,939
元本等合計	4,567,697,389	3,912,825,375
純資産合計	4,567,697,389	3,912,825,375
負債純資産合計	4,621,896,724	3,951,842,339

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第25期 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月26日	第26期 自　平成25年8月27日 至　平成26年2月25日
営業収益		
受取利息	34,876	25,426
有価証券売買等損益	276,984,407	221,395,318
営業収益合計	277,019,283	221,420,744
営業費用		
受託者報酬	2,540,225	2,229,634
委託者報酬	35,563,677	31,215,583
その他費用	120,566	105,822
営業費用合計	38,224,468	33,551,039
営業利益又は営業損失（△）	238,794,815	187,869,705
経常利益又は経常損失（△）	238,794,815	187,869,705
当期純利益又は当期純損失（△）	238,794,815	187,869,705
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	28,016,319	24,297,592
期首剰余金又は期首欠損金（△）	98,770,553	293,012,781
剰余金増加額又は欠損金減少額	958,685	2,743,904
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	958,685	2,743,904
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,220,269	54,347,671
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,220,269	54,347,671
分配金	※1 4,274,684	※1 3,511,355
期末剰余金又は期末欠損金（△）	293,012,781	401,469,772

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日及び8月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成25年8月26日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
１．　※１　期首元本額	4,912,057,630円	4,274,684,608円
期中追加設定元本額	18,759,515円	28,695,833円
期中一部解約元本額	656,132,537円	792,024,838円
２．　受益権の総数	4,274,684,608口	3,511,355,603口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第25期 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月26日	第26期 自　平成25年8月27日 至　平成26年2月25日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（30,969,332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（43,605,192円）及び分配準備積立金（434,701,515円）より分配対象収益は509,276,039円（1万口当たり1,191.38円）であり、うち4,274,684円（1万口当たり10円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（22,598,574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（25,150,593円）、信託約款に規定される収益調整金（38,620,445円）及び分配準備積立金（376,232,127円）より分配対象収益は462,601,739円（1万口当たり1,317.44円）であり、うち3,511,355円（1万口当たり10円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	213,085,881	185,507,912
合計	213,085,881	185,507,912

（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25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26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）	1.0685円 (10,685円)	1.1143円 (11,143円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	432,117,355	748,513,682	
	ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	1,795,571,796	2,537,502,062	
	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	107,203,026	208,177,556	
	ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	149,085,429	320,235,501	
親投資信託受益証券　合計		2,483,977,606	3,814,428,801	
合計		2,483,977,606	3,814,428,801	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

バランス物語５０（安定・成長型）

（１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
（２）当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間（平成25年8月27日から平成26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。

【バランス物語５０（安定・成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	72,431,305	72,789,044
親投資信託受益証券	2,286,454,044	1,854,189,583
流動資産合計	2,358,885,349	1,926,978,627
資産合計	2,358,885,349	1,926,978,627
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,355,223	3,336,857
未払解約金	628,598	6,853,095
未払受託者報酬	1,323,568	1,133,941
未払委託者報酬	18,530,382	15,875,728
その他未払費用	62,784	53,766
流動負債合計	24,900,555	27,253,387
負債合計	24,900,555	27,253,387
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,177,611,769	※1 1,668,428,942
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	156,373,025	231,296,298
（分配準備積立金）	374,437,329	293,859,804
元本等合計	2,333,984,794	1,899,725,240
純資産合計	2,333,984,794	1,899,725,240
負債純資産合計	2,358,885,349	1,926,978,627

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第25期 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月26日	第26期 自　平成25年8月27日 至　平成26年2月25日
営業収益		
受取利息	18,381	14,606
有価証券売買等損益	227,785,264	157,735,539
営業収益合計	227,803,645	157,750,145
営業費用		
受託者報酬	1,323,568	1,133,941
委託者報酬	18,530,382	15,875,728
その他費用	62,784	53,766
営業費用合計	19,916,734	17,063,435
営業利益又は営業損失（△）	207,886,911	140,686,710
経常利益又は経常損失（△）	207,886,911	140,686,710
当期純利益又は当期純損失（△）	207,886,911	140,686,710
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	31,861,256	26,340,679
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△19,475,359	156,373,025
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,177,952	1,619,666
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,339,140	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	838,812	1,619,666
剰余金減少額又は欠損金増加額	－	37,705,567
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	37,705,567
分配金	※1 4,355,223	※1 3,336,857
期末剰余金又は期末欠損金（△）	156,373,025	231,296,298

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日及び8月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成25年8月26日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
１．　※１　期首元本額	2,615,245,758円	2,177,611,769円
期中追加設定元本額	19,890,013円	15,171,242円
期中一部解約元本額	457,524,002円	524,354,069円
２．　受益権の総数	2,177,611,769口	1,668,428,942口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第25期 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月26日	第26期 自　平成25年8月27日 至　平成26年2月25日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,889,090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（106,694,770円）及び分配準備積立金（359,903,462円）より分配対象収益は485,487,322円（1万口当たり2,229.45円）であり、うち4,355,223円（1万口当たり20円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,503,153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（83,952,673円）及び分配準備積立金（284,693,508円）より分配対象収益は381,149,334円（1万口当たり2,284.48円）であり、うち3,336,857円（1万口当たり20円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	173,100,922	123,197,413
合計	173,100,922	123,197,413

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26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）	1.0718円 (10,718円)	1.1386円 (11,386円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	332,124,988	575,306,904	
	ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	570,556,100	806,309,880	
	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	121,332,827	235,616,216	
	ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	110,314,983	236,956,583	
親投資信託受益証券　合計		1,134,328,898	1,854,189,583	
合計		1,134,328,898	1,854,189,583	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

バランス物語７０（成長型）

（１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
（２）当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間（平成25年8月27日から平成26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。

【バランス物語７０（成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	40,484,091	38,090,127
親投資信託受益証券	1,225,723,622	1,007,448,732
流動資産合計	1,266,207,713	1,045,538,859
資産合計	1,266,207,713	1,045,538,859
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,537,910	2,715,795
未払解約金	6,332,256	22,746
未払受託者報酬	741,191	608,495
未払委託者報酬	10,377,287	8,519,792
その他未払費用	35,124	28,815
流動負債合計	21,023,768	11,895,643
負債合計	21,023,768	11,895,643
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,179,303,444	※1 905,265,042
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	65,880,501	128,378,174
（分配準備積立金）	273,026,706	212,150,964
元本等合計	1,245,183,945	1,033,643,216
純資産合計	1,245,183,945	1,033,643,216
負債純資産合計	1,266,207,713	1,045,538,859

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第25期 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月26日	第26期 自　平成25年8月27日 至　平成26年2月25日
営業収益		
受取利息	11,660	8,677
有価証券売買等損益	179,067,750	106,725,110
営業収益合計	179,079,410	106,733,787
営業費用		
受託者報酬	741,191	608,495
委託者報酬	10,377,287	8,519,792
その他費用	35,124	28,815
営業費用合計	11,153,602	9,157,102
営業利益又は営業損失（△）	167,925,808	97,576,685
経常利益又は経常損失（△）	167,925,808	97,576,685
当期純利益又は当期純損失（△）	167,925,808	97,576,685
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	41,575,381	17,555,813
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△101,080,363	65,880,501
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,216,104	1,138,014
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	44,216,104	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	1,138,014
剰余金減少額又は欠損金増加額	67,757	15,945,418
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	15,945,418
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	67,757	－
分配金	※1 3,537,910	※1 2,715,795
期末剰余金又は期末欠損金（△）	65,880,501	128,378,174

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日及び8月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成25年8月26日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
１．　※１　期首元本額	2,072,698,030円	1,179,303,444円
期中追加設定元本額	14,067,699円	10,878,686円
期中一部解約元本額	907,462,285円	284,917,088円
２．　受益権の総数	1,179,303,444口	905,265,042口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第25期 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月26日	第26期 自　平成25年8月27日 至　平成26年2月25日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,880,735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（113,180,604円）及び分配準備積立金（265,683,881円）より分配対象収益は389,745,220円（1万口当たり3,304.88円）であり、うち3,537,910円（1万口当たり30円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,449,270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（89,056,655円）及び分配準備積立金（207,417,489円）より分配対象収益は303,923,414円（1万口当たり3,357.29円）であり、うち2,715,795円（1万口当たり30円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	124,869,106	84,241,062
合計	124,869,106	84,241,062

（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25期 平成25年8月26日現在	第26期 平成26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）	1.0559円 (10,559円)	1.1418円 (11,418円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド	243,011,886	420,945,188	
	ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	154,045,619	217,697,268	
	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	103,192,562	200,389,636	
	ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド	78,406,257	168,416,640	
親投資信託受益証券　合計		578,656,324	1,007,448,732	
合計		578,656,324	1,007,448,732	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「バランス物語３０（安定型）」、「バランス物語５０（安定・成長型）」、「バランス物語７０（成長型）」は、「ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」受益証券、「ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」受益証券、「ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド」受益証券及び「ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		54,813	36,280
コール・ローン		275,498,868	367,494,431
株式		27,619,043,600	26,799,538,400
未収入金		110,931,452	177,504,870
未収配当金		21,860,880	21,948,910
流動資産合計		28,027,389,613	27,366,522,891
資産合計		28,027,389,613	27,366,522,891
負債の部			
流動負債			
未払金		120,695,399	187,844,770
流動負債合計		120,695,399	187,844,770
負債合計		120,695,399	187,844,770
純資産の部			
元本等			
元本	※１	17,566,861,275	15,690,665,773
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		10,339,832,939	11,488,012,348
元本等合計		27,906,694,214	27,178,678,121
純資産合計		27,906,694,214	27,178,678,121
負債純資産合計		28,027,389,613	27,366,522,891

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	**株式** **移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。**
２．　収益及び費用の計上基準	**受取配当金** **原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。**

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,856,693,464円	17,566,861,275円
同期中追加設定元本額	198,806,084円	214,363,602円
同期中一部解約元本額	4,488,638,273円	2,090,559,104円
元本の内訳		
ファンド名		
バランス物語３０（安定型）	550,768,802円	432,117,355円
バランス物語５０（安定・成長型）	444,672,723円	332,124,988円
バランス物語７０（成長型）	315,231,895円	243,011,886円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	861,634,343円	815,185,741円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,180,138,098円	3,135,123,981円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,714,970,484円	3,708,349,009円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ１（安定型）	1,199,088,758円	880,102,218円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ２（安定・成長型）	3,726,496,934円	3,208,726,389円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ３（成長型）	1,609,042,209円	1,376,024,936円
ＤＩＡＭバランス物語３０ＶＡ（安定型）	588,415,447円	423,750,693円
ＤＩＡＭバランス物語５０ＶＡ（安定・成長型）	1,059,324,695円	848,168,960円
ＤＩＡＭバランス物語７０ＶＡ（成長型）	317,076,887円	287,979,617円
計	17,566,861,275円	15,690,665,773円
２．　受益権の総数	17,566,861,275口	15,690,665,773口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	2,513,317,111	4,249,532,481
合計	2,513,317,111	4,249,532,481

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成25年3月16日から平成25年8月26日まで及び平成25年3月16日から平成26年2月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年8月26日現在	平成26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）	1.5886円 (15,886円)	1.7322円 (17,322円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
（１）株式

平成26年2月25日現在

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考
		単　価	金　額	
積水ハウス	148,000	1,335	197,580,000	
日　揮	56,000	3,775	211,400,000	
新日鉄住金ＳＯＬ	66,900	2,733	182,837,700	
エムスリー	1,195	340,500	406,897,500	
インフォマート	39,500	1,513	59,763,500	
大黒天物産	42,800	2,747	117,571,600	
日本たばこ産業	141,500	3,360	475,440,000	
ウエルシアＨＤ	77,500	5,860	454,150,000	
セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ	65,600	4,038	264,892,800	
三菱瓦斯化学	242,000	691	167,222,000	
ダイセル	207,000	899	186,093,000	
日本ゼオン	128,000	1,044	133,632,000	
イオンファンタジー	56,900	1,487	84,610,300	
武田薬品	61,700	4,901	302,391,700	
アステラス製薬	36,900	6,415	236,713,500	
塩野義製薬	86,700	2,133	184,931,100	
ＤＩＣ	1,024,000	287	293,888,000	
フジ・メディア・ＨＤ	115,500	1,953	225,571,500	
ヤフー	855,000	654	559,170,000	
アルファシステムズ	151,500	1,398	211,797,000	
楽天	164,800	1,534	252,803,200	
ＪＸホールディングス	708,000	546	386,568,000	
ブリヂストン	89,000	3,710	330,190,000	
日本特殊陶業	133,000	2,317	308,161,000	
新日鐵住金	1,611,000	301	484,911,000	
三井金属	448,000	274	122,752,000	
ＵＡＣＪ	356,000	416	148,096,000	
三和ホールディングス	251,000	704	176,704,000	
東芝機械	286,000	507	145,002,000	
豊田自動織機	47,200	4,880	230,336,000	
ＳＭＣ	16,400	25,965	425,826,000	
小松製作所	143,900	2,135	307,226,500	
荏原製作所	539,000	709	382,151,000	
ミネベア	243,000	894	217,242,000	
日　立	942,000	814	766,788,000	
三菱電機	305,000	1,203	366,915,000	
安川電機	122,000	1,553	189,466,000	
東芝テック	220,000	669	147,180,000	
日本電産	66,500	12,200	811,300,000	
日立国際電気	109,000	1,392	151,728,000	
メガチップス	103,500	1,265	130,927,500	
デンソー	39,200	5,448	213,561,600	
エンプラス	122,000	6,570	801,540,000	

村田製作所	31,900	9,775	311,822,500	
トヨタ自動車	246,900	5,990	1,478,931,000	
日野自動車	197,000	1,548	304,956,000	
アイシン精機	54,500	3,575	194,837,500	
マ　ツ　ダ	882,000	495	436,590,000	
本田技研	203,000	3,710	753,130,000	
富士重工業	196,000	2,777	544,292,000	
キヤノン	45,800	3,179	145,598,200	
藤森工業	28,800	2,459	70,819,200	
伊　藤　忠	339,000	1,281	434,259,000	
丸　紅	335,000	728	243,880,000	
三菱商事	49,200	2,002	98,498,400	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	1,805,000	615	1,110,075,000	
三井住友フィナンシャルＧ	252,000	4,791	1,207,332,000	
みずほフィナンシャルＧ	1,977,000	216	427,032,000	
オリックス	419,000	1,573	659,087,000	
東京海上ＨＤ	180,000	3,100	558,000,000	
三井不動産	261,000	3,139	819,279,000	
三菱地所	166,000	2,501	415,166,000	
東日本旅客鉄道	28,400	7,805	221,662,000	
山　九	378,000	454	171,612,000	
商船三井	442,000	417	184,314,000	
住友倉庫	296,000	523	154,808,000	
日本テレビＨＬＤＳ	179,300	1,706	305,885,800	
日本電信電話	110,700	5,778	639,624,600	
ＫＤＤＩ	98,000	6,146	602,308,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	47,100	3,455	162,730,500	
エイチ・アイ・エス	35,600	6,010	213,956,000	
ＳＣＳＫ	61,200	3,115	190,638,000	
コナミ	130,700	2,591	338,643,700	
ニトリホールディングス	66,600	4,940	329,004,000	
ソフトバンク	76,200	8,095	616,839,000	
合計	20,288,595		26,799,538,400	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		841,310,749	684,696,899
国債証券		16,276,521,520	13,936,906,960
特殊債券		－	200,084,000
社債券		25,227,812,360	24,342,544,490
未収入金		－	769,956,900
未収利息		161,121,112	145,267,875
前払費用		3,598,320	5,402,108
流動資産合計		42,510,364,061	40,084,859,232
資産合計		42,510,364,061	40,084,859,232
負債の部			
流動負債			
未払金		214,196,000	1,229,547,000
流動負債合計		214,196,000	1,229,547,000
負債合計		214,196,000	1,229,547,000
純資産の部			
元本等			
元本	※１	30,749,869,414	27,495,036,539
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		11,546,298,647	11,360,275,693
元本等合計		42,296,168,061	38,855,312,232
純資産合計		42,296,168,061	38,855,312,232
負債純資産合計		42,510,364,061	40,084,859,232

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	**国債証券、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。** **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。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。**

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	31,942,037,529円	30,749,869,414円
同期中追加設定元本額	1,972,766,034円	882,034,540円
同期中一部解約元本額	3,164,934,149円	4,136,867,415円
元本の内訳		
ファンド名		
バランス物語３０（安定型）	2,192,595,594円	1,795,571,796円
バランス物語５０（安定・成長型）	734,822,390円	570,556,100円
バランス物語７０（成長型）	200,599,184円	154,045,619円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	3,481,009,563円	3,542,128,647円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	5,441,022,574円	5,684,787,700円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,434,830,990円	2,557,072,787円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ１（安定型）	4,737,551,439円	3,520,534,647円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ２（安定・成長型）	6,250,629,377円	5,519,812,700円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ３（成長型）	996,184,470円	853,176,702円
ＤＩＡＭバランス物語３０ＶＡ（安定型）	2,347,093,520円	1,682,518,648円
ＤＩＡＭバランス物語５０ＶＡ（安定・成長型）	1,738,451,279円	1,430,419,880円
ＤＩＡＭバランス物語７０ＶＡ（成長型）	195,079,034円	184,411,313円
計	30,749,869,414円	27,495,036,539円
２．　受益権の総数	30,749,869,414口	27,495,036,539口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年8月26日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	平成26年2月25日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	37,483,010	460,190,040
特殊債券	－	684,000
社債券	75,308,420	272,717,490
合計	112,791,430	733,591,530

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成25年5月28日から平成25年8月26日まで及び平成25年5月28日から平成26年2月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年8月26日現在	平成26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）	1.3755円 (13,755円)	1.4132円 (14,132円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種　類	銘　柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	６回　利付国庫債券（４０年）	120,000,000	126,823,200	
	３１３回　利付国庫債券（１０年）	1,565,000,000	1,669,682,850	
	３２２回　利付国庫債券（１０年）	875,000,000	907,025,000	
	３２４回　利付国庫債券（１０年）	1,055,000,000	1,083,706,550	
	３３回　利付国庫債券（３０年）	2,549,000,000	2,770,023,790	
	１０６回　利付国庫債券（２０年）	680,000,000	794,314,800	
	１０８回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	675,762,000	
	１１４回　利付国庫債券（２０年）	332,000,000	380,817,280	
	１１９回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	329,493,000	
	１２１回　利付国庫債券（２０年）	2,879,000,000	3,197,158,290	
	１２３回　利付国庫債券（２０年）	720,000,000	819,820,800	
	１３０回　利付国庫債券（２０年）	1,090,000,000	1,182,279,400	
国債証券　合計		12,765,000,000	13,936,906,960	
特殊債券	４４回　韓国産業銀行円貨債	200,000,000	200,084,000	
特殊債券　合計		200,000,000	200,084,000	
社債券	１２回　ポスコ円貨社債	300,000,000	298,509,000	
	１０回　現代キャピタル・サービシズ・インク円貨債	300,000,000	300,288,000	
	４１回　鹿島建設社債	300,000,000	303,342,000	
	２７回　双日社債	300,000,000	307,386,000	
	２８回　双日社債	200,000,000	202,372,000	
	２回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	106,024,000	
	７回　森ビル社債	100,000,000	105,204,000	
	１０回　森ビル社債	300,000,000	305,727,000	
	１１回　森ビル社債	400,000,000	405,912,000	
	１２回　森ビル社債	100,000,000	100,197,000	
	４４回　三井化学社債	300,000,000	302,664,000	
	２３回　コスモ石油社債	300,000,000	302,805,000	
	３回　出光興産社債	200,000,000	202,616,000	
	２３回　太平洋セメント社債	200,000,000	201,534,000	
	１２回　三井金属社債	100,000,000	101,759,000	
	１３回　三井金属社債	100,000,000	100,718,000	
	２９回　三菱マテリアル社債	200,000,000	203,030,000	
	１回　小森コーポレーション社債	200,000,000	200,262,000	
	１回　セガサミーホールディングス社債	200,000,000	201,122,000	
	２回　セガサミーホールディングス社債	100,000,000	100,163,000	
	２７回　富士電機社債	600,000,000	609,750,000	
	５回　アンリツ社債	200,000,000	201,520,000	
	３６回　ＩＨＩ社債	200,000,000	203,846,000	
	３７回　ＩＨＩ社債	200,000,000	202,268,000	
	３８回　ＩＨＩ社債	200,000,000	204,948,000	

２１回　トピー工業社債	400,000,000	409,052,000	
２５回　阪和興業社債	200,000,000	200,294,000	
２４回　丸井グループ社債	200,000,000	201,276,000	
２回　新生銀行劣後債券	100,000,000	101,707,000	
８回　みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	213,804,000	
２５回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	100,000,000	105,191,000	
２８回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	100,000,000	106,864,000	
３７回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	211,352,000	
４回　りそな銀行劣後社債	600,000,000	671,412,000	
６回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,192,000	
１０回　西日本シティ銀行期限前償還条項付劣後社債	600,000,000	605,346,000	
３回　武蔵野銀行期限前償還条項付劣後社債	700,000,000	704,137,000	
３回　十六銀行期限前償還条項付劣後社債	700,000,000	704,109,000	
３回　大垣共立銀行期限前償還条項付劣後債	100,000,000	101,030,000	
２回　清水銀行期限前償還条項付劣後社債	500,000,000	505,150,000	
３回　紀陽銀行期限前償還条項付劣後社債	400,000,000	402,760,000	
５回　ほくほくフィナンシャルグループ期限前償還条項付劣後社債	600,000,000	605,376,000	
３回　宮崎銀行期限前償還条項付劣後社債	200,000,000	202,060,000	
３回　琉球銀行期限前償還条項付劣後社債	300,000,000	302,544,000	
６回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	100,000,000	108,395,000	
７回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	200,000,000	213,412,000	
９回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	200,000,000	214,938,000	
１１回　住友信託銀行劣後債	200,000,000	212,888,000	
１９回　みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	214,706,000	
２０回　みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,974,000	
３回　興銀リース社債	200,000,000	200,096,000	
１６回　ポケットカード社債	100,000,000	100,164,000	
６３回　アコム社債	300,000,000	304,659,000	
６４回　アコム社債	100,000,000	101,339,000	
６５回　アコム社債	200,000,000	200,118,000	
６６回　アコム社債	300,000,000	300,225,000	
７回　ジャックス社債	200,000,000	202,696,000	
８回　ジャックス社債	500,000,000	512,860,000	
９回　ジャックス社債	100,000,000	100,535,000	
１５７回　オリックス社債	500,000,000	512,000,000	
１６４回　オリックス社債	200,000,000	207,066,000	
１６７回　オリックス社債	100,000,000	100,560,000	
１４回　大和証券グループ本社社債	200,000,000	204,232,000	
１回　あいおいニッセイ同和損害保険劣後社債	500,000,000	518,290,000	
２回　あいおいニッセイ同和損害保険期限前償還条項付劣後社債	800,000,000	806,904,000	

	１８回　平和不動産社債	300,000,000	302,568,000	
	１４回　東京建物社債	500,000,000	517,205,000	
	１６回　東京建物社債	200,000,000	202,968,000	
	１７回　東京建物社債	300,000,000	310,014,000	
	１９回　東急不動産社債	100,000,000	100,754,000	
	２回　京阪神不動産社債	100,000,000	103,913,000	
	１回　京阪神不動産社債	400,000,000	406,008,000	
	７回　大京社債	100,000,000	103,661,000	
	１９回　山陽電気鉄道社債	200,000,000	202,088,000	
	１回　山九社債	200,000,000	200,760,000	
	２９回　日本郵船社債	100,000,000	106,632,000	
	３６回　日本郵船社債	300,000,000	301,545,000	
	３７回　日本郵船社債	200,000,000	203,446,000	
	７回　澁澤倉庫社債	200,000,000	202,090,000	
	４８９回　関西電力社債	500,000,000	504,305,000	
	４９１回　関西電力社債	250,000,000	250,645,000	
	３７６回　中国電力社債	100,000,000	101,142,000	
	４４５回　東北電力社債	330,000,000	349,740,600	
	４６６回　東北電力社債	200,000,000	202,968,000	
	４７１回　東北電力社債	200,000,000	202,196,000	
	４２５回　九州電力社債	376,000,000	375,902,240	
	４２６回　九州電力社債	250,000,000	250,100,000	
	３１５回　北海道電力社債	200,000,000	203,022,000	
	３１６回　北海道電力社債	300,000,000	310,080,000	
	３１７回　北海道電力社債	245,000,000	247,148,650	
	２回　東京都競馬社債	200,000,000	201,508,000	
	９回　コナミ社債	100,000,000	100,441,000	
	１１回　コナミ社債	100,000,000	101,015,000	
社債券　合計		23,851,000,000	24,342,544,490	
合計		36,816,000,000	38,479,535,450	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		42,866,179	9,028,673
コール・ローン		151,997,775	93,407,481
株式		11,358,975,821	11,240,731,397
派生商品評価勘定		－	74,200
未収入金		－	490,126,721
未収配当金		17,807,606	29,529,262
流動資産合計		11,571,647,381	11,862,897,734
資産合計		11,571,647,381	11,862,897,734
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	85,100
未払金		34,173,437	483,581,157
流動負債合計		34,173,437	483,666,257
負債合計		34,173,437	483,666,257
純資産の部			
元本等			
元本	※１	7,063,621,382	5,859,840,624
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		4,473,852,562	5,519,390,853
元本等合計		11,537,473,944	11,379,231,477
純資産合計		11,537,473,944	11,379,231,477
負債純資産合計		11,571,647,381	11,862,897,734

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,984,564,425円	7,063,621,382円
同期中追加設定元本額	153,595,623円	37,386,397円
同期中一部解約元本額	1,074,538,666円	1,241,167,155円
元本の内訳		
ファンド名		
バランス物語３０（安定型）	143,104,387円	107,203,026円
バランス物語５０（安定・成長型）	173,219,281円	121,332,827円
バランス物語７０（成長型）	150,088,696円	103,192,562円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	228,317,916円	206,732,467円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,292,775,024円	1,180,501,748円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,771,779,081円	1,638,423,124円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ１（安定型）	317,656,260円	215,297,861円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ２（安定・成長型）	1,494,592,642円	1,177,080,023円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ３（成長型）	755,373,648円	581,748,385円
ＤＩＡＭバランス物語３０ＶＡ（安定型）	158,069,275円	100,418,667円
ＤＩＡＭバランス物語５０ＶＡ（安定・成長型）	429,338,898円	303,643,922円
ＤＩＡＭバランス物語７０ＶＡ（成長型）	149,306,274円	124,266,012円
計	7,063,621,382円	5,859,840,624円
２．　受益権の総数	7,063,621,382口	5,859,840,624口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	744,800,527	1,734,352,062
合計	744,800,527	1,734,352,062

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成25年3月16日から平成25年8月26日まで及び平成25年3月16日から平成26年2月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成25年8月26日 現在				平成26年2月25日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	－	－	－	－	102,040,200	－	102,092,600	△52,400
アメリカ・ドル	－	－	－	－	61,512,000	－	61,524,000	△12,000
イギリス・ポンド	－	－	－	－	28,978,200	－	29,032,600	△54,400
スイス・フラン	－	－	－	－	11,550,000	－	11,536,000	14,000
買　建	－	－	－	－	95,100,900	－	95,142,400	41,500
カナダ・ドル	－	－	－	－	12,912,200	－	12,972,400	60,200
デンマーク・クローネ	－	－	－	－	23,027,500	－	23,021,400	△6,100
ユーロ	－	－	－	－	59,161,200	－	59,148,600	△12,600
合計	－	－	－	－	197,141,100	－	197,235,000	△10,900

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3．換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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25年8月26日現在	平成26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）	1.6334円 (16,334円)	1.9419円 (19,419円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

平成26年2月25日現在

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
アメリカ・ドル	VERIZON COMMUNICATIONS INC	6,305	46.760	294,821.800	
	AMAZON.COM INC	1,575	351.780	554,053.500	
	ALLERGAN INC	3,108	124.500	386,946.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,691	93.760	439,828.160	
	AMGEN INC	2,857	125.790	359,382.030	
	AMERICAN INTL GROUP	10,143	49.450	501,571.350	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	3,395	183.550	623,152.250	
	ARRIS GROUP INC	7,031	29.690	208,750.390	
	VALERO ENERGY CORP	6,665	50.920	339,381.800	
	APPLE INC	3,319	527.550	1,750,938.450	
	ASPEN TECHNOLOGY INC	5,429	47.500	257,877.500	
	AMETEK INC	6,756	52.860	357,122.160	
	BE AEROSPACE INC	3,674	83.510	306,815.740	
	VERIZON COMM INC	11,357	46.230	525,034.110	
	BOEING CO	3,597	129.590	466,135.230	
	BORGWARNER INC	4,559	61.300	279,466.700	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	8,687	54.310	471,790.970	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,847	38.790	226,805.130	
	CABOT OIL & GAS CORP	7,911	35.650	282,027.150	
	CARDINAL HEALTH INC	5,030	71.770	361,003.100	
	CELGENE CORP	2,139	164.090	350,988.510	
	JPMORGAN CHASE & CO	15,497	58.030	899,290.910	
	CIGNA CORP	5,770	79.190	456,926.300	
	COCA-COLA CO/THE	13,700	37.500	513,750.000	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	5,318	53.470	284,353.460	
	COMCAST CORP-CL A	10,461	51.150	535,080.150	
	MANHATTAN ASSOCIATES INC	7,409	36.500	270,428.500	
	CUBIST PHARMACEUTICALS INC	1,767	79.290	140,105.430	
	QUESTCOR PHARMACEUTICALS INC	3,538	79.460	281,129.480	
	ULTIMATE SOFTWARE GROUP INC	1,608	170.790	274,630.320	
	DR HORTON INC	11,336	23.710	268,776.560	
	THE WALT DISNEY CO	11,316	80.730	913,540.680	
	EBAY INC	5,897	56.300	332,001.100	

BANK OF AMERICA CORP	50,694	16.530	837,971.820	
CITIGROUP INC	9,156	48.980	448,460.880	
EOG RESOURCES INC	4,318	180.400	778,967.200	
CONCUR TECHNOLOGIES INC	1,771	126.130	223,376.230	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	4,475	74.350	332,716.250	
EXXON MOBIL CORP	14,840	96.440	1,431,169.600	
FIFTH THIRD BANCORP	20,384	21.610	440,498.240	
FOREST LABORATORIES INC	3,195	98.250	313,908.750	
GILEAD SCIENCES INC	12,467	83.570	1,041,867.190	
GENERAL ELECTRIC CO	35,087	25.290	887,350.230	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	1,570	121.490	190,739.300	
HELEN OF TROY LTD	4,523	63.120	285,491.760	
HERSHEY FOODS CORP	4,345	108.070	469,564.150	
HEWLETT-PACKARD CO	8,107	29.920	242,561.440	
JUNIPER NETWORKS INC	16,078	27.580	443,431.240	
HOME DEPOT INC	8,135	77.870	633,472.450	
BIOGEN IDEC INC	1,366	345.630	472,130.580	
IDEX CORP	3,738	73.560	274,967.280	
INTEL CORP	14,020	24.630	345,312.600	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16,982	17.170	291,580.940	
INCYTE CORP	2,840	67.030	190,365.200	
JOHNSON & JOHNSON	11,784	91.110	1,073,640.240	
HAIN CELESTIAL GROUP INC	3,939	88.440	348,365.160	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,412	72.290	391,233.480	
LINCOLN NATIONAL CORP	11,112	50.770	564,156.240	
LOCKHEED MARTIN CORP	3,353	166.140	557,067.420	
MDU RESOURCES GROUP INC	12,653	34.780	440,071.340	
MARSH & MCLENNAN COS	9,737	48.070	468,057.590	
METLIFE INC	8,502	50.870	432,496.740	
CVS CAREMARK CORP	6,467	71.370	461,549.790	
MERCK & CO.INC.	15,432	56.180	866,969.760	
MICROSOFT CORP	29,885	37.690	1,126,365.650	
MYLAN LABORATORIES	8,433	51.050	430,504.650	
ILLUMINA INC	2,336	178.530	417,046.080	
WELLS FARGO & CO	24,857	46.080	1,145,410.560	
NPS PHARMACEUTICALS INC	11,084	39.060	432,941.040	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,914	153.870	448,377.180	
ORACLE CORP	12,359	38.140	471,372.260	
PEPSICO INC	5,344	78.880	421,534.720	

PENTAIR LTD	4,104	79.520	326,350.080	
PFIZER INC	31,438	31.990	1,005,701.620	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,080	194.740	599,799.200	
ALTRIA GROUP INC	11,566	35.380	409,205.080	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,355	81.340	435,575.700	
AETNA INC	5,009	71.800	359,646.200	
PROCTER & GAMBLE CO	10,036	77.860	781,402.960	
QUALCOMM INC	6,319	75.430	476,642.170	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,177	347.620	409,148.740	
SEATTLE GENETICS INC /WA	2,977	54.330	161,740.410	
RITE AID CORP	67,581	6.530	441,303.930	
RPM INTERNATIONAL INC	5,385	40.100	215,938.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,121	286.300	893,542.300	
ST JUDE MEDICAL INC	6,488	67.720	439,367.360	
PRICELINE.COM INC	466	1,313.670	612,170.220	
SCHLUMBERGER LTD	7,548	92.720	699,850.560	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,827	68.580	331,035.660	
SINCLAIR BROADCAST GROUP-A	5,151	29.830	153,654.330	
IAC INTERACTIVE CORP	3,822	74.160	283,439.520	
ACUITY BRANDS INC	2,090	136.310	284,887.900	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,198	84.960	441,622.080	
AT&T INC	20,856	32.470	677,194.320	
STATE STREET CORP	6,126	69.070	423,122.820	
LIN MEDIA LLC-A	8,856	22.780	201,739.680	
NETFLIX INC	433	447.000	193,551.000	
TEREX CORP	5,473	43.040	235,557.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,411	123.370	420,815.070	
UNION PACIFIC CORP	4,026	179.610	723,109.860	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	4,121	83.110	342,496.310	
CBS CORP	9,985	66.460	663,603.100	
ACTAVIS PLC	3,176	222.370	706,247.120	
NEXSTAR BROADCASTING GROUP INC	4,777	44.190	211,095.630	
WABTEC CORP	6,890	79.140	545,274.600	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,613	34.400	227,487.200	
TJX COMPANIES INC	8,876	60.390	536,021.640	
DOMINO'S PIZZA INC	6,131	74.690	457,924.390	
GOOGLE INC	1,365	1,212.510	1,655,076.150	
T-MOBILE US INC	10,851	32.310	350,595.810	
LAS VEGAS SANDS CORP	3,083	84.410	260,236.030	

	MEDIVATION INC	2,632	86.970	228,905.040	
	WEB.COM GROUP INC	6,152	36.420	224,055.840	
	TRANSDIGM GROUP INC	2,092	178.220	372,836.240	
	MASTERCARD INC	9,440	75.960	717,062.400	
	TIME WARNER CABLE INC	4,127	139.160	574,313.320	
	DELTA AIR LINES INC	12,110	32.450	392,969.500	
	DISCOVER FINANCIAL	7,402	57.440	425,170.880	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	6,589	79.170	521,651.130	
	VISA INC	3,074	226.190	695,308.060	
	COLFAX CORP	4,729	70.620	333,961.980	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	5,801	85.970	498,711.970	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	5,809	59.570	346,042.130	
	PACIRA PHARMACEUTICALS INC	3,374	73.330	247,415.420	
	AOL INC	3,677	43.700	160,684.900	
	CORNERSTONE ONDEMAND INC	4,883	59.860	292,296.380	
	SPLUNK INC	1,797	90.750	163,077.750	
	REXNORD CORP	7,677	29.140	223,707.780	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,464	171.750	251,442.000	
	NXP SEMICONDUCTOR NV	5,876	55.550	326,411.800	
	TARGA RESOURCES CORP	3,512	96.210	337,889.520	
	ACADIA HEALTHCARE CO INC	4,351	50.930	221,596.430	
	GENERAL MOTORS CO	7,584	36.550	277,195.200	
	PROOFPOINT INC	4,315	41.420	178,727.300	
	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	5,955	66.510	396,067.050	
	DEMANDWARE INC	2,954	73.880	218,241.520	
	YELP INC	2,533	94.670	239,799.110	
	FACEBOOK INC	6,242	70.780	441,808.760	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,395	64.800	284,796.000	
	WHITEWAVE FOODS CO	15,881	29.180	463,407.580	
	LIFELOCK INC	10,031	20.320	203,829.920	
	ABBVIE INC	5,575	50.850	283,488.750	
	ENANTA PHARMACEUTICALS INC	4,602	38.650	177,867.300	
	COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,602	22.920	288,837.840	
	PERRIGO CO PLC	2,041	160.510	327,600.910	
	ARAMARK HOLDINGS CORP	9,733	28.260	275,054.580	
アメリカ・ドル	小計	1,140,184		65,792,373.610 (6,747,007,913)	
イギリス・ポンド	ASHTEAD GROUP	25,777	8.680	223,744.360	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	33,227	4.340	144,205.180	

	BTG PLC	23,507	6.000	141,042.000	
	BT GROUP PLC	111,053	4.139	459,648.360	
	DIAGEO PLC	10,308	19.100	196,882.800	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	10,931	31.825	347,879.070	
	GREENCORE GROUP PLC	89,831	2.380	213,797.780	
	IMI PLC	13,209	15.200	200,776.800	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,167	32.980	137,427.660	
	HSBC HOLDINGS PLC	74,550	6.357	473,914.350	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,586	7.810	246,686.660	
	PACE PLC	31,042	4.170	129,445.140	
	PRUDENTIAL PLC	41,373	13.720	567,637.560	
	RIO TINTO PLC	15,641	35.365	553,143.960	
	VODAFONE GROUP PLC	130,778	2.523	329,952.890	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,721	50.250	136,730.250	
	BP PLC	73,081	5.059	369,716.770	
	SHIRE PLC	9,611	34.100	327,735.100	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	265,396	0.816	216,563.130	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	19,309	16.830	324,970.470	
	DAILY MAIL & GENERAL TST-A NV	13,624	10.650	145,095.600	
	ASTRAZENECA PLC	5,120	41.000	209,920.000	
	ASOS PLC	2,577	70.250	181,034.250	
	ITV PLC	208,034	2.038	423,973.290	
	BOOKER GROUP PLC	124,918	1.710	213,609.780	
	MONITISE PLC	129,476	0.785	101,638.660	
	GLENCORE XSTRATA PLC	79,167	3.365	266,396.950	
	TALKTALK TELECOM GROUP PLC	50,695	3.192	161,818.440	
イギリス・ポンド　小計		1,630,709		7,445,387.260 (1,271,597,690)	
オーストラリア・ドル	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	5,763	75.360	434,299.680	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	16,968	34.430	584,208.240	
オーストラリア・ドル　小計		22,731		1,018,507.920 (94,354,574)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	6,932	87.220	604,609.040	
	NATIONAL BANK OF CANADA	10,484	43.610	457,207.240	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	3,367	161.410	543,467.470	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	5,174	95.840	495,876.160	
	ROYAL BANK OF CANADA	5,949	72.490	431,243.010	

	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,883	174.870	679,020.210	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,042	237.430	247,402.060	
	BADGER DAYLIGHTING LTD	9,002	33.240	299,226.480	
カナダ・ドル　小計		45,833		3,758,051.670 (348,258,648)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	15,239	66.400	1,011,869.600	
	CIE FINANC RICHEMONT	2,780	88.600	246,308.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,045	270.000	822,150.000	
	SIKA INHABER	81	3,251.000	263,331.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	9,635	74.400	716,844.000	
	SWISSCOM AG-REG	634	521.000	330,314.000	
	ADECCO SA-REG	5,051	73.600	371,753.600	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	6	50,175.000	301,050.000	
	ACTELION	4,560	89.800	409,488.000	
	AUTONEUM HOLDING AG	1,260	155.800	196,308.000	
スイス・フラン　小計		42,291		4,669,416.200 (538,710,547)	
スウェーデン・クローナ	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	11,599	192.500	2,232,807.500	
	ASSA ABLOY AB-B	6,677	329.500	2,200,071.500	
スウェーデン・クローナ　小計		18,276		4,432,879.000 (69,862,173)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	9,679	247.000	2,390,713.000	
	PANDORA A/S	3,505	351.500	1,232,007.500	
デンマーク・クローネ　小計		13,184		3,622,720.500 (68,360,736)	
ユーロ	AIRBUS GROUP NV	9,391	53.070	498,380.370	
	AXA	24,068	19.635	472,575.180	
	SAFRAN SA	8,650	50.930	440,544.500	
	BNP PARIBAS	8,235	59.340	488,664.900	
	CAP GEMINI SA	2,853	56.680	161,708.040	
	INGENICO	2,619	67.890	177,803.910	
	NATIXIS	57,408	5.143	295,249.340	
	UNITED INTERNET	9,190	33.740	310,070.600	
	PUBLICIS GROUPE	3,385	68.870	233,124.950	
	HUHTAMAKI	12,124	20.350	246,723.400	
	INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATICHE SPA	5,110	36.500	186,515.000	
	MEDIOBANCA SPA	36,710	7.150	262,476.500	
	CONTINENTAL AG	1,482	169.150	250,680.300	
	DEUTSCHE POST AG-REG	17,366	26.510	460,372.660	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	3,197	74.660	238,688.020	
	SOCIETE GENERALE-A	13,702	47.950	657,010.900	

	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	17,127	13.710	234,811.170	
	TOTAL SA	9,138	46.235	422,495.430	
	HENKEL AG & CO KGAA	3,439	74.660	256,755.740	
	SIEMENS AG-REG	3,390	95.690	324,389.100	
	ING GROEP NV-CVA	69,485	10.615	737,583.270	
	BAYER AG	3,735	102.200	381,717.000	
	DAIMLER AG	8,731	67.690	591,001.390	
	DUERR AG	3,893	61.480	239,341.640	
	SAMPO OYJ-A SHS	8,563	36.760	314,775.880	
	ALLIANZ SE	1,887	130.800	246,819.600	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	8,315	34.750	288,946.250	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	38,627	9.072	350,424.140	
	TUI AG	22,708	13.150	298,610.200	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	7,841	25.550	200,337.550	
	SANOFI	4,533	74.650	338,388.450	
	DRILLISCH AG	13,078	24.350	318,449.300	
	ENEL SPA	56,366	3.768	212,387.080	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	33,608	12.510	420,436.080	
	WIRECARD AG	4,758	33.905	161,319.990	
	TELECOM ITALIA SPA	186,798	0.870	162,514.260	
	AZIMUT HOLDING SPA	7,006	24.040	168,424.240	
	SKY DEUTSCHLAND AG	22,411	7.540	168,978.940	
	AURELIUS AG	5,702	28.880	164,673.760	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	13,986	20.140	281,678.040	
	FREENET AG	8,854	24.495	216,878.730	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,941	14.190	325,532.790	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	31,023	5.410	167,834.430	
	JAZZTEL PLC	16,307	9.920	161,765.440	
	ZIGGO NV	6,158	33.570	206,724.060	
ユーロ　小計		855,898		13,744,582.520 (1,935,787,003)	
香港・ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	57,000	103.300	5,888,100.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	93,000	72.350	6,728,550.000	
香港・ドル　小計		150,000		12,616,650.000 (166,792,113)	
合計		3,919,106		11,240,731,397 (11,240,731,397)	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	146銘柄	59.29%	60.02%
イギリス・ポンド	株式	28銘柄	11.17%	11.31%
オーストラリア・ドル	株式	2銘柄	0.83%	0.84%
カナダ・ドル	株式	8銘柄	3.06%	3.10%
スイス・フラン	株式	10銘柄	4.73%	4.79%
スウェーデン・クローナ	株式	2銘柄	0.61%	0.62%
デンマーク・クローネ	株式	2銘柄	0.60%	0.61%
ユーロ	株式	45銘柄	17.01%	17.22%
香港・ドル	株式	2銘柄	1.47%	1.48%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		13,598,095	9,604,005
コール・ローン		108,783,718	111,634,705
国債証券		15,026,042,854	11,472,421,690
特殊債券		514,295,883	465,800,559
派生商品評価勘定		17,029,728	1,306,933
未収入金		695,139,493	5,088,643
未収利息		121,111,338	122,257,165
前払費用		21,196,270	14,932,040
流動資産合計		16,517,197,379	12,203,045,740
資産合計		16,517,197,379	12,203,045,740
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,336,714	1,668,230
未払金		703,875,791	1,055,441
流動負債合計		716,212,505	2,723,671
負債合計		716,212,505	2,723,671
純資産の部			
元本等			
元本	※１	7,917,275,754	5,679,955,165
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		7,883,709,120	6,520,366,904
元本等合計		15,800,984,874	12,200,322,069
純資産合計		15,800,984,874	12,200,322,069
負債純資産合計		16,517,197,379	12,203,045,740

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,067,347,657円	7,917,275,754円
同期中追加設定元本額	190,165,053円	123,157,341円
同期中一部解約元本額	340,236,956円	2,360,477,930円
元本の内訳		
ファンド名		
バランス物語３０（安定型）	192,113,549円	149,085,429円
バランス物語５０（安定・成長型）	143,482,507円	110,314,983円
バランス物語７０（成長型）	102,148,102円	78,406,257円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	281,871,632円	290,389,993円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,027,010,785円	1,053,765,641円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,185,397,771円	1,230,795,999円
外国債券私募オープン（適格機関投資家向け）	2,125,031,065円	470,702,193円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ１（安定型）	409,093,849円	300,557,340円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ２（安定・成長型）	1,256,275,458円	1,046,128,280円
ＤＩＡＭライフサイクル・ファンドＶＡ３（成長型）	524,061,559円	440,157,825円
ＤＩＡＭバランス物語３０ＶＡ（安定型）	209,452,338円	144,862,135円
ＤＩＡＭバランス物語５０ＶＡ（安定・成長型）	359,492,459円	272,638,253円
ＤＩＡＭバランス物語７０ＶＡ（成長型）	101,844,680円	92,150,837円
計	7,917,275,754円	5,679,955,165円
２．　受益権の総数	7,917,275,754口	5,679,955,165口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年8月26日現在	平成26年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△436,431,600	△182,120,330
特殊債券	△16,485,981	△15,928,066
合計	△452,917,581	△198,048,396

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成25年5月28日から平成25年8月26日まで及び平成25年5月28日から平成26年2月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成25年8月26日 現在				平成26年2月25日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	1,824,400,710	－	1,836,737,424	△12,336,714	1,001,455,140	－	1,002,519,235	△1,064,095
アメリカ・ドル	1,350,511,638	－	1,360,218,024	△9,706,386	572,029,035	－	571,805,935	223,100
イギリス・ポンド	431,669,244	－	433,659,600	△1,990,356	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	15,836,562	－	15,991,200	△154,638	8,229,105	－	8,313,300	△84,195
スウェーデン・クローナ	26,383,266	－	26,868,600	△485,334	－	－	－	－
ユーロ	－	－	－	－	421,197,000	－	422,400,000	△1,203,000
買　建	1,664,440,588	－	1,681,470,316	17,029,728	888,801,121	－	889,503,919	702,798
アメリカ・ドル	10,622,382	－	10,650,916	28,534	46,396,744	－	46,548,419	151,675
イギリス・ポンド	－	－	－	－	17,006,130	－	17,068,000	61,870
カナダ・ドル	391,371,559	－	393,399,100	2,027,541	－	－	－	－
シンガポール・ドル	93,995,370	－	94,943,700	948,330	62,106,275	－	62,524,000	417,725
スイス・フラン	58,416,875	－	58,965,500	548,625	44,936,970	－	44,990,400	53,430
ノルウェー・クローネ	49,654,220	－	50,542,800	888,580	40,826,187	－	41,212,800	386,613
ポーランド・ズロチ	120,966,274	－	122,809,800	1,843,526	105,499,780	－	105,512,300	12,520
ユーロ	939,413,908	－	950,158,500	10,744,592	572,029,035	－	571,648,000	△381,035
合計	3,488,841,298	－	3,518,207,740	4,693,014	1,890,256,261	－	1,892,023,154	△361,297

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

２．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
３．換算において円未満の端数は切捨てております。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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25年8月26日現在	平成26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）	1.9958円 (19,958円)	2.1480円 (21,480円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成26年2月25日現在

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.5 07/31/17	1,500,000.000	1,477,500.000	
		US T N/B 1.0 08/31/16	7,150,000.000	7,230,938.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	1,800,000.000	1,723,140.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	2,600,000.000	2,592,278.000	
		US T N/B 1.375 11/30/15	4,300,000.000	4,381,958.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	5,500,000.000	5,493,510.000	
		US T N/B 1.75 05/31/16	7,900,000.000	8,131,075.000	
		US T N/B 1.875 09/30/17	3,400,000.000	3,501,864.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	500,000.000	484,605.000	
		US T N/B 2.625 11/15/20	100,000.000	103,210.000	
		US T N/B 2.75 11/15/23	3,650,000.000	3,658,833.000	
		US T N/B 3.125 02/15/42	2,400,000.000	2,161,488.000	
		US T N/B 3.75 11/15/43	300,000.000	302,505.000	
		US T N/B 4.375 05/15/40	1,300,000.000	1,467,674.000	
	アメリカ・ドル　小計		42,400,000.000 (4,348,120,000)	42,710,578.000 (4,379,969,774)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.75 09/07/22	100,000.000	93,350.000	
		UK TREASURY 4.0 03/07/22	650,000.000	721,890.000	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	600,000.000	674,700.000	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	300,000.000	338,820.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,550,000.000	1,844,500.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	600,000.000	728,880.000	
		UK TREASURY 5.0 09/07/14	970,000.000	993,765.000	
	イギリス・ポンド　小計		4,770,000.000 (814,668,300)	5,395,905.000 (921,566,615)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	1,600,000.000	1,733,408.000	
		AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	280,000.000	310,284.800	
	オーストラリア・ドル　小計		1,880,000.000 (174,163,200)	2,043,692.800 (189,327,701)	
	カナダ・ドル	CANADA 1.0 11/01/15	900,000.000	899,487.000	
		CANADA 1.25 09/01/18	900,000.000	885,807.000	
		CANADA 3.5 12/01/45	300,000.000	329,370.000	
		CANADA 8.0 06/01/23	660,000.000	970,140.600	

	カナダ・ドル　小計		2,760,000.000 (255,769,200)	3,084,804.600 (285,868,842)	
	シンガポール・ドル	SINGAPORE 3.125 09/01/22	500,000.000	530,565.000	
	シンガポール・ドル　小計		500,000.000 (40,615,000)	530,565.000 (43,097,795)	
	スウェーデン・クローナ	SWEDEN 3.0 07/12/16	1,000,000.000	1,049,720.000	
		SWEDEN 3.5 06/01/22	3,000,000.000	3,333,420.000	
		SWEDEN 4.5 08/12/15	100,000.000	105,563.000	
	スウェーデン・クローナ　小計		4,100,000.000 (64,616,000)	4,488,703.000 (70,741,959)	
	ユーロ	AUSTRIA 3.5 07/15/15	2,100,000.000	2,196,600.000	
		BUNDESOBL 0.5 04/07/17	1,600,000.000	1,612,848.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	500,000.000	493,300.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	190,000.000	216,453.700	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	500,000.000	574,500.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,750,000.000	5,112,000.000	
		FINLAND 4.25 07/04/15	800,000.000	844,128.000	
		FR TREASURY 2.5 07/25/16	4,800,000.000	5,054,064.000	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/18	3,720,000.000	3,731,718.000	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,200,000.000	6,904,444.000	
		FRANCE OAT 3.75 04/25/17	1,400,000.000	1,544,606.000	
		FRANCE OAT 3.75 04/25/21	2,000,000.000	2,298,400.000	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,800,000.000	2,062,908.000	
		FRANCE OAT 4.25 04/25/19	2,000,000.000	2,324,420.000	
		FRANCE OAT 5.0 10/25/16	500,000.000	561,765.000	
		NETHERLANDS 4.0 07/15/18	3,600,000.000	4,100,400.000	
	ユーロ　小計		35,460,000.000 (4,994,186,400)	39,632,554.700 (5,581,849,004)	
国債証券　合計			10,692,138,100 (10,692,138,100)	11,472,421,690 (11,472,421,690)	
特殊債券	アメリカ・ドル	EIB 5.125 05/30/17	3,000,000.000	3,391,500.000	
		KFW 4.875 06/17/19	1,000,000.000	1,150,680.000	
	アメリカ・ドル　小計		4,000,000.000 (410,200,000)	4,542,180.000 (465,800,559)	
特殊債券　合計			410,200,000 (410,200,000)	465,800,559 (465,800,559)	
合計			11,102,338,100 (11,102,338,100)	11,938,222,249 (11,938,222,249)	

（注）１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
２．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券　14銘柄 特殊債券　2銘柄	35.90% 3.82%	40.59%
イギリス・ポンド	国債証券　7銘柄	7.55%	7.72%
オーストラリア・ドル	国債証券　2銘柄	1.55%	1.59%
カナダ・ドル	国債証券　4銘柄	2.34%	2.39%
シンガポール・ドル	国債証券　1銘柄	0.35%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券　3銘柄	0.58%	0.59%
ユーロ	国債証券　16銘柄	45.75%	46.76%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

バランス物語３０（安定型）

平成26年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	3,899,784,132円
Ⅱ　負債総額	13,162,846円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,886,621,286円
Ⅳ　発行済数量	3,502,707,708口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1096円

バランス物語５０（安定・成長型）

平成26年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	1,889,598,437円
Ⅱ　負債総額	1,561,550円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,888,036,887円
Ⅳ　発行済数量	1,669,747,801口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1307円

バランス物語７０（成長型）

平成26年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	1,027,528,225円
Ⅱ　負債総額	626,132円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,026,902,093円
Ⅳ　発行済数量	907,952,255口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1310円

（参考）

ＤＬジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	27,851,565,078円
Ⅱ　負債総額	738,006,221円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	27,113,558,857円
Ⅳ　発行済数量	15,981,820,496口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6965円

ＤＬジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	39,071,291,461円
Ⅱ　負債総額	204,812,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	38,866,479,461円
Ⅳ　発行済数量	27,495,036,539口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4136円

ＤＬインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	11,329,244,968円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,329,244,968円
Ⅳ　発行済数量	5,859,840,624口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9334円

ＤＬインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成26年2月28日現在

Ⅰ　資産総額	12,188,873,383円
Ⅱ　負債総額	6,888,224円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	12,181,985,159円
Ⅳ　発行済数量	5,675,299,671口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1465円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4)受益権の譲渡の対抗要件

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

(5)受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

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

直近5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

①　会社の意思決定機構

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

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

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

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

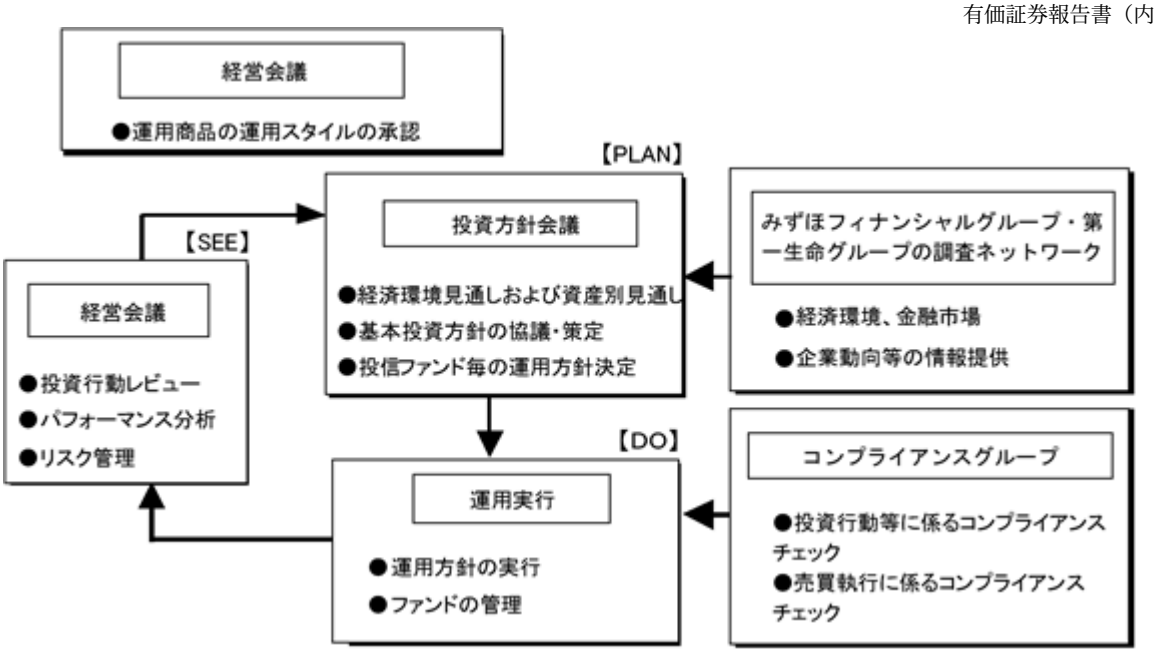
②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



※上記体制は平成26年2月28日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は315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	8	21,903,771,605
追加型株式投資信託	297	4,966,954,572,956
単位型公社債投資信託	9	89,877,531,429
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	102,533,373
合計	315	5,078,838,409,363

３【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
   また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

3. 委託会社は、第28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）		第28期 （平成25年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		12,520,748		10,806,745
金銭の信託		6,548,577		10,214,440
前払費用		25,744		69,143
未収委託者報酬		2,780,527		3,073,481
未収運用受託報酬		1,167,998		1,173,744
未収投資助言報酬	※2	241,851	※2	245,819
未収収益		212,226		244,974
繰延税金資産		344,793		426,229
その他		22,264		25,354
流動資産計		23,864,733		26,279,933
固定資産				
有形固定資産		470,082		378,530
建物	※1	167,433	※1	142,820
車両運搬具	※1	4,752	※1	2,770
器具備品	※1	188,367	※1	231,732
建設仮勘定		109,529		1,207
無形固定資産		1,262,102		1,337,985
商標権	※1	383	※1	289
ソフトウエア	※1	1,101,685	※1	1,261,335
ソフトウエア仮勘定		152,513		68,920
電話加入権		7,148		7,148
電話施設利用権	※1	371	※1	292
投資その他の資産		3,982,258		4,002,042
投資有価証券		450,882		400,579
関係会社株式		2,119,074		2,119,074
繰延税金資産		590,822		661,777
長期差入保証金		731,197		731,564
その他		90,282		89,047
固定資産計		5,714,444		5,718,557
資産合計		29,579,177		31,998,491

（単位：千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	132,805	571,153
未払金	1,460,128	1,547,527
未払収益分配金	670	48
未払償還金	86,391	84,932
未払手数料	1,088,348	1,195,452
その他未払金	284,718	267,093
未払費用	※2 1,105,512	※2 1,306,837
未払法人税等	1,195,056	1,299,068
未払消費税等	92,354	116,872
賞与引当金	574,646	724,974
その他	―	100,000
流動負債計	4,560,503	5,666,434
固定負債		
退職給付引当金	680,768	802,603
役員退職慰労引当金	56,690	98,510
固定負債計	737,458	901,113
負債合計	5,297,962	6,567,548
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	19,716,594	20,898,697
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,463,300	3,945,403
株主資本計	24,145,072	25,327,175
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	136,143	103,768
評価・換算差額等計	136,143	103,768
純資産合計	24,281,215	25,430,943
負債・純資産合計	29,579,177	31,998,491

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第27期 （自　平成23年4月 1日 至　平成24年3月31日）		第28期 （自　平成24年4月 1日 至　平成25年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	23,208,602		23,374,427	
運用受託報酬	4,966,992		5,374,163	
投資助言報酬	943,057		885,923	
その他営業収益	697,063		715,164	
営業収益計		29,815,715		30,349,678
営業費用				
支払手数料	10,154,958		10,846,568	
広告宣伝費	164,286		177,553	
公告費	―		3,769	
調査費	4,590,302		4,546,312	
調査費	2,888,013		3,001,788	
委託調査費	1,702,289		1,544,523	
委託計算費	335,754		341,978	
営業雑経費	496,565		456,677	
通信費	26,941		25,513	
印刷費	399,066		374,775	
協会費	25,014		25,492	
諸会費	41		42	
支払販売手数料	45,500		30,854	
営業費用計		15,741,867		16,372,860
一般管理費				
給料	4,630,102		4,870,759	
役員報酬	245,224		242,014	
給料・手当	3,824,122		4,035,751	
賞与	560,755		592,994	
交際費	35,987		36,212	
寄付金	3,156		2,693	
旅費交通費	213,642		187,653	
租税公課	84,346		95,064	
不動産賃借料	656,463		675,811	
退職給付費用	164,627		173,065	
固定資産減価償却費	475,556		524,750	
福利厚生費	24,887		26,642	
修繕費	6,721		6,018	
賞与引当金繰入	574,646		724,974	
役員退職慰労引当金繰入	30,048		47,820	
役員退職金	27,503		7,200	
機器リース料	1,510		35	
事務委託費	323,740		224,066	
消耗品費	58,739		60,044	
器具備品費	2,889		2,065	
諸経費	114,695		159,247	

一般管理費計		7,429,267		7,824,126
営業利益		6,644,580		6,152,691

（単位：千円）

	第27期 （自　平成23年4月 1日 至　平成24年3月31日）		第28期 （自　平成24年4月 1日 至　平成25年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	61,720		10,223	
受取利息	3,921		3,554	
時効成立分配金	11,383		2,080	
為替差益	1,660		－	
金銭の信託運用益	－		168,444	
雑収入	5,992		4,957	
営業外収益計		84,678		189,260
営業外費用				
為替差損	－		6,549	
時効成立後支払分配金	36		－	
金銭の信託運用損	417,812		－	
雑損失	1,152		－	
営業外費用計		419,001		6,549
経常利益		6,310,257		6,335,402
特別利益				
ゴルフ会員権売却益	1,959		－	
特別利益計		1,959		－
特別損失				
固定資産除却損	※1　36,415		※1　1,752	
固定資産売却損	381		115	
関係会社株式評価損	338,244		－	
特別損失計		375,042		1,868
税引前当期純利益		5,937,173		6,333,533
法人税、住民税及び事業税		2,582,251		2,573,893
法人税等調整額		△56,997		△ 134,463
法人税等合計		2,525,253		2,439,430
当期純利益		3,411,920		3,894,102

（３）【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

		第27期 （自　平成23年4月 1日 至　平成24年3月31日）	第28期 （自　平成24年4月 1日 至　平成25年3月31日）
株主資本			
	資本金		
	当期首残高	2,000,000	2,000,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,000,000	2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	当期首残高	2,428,478	2,428,478
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,428,478	2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	当期首残高	123,293	123,293
	当期変動額	-	-
	当期末残高	123,293	123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	当期首残高	13,430,000	15,630,000
	当期変動額	2,200,000	700,000
	当期末残高	15,630,000	16,330,000
	研究開発積立金		
	当期首残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
	運用責任準備積立金		
	当期首残高	200,000	200,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	200,000	200,000
	繰越利益剰余金		
	当期首残高	4,459,380	3,463,300
	当期変動額		
	剰余金の配当	△2,208,000	△ 2,712,000
	別途積立金の積立	△2,200,000	△ 700,000
	当期純利益	3,411,920	3,894,102
	当期末残高	3,463,300	3,945,403
	利益剰余金合計		
	当期首残高	18,512,674	19,716,594
	当期変動額	1,203,920	1,182,102
	当期末残高	19,716,594	20,898,697
	株主資本合計		
	当期首残高	22,941,152	24,145,072
	当期変動額	1,203,920	1,182,102
	当期末残高	24,145,072	25,327,175

評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高	216,534	136,143
	当期変動額（純額）	△80,390	△ 32,375
	当期末残高	136,143	103,768
純資産合計			
	当期首残高	23,157,686	24,281,215
	当期変動額	1,123,529	1,149,727
	当期末残高	24,281,215	25,430,943

重要な会計方針

項目	第28期 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウエアについては、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。 （会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更） 法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (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。 (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。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第28期　（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）
「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針 平成24年5月17日） （1）概要 財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。 （2）適用予定日 平成25年4月1日以後に開始する事業年度の期末から適用予定であります。ただし、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。 （3）当該会計基準等の適用による影響 財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1．固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
建物	513,080	539,393
車両運搬具	171	2,152
器具備品	462,449	565,794
商標権	2,555	649
ソフトウエア	961,584	1,071,133
電話施設利用権	1,225	1,304

※2．関係会社項目

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

（千円）

		第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	238,121	241,190
流動負債	未払費用	292,536	334,888

（損益計算書関係）

※1．固定資産除却損の内訳

（千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
建物	1,892	―
器具備品	18,917	―
ソフトウエア	15,606	1,752

（株主資本等変動計算書関係）

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（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24年6月29日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日定時株主総会	普通株式	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成25年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

（リース取引関係）

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

①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

該当事項はありません。

②未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

③支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
支払リース料	588	－
減価償却費相当額	543	－
支払利息相当額	1	－

④減価償却費相当額の算定方法

該当事項はありません。

⑤利息相当額の算定方法

該当事項はありません。

2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第27期（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	12,520,748	12,520,748	―
(2) 金銭の信託	6,548,577	6,548,577	―
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	370,636	370,636	―
資産計	19,439,962	19,439,962	―
(1) 未払法人税等	1,195,056	1,195,056	―
負債計	1,195,056	1,195,056	―

第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	10,806,745	10,806,745	－
(2) 金銭の信託	10,214,440	10,214,440	－
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	320,332	320,332	－
資産計	21,341,518	21,341,518	－
(1) 未払法人税等	1,299,068	1,299,068	－
負債計	1,299,068	1,299,068	－

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負　債

(1) 未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
①非上場株式	80,246	80,246
②関係会社株式	2,119,074	2,119,074
③長期差入保証金	731,197	731,564

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

③長期差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期（平成24年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
（1）預金	12,520,524	－	－	－
合計	12,520,524	－	－	－

第28期（平成25年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
（1）預金	10,806,412	－	－	－
合計	10,806,412	－	－	－

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第27期及び第28期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4．その他有価証券

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

区　分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	359,540	146,101	213,438
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	3,482	3,000	482
小計	363,022	149,101	213,920
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	7,614	10,000	△2,386
小計	7,614	10,000	△2,386
合計	370,636	159,101	211,534

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

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

区　分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	307,639	146,101	161,537
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	8,688	10,000	△1,312
小計	8,688	10,000	△1,312
合計	320,332	159,101	161,231

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第27期　（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	6,548,577	△495,939

第28期　（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,214,440	946,377

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、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

（千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
（1） 退職給付債務	740,560	936,125
（2） 未認識数理計算上の差異	△59,792	△133,522
退職給付引当金	680,768	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

（千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
（1） 勤務費用	102,728	102,125
（2） 利息費用	9,549	11,108
（3） 数理計算上の差異の費用処理額	13,388	17,593
（4） 確定拠出年金　拠出額	38,960	41,923
（5） その他	－	314
退職給付費用	164,627	173,065

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（1）割引率

第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
1.5%	1.5%

（2）退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

（3）数理計算上の差異の処理年数

5年（各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理する方法）

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
未払事業税	87,682	107,022
未払事業所税	5,792	5,986
賞与引当金	218,423	275,562
未払法定福利費	24,791	34,566
未払確定拠出年金掛金	2,607	3,091
減価償却超過額（一括償却資産）	5,496	5,192
減価償却超過額	150,369	159,737
繰延資産償却超過額（税法上）	47,261	27,873
退職給付引当金	243,845	286,796
役員退職慰労引当金	20,204	35,109
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	4,410	22,907
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	678	109
繰延税金資産合計	935,615	1,088,007
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	－	－
繰延税金負債合計	－	－
差引繰延税金資産の純額	935,615	1,088,007

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

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

（セグメント情報等）

１．セグメント情報

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

２．関連情報

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	23,208,602	5,910,049	697,063	29,815,715

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名,出向2名,転籍3名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	687,972	未収投資助言報酬	177,282

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名，出向2名，転籍3名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	710,289	未収投資助言報酬	203,114

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	523,845	未払費用	158,645
	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	203,092	未払費用	75,484

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	520,967	未払費用	175,664
	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	214,290	未払費用	89,815

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	7,000億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	1,548,354	未払手数料	122,786
								預金の引出（純額）	91,135	現金・預金	433,779
								受取利息	104	未収収益	-
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	450,766	未払手数料	83,446
								預金の預入（純額）	392,267	現金・預金	11,440,025
								受取利息	3,654	未収収益	-
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	―	―	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払	237,031	未払費用	127,757
								業務委託料の支払	15,140	未払費用	6,373
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	―	―	当社信託財産の運用	信託元本の追加（純額）	1,000,000	金銭の信託	6,548,577
								信託報酬の支払	5,087		

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	7,000億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	1,661,638	未払手数料	142,323
								預金の預入（純額）	191,782	現金・預金	625,561
								受取利息	106	未収収益	-
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	460,605	未払手数料	100,875
								預金の引出（純額）	1,912,442	現金・預金	9,527,582
								受取利息	3,210	未収収益	61
	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	－	－	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払	259,435	未払費用	132,250
								業務委託料の支払	11,140	未払費用	5,848
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	－	－	当社信託財産の運用	信託元本の追加（純額）	3,500,000	金銭の信託	10,214,440
								信託報酬の支払	5,908		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
1株当たり純資産額	1,011,717円32銭	1,059,622円64銭
1株当たり当期純利益金額	142,163円33銭	162,254円29銭

（注1）潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第29期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		9,422,331
金銭の信託		9,988,674
前払費用		81,570
未収委託者報酬		3,539,476
未収運用受託報酬		1,927,231
未収投資助言報酬		233,557
未収収益		265,944
繰延税金資産		365,930
その他		77,287
流動資産計		25,902,003
固定資産		
有形固定資産		332,918
建物	※1	131,728
車両運搬具	※1	2,193
器具備品	※1	192,157
建設仮勘定		6,839
無形固定資産		1,441,730
商標権	※1	242
ソフトウエア	※1	1,141,508
ソフトウエア仮勘定		292,572
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	※1	258
投資その他の資産		4,022,411
投資有価証券		409,446
関係会社株式		2,119,074
繰延税金資産		675,426
差入保証金		731,197
その他		87,266
固定資産計		5,797,060
資産合計		31,699,064

（単位：千円）

	第29期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	915,630
未払金	1,777,659
未払収益分配金	48
未払償還金	51,109
未払手数料	1,403,573
その他未払金	322,928
未払費用	1,320,067
未払法人税等	1,362,916
未払消費税等	149,912
賞与引当金	592,328
流動負債計	6,118,515
固定負債	
退職給付引当金	870,468
役員退職慰労引当金	121,100
固定負債計	991,568
負債合計	7,110,084
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	20,051,026
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	19,927,733
別途積立金	17,130,000
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	2,297,733
株主資本計	24,479,504
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	109,475
評価・換算差額等計	109,475
純資産合計	24,588,979
負債・純資産合計	31,699,064

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日至平成25年9月30日）	
営業収益		
委託者報酬	12,617,519	
運用受託報酬	3,032,543	
投資助言報酬	455,315	
その他営業収益	409,599	
営業収益計		16,514,977
営業費用		
支払手数料	5,584,176	
広告宣伝費	113,543	
調査費	2,650,938	
調査費	1,833,878	
委託調査費	817,060	
委託計算費	178,138	
営業雑経費	239,279	
通信費	16,255	
印刷費	206,531	
協会費	12,524	
諸会費	15	
支払販売手数料	3,952	
営業費用計		8,766,076
一般管理費		
給料	2,201,917	
役員報酬	125,877	
給料・手当	2,076,040	
交際費	17,522	
寄付金	2,515	
旅費交通費	97,277	
租税公課	53,858	
不動産賃借料	341,829	
退職給付費用	110,074	
固定資産減価償却費	※1 279,285	
福利厚生費	11,941	
修繕費	5,939	
賞与引当金繰入額	592,328	
役員退職慰労引当金繰入額	26,388	
役員退職慰労金	528	
機器リース料	23	
事務委託費	105,422	
事務用消耗品費	32,711	
器具備品費	2,550	
諸経費	56,566	
一般管理費計		3,938,680
営業利益		3,810,221

（単位：千円）

	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日至平成25年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,371	
受取利息	1,297	
時効成立分配金・償還金	33,823	
雑収入	3,864	
営業外収益計		45,357
営業外費用		
為替差損	5,352	
金銭の信託運用損	205,313	
営業外費用計		210,666
経常利益		3,644,913
特別損失		
固定資産除却損	22	
固定資産売却損	1,448	
特別損失計		1,470
税引前中間純利益		3,643,442
法人税、住民税及び事業税		1,351,622
法人税等調整額		43,490
法人税等合計		1,395,112
中間純利益		2,248,329

(3) 中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

		第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日至平成25年9月30日）
株主資本		
	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	当期首残高	16,330,000
	当中間期変動額	800,000
	当中間期末残高	17,130,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	3,945,403
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	△ 3,096,000
	別途積立金の積立	△ 800,000
	中間純利益	2,248,329
	当中間期末残高	2,297,733
	利益剰余金合計	
	当期首残高	20,898,697
	当中間期変動額	△847,670
	当中間期末残高	20,051,026
	株主資本合計	
	当期首残高	25,327,175
	当中間期変動額	△847,670
	当中間期末残高	24,479,504
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	103,768
	当中間期変動額（純額）	5,706
	当中間期末残高	109,475
純資産合計		
	当期首残高	25,430,943
	当中間期変動額	△841,963
	当中間期末残高	24,588,979

重要な会計方針

項目	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
２．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
３．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
４．固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
５．引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異及び過去勤務債務の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務債務：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。

項目	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
７．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第29期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）
※１．固定資産の減価償却累計額	建物 … 550,694千円 車両運搬具 … 2,730千円 器具備品 … 610,752千円 商標権 … 696千円 ソフトウエア … 1,285,419千円 電信電話専用施設利用権 … 1,338千円

（中間損益計算書関係）

項目	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
※１．減価償却実施額	有形固定資産 … 64,676千円 無形固定資産 … 214,609千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
（1）現金・預金	9,422,331	9,422,331	－
（2）金銭の信託	9,988,674	9,988,674	－
（3）投資有価証券			
その他有価証券	329,200	329,200	－
資産計	19,740,206	19,740,206	－
（1）未払法人税等	1,362,916	1,362,916	－
負債計	1,362,916	1,362,916	－

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）投資有価証券

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

負　債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 （千円）
①非上場株式	80,246
②関係会社株式	2,119,074
③差入保証金	731,197

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

③差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

１．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

２．子会社株式及び関連会社株式

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

３．その他有価証券

区　分	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	315,920	146,101	169,818
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	4,263	3,000	1,263
小計	320,184	149,101	171,082
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	9,016	10,000	△984
小計	9,016	10,000	△984
合計	329,200	159,101	170,098

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

（金銭の信託関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

１．満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

２．その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

１．セグメント情報

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

２．関連情報

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	12,617,519	3,487,859	409,599	16,514,977

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,024,540円	82銭
1株当たり中間純利益金額	93,680円	39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29期中間会計期間 （自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
中間純利益	2,248,329千円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式に係る中間純利益	2,248,329千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

(2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

(3) 通常の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。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記(3) (4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

平成25年3月末日現在　324,279百万円

ｃ．事業の内容

日本において信託業務および銀行業務を営んでいます。

（２）販売会社

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

名　　称	資本金の額＊ (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行（※1）	(※2)1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社ＳＢＩ証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

＊　平成25年3月末日現在

（※1）既契約者による定時定額購入（積立）によるお申込みを除き、募集の取り扱いおよび販売業務を行いません。

（※2）平成25年7月1日現在

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
有価証券報告書	平成25年11月26日
有価証券届出書	平成25年11月26日

独立監査人の監査報告書

平成２５年６月６日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山内　正彦　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　浅野　　功　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　近藤　敏弘　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２４年４月１日から平成２５年３月３１日までの第２８期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２５年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注１）上記は、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。
（注２）財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成２６年４月９日

ＤＩＡＭ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 業務執行社員	公認会計士	柴　　毅	印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和　田　　渉	印

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

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語３０（安定型）の平成２６年２月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係
ＤＩＡＭ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。

※　ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２６年４月９日

ＤＩＡＭ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 業務執行社員	公認会計士	柴　　毅	印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和　田　　渉	印

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

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語５０（安定・成長型）の平成２６年２月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係
ＤＩＡＭ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。

※　ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２６年４月９日

ＤＩＡＭ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 業務執行社員	公認会計士	柴　　毅　　印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和　田　　渉　印

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

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランス物語７０（成長型）の平成２６年２月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係
ＤＩＡＭ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。

※　ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成２５年１２月６日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山内　正彦　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　浅野　　功　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　近藤　敏弘　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２５年４月１日から平成２６年３月３１日までの第２９期事業年度の中間会計期間（平成２５年４月１日から平成２５年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２５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２５年４月１日から平成２５年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

（注１）上記は、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。
（注２）中間財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれておりません。