

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成25年2月25日

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 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】 大楽 信雄

【電話番号】 03-3287-3110

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1 安定型  
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型  
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3 成長型

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書の提出に伴い、平成24年8月24日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

## 2【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

（略）

属性区分定義

（略）

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、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは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、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、以下の方法でご確認ください。

（略）

<訂正後>

（略）

属性区分定義

（略）

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、以下の方法でご確認ください。

（略）

##### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社の概況

（略）

資本金の額

20億円（平成24年5月31日現在）

(略)

大株主の状況

(平成24年5月31日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

&lt;訂正後&gt;

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成24年11月30日現在）

(略)

大株主の状況

(平成24年11月30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	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

**2【投資方針】****(1)【投資方針】**

&lt;訂正前&gt;

基本方針

当ファンドは、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。

投資態度

(略)

&lt;訂正後&gt;

基本方針

当ファンドは、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

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

(略)

**(2)【投資対象】**


&lt;訂正前&gt;

(略)

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要


ファンド名	D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>TOPIX（東証株価指数）を中長期的に上回ることを目標に運用します。企業のファンダメンタルズ分析を重視したボトムアップによる銘柄選択を行うことを原則とします。</p> <p>銘柄選択はファンドマネジャーが自ら会社訪問を行ない、企業の成長性と投資価値を総合的に判断し、組入銘柄を決定します。</p> <p>株式の組入比率は、原則として100%に近い状態を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>特定の銘柄や業種に対し、過度の集中がないように配慮します。</p> <p><u>ポートフォリオ構築プロセス</u></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>2) 株式運用本部のアナリストおよびファンドマネジャーは、1)の組入候補銘柄について、企業訪問等を中心とした積極的な調査活動により個別銘柄の調査・分析を行います。</li> <li>3) 2)により得られた企業業績予測を、短期的・中長期的な視点で株価への折り込み度合い等から独自にレーティングし、バリュエーション評価を行ったうえで、組入銘柄を選出します。</li> <li>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。</li> </ol>
(略)	

ファンド名	D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド
(略)	

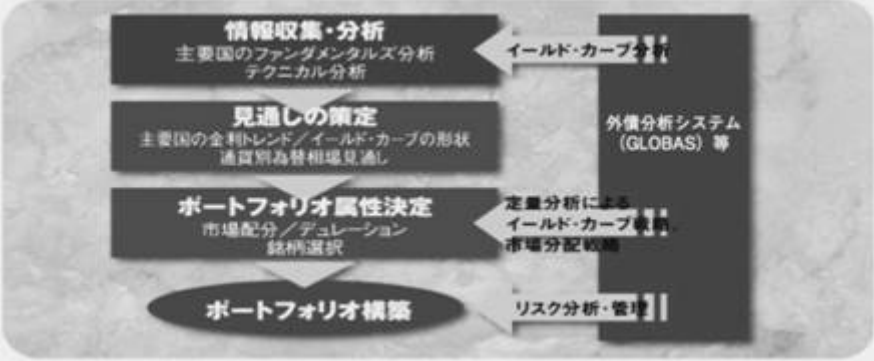
投資態度	<p>NOMURA - B P I 総合を中長期的に上回ることを目標に運用を行います。マクロ経済分析をベースとしたファンダメンタルズ分析等に基づき、金利の方向性予測、イールドカーブ戦略、セクター戦略により超過収益を積み上げることをめざします。</p> <p><u>ポートフォリオ構築プロセス</u></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) マクロ経済分析をベースとしたファンダメンタルズ分析等に基づき、短中長期金利の方向性、イールドカーブ、セクターブレッドの予測を行います。</li> <li>2) 1)により得られた分析に基づき、デュレーション戦略、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。</li> <li>3) 委託会社独自の円債分析システム「Y B A S」を活用することで、きめ細かい定量分析・リスク分析を行い、ポートフォリオを構築します。</li> </ol> 
------	---

(略)

ファンド名	D L インターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド
(略)	

投資態度	<p>積極的な企業調査訪問を基にしたボトムアップ・アプローチと各国のマクロ経済分析等によるトップダウン・アプローチを併用することによりポートフォリオを構築します。</p> <p>M S C Iコクサイ・インデックスを長期的に上回ることをめざして運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として100%に近い状態を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p><u>ポートフォリオ構築プロセス</u></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>  <p><b>徹底したボトムアップの企業調査</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●地域・国を超えたグローバル・セクター別の運用体制</li> <li>●各グローバル・セクターの担当アナリストが直接現地へ企業訪問</li> </ul> <p><b>ミクロ分析を基にしたマクロ環境の分析</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●それぞれの市場特性に応じた柔軟な企業評価</li> <li>●企業調査情報をもとにセクター選定、市場環境を分析・評価</li> </ul> <p><b>グローバルな視点に立った投資判断</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●セクター評価・市場評価をファクターとして加味した銘柄評価</li> <li>●世界中の情報を重宝に一気集中させ、グローバルレベルでの分析・判断</li> </ul> <p><b>リスクをコントロールしつつ国際分散投資</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●セクター・アロケーション、地域別アロケーションを調整し、意図せざるリスクを軽減</li> </ul>
(略)	

ファンド名	D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド
(略)	

投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>金利見通しに基づく各国市場配分に加え、各国ポートフォリオにおけるデュレーション、償還構成をコントロールすることにより超過収益を獲得することをめざします。</p> <p>為替については、金利とは独立した投資対象と考え、エクスポージャーのコントロールを行うことにより、運用効率の向上を図ります。ただし、為替エクスポージャーは原則として信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p><u>ポートフォリオ構築プロセス</u></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol> 
(略)	(略)

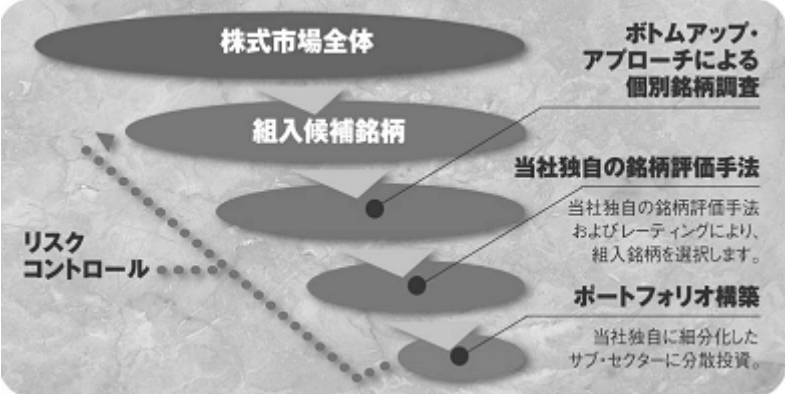
(略)


&lt;訂正後&gt;

(略)

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

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


<p><u>ポートフォリオ構築プロセス</u></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>2)株式運用本部のアナリストおよびファンドマネジャーは、1)の組入候補銘柄について、企業訪問等を中心とした積極的な調査活動により個別銘柄の調査・分析を行います。</li> <li>3)2)により得られた企業業績予測を、短期的・中長期的な視点で株価への折り込み度合い等から独自にレーティングし、バリュエーション評価を行ったうえで、組入銘柄を選出します。</li> <li>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。</li> </ol> 
(略)	

<p>ファンド名</p>	<p>D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド</p>
(略)	
<p>投資態度</p>	<p>NOMURA - B P I総合を中長期的に上回ることを目標に運用を行います。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がをめざします。</p>
<p><u>ポートフォリオ構築プロセス</u></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>3)委託会社独自の円債分析システム「Y B A S」を活用することで、きめ細かい定量分析・リスク分析を行い、ポートフォリオを構築します。</li> </ol> 
(略)	



ファンド名	D L インターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>積極的な企業調査訪問を基にしたボトムアップ・アプローチと各国のマクロ経済分析等によるトップダウン・アプローチを併用することによりポートフォリオを構築します。</p> <p>M S C I コクサイ・インデックスを長期的に上回ることをめざして運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として100%に近い状態を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p>
ポートフォリオ構築プロセス	<p>1) グローバルセクター別に調査・運用チームを編成し、ファンドマネジャーが主に直接現地へ訪問、個別企業およびマクロ経済の調査を行います。</p> <p>2) 1)の調査活動を基に、ボトムアップ企業調査に基づくミクロ分析とマクロ分析を相互補完的に行います。</p> <p>3) 2)の分析を基に、当社独自のグローバルな視点からの総合的な銘柄評価手法を用い、地域配分・セクター配分を加味したうえでポートフォリオを構築します。</p>
(略)	

ファンド名	D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>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。</p> <p>委託会社が独自に開発した外債分析システム「G L O B A S」を活用して運用を行います。</p> <p>金利見通しに基づく各国市場配分に加え、各国ポートフォリオにおけるデュレーション、償還構成をコントロールすることにより超過収益を獲得することをめざします。</p> <p>為替については、金利とは独立した投資対象と考え、エクスポージャーのコントロールを行うことにより、運用効率の向上を図ります。ただし、為替エクスポージャーは原則として信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p>

<p><b>ポートフォリオ構築プロセス</b></p>	<p>1)世界主要国のファンダメンタルズ分析・テクニカル分析等に基づき、主要国の金利トレンド・イールドカーブの形状・通貨別為替相場の見通しを策定します。</p> <p>2)当社独自開発の外債分析システム「GLOBAS」を活用し、イールドカーブ分析等の定量分析を行います。</p> <p>3)「GLOBAS」等を活用し、為替・金利見通しに基づく市場配分・通貨配分戦略、デュレーション・償還構成戦略より、ポートフォリオ属性を決定・構築します。</p> 
(略)	(略)

### (3) 【運用体制】

<訂正前>

(略)

上記体制は平成24年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

上記体制は平成24年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### (5) 【投資制限】

<訂正前>

(略)

各ファンド共通

(略)

投資する株式等の範囲（各約款第17条）

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

(略)

<訂正後>

(略)

各ファンド共通

(略)

投資する株式等の範囲（各約款第17条）

1)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、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。

(略)

### 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<運用評価・運用リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成24年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

<運用評価・運用リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成24年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 4【手数料等及び税金】

#### (5)【課税上の取扱い】

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

<更新・訂正後>

ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

確定拠出年金の加入者におかれましては、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

なお、上記以外の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

#### 個人の受益者に対する課税

時期	項目	税金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して10.147%
換金（解約）時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して10.147%

税金は表に記載の時期に適用されます。

上記の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

上記の税率には復興特別所得税が含まれます。平成26年1月1日以降は20.315%の税率となる予定です。

#### 法人の受益者に対する課税

平成25年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税7.147%（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。

上記7.147%の税率は平成26年1月1日以降、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））と

なる予定です。

#### 益金不算入制度、配当控除の適用

益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

上記は、平成25年1月1日現在のもので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1 安定型

平成24年11月30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	6,173,119,080	98.51
内 日本	6,173,119,080	98.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	93,150,414	1.49
純資産総額	6,266,269,494	100.00

D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

平成24年11月30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	13,773,000,701	98.58
内 日本	13,773,000,701	98.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	198,580,522	1.42
純資産総額	13,971,581,223	100.00

D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3 成長型

平成24年11月30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	11,348,884,424	98.64
内 日本	11,348,884,424	98.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	156,828,568	1.36
純資産総額	11,505,712,992	100.00

## （参考）マザーファンドの投資状況

## D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成24年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	27,347,785,100	97.61
内 日本	27,347,785,100	97.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	669,796,811	2.39
純資産総額	28,017,581,911	100.00

## D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成24年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	17,896,834,860	43.92
内 日本	17,896,834,860	43.92
社債券	21,220,171,000	52.07
内 日本	21,220,171,000	52.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,634,287,332	4.01
純資産総額	40,751,293,192	100.00

## D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成24年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	10,863,536,982	98.71
内 アメリカ	6,386,872,484	58.04
内 イギリス	1,297,959,055	11.79
内 ユーロ	1,239,145,451	11.26
内 カナダ	516,912,553	4.70
内 スイス	330,903,913	3.01
内 オーストラリア	279,213,204	2.54
内 シンガポール	258,371,430	2.35
内 香港	246,410,144	2.24
内 スウェーデン	143,055,924	1.30
内 デンマーク	106,848,736	0.97
内 ノルウェー	57,844,088	0.53
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	141,579,724	1.29
純資産総額	11,005,116,706	100.00

## D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成24年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	13,630,450,630	93.05
内 ユーロ	6,328,087,392	43.20
内 アメリカ	5,662,586,317	38.66
内 イギリス	1,544,072,895	10.54
内 スウェーデン	95,704,026	0.65
特殊債券	710,753,463	4.85
内 アメリカ	474,867,112	3.24
内 オーストラリア	181,013,101	1.24
内 ユーロ	54,873,250	0.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	307,588,344	2.10
純資産総額	14,648,792,437	100.00

## その他資産の投資状況

平成24年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	1,993,871,182	13.61
内 日本	1,993,871,182	13.61
為替予約取引（売建）	2,141,648,250	14.62
内 日本	2,141,648,250	14.62

（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）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

（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】

D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金 &gt; 1 安定型

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成24年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還 日	投資 比率
1	D Lジャパン・ボ ンド・オープン・ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,981,445,168	1.3509 4,027,848,405	1.3501 4,025,249,121	- -	64.24%
2	D Lジャパン・ア クティブ・オープ ン・マザーファン ド 日本	親投資 信託受 益証券	1,196,563,472	0.9807 1,173,495,743	1.0643 1,273,502,503	- -	20.32%
3	D Lインターナ ショナル・ボンド ・オープン・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	310,579,013	1.5814 491,163,028	1.6949 526,400,369	- -	8.40%
4	D Lインターナ ショナル・ハイブ リッド・オープン ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	297,407,767	1.0224 304,082,101	1.1700 347,967,087	- -	5.55%

（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24年11月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.51%
合計	98.51%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 2 安定・成長型

## 投資有価証券の主要銘柄

平成24年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還 日	投資 比率
1	D L ジャパン・ボ ンド・オープン・ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,351,976,696	1.3510 5,879,825,603	1.3501 5,875,603,737	- -	42.05%
2	D L ジャパン・ア クティブ・オー プン・マザーファン ド 日本	親投資 信託受 益証券	4,142,180,508	0.9807 4,062,442,194	1.0643 4,408,522,714	- -	31.55%
3	D L インターナ ショナル・ハイブ リッド・オープン ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,511,594,253	1.0225 1,545,743,064	1.1700 1,768,565,276	- -	12.66%
4	D L インターナ ショナル・ボンド ・オープン・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,014,991,430	1.5819 1,605,627,185	1.6949 1,720,308,974	- -	12.31%

(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24年11月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.58%
合計	98.58%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 3 成長型

## 投資有価証券の主要銘柄

平成24年11月30日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還 日	投資 比率
1	D L ジャパン・ア クティブ・オー プン・マザーファン ド 日本	親投資 信託受 益証券	4,497,211,040	0.9808 4,411,247,978	1.0643 4,786,381,709	- -	41.60%



2	D Lジャパン・ボ ンド・オープン・ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,804,383,218	1.3512	1.3501	-	21.17%
				2,438,123,296	2,436,097,782	-	
3	D Lインターナ ショナル・ハイブ リッド・オープン ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,931,094,812	1.0225	1.1700	-	19.64%
				1,974,691,801	2,259,380,930	-	
4	D Lインターナ ショナル・ボンド ・オープン・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,101,554,076	1.5820	1.6949	-	16.23%
				1,742,687,647	1,867,024,003	-	

(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24年11月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.64%
合計	98.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

D L ジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成24年11月30日現在

順位	銘柄名 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	334,000	3,556.47 1,187,861,106	3,535.00 1,180,690,000	- -	4.21%
2	三菱UFJフィナン シャルG 日本	株式 銀行業	2,720,000	430.20 1,170,149,200	377.00 1,025,440,000	- -	3.66%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	326,000	3,128.79 1,019,987,655	2,732.00 890,632,000	- -	3.18%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	323,000	2,845.41 919,070,508	2,654.00 857,242,000	- -	3.06%
5	エンブラス 日本	株式 電気機器	228,900	1,905.60 436,193,270	3,610.00 826,329,000	- -	2.95%
6	メガチップス 日本	株式 電気機器	401,000	1,566.31 628,090,971	1,850.00 741,850,000	- -	2.65%
7	三井不動産 日本	株式 不動産業	422,000	1,645.90 694,570,000	1,719.00 725,418,000	- -	2.59%
8	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	193,400	3,874.55 749,338,035	3,685.00 712,679,000	- -	2.54%
9	三菱地所 日本	株式 不動産業	431,000	1,520.12 655,171,948	1,589.00 684,859,000	- -	2.44%
10	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	126,100	5,260.53 663,353,083	5,410.00 682,201,000	- -	2.43%
11	武田薬品 日本	株式 医薬品	174,600	3,675.75 641,787,604	3,770.00 658,242,000	- -	2.35%
12	エヌ・ティ・ティ・ド コモ 日本	株式 情報・通信業	5,110	139,389.67 712,281,259	118,900.00 607,579,000	- -	2.17%
13	シークス 日本	株式 卸売業	574,000	1,194.00 685,356,000	1,034.00 593,516,000	- -	2.12%
14	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	4,350,000	136.67 594,547,779	132.00 574,200,000	- -	2.05%
15	オリックス 日本	株式 その他金融業	67,800	8,158.97 553,178,620	8,270.00 560,706,000	- -	2.00%
16	ヤフー 日本	株式 情報・通信業	20,200	28,049.31 566,596,175	27,680.00 559,136,000	- -	2.00%
17	三井物産 日本	株式 卸売業	475,000	1,385.88 658,296,995	1,139.00 541,025,000	- -	1.93%
18	東京海上HD 日本	株式 保険業	251,000	2,284.46 573,399,680	2,114.00 530,614,000	- -	1.89%
19	日立 日本	株式 電気機器	1,075,000	485.91 522,356,939	476.00 511,700,000	- -	1.83%
20	日本セラミック 日本	株式 電気機器	378,000	1,434.00 542,052,000	1,249.00 472,122,000	- -	1.69%
21	京セラ 日本	株式 電気機器	62,200	7,030.59 437,302,821	7,590.00 472,098,000	- -	1.69%

22	日東電工	日本	株式 化学	106,600	3,361.38 358,323,580	4,295.00 457,847,000	- -	1.63%
23	新日鐵住金	日本	株式 鉄鋼	2,417,000	228.95 553,377,659	189.00 456,813,000	- -	1.63%
24	キヤノン	日本	株式 電気機器	157,800	3,913.80 617,599,020	2,883.00 454,937,400	- -	1.62%
25	村田製作所	日本	株式 電気機器	96,900	4,555.28 441,407,110	4,670.00 452,523,000	- -	1.62%
26	J Xホールディングス	日本	株式 石油・石炭 製品	978,000	430.88 421,402,990	440.00 430,320,000	- -	1.54%
27	日産自動車	日本	株式 輸送用機器	538,000	882.92 475,011,660	799.00 429,862,000	- -	1.53%
28	信越化学	日本	株式 化学	82,200	4,678.54 384,576,282	4,850.00 398,670,000	- -	1.42%
29	小松製作所	日本	株式 機械	215,000	2,335.09 502,045,668	1,847.00 397,105,000	- -	1.42%
30	ファナック	日本	株式 電気機器	26,700	15,129.72 403,963,577	13,900.00 371,130,000	- -	1.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成24年11月30日現在

種類	投資比率
株式	97.61%
合計	97.61%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

平成24年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	18.26%
輸送用機器	国内	10.06%
銀行業	国内	9.13%
情報・通信業	国内	8.76%
小売業	国内	6.90%
卸売業	国内	6.68%
不動産業	国内	5.19%
化学	国内	4.47%
サービス業	国内	3.98%
食料品	国内	3.29%
医薬品	国内	3.23%
鉄鋼	国内	2.55%
機械	国内	2.55%
陸運業	国内	2.43%
その他金融業	国内	2.00%
保険業	国内	1.89%
石油・石炭製品	国内	1.54%
非鉄金属	国内	1.30%
ゴム製品	国内	1.24%
その他製品	国内	1.10%
繊維製品	国内	0.91%
空運業	国内	0.14%
合計		97.61%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## D L ジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成24年11月30日現在

順位	銘柄名 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	1 2 1 回 利付国 庫債券(20 年) 日本	国債 証券	3,589,000,000	104.32 3,744,116,580	105.32 3,780,006,580	1.900000 2030/9/20	9.28%
2	3 1 5 回 利付国 庫債券(10 年) 日本	国債 証券	3,415,000,000	103.98 3,551,138,500	105.38 3,599,034,350	1.200000 2021/6/20	8.83%
3	3 3 回 利付国庫 債券(30年) 日本	国債 証券	2,649,000,000	103.52 2,742,285,590	102.19 2,707,013,100	2.000000 2040/9/20	6.64%
4	1 3 0 回 利付国 庫債券(20 年) 日本	国債 証券	2,100,000,000	102.31 2,148,524,000	102.88 2,160,669,000	1.800000 2031/9/20	5.30%
5	3 2 4 回 利付国 庫債券(10 年) 日本	国債 証券	1,975,000,000	100.32 1,981,398,250	101.12 1,997,120,000	0.800000 2022/6/20	4.90%
6	8 4 回 利付国庫 債券(20年) 日本	国債 証券	1,511,000,000	109.07 1,648,136,860	111.28 1,681,455,910	2.000000 2025/12/20	4.13%
7	ヤマダ電機 J P Y 建て転換制限 条項付 C B 3 / 3 1 / 1 5 日本	社債 券	1,400,000,000	98.60 1,380,400,000	98.40 1,377,600,000	- 2015/3/31	3.38%
8	川崎汽船 J P Y 建て C B 4 / 4 / 1 3 日本	社債 券	1,100,000,000	96.13 1,057,430,000	98.00 1,078,000,000	- 2013/4/4	2.65%
9	1 回 野村総合研 究所 転換社債 日本	社債 券	1,030,000,000	99.00 1,019,700,000	99.15 1,021,245,000	- 2014/3/31	2.51%
10	3 0 4 回 利付国 庫債券(2年) 日本	国債 証券	1,000,000,000	100.07 1,000,776,000	100.04 1,000,440,000	0.200000 2013/5/15	2.45%
11	2 回 琉球銀行期 限前償還条項付 劣後社債 日本	社債 券	800,000,000	100.91 807,304,000	102.58 820,640,000	1.740000 2021/3/23	2.01%
12	2 回 武蔵野銀行 期限前償還条項 付劣後社債 日本	社債 券	800,000,000	101.32 810,630,000	101.60 812,864,000	1.300000 2021/7/28	1.99%
13	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	100.00 800,000,000	100.36 802,888,000	1.270000 2022/9/27	1.97%
14	2 0 回 シャープ 転換社債 日本	社債 券	1,273,000,000	97.50 1,241,175,000	62.50 795,625,000	- 2013/9/30	1.95%

15	3回 百五銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	700,000,000	100.93 706,524,000	102.00 714,042,000	1.330000 2021/6/7	1.75%
16	14回 東京建物社債 日本	社債券	700,000,000	101.83 712,811,000	101.85 712,971,000	1.440000 2017/7/14	1.75%
17	2回 大垣共立銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	700,000,000	100.62 704,347,000	101.71 712,019,000	1.310000 2021/9/27	1.75%
18	2回 百十四銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	700,000,000	100.75 705,288,000	100.93 706,573,000	1.420000 2021/6/28	1.73%
19	7回 ドン・キホーテ社債 日本	社債券	700,000,000	100.00 700,000,000	100.04 700,336,000	0.850000 2017/12/4	1.72%
20	20回 三井住友銀行劣後社債 日本	社債券	600,000,000	109.54 657,240,000	109.52 657,162,000	2.210000 2019/7/24	1.61%
21	3回 りそな銀行劣後社債 日本	社債券	600,000,000	103.35 620,112,000	102.71 616,302,000	2.520000 2019/6/4	1.51%
22	148回 オリックス社債 日本	社債券	600,000,000	101.07 606,426,000	102.26 613,566,000	1.260000 2017/2/24	1.51%
23	6回 西日本シティ銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	600,000,000	101.53 609,210,000	101.92 611,526,000	1.700000 2020/4/15	1.50%
24	39回 ソフトバンク社債 日本	社債券	600,000,000	99.30 595,800,000	95.20 571,206,000	0.740000 2017/9/22	1.40%
25	23回 コスモ石油社債 日本	社債券	600,000,000	100.88 605,328,000	91.77 550,656,000	1.440000 2016/12/9	1.35%
26	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	100.35 501,772,000	100.83 504,175,000	1.809000 2022/9/27	1.24%
27	5回 阿波銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	500,000,000	100.16 500,830,000	100.83 504,155,000	1.010000 2020/9/10	1.24%
28	4回 福岡銀行期限前償還条項付劣後社債 日本	社債券	500,000,000	100.10 500,500,000	100.55 502,750,000	1.110000 2020/8/20	1.23%
29	299回 利付国庫債券（2年） 日本	国債証券	500,000,000	100.05 500,250,000	100.00 500,015,000	0.200000 2012/12/15	1.23%
30	17回 三井住友銀行劣後社債 日本	社債券	400,000,000	112.64 450,568,000	112.82 451,296,000	2.800000 2019/2/12	1.11%

（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24年11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	43.92%
社債券	52.07%
合計	95.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## D L インターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成24年11月30日現在

順位	銘柄名 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	6,006	48,416.30 290,788,355	48,398.24 290,679,848	- -	2.64%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	26,246	7,042.12 184,827,640	7,236.41 189,926,932	- -	1.73%
3	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	12,971	8,971.25 116,366,123	8,687.47 112,685,235	- -	1.02%
4	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	33,046	3,562.14 117,714,808	3,384.98 111,860,260	- -	1.02%
5	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	20,037	4,993.09 100,046,584	5,400.32 108,206,412	- -	0.98%
6	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	129,490	757.50 98,089,322	832.06 107,744,723	- -	0.98%
7	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	14,420	7,071.28 101,967,886	7,417.89 106,966,112	- -	0.97%
8	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	52,151	1,801.98 93,975,358	2,040.68 106,423,606	- -	0.97%
9	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	6,750	16,811.60 113,478,343	15,728.44 106,166,994	- -	0.96%
10	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	87,287	1,034.15 90,268,636	1,187.63 103,665,191	- -	0.94%
11	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	58,962	1,620.12 95,525,687	1,735.19 102,310,602	- -	0.93%
12	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	36,019	2,650.11 95,454,394	2,786.33 100,360,877	- -	0.91%
13	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	34,910	3,037.78 106,048,978	2,841.63 99,201,366	- -	0.90%
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	17,283	5,542.64 95,793,523	5,707.33 98,639,957	- -	0.90%
15	BHP BILLITON LTD オーストラリア	株式 金属・鉱業	33,274	3,050.70 101,509,281	2,930.77 97,518,464	- -	0.89%
16	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	43,859	2,691.07 118,027,744	2,213.13 97,065,844	- -	0.88%
17	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 タバコ	21,776	4,264.42 92,862,092	4,325.02 94,181,726	- -	0.86%
18	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	34,382	2,750.36 94,562,975	2,723.09 93,625,596	- -	0.85%

19	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	1,620	50,585.09 81,947,860	56,818.00 92,045,171	- -	0.84%
20	FRASER & NEAVE LTD-ORD シンガポール	株式 コングロマリット	134,000	460.35 61,688,087	631.94 84,680,898	- -	0.77%
21	ALLIANZ SE ユーロ	株式 保険	7,952	9,611.28 76,428,939	10,633.68 84,559,102	- -	0.77%
22	DIAGEO PLC イギリス	株式 飲料	34,175	2,094.69 71,586,281	2,466.83 84,303,965	- -	0.77%
23	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	26,966	2,893.76 78,033,335	3,118.09 84,082,587	- -	0.76%
24	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	14,784	5,328.95 78,783,276	5,684.34 84,037,377	- -	0.76%
25	SCHLUMBERGER LTD アメリカ	株式 エネルギー設備・サー ビス	13,978	6,005.72 83,947,986	5,797.67 81,039,859	- -	0.74%
26	WESTPAC BANKING CORPORATION オーストラリア	株式 商業銀行	36,435	1,955.01 71,230,897	2,161.45 78,752,580	- -	0.72%
27	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA オーストラリア	株式 商業銀行	15,409	4,180.69 64,420,344	5,092.22 78,466,091	- -	0.71%
28	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サービス	370,884	221.78 82,254,729	211.17 78,322,993	- -	0.71%
29	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV ユーロ	株式 飲料	11,018	6,002.83 66,139,237	7,091.96 78,139,303	- -	0.71%
30	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$ カナダ	株式 商業銀行	11,190	6,846.73 76,614,964	6,840.11 76,540,895	- -	0.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成24年11月30日現在

種類	投資比率
株式	98.71%
合計	98.71%

(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24年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
石油・ガス・消耗燃料	外国	8.67%
商業銀行		7.72%
医薬品		7.54%
化学		5.02%
保険		3.89%
コンピュータ・周辺機器		3.61%
飲料		3.36%
情報技術サービス		3.03%
ソフトウェア		2.93%
機械		2.89%
コングロマリット		2.86%
金属・鉱業		2.76%
専門小売り		2.59%
各種電気通信サービス		2.57%
タバコ		2.45%
インターネットソフトウェア・サービス		2.42%
各種金融サービス		2.36%
食品		2.36%
バイオテクノロジー		2.35%
メディア		2.20%
不動産管理・開発		1.76%

エネルギー設備・サービス	1.62%
陸運・鉄道	1.48%
半導体・半導体製造装置	1.44%
食品・生活必需品小売り	1.44%
ホテル・レストラン・レジャー	1.32%
無線通信サービス	1.27%
資本市場	1.26%
通信機器	1.04%
電子装置・機器・部品	0.96%
電気設備	0.92%
家庭用品	0.90%
自動車部品	0.90%
水道	0.83%
家庭用耐久財	0.68%
消費者金融	0.67%
インターネット販売・カタログ販売	0.66%
建設関連製品	0.59%
航空宇宙・防衛	0.57%
複合小売り	0.53%
ヘルスケア・テクノロジー	0.49%
ヘルスケア機器・用品	0.45%
建設資材	0.43%
自動車	0.43%
商社・流通業	0.42%
運送インフラ	0.34%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.32%
総合公益事業	0.30%
ガス	0.29%
繊維・アパレル・贅沢品	0.29%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.23%
専門サービス	0.21%
商業サービス・用品	0.08%
合計	98.71%

（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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### D L インターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

#### 投資有価証券の主要銘柄

平成24年11月30日現在

順位	銘柄名 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	FR TREASURY 2.0 09/25/13 ユーロ	国債証券	809,780,000	102.33 828,688,363	101.59 822,695,991	2.000000 2013/9/25	5.62%
2	FR TREASURY 2.5 07/25/16 ユーロ	国債証券	713,885,000	105.80 755,318,672	107.53 767,661,957	2.500000 2016/7/25	5.24%
3	US T N/B 0.25 09/15/14 アメリカ	国債証券	747,292,000	99.99 747,221,107	100.05 747,725,429	0.250000 2014/9/15	5.10%



4	FRANCE OAT 3.25 10/25/21 ユーロ	国債証券	660,610,000	106.78 705,432,388	111.78 738,443,070	3.250000 2021/10/25	5.04%
5	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	648,748,000	104.51 678,064,922	104.64 678,875,857	1.750000 2016/5/31	4.63%
6	DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22 ユーロ	国債証券	532,750,000	105.15 560,186,625	103.75 552,749,435	1.750000 2022/7/4	3.77%
7	DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22 ユーロ	国債証券	479,475,000	106.34 509,921,662	106.42 510,305,242	2.000000 2022/1/4	3.48%
8	US T N/B 4.5 11/15/15 アメリカ	国債証券	451,660,000	113.63 513,230,291	112.20 506,776,069	4.500000 2015/11/15	3.46%
9	NETHERLANDS 4.0 07/15/18 ユーロ	国債証券	426,200,000	116.04 494,562,480	117.34 500,103,080	4.000000 2018/7/15	3.41%
10	UK TREASURY 4.0 03/07/22 イギリス	国債証券	408,394,000	119.85 489,460,209	120.63 492,686,521	4.000000 2022/3/7	3.36%
11	US T N/B 1.875 09/30/17 アメリカ	国債証券	443,448,000	105.22 466,622,592	106.01 470,121,397	1.875000 2017/9/30	3.21%
12	BUNDESUBL 0.5 04/07/17 ユーロ	国債証券	362,270,000	100.70 364,820,380	100.86 365,385,522	0.500000 2017/4/7	2.49%
13	US T N/B 1.375 11/30/15 アメリカ	国債証券	353,116,000	102.95 363,557,640	103.05 363,886,038	1.375000 2015/11/30	2.48%
14	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	328,480,000	102.41 336,409,507	104.47 343,169,625	2.000000 2022/2/15	2.34%
15	US T N/B 4.0 02/15/15 アメリカ	国債証券	312,056,000	109.68 342,272,382	108.15 337,494,805	4.000000 2015/2/15	2.30%
16	UK TREASURY 4.75 12/07/30 イギリス	国債証券	243,719,000	130.48 318,028,923	132.27 322,391,493	4.750000 2030/12/7	2.20%
17	US T N/B 3.125 02/15/42 アメリカ	国債証券	287,420,000	105.64 303,630,488	107.30 308,401,660	3.125000 2042/2/15	2.11%
18	EIB 5.125 05/30/17 アメリカ	特殊債券	246,360,000	115.95 285,654,420	118.25 291,320,700	5.125000 2017/5/30	1.99%
19	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21 ユーロ	国債証券	266,375,000	108.74 289,682,812	108.92 290,162,287	2.250000 2021/9/4	1.98%
20	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	287,420,000	99.02 284,624,391	99.63 286,362,294	0.500000 2017/7/31	1.95%
21	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21 ユーロ	国債証券	234,410,000	117.66 275,806,806	117.18 274,681,638	3.250000 2021/7/4	1.88%
22	US T N/B 2.25 01/31/15 アメリカ	国債証券	246,360,000	104.92 258,493,230	104.24 256,820,445	2.250000 2015/1/31	1.75%
23	FRANCE OAT 4.25 04/25/19 ユーロ	国債証券	213,100,000	114.86 244,783,708	118.73 253,024,285	4.250000 2019/4/25	1.73%
24	US T N/B 1.25 08/31/15 アメリカ	国債証券	246,360,000	102.55 252,642,180	102.52 252,575,662	1.250000 2015/8/31	1.72%
25	US T N/B 1.0 08/31/16 アメリカ	国債証券	246,360,000	101.48 250,025,836	102.05 251,430,088	1.000000 2016/8/31	1.72%
26	FRANCE OAT 3.75 04/25/21 ユーロ	国債証券	213,100,000	110.97 236,494,118	116.05 247,302,550	3.750000 2021/4/25	1.69%

27	AUSTRIA 3.5 07/15/15 ユーロ	国債証券	223,755,000	108.20 242,102,910	108.66 243,154,558	3.500000 2015/7/15	1.66%
28	US T N/B 3.0 05/15/42 アメリカ	国債証券	205,300,000	106.21 218,059,073	104.58 214,713,005	3.000000 2042/5/15	1.47%
29	UK TREASURY 5.0 09/07/14 イギリス	国債証券	180,483,800	109.65 197,903,002	108.30 195,482,003	5.000000 2014/9/7	1.33%
30	US T N/B 3.125 05/15/21 アメリカ	国債証券	164,240,000	113.46 186,347,730	114.42 187,938,189	3.125000 2021/5/15	1.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成24年11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	93.05%
特殊債券	4.85%
合計	97.90%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成24年11月30日現在

種類	地域	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	日本	ユーロ買/円売2012年12月	買建	8,280,000	862,544,287	882,151,200	6.02%
		カナダ・ドル買/円売2012年12月	買建	5,120,000	417,269,760	423,219,200	2.89%
		アメリカ・ドル買/円売2012年12月	買建	3,492,349	285,325,000	286,686,982	1.96%
		シンガポール・ドル買/円売2012年12月	買建	2,060,000	136,808,720	138,555,600	0.95%
		ポーランド・ズロチ買/円売2012年12月	買建	4,280,000	107,312,440	111,194,400	0.76%
		スイス・フラン買/円売2012年12月	買建	720,000	62,185,680	63,734,400	0.44%
		オーストラリア・ドル買/円売2012年12月	買建	600,000	50,599,800	51,270,000	0.35%
		ノルウェー・クローネ買/円売2012年12月	買建	2,570,000	36,355,220	37,059,400	0.25%
		アメリカ・ドル売/円買2012年12月	売建	10,989,020	893,906,191	902,088,650	6.16%
		ユーロ売/円買2012年12月	売建	5,860,000	612,171,630	624,324,400	4.26%
		イギリス・ポンド売/円買2012年12月	売建	4,590,000	593,337,990	604,411,200	4.13%
		スウェーデン・クローネ売/円買2012年12月	売建	880,000	10,599,600	10,824,000	0.07%

(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】

## D I A Mライフサイクル・ファンド＜DC年金＞1安定型

## 【純資産の推移】

直近日（平成24年11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。

	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2計算期間末 (平成15年5月26日)	242	242	0.9816	0.9816
第3計算期間末 (平成16年5月25日)	396	396	1.0265	1.0265
第4計算期間末 (平成17年5月25日)	1,181	1,181	1.0461	1.0461
第5計算期間末 (平成18年5月25日)	2,300	2,300	1.1264	1.1264
第6計算期間末 (平成19年5月25日)	3,457	3,457	1.1803	1.1803
第7計算期間末 (平成20年5月26日)	4,089	4,089	1.1203	1.1203
第8計算期間末 (平成21年5月25日)	4,202	4,202	0.9862	0.9862
第9計算期間末 (平成22年5月25日)	4,945	4,945	1.0263	1.0263
第10計算期間末 (平成23年5月25日)	5,506	5,506	1.0450	1.0450
第11計算期間末 (平成24年5月25日)	5,981	5,981	1.0302	1.0302
平成23年11月末日	5,677	-	1.0144	-
12月末日	5,765	-	1.0192	-
平成24年1月末日	5,815	-	1.0266	-
2月末日	6,042	-	1.0599	-
3月末日	6,150	-	1.0681	-
4月末日	6,123	-	1.0601	-
5月末日	6,021	-	1.0303	-
6月末日	6,084	-	1.0415	-
7月末日	6,083	-	1.0355	-
8月末日	6,086	-	1.0299	-
9月末日	6,137	-	1.0346	-
10月末日	6,165	-	1.0325	-
11月末日	6,266	-	1.0517	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第2計算期間	3.7
第3計算期間	4.6
第4計算期間	1.9
第5計算期間	7.7
第6計算期間	4.8
第7計算期間	5.1
第8計算期間	12.0
第9計算期間	4.1
第10計算期間	1.8
第11計算期間	1.4
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	1.6

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金&gt; 2 安定・成長型

## 純資産の推移

直近日（平成24年11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。

	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2計算期間末 (平成15年5月26日)	394	394	0.9460	0.9460
第3計算期間末 (平成16年5月25日)	699	699	1.0396	1.0396
第4計算期間末 (平成17年5月25日)	2,251	2,251	1.0668	1.0668
第5計算期間末 (平成18年5月25日)	5,118	5,118	1.2322	1.2322
第6計算期間末 (平成19年5月25日)	7,849	7,849	1.3334	1.3334
第7計算期間末 (平成20年5月26日)	9,395	9,395	1.2177	1.2177
第8計算期間末 (平成21年5月25日)	9,042	9,042	0.9774	0.9774
第9計算期間末 (平成22年5月25日)	10,649	10,649	1.0090	1.0090
第10計算期間末 (平成23年5月25日)	12,154	12,154	1.0380	1.0380
第11計算期間末 (平成24年5月25日)	12,994	12,994	1.0014	1.0014
平成23年11月末日	12,303	-	0.9795	-
12月末日	12,520	-	0.9857	-
平成24年1月末日	12,705	-	0.9973	-
2月末日	13,473	-	1.0528	-
3月末日	13,750	-	1.0669	-
4月末日	13,592	-	1.0518	-
5月末日	13,048	-	0.9987	-
6月末日	13,253	-	1.0169	-
7月末日	13,226	-	1.0088	-
8月末日	13,272	-	1.0060	-
9月末日	13,456	-	1.0151	-
10月末日	13,562	-	1.0171	-
11月末日	13,971	-	1.0449	-

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	-

## 収益率の推移

	収益率(%)
第2計算期間	8.8
第3計算期間	9.9
第4計算期間	2.6
第5計算期間	15.5
第6計算期間	8.2
第7計算期間	8.7
第8計算期間	19.7
第9計算期間	3.2
第10計算期間	2.9
第11計算期間	3.5
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	3.7

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金&gt; 3成長型

## 純資産の推移

直近日（平成24年11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。

	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2計算期間末 (平成15年5月26日)	252	252	0.9168	0.9168
第3計算期間末 (平成16年5月25日)	506	506	1.0537	1.0537
第4計算期間末 (平成17年5月25日)	1,710	1,710	1.0877	1.0877
第5計算期間末 (平成18年5月25日)	4,180	4,180	1.3364	1.3364
第6計算期間末 (平成19年5月25日)	6,737	6,737	1.4941	1.4941
第7計算期間末 (平成20年5月26日)	7,967	7,967	1.3167	1.3167
第8計算期間末 (平成21年5月25日)	7,084	7,084	0.9602	0.9602
第9計算期間末 (平成22年5月25日)	8,415	8,415	0.9820	0.9820
第10計算期間末 (平成23年5月25日)	9,867	9,867	1.0197	1.0197
第11計算期間末 (平成24年5月25日)	10,388	10,388	0.9625	0.9625
平成23年11月末日	9,703	-	0.9362	-
12月末日	9,906	-	0.9434	-
平成24年1月末日	10,105	-	0.9585	-
2月末日	10,958	-	1.0327	-
3月末日	11,274	-	1.0519	-
4月末日	11,073	-	1.0309	-
5月末日	10,416	-	0.9575	-
6月末日	10,692	-	0.9814	-
7月末日	10,675	-	0.9719	-
8月末日	10,749	-	0.9718	-
9月末日	10,938	-	0.9846	-
10月末日	11,094	-	0.9905	-
11月末日	11,505	-	1.0256	-



## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	-

## 収益率の推移

	収益率(%)
第2計算期間	13.3
第3計算期間	14.9
第4計算期間	3.2
第5計算期間	22.9
第6計算期間	11.8
第7計算期間	11.9
第8計算期間	27.1
第9計算期間	2.3
第10計算期間	3.8
第11計算期間	5.6
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	5.7

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

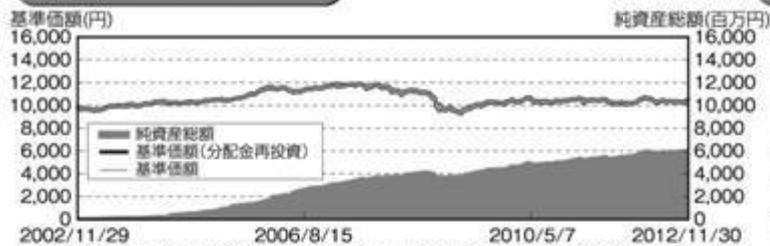
## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2012年11月30日

## DIAMライフサイクル・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型

## 基準価額・純資産の推移

(2002年11月29日～2012年11月30日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2001年10月1日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第7期	(2008.05.26)	0円
第8期	(2009.05.25)	0円
第9期	(2010.05.25)	0円
第10期	(2011.05.25)	0円
第11期	(2012.05.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

## 主要な資産の状況

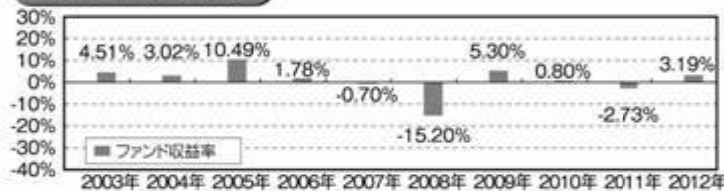
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 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	64.24%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザー・ファンド	20.32%
3	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザー・ファンド	8.40%
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	5.55%

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

## 年間収益率の推移

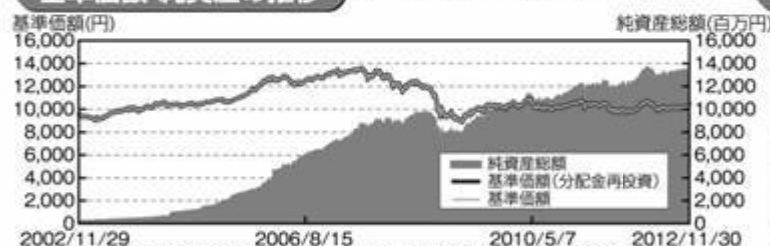


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。  
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## DIAMライフサイクル・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型

## 基準価額・純資産の推移

(2002年11月29日～2012年11月30日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2001年10月1日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第7期	(2008.05.26)	0円
第8期	(2009.05.25)	0円
第9期	(2010.05.25)	0円
第10期	(2011.05.25)	0円
第11期	(2012.05.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

## 主要な資産の状況

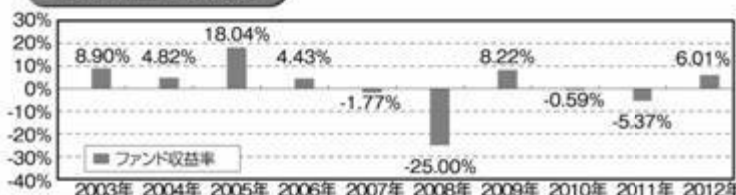
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 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	42.05%
2	DLジャパン・アクティブ・オープン・マザー・ファンド	31.55%
3	DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザー・ファンド	12.66%
4	DLインターナショナル・ボンド・オープン・マザー・ファンド	12.31%

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

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。  
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2012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。

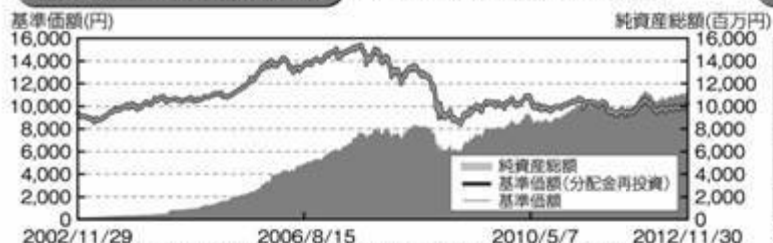
- 掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2012年11月30日

## DIAMライフサイクル・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型

## 基準価額・純資産の推移

(2002年11月29日～2012年11月30日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日2001年10月1日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第7期	(2008.05.26)	0円
第8期	(2009.05.25)	0円
第9期	(2010.05.25)	0円
第10期	(2011.05.25)	0円
第11期	(2012.05.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

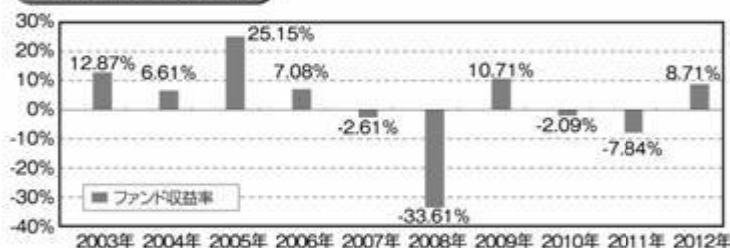
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 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	41.60%
2	DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド	21.17%
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	19.64%
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	16.23%

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

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。  
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2012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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.61
内 日本	97.61
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.39
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	18.26%
2	輸送用機器	10.06%
3	銀行業	9.13%
4	情報・通信業	8.76%
5	小売業	6.90%

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.21%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	3.66%
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	3.18%
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	3.06%
5	エンプラス	株式	日本	電気機器	2.95%
6	メガチップス	株式	日本	電気機器	2.65%
7	三井不動産	株式	日本	不動産業	2.59%
8	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	2.54%
9	三菱地所	株式	日本	不動産業	2.44%
10	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	2.43%

○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:2012年11月30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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	43.92
内 日本	43.92
社債券	52.07
内 日本	52.07
コールローン、その他の資産(負債控除後)	4.01
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	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	9.28%
2	315回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.200000	2021/6/20	8.83%
3	33回 利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	2.000000	2040/9/20	6.64%
4	130回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.800000	2031/9/20	5.30%
5	324回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2022/6/20	4.90%
6	84回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	2.000000	2025/12/20	4.13%
7	ヤマダ電機JPY建て転換社債(満期償付)08/3/31/15	社債券	日本	-	2015/3/31	3.38%
8	川崎汽船JPY建てCB 4/4/13	社債券	日本	-	2013/4/4	2.65%
9	1回 野村総合研究所 転換社債	社債券	日本	-	2014/3/31	2.51%
10	304回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.200000	2013/5/15	2.45%

## ■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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.71
内 アメリカ	58.04
内 イギリス	11.79
内 ユーロ	11.26
内 カナダ	4.70
内 スイス	3.01
内 その他	9.91
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.29
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	2.64%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.73%
3	CHEVRON CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.02%
4	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	各種金融サービス	1.02%
5	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.98%
6	HSBC HOLDINGS PLC	株式	イギリス	商業銀行	0.98%
7	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	アメリカ	タバコ	0.97%
8	PFIZER INC	株式	アメリカ	医薬品	0.97%
9	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	アメリカ	情報技術サービス	0.96%
10	PRUDENTIAL PLC	株式	イギリス	保険	0.94%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	石油・ガス・消耗燃料	8.67%
2	商業銀行	7.72%
3	医薬品	7.54%
4	化学	5.02%
5	保険	3.89%

## ■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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	93.05
内 ユーロ	43.20
内 アメリカ	38.66
内 イギリス	10.54
内 スウェーデン	0.65
特殊債券	4.85
内 アメリカ	3.24
内 オーストラリア	1.24
内 ユーロ	0.37
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.10
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	FR TREASURY 2.0 09/25/13	国債証券	ユーロ	2.000000	2013/9/25	5.62%
2	FR TREASURY 2.5 07/25/16	国債証券	ユーロ	2.500000	2016/7/25	5.24%
3	US T N/B 0.25 09/15/14	国債証券	アメリカ	0.250000	2014/9/15	5.10%
4	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	ユーロ	3.250000	2021/10/25	5.04%
5	US T N/B 1.75 05/31/16	国債証券	アメリカ	1.750000	2016/5/31	4.63%
6	DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	ユーロ	1.750000	2022/7/4	3.77%
7	DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	ユーロ	2.000000	2022/1/4	3.48%
8	US T N/B 4.5 11/15/15	国債証券	アメリカ	4.500000	2015/11/15	3.46%
9	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債証券	ユーロ	4.000000	2018/7/15	3.41%
10	UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	イギリス	4.000000	2022/3/7	3.36%

## 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)	13.61
為替予約取引(売建)	△14.62

○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。

**(4)【設定及び解約の実績】**

## D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金&gt; 1 安定型

	設定口数	解約口数
第2計算期間	238,811,942	21,814,930
第3計算期間	193,049,908	54,038,792
第4計算期間	800,911,568	57,738,368
第5計算期間	1,208,403,508	295,821,507
第6計算期間	1,281,673,947	394,518,362
第7計算期間	1,250,876,864	529,867,918
第8計算期間	1,100,330,733	489,188,089
第9計算期間	947,154,368	389,743,280
第10計算期間	858,438,632	407,732,942
第11計算期間	984,636,854	448,576,851
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	347,726,201	222,809,810

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

## D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金&gt; 2 安定・成長型

	設定口数	解約口数
第2計算期間	407,286,325	24,774,832
第3計算期間	302,024,132	45,632,769
第4計算期間	1,515,139,698	77,517,245
第5計算期間	2,452,656,260	409,489,500
第6計算期間	2,188,674,269	456,165,592
第7計算期間	2,518,326,095	689,031,640
第8計算期間	2,321,520,599	786,059,380
第9計算期間	1,984,711,804	680,768,243
第10計算期間	1,808,556,689	653,872,356
第11計算期間	2,085,581,699	818,521,250
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	761,331,751	437,922,382

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

## D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金&gt; 3 成長型

	設定口数	解約口数
第2計算期間	273,496,648	25,780,705
第3計算期間	263,058,387	57,598,401
第4計算期間	1,159,186,255	67,261,265
第5計算期間	1,955,734,226	400,545,962
第6計算期間	1,895,146,326	513,567,654
第7計算期間	2,316,340,400	774,573,284
第8計算期間	2,117,820,436	790,564,114
第9計算期間	1,936,865,671	745,783,334
第10計算期間	1,838,088,049	730,945,611
第11計算期間	1,930,093,539	813,628,250
平成24年5月26日～ 平成24年11月25日	754,848,668	373,893,018

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

**第2【管理及び運営】****3【資産管理等の概要】****(1)【資産の評価】**

## &lt;訂正前&gt;

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。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

（略）

## &lt;訂正後&gt;

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。）を法令およ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。

（略）

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」につきましては、以下の内容が追加されます。

<追 加>

#### D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金> 1 安定型

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成24年5月26日から平成24年11月25日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

## 【D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C年金 &gt; 1 安定型】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		95,958,662
親投資信託受益証券		6,162,940,820
流動資産合計		6,258,899,482
資産合計		6,258,899,482
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,980,344
未払受託者報酬		3,170,876
未払委託者報酬		44,392,990
その他未払費用		150,536
流動負債合計		49,694,746
負債合計		49,694,746
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,930,562,646
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		278,642,090
（分配準備積立金）		119,439,684
元本等合計		6,209,204,736
純資産合計		6,209,204,736
負債純資産合計		6,258,899,482



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第12期中間計算期間 自 平成24年5月26日 至 平成24年11月25日
営業収益		
受取利息		43,189
有価証券売買等損益		146,270,093
営業収益合計		146,313,282
営業費用		
受託者報酬		3,170,876
委託者報酬		44,392,990
その他費用		150,536
営業費用合計		47,714,402
営業利益又は営業損失（ ）		98,598,880
経常利益又は経常損失（ ）		98,598,880
中間純利益又は中間純損失（ ）		98,598,880
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		753,085
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		175,597,112
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,969,921
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,969,921
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,770,738
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,770,738
分配金		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		278,642,090

## (3)【中間注記表】

(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。
----	-----------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在	
1.		
1	期首元本額	5,805,646,255円
	期中追加設定元本額	347,726,201円
	期中一部解約元本額	222,809,810円
2.	受益権の総数	5,930,562,646口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
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。
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。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
1口当たり純資産額	1.0470円
（1万口当たり純資産額）	（10,470円）

D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成24年5月26日から平成24年11月25日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

## 【D I A Mライフサイクル・ファンド&lt;DC年金&gt; 2 安定・成長型】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		237,807,616
親投資信託受益証券		13,628,144,527
未収入金		50,000,000
流動資産合計		13,915,952,143
資産合計		13,915,952,143
負債の部		
流動負債		
未払解約金		4,464,330
未払受託者報酬		6,933,639
未払委託者報酬		97,071,540
その他未払費用		329,257
流動負債合計		108,798,766
負債合計		108,798,766
純資産の部		
元本等		
元本	1	13,300,373,854
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		506,779,523
（分配準備積立金）		561,695,613
元本等合計		13,807,153,377
純資産合計		13,807,153,377
負債純資産合計		13,915,952,143

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第12期中間計算期間 自 平成24年5月26日 至 平成24年11月25日
営業収益		
受取利息		86,142
有価証券売買等損益		589,769,164
営業収益合計		589,855,306
営業費用		
受託者報酬		6,933,639
委託者報酬		97,071,540
その他費用		329,257
営業費用合計		104,334,436
営業利益又は営業損失（ ）		485,520,870
経常利益又は経常損失（ ）		485,520,870
中間純利益又は中間純損失（ ）		485,520,870
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		4,402,953
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		17,609,893
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,742,459
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,742,459
剰余金減少額又は欠損金増加額		690,746
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		690,746
分配金		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		506,779,523

## (3)【中間注記表】

(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。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
1. 1 期首元本額	12,976,964,485円
期中追加設定元本額	761,331,751円
期中一部解約元本額	437,922,382円
2. 受益権の総数	13,300,373,854口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。
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。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
1口当たり純資産額	1.0381円
（1万口当たり純資産額）	（10,381円）

D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3成長型

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成24年5月26日から平成24年11月25日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

## 【D I A Mライフサイクル・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		193,215,205
親投資信託受益証券		11,209,150,828
未収入金		55,000,000
流動資産合計		11,457,366,033
資産合計		11,457,366,033
負債の部		
流動負債		
未払解約金		7,937,061
未払受託者報酬		5,619,381
未払委託者報酬		78,671,896
その他未払費用		266,836
流動負債合計		92,495,174
負債合計		92,495,174
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,174,156,430
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		190,714,429
（分配準備積立金）		545,950,146
元本等合計		11,364,870,859
純資産合計		11,364,870,859
負債純資産合計		11,457,366,033



## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第12期中間計算期間 自 平成24年5月26日 至 平成24年11月25日
営業収益		
受取利息		77,057
有価証券売買等損益		688,461,353
営業収益合計		688,538,410
営業費用		
受託者報酬		5,619,381
委託者報酬		78,671,896
その他費用		266,836
営業費用合計		84,558,113
営業利益又は営業損失（ ）		603,980,297
経常利益又は経常損失（ ）		603,980,297
中間純利益又は中間純損失（ ）		603,980,297
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		6,349,390
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		404,399,634
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,854,255
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,854,255
剰余金減少額又は欠損金増加額		16,371,099
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		16,371,099
分配金		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		190,714,429

## (3) 【中間注記表】

(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。
---------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
1 . 1 期首元本額	10,793,200,780円
期中追加設定元本額	754,848,668円
期中一部解約元本額	373,893,018円
2 . 受益権の総数	11,174,156,430口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。
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。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第12期中間計算期間末 平成24年11月25日現在
1口当たり純資産額	1.0171円
（1万口当たり純資産額）	（10,171円）

## （参考）

「D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金 > 1安定型」、「D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金 > 2安定・成長型」、「D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金 > 3成長型」は、「D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」受益証券、「D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」受益証券、「D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド」受益証券及び「D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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。

## 「D L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24年11月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		209,299
コール・ローン		423,570,688
株式		27,093,645,500
未収入金		194,271,509
未収配当金		237,778,138
流動資産合計		27,949,475,134
資産合計		27,949,475,134
負債の部		
流動負債		
未払金		198,356,517
流動負債合計		198,356,517
負債合計		198,356,517
純資産の部		
元本等		
元本	1	26,324,936,026
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		1,426,182,591
元本等合計		27,751,118,617
純資産合計		27,751,118,617
負債純資産合計		27,949,475,134

## 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24年11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	25,746,497,428円
同期中追加設定元本額	1,367,008,341円
同期中一部解約元本額	788,569,743円
元本の内訳	
ファンド名	
バランス物語30（安定型）	948,922,303円
バランス物語50（安定・成長型）	752,785,425円
バランス物語70（成長型）	709,292,657円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	1,196,563,472円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	4,142,180,508円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	4,497,211,040円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1 （安定型）	2,471,392,193円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2 （安定・成長型）	5,818,589,829円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3 （成長型）	2,254,252,043円
D I A Mバランス物語30 V A （安定型）	1,304,500,813円
D I A Mバランス物語50 V A （安定・成長型）	1,717,753,217円
D I A Mバランス物語70 V A （成長型）	511,492,526円
計	26,324,936,026円
2 . 受益権の総数	26,324,936,026口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年11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。
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。
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。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成24年11月25日現在
1口当たり純資産額	1.0542円
（1万口当たり純資産額）	（10,542円）

## 「D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成24年11月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		948,635,300
国債証券		18,999,441,210
社債券		20,201,931,000
未収入金		323,297,369
未収利息		118,556,837
前払費用		14,057,466
流動資産合計		40,605,919,182
資産合計		40,605,919,182
負債の部		
流動負債		
未払金		213,496,000
流動負債合計		213,496,000
負債合計		213,496,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	29,987,519,155
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		10,404,904,027
元本等合計		40,392,423,182
純資産合計		40,392,423,182
負債純資産合計		40,605,919,182

## 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	<p>国債証券及び社債券</p> <p>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。</p> <p>社債券（転換社債及び新株予約権付社債）</p> <p>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。</p>
--------------------	---

## （貸借対照表に関する注記）

	項目	平成24年11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	31,887,530,378円
	同期中追加設定元本額	510,309,963円
	同期中一部解約元本額	2,410,321,186円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	バランス物語30（安定型）	2,399,640,501円
	バランス物語50（安定・成長型）	764,634,718円
	バランス物語70（成長型）	265,273,370円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1 安定型	2,996,283,601円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	4,314,925,933円
	D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,774,736,015円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	5,908,613,555円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	5,688,031,644円
	D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	793,437,564円
	D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	3,197,107,139円
	D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	1,714,084,442円
	D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	170,750,673円
	計	29,987,519,155円
2.	受益権の総数	29,987,519,155口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年11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。
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。
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。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成24年11月25日現在
1口当たり純資産額	1,3470円
（1万口当たり純資産額）	（13,470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」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成24年11月25日現在
資産の部		
流動資産		
預金		62,519,666
コール・ローン		93,273,357
株式		10,680,443,465
未収入金		998,618,393
未収配当金		21,820,886
流動資産合計		11,856,675,767
資産合計		11,856,675,767
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,913,820
未払金		589,502,538
未払解約金		445,000,000
流動負債合計		1,038,416,358
負債合計		1,038,416,358
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,406,285,322
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		1,411,974,087
元本等合計		10,818,259,409
純資産合計		10,818,259,409
負債純資産合計		11,856,675,767

## 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24年11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	9,995,407,909円
同期中追加設定元本額	49,000,326円
同期中一部解約元本額	638,122,913円
元本の内訳	
ファンド名	
バランス物語30（安定型）	239,157,632円
バランス物語50（安定・成長型）	280,631,106円
バランス物語70（成長型）	315,351,058円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 1 安定型	297,407,767円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,511,594,253円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,931,094,812円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	602,837,447円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	2,100,635,866円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	965,247,076円
D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	319,065,666円
D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	627,889,657円
D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	215,372,982円
計	9,406,285,322円
2 . 受益権の総数	9,406,285,322口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年11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。
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。
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。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

#### 通貨関連

種類	平成24年11月25日 現在			
	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	454,365,880	-	458,279,700	3,913,820
アメリカ・ドル	261,888,000	-	263,808,000	1,920,000
イギリス・ポンド	161,323,780	-	162,982,700	1,658,920
カナダ・ドル	13,968,900	-	14,069,200	100,300
スウェーデン・クローナ	10,893,600	-	11,061,000	167,400
ユーロ	6,291,600	-	6,358,800	67,200
合計	454,365,880	-	458,279,700	3,913,820

## （注） 時価の算定方法

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

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成24年11月25日現在
1口当たり純資産額	1,1501円
（1万口当たり純資産額）	（11,501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」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成24年11月25日現在
資産の部		
流動資産		
預金		9,304,914
コール・ローン		296,112,070
国債証券		13,561,448,957
特殊債券		712,406,658
派生商品評価勘定		29,837,034
未収入金		878,548,793
未収利息		102,682,044
前払費用		8,642,398
流動資産合計		15,598,982,868
資産合計		15,598,982,868
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		38,643,211
未払金		507,818,665
未払解約金		485,000,000
流動負債合計		1,031,461,876
負債合計		1,031,461,876
純資産の部		
元本等		
元本	1	8,643,082,434
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		5,924,438,558
元本等合計		14,567,520,992
純資産合計		14,567,520,992
負債純資産合計		15,598,982,868

## 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24年11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	8,870,306,525円
同期中追加設定元本額	157,346,367円
同期中一部解約元本額	384,570,458円
元本の内訳	
ファンド名	
バランス物語30（安定型）	249,716,383円
バランス物語50（安定・成長型）	190,878,915円
バランス物語70（成長型）	177,251,789円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C 年金> 1 安定型	310,579,013円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型	1,014,991,430円
D I A Mライフサイクル・ファンド< D C 年金> 3 成長型	1,101,554,076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
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 1（安定型）	634,813,588円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 2（安定・成長型）	1,411,165,963円
D I A Mライフサイクル・ファンドV A 3（成長型）	547,625,293円
D I A Mバランス物語30 V A（安定型）	336,712,693円
D I A Mバランス物語50 V A（安定・成長型）	420,234,185円
D I A Mバランス物語70 V A（成長型）	122,528,041円
計	8,643,082,434円
2 . 受益権の総数	8,643,082,434口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年11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。

2 . 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

#### 通貨関連

種類	平成24年11月25日 現在			
	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	2,341,365,270	-	2,380,008,481	38,643,211
アメリカ・ドル	1,040,887,036	-	1,054,914,073	14,027,037
イギリス・ポンド	667,080,082	-	679,293,041	12,212,959
スウェーデン・クローナ	10,599,600	-	10,797,600	198,000
ユーロ	622,798,552	-	635,003,767	12,205,215
買 建	1,818,290,979	-	1,848,128,013	29,837,034
アメリカ・ドル	145,215,072	-	147,304,913	2,089,841
オーストラリア・ドル	50,599,800	-	51,180,000	580,200
カナダ・ドル	417,269,760	-	423,372,800	6,103,040
シンガポール・ドル	136,808,720	-	138,658,600	1,849,880
スイス・フラン	62,185,680	-	63,367,200	1,181,520
ノルウェー・クローネ	36,355,220	-	37,033,700	678,480
ポーランド・ズロチ	107,312,440	-	109,696,400	2,383,960
ユーロ	862,544,287	-	877,514,400	14,970,113
合計	4,159,656,249	-	4,228,136,494	8,806,177

(注) 時価の算定方法

- 1 . 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう  
に評価しております。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場  
合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない  
場合は、以下の方法によっております。

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

## （1口当たり情報に関する注記）

平成24年11月25日現在	
1口当たり純資産額	1.6855円
（1万口当たり純資産額）	（16,855円）



**2【ファンドの現況】**

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

**【純資産額計算書】**

D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 1 安定型

平成24年11月30日現在

資産総額	6,271,846,710円
負債総額	5,577,216円
純資産総額 ( - )	6,266,269,494円
発行済数量	5,958,244,728口
1口当たり純資産額 ( / )	1.0517円

D I A Mライフサイクル・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 2 安定・成長型

平成24年11月30日現在

資産総額	13,985,517,517円
負債総額	13,936,294円
純資産総額 ( - )	13,971,581,223円
発行済数量	13,371,822,058口
1口当たり純資産額 ( / )	1.0449円

## D I A Mライフサイクル・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型

平成24年11月30日現在

資産総額	11,524,990,634円
負債総額	19,277,642円
純資産総額（ - ）	11,505,712,992円
発行済数量	11,218,315,181口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0256円

（参考）マザーファンドの現況

## D Lジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド

平成24年11月30日現在

資産総額	28,220,211,224円
負債総額	202,629,313円
純資産総額（ - ）	28,017,581,911円
発行済数量	26,324,936,026口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0643円

## D Lジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド

平成24年11月30日現在

資産総額	41,755,535,192円
負債総額	1,004,242,000円
純資産総額（ - ）	40,751,293,192円
発行済数量	30,183,986,278口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3501円

## D Lインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド

平成24年11月30日現在

資産総額	11,005,116,706円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	11,005,116,706円
発行済数量	9,406,285,322口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1700円

## D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド

平成24年11月30日現在

資産総額	14,680,503,189円
負債総額	31,710,752円
純資産総額（ - ）	14,648,792,437円
発行済数量	8,643,082,434口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6949円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

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

<更新・訂正後>

##### (1) 資本金の額

本書提出日現在の資本金の額 20億円

発行する株式総数 80,000株

発行済株式総数 24,000株

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

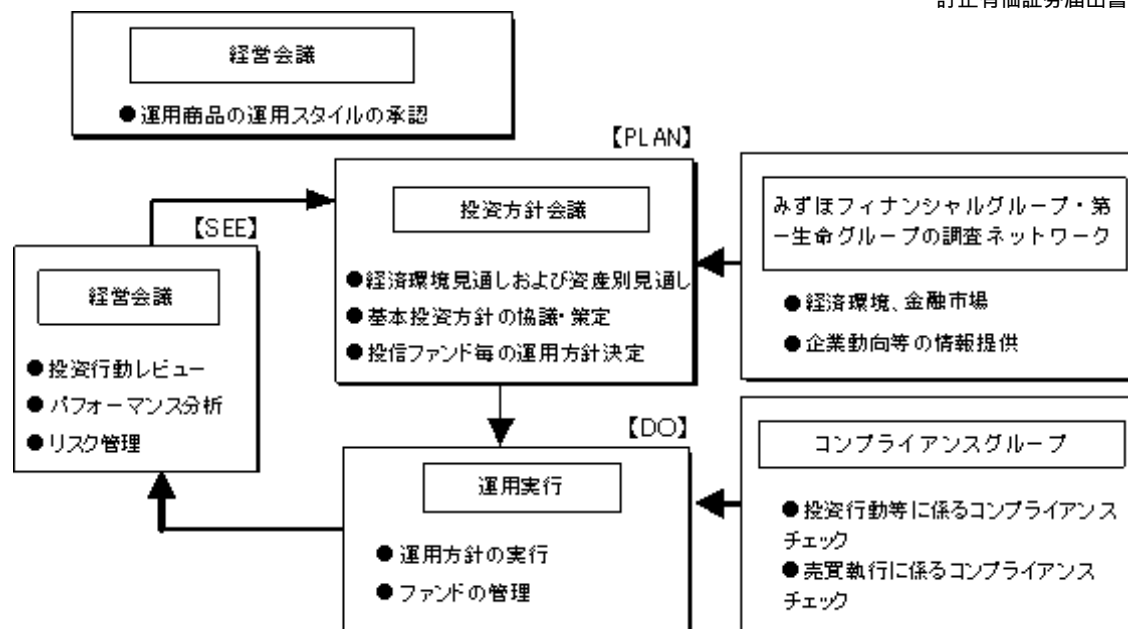
###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成24年11月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。平成24年11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は281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	12	51,570,670,636
追加型株式投資信託	260	4,075,768,589,790
単位型公社債投資信託	8	76,826,427,166
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	165,417,806
合計	281	4,204,331,105,398

### 3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

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

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27期事業年度（自平成23年4月1日至平成24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28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24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26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,220,759	12,520,748
金銭の信託	5,967,344	6,548,577
前払費用	27,593	25,744
未収委託者報酬	2,942,180	2,780,527
未収運用受託報酬	1,061,935	1,167,998
未収投資助言報酬	2 267,240	2 241,851
未収収益	186,483	212,226
繰延税金資産	403,201	344,793
その他	102,404	22,264
流動資産計	23,179,143	23,864,733
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 183,704	1 167,433
車両運搬具	-	1 4,752
器具備品	1 206,306	1 188,367
建設仮勘定	10,956	109,529
無形固定資産		
商標権	1 510	1 383
ソフトウェア	1 780,190	1 1,101,685
ソフトウェア仮勘定	478,971	152,513
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 451	1 371
投資その他の資産		
投資有価証券	4,252,397	3,982,258
関係会社株式	604,498	450,882
関係会社株式	2,457,319	2,119,074
繰延税金資産	402,191	590,822
長期差入保証金	702,696	731,197
その他	85,690	90,282
固定資産計	5,920,638	5,714,444
資産合計	29,099,782	29,579,177

（単位：千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	120,910	132,805
未払金	1,479,756	1,460,128
未払収益分配金	3,223	670
未払償還金	98,362	86,391
未払手数料	1,134,992	1,088,348
その他未払金	243,178	284,718
未払費用	2 1,226,658	2 1,105,512
未払法人税等	1,706,391	1,195,056
未払消費税等	143,728	92,354
賞与引当金	575,326	574,646
その他	10,000	-
流動負債計	5,262,771	4,560,503
固定負債		
退職給付引当金	579,063	680,768
役員退職慰労引当金	100,260	56,690
固定負債計	679,324	737,458
負債合計	5,942,095	5,297,962
（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	18,512,674	19,716,594
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	13,430,000	15,630,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,459,380	3,463,300
株主資本計	22,941,152	24,145,072
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216,534	136,143
評価・換算差額等計	216,534	136,143
純資産合計	23,157,686	24,281,215
負債・純資産合計	29,099,782	29,579,177

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		24,367,005		23,208,602
運用受託報酬		4,458,894		4,966,992
投資助言報酬		1,019,727		943,057
その他営業収益		789,867		697,063
営業収益計		30,635,495		29,815,715
営業費用				
支払手数料		10,405,593		10,154,958
広告宣伝費		272,928		164,286
公告費		2,297		-
調査費		4,755,890		4,590,302
調査費		2,611,173		2,888,013
委託調査費		2,144,716		1,702,289
委託計算費		338,206		335,754
営業雑経費		671,721		496,565
通信費		30,286		26,941
印刷費		585,041		399,066
協会費		23,561		25,014
諸会費		38		41
支払販売手数料		32,794		45,500
営業費用計		16,446,637		15,741,867
一般管理費				
給料		4,576,265		4,630,102
役員報酬	1	235,289	1	245,224
給料・手当		3,768,114		3,824,122
賞与		572,860		560,755
交際費		38,997		35,987
寄付金		13,335		3,156
旅費交通費		255,190		213,642
租税公課		89,571		84,346
不動産賃借料		718,929		656,463
退職給付費用		139,773		164,627
固定資産減価償却費		486,987		475,556
福利厚生費		20,476		24,887
修繕費		20,842		6,721
賞与引当金繰入		575,326		574,646
役員退職慰労引当金繰入		42,036		30,048
役員退職金		13,140		27,503
機器リース料		1,951		1,510
事務委託費		331,935		323,740
消耗品費		70,952		58,739
器具備品費		575		2,889
諸経費		124,218		114,695
一般管理費計		7,520,506		7,429,267
営業利益		6,668,351		6,644,580



（単位：千円）

	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）		第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	4	341,775		61,720
受取利息		9,168		3,921
時効成立分配金		2,574		11,383
為替差益		-		1,660
投資信託解約益		157,213		-
先物利益		9,816		-
金銭の信託運用益		69,014		-
雑収入		8,602		5,992
営業外収益計		598,165		84,678
営業外費用				
為替差損		755		-
時効成立後支払分配金		-		36
金銭の信託運用損		-		417,812
雑損失		6,089		1,152
営業外費用計		6,844		419,001
経常利益		7,259,672		6,310,257
特別利益				
ゴルフ会員権売却益		-		1,959
貸倒引当金戻入益		4,288		-
過年度損益修正益	3, 4	105,241		-
特別利益計		109,530		1,959
特別損失				
固定資産除却損	2	31,419	2	36,415
固定資産売却損		1,440		381
関係会社株式評価損		3,825		338,244
特別損失計		36,684		375,042
税引前当期純利益		7,332,518		5,937,173
法人税、住民税及び事業税		2,885,426		2,582,251
法人税等調整額		7,586		56,997
法人税等合計		2,877,839		2,525,253
当期純利益		4,454,678		3,411,920

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24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	11,650,000	13,430,000
当期変動額	1,780,000	2,200,000
当期末残高	13,430,000	15,630,000
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	3,464,702	4,459,380
当期変動額		
剰余金の配当	1,680,000	2,208,000
別途積立金の積立	1,780,000	2,200,000
当期純利益	4,454,678	3,411,920
当期末残高	4,459,380	3,463,300
利益剰余金合計		
当期首残高	15,737,995	18,512,674
当期変動額	2,774,678	1,203,920
当期末残高	18,512,674	19,716,594
株主資本合計		
当期首残高	20,166,473	22,941,152

	当期変動額	2,774,678	1,203,920
	当期末残高	22,941,152	24,145,072
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高	231,525	216,534
	当期変動額(純額)	14,991	80,390
	当期末残高	216,534	136,143
純資産合計			
	当期首残高	20,397,999	23,157,686
	当期変動額	2,759,687	1,123,529
	当期末残高	23,157,686	24,281,215

[次へ](#)

## 重要な会計方針

項目	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24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（リース資産を除く） 定率法によっております。 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
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. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
8. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

## 追加情報

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## 注記事項

（貸借対照表関係）

## 1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
建物	484,832	513,080
車両運搬具	-	171
器具備品	499,620	462,449
商標権	2,428	2,555
ソフトウェア	809,403	961,584
電話施設利用権	1,145	1,225

## 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26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	266,194	238,121
流動負債	未払費用	291,628	292,536

（損益計算書関係）

## 1. 役員報酬の限度額

（千円）

	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
取締役（年額）	250,000	250,000
監査役（年額）	50,000	50,000

## 2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
建物	15,317	1,892
器具備品	3,597	18,917
ソフトウェア	12,503	15,606

## 3. 過年度損益修正益の内訳

第26期(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。

第27期(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

該当事項はありません。

## 4. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。

(千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
受取配当金	331,240	-
過年度損益修正益	105,241	-

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自平成22年4月1日 至平成23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22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日
----------------------	----------	-----------	--------	------------	-----------

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

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

## 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

平成24年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成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

（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

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

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）			第27期 （平成24年3月31日現在）		
	取得価額 相当額	減価償却累 計額相当額	期末残高 相当額	取得価額 相当額	減価償却累 計額相当額	期末残高 相当額
器具備品	46,681	46,138	543	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-
合計	46,681	46,138	543	-	-	-

未経過リース料期末残高相当額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
	一年以内	586
一年超	-	-
合計	586	-

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26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
	支払リース料	15,998
減価償却費相当額	14,995	543
支払利息相当額	234	1

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

2. オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
	一年以内	1,475
一年超	-	-



合計	1,475	-
----	-------	---

## （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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

## 第26期（平成23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	12,220,759	12,220,759	-
(2) 金銭の信託	5,967,344	5,967,344	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	524,252	524,252	-
資産計	18,712,356	18,712,356	-
(1) 未払法人税等	1,706,391	1,706,391	-
負債計	1,706,391	1,706,391	-

## 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 其他有価証券	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	-

## （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26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,457,319	2,119,074
長期差入保証金	702,696	731,197

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

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

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、記載していません。

（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26期（平成23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	12,220,413	-	-	-
合計	12,220,413	-	-	-

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	-	-	-

（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26期の貸借対照表計上額2,457,319千円、第27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、記載していません。

## 4. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	513,129	146,101	367,027
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,400	3,000	400
小計	516,529	149,101	367,427
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,723	10,000	2,277
小計	7,723	10,000	2,277
合計	524,252	159,101	365,150

（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			
株式	359,540	146,101	213,438
債券	-	-	-
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			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
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。

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其他有価証券  
第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

（千円）

区分	売却額	売却益の合計	売却損の合計
その他（投資信託）	719,016	162,043	4,830

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券  
当事業年度において、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。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託  
第26期（平成23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	5,967,344	119,701

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

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26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
(1) 退職給付債務	636,624	740,560
(2) 未認識数理計算上の差異	57,560	59,792
退職給付引当金	579,063	680,768

## 3. 退職給付費用に関する事項

（千円）

	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
(1) 勤務費用	85,216	102,728
(2) 利息費用	7,954	9,549
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	9,383	13,388
(4) 確定拠出年金 拠出額	37,218	38,960
退職給付費用	139,773	164,627

## 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26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24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26期	第27期
	(平成23年3月31日現在)	(平成24年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	128,299	87,682
未払事業所税	6,141	5,792
賞与引当金	234,157	218,423
未払法定福利費	28,823	24,791
未払確定拠出年金掛金	2,739	2,607
減価償却超過額（一括償却資産）	3,039	5,496
減価償却超過額	36,256	150,369
繰延資産償却超過額（税法上）	139,027	47,261
退職給付引当金	235,678	243,845
役員退職慰労引当金	40,806	20,204
ゴルフ会員権評価損	5,577	2,138
投資有価証券評価損	763	4,410
関係会社株式評価損	1,556	121,913
その他有価証券評価差額金	-	678
貸倒引当金繰入額	-	-
繰延税金資産合計	862,867	935,615
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	57,474	-
繰延税金負債合計	57,474	-
差引繰延税金資産の純額	805,393	935,615

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

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

## 3. 法人税率の変更等による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.01%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.64%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は98,284千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は108,988千円増加し、その他有価証券評価差額金は10,703千円増加しております。



## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## 第26期（自平成22年4月1日 至平成23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	24,367,005	5,478,622	789,867	30,635,495

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## 第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

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## （関連当事者との取引）

## (1)親会社及び法人主要株主等

## 第26期（自平成22年4月1日 至平成23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 3名, 転籍 2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,392	未収投資 助言報酬	190,149

## 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

## 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26期（自平成22年4月1日 至平成23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	646,432	未払 費用	172,736
	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	224,694	未払 費用	88,837
	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接 100%	-	なし	増資の引 受	300,000	-	-

## 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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23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	1,538,792	未払 手数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	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	536,163	未払 手数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	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	198,967	未払 費用	94,085
業務委託料 の支払								17,740	未払 費用	21,598	
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)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344	
							信託報酬の 支払	3,163			

## 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  預金の引出 (純額)  受取利息	1,548,354  91,135  104	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	122,786  433,779  -
	株式会 社みずほ コーポ レート 銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料  預金の預入 (純額)  受取利息	450,766  392,267  3,654	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	83,446  11,440,025  -
	みずほ第 一フィ 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)  信託報酬の 支払	1,000,000  5,087	金銭の 信託

## 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26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
1株当たり純資産額	964,903円60銭	1,011,717円32銭
1株当たり当期純利益金額	185,611円60銭	142,163円33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26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
当期純利益	4,454,678千円	3,411,920千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,454,678千円	3,411,920千円
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。

[次へ](#)

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第28期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,242,702
金銭の信託		7,499,425
前払費用		92,263
未収委託者報酬		2,663,804
未収運用受託報酬		1,676,248
未収投資助言報酬		229,963
未収収益		208,987
繰延税金資産		353,360
その他		20,041
	流動資産計	22,986,796
固定資産		
有形固定資産		410,173
建物	1	154,028
車両運搬具	1	3,761
器具備品	1	141,266
建設仮勘定		111,117
無形固定資産		1,414,348
商標権	1	336
ソフトウェア	1	1,104,659
ソフトウェア仮勘定		301,872
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	331
投資その他の資産		3,941,169
投資有価証券		352,985
関係会社株式		2,119,074
繰延税金資産		649,103
長期差入保証金		731,564
その他		88,442
	固定資産計	5,765,691
資産合計		28,752,487

（単位：千円）

	第28期中間会計期間末 （平成24年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	90,304
未払金	1,586,848
未払収益分配金	670
未払償還金	84,932
未払手数料	1,045,061
その他未払金	456,184
未払費用	1,144,835
未払法人税等	1,153,892
未払消費税等	94,807
前受収益	4,645
賞与引当金	592,564
流動負債計	4,667,898
固定負債	
退職給付引当金	745,286
役員退職慰労引当金	83,600
固定負債計	828,887
負債合計	5,496,785
（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	18,754,087
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	16,330,000
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	1,800,793
株主資本計	23,182,565
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	73,136
評価・換算差額等計	73,136
純資産合計	23,255,702
負債・純資産合計	28,752,487



## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日至平成24年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	11,666,848	
運用受託報酬	2,624,179	
投資助言報酬	432,133	
その他営業収益	323,176	
営業収益計		15,046,337
営業費用		
支払手数料	5,650,162	
広告宣伝費	74,513	
公告費	1,649	
調査費	2,242,409	
調査費	1,509,414	
委託調査費	732,994	
委託計算費	164,548	
営業雑経費	214,207	
通信費	12,777	
印刷費	185,164	
協会費	12,746	
諸会費	18	
支払販売手数料	3,500	
営業費用計		8,347,489
一般管理費		
給料	2,141,911	
役員報酬	120,924	
給料・手当	2,020,987	
交際費	16,251	
寄付金	2,693	
旅費交通費	89,758	
租税公課	49,433	
不動産賃借料	337,699	
退職給付費用	85,485	
固定資産減価償却費	1 250,300	
福利厚生費	9,221	
修繕費	5,343	
賞与引当金繰入	592,564	
役員退職慰労引当金繰入	26,910	
機器リース料	23	
事務委託費	123,542	
消耗品費	30,045	
器具備品費	894	
諸経費	51,882	
一般管理費計		3,813,961
営業利益		2,884,886

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自平成24年4月1日至平成24年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	4,243	
受取利息	1,821	
時効成立分配金	1,459	
為替差益	4,637	
雑収入	4,289	
営業外収益計		16,451
営業外費用		
金銭の信託運用損	48,384	
営業外費用計		48,384
経常利益		2,852,953
特別損失		
固定資産除却損	124	
特別損失計		124
税引前中間純利益		2,852,828
法人税、住民税及び事業税		1,135,292
法人税等調整額		31,957
法人税等合計		1,103,335
中間純利益		1,749,493

## (3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日至平成24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		15,630,000
	当中間期変動額		700,000
	当中間期末残高		16,330,000
	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		3,463,300
	当中間期変動額		
	剰余金の配当		2,712,000
	別途積立金の積立		700,000
	中間純利益		1,749,493
	当中間期末残高		1,800,793
	利益剰余金合計		
	当期首残高		19,716,594
	当中間期変動額		962,506
	当中間期末残高		18,754,087
	株主資本合計		
	当期首残高		24,145,072
	当中間期変動額		962,506
	当中間期末残高		23,182,565
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高		136,143
	当中間期変動額(純額)		63,006
	当中間期末残高		73,136
純資産合計			

当期首残高	24,281,215
当中間期変動額	1,025,513
当中間期末残高	23,255,702

[前へ](#)   [次へ](#)

## 重要な会計方針

項目	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24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 (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) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、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中間純利益に与える影響は軽微であります。 (2) 無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法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 (4) 役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。

6. 外貨建て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28期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)	
	1. 固定資産の減価償却累計額	建物
	車両運搬具	1,162千円
	器具備品	509,550千円
	商標権	602千円
	ソフトウェア	871,599千円
	電話施設利用権	1,265千円

## (中間損益計算書関係)

項目	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産
	無形固定資産	188,803千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第28期中間会計期間(自平成24年4月1日 至平成24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

## (金融商品関係)

第28期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,242,702	10,242,702	-
(2) 金銭の信託	7,499,425	7,499,425	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	272,739	272,739	-
資産計	18,014,867	18,014,867	-
(1) 未払法人税等	1,153,892	1,153,892	-
負債計	1,153,892	1,153,892	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## 負債

### (1) 未払法人税等

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

### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,119,074
長期差入保証金	731,564

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

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

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。



## （有価証券関係）

## 第28期中間会計期間末（平成24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			
株式	262,099	146,101	115,997
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,454	3,000	454
小計	265,553	149,101	116,451
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,186	10,000	2,814
小計	7,186	10,000	2,814
合計	272,739	159,101	113,637

（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28期中間会計期間末（平成24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28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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	11,666,848	3,056,312	323,176	15,046,337

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## （1株当たり情報）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）		
1株当たり純資産額	968,987円	59銭
1株当たり中間純利益金額	72,895円	54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いません。		

（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28期中間会計期間 （自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
中間純利益	1,749,493千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,749,493千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

## 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】

<訂正前>

(略)

販売会社

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

(平成24年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
(略)		
みずほ証券株式会社	125,167	「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。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「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。

<訂正後>

(略)

販売会社

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

(平成24年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
(略)		
みずほ証券株式会社	( 1 ) 125,167	「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。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「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。

( 1 )平成25年1月4日現在

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年1月16日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成24年5月26日から平成24年11月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成24年11月25日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年5月26日から平成24年11月25日まで）の損益の状況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

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

以 上

---

上記は、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。

中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年1月16日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 2安定・成長型の平成24年5月26日から平成24年11月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金> 2安定・成長型の平成24年11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中間計算期間（平成24年5月26日から平成24年11月25日まで）の損益の状況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

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

以 上

---

上記は、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。

中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。



## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年1月16日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金 > 3成長型の平成24年5月26日から平成24年11月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mライフサイクル・ファンド< D C年金 > 3成長型の平成24年11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中間計算期間（平成24年5月26日から平成24年11月25日まで）の損益の状況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

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

以 上

---

上記は、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。

中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

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





## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 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D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24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) 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[ファンド監査報告書3へ](#)[委託会社の監査報告書\(中間\)へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月7日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	山内 正彦
業務執行社員	士	印
指定有限責任社員	公認会計士	浅野 功
業務執行社員	士	印
指定有限責任社員	公認会計士	近藤 敏弘
業務執行社員	士	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24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24年4月1日から平成24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）上記は、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)