

【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23年11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バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型
D I A Mバランス・ファンド<DC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23年5月25日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものがあります。

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)

- DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型
比較的リスクの低い資産(国内債券)を中心に組入れ、安定運用を行います。
- DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型
各資産をバランスよく組入れ、ミドルリスク・ミドルリターンをめざします。
- DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型
株式・外国証券等のリスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。

商品分類表

(略)

<訂正後>

(略)

- DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型
比較的リスクの低い資産(国内債券)を中心に組入れ、安定運用を行います。
- DIAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型
各資産をバランスよく組入れ、ミドルリスク・ミドルリターンをめざします。
- DIAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型
株式・外国証券等のリスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。

分配方針

年1回の決算時(2月25日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

商品分類表

(略)

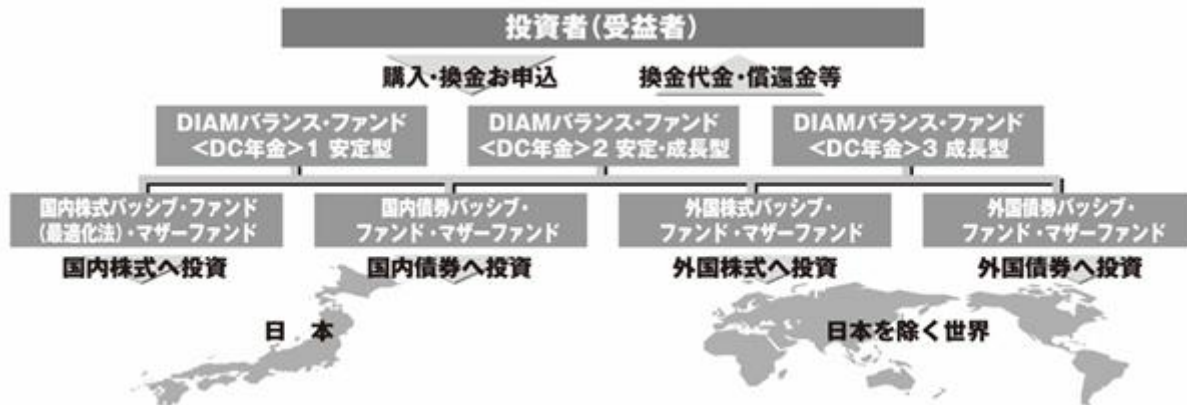
(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

ファミリーファンド方式とは

(略)



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

委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成23年2月28日現在）

(略)

大株主の状況

(平成23年2月28日現在)

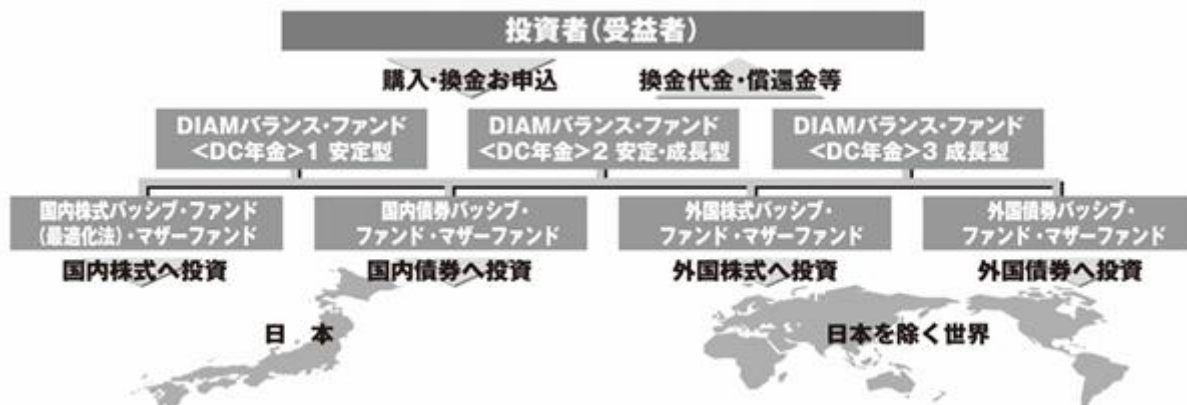
| 株主名 | 住所 | 所有株数 | 所有比率 |
|--------------------|--------------------|---------|-------|
| 第一生命保険株式会社 | 東京都千代田区有楽町一丁目13番1号 | 12,000株 | 50.0% |
| 株式会社みずほフィナンシャルグループ | 東京都千代田区丸の内二丁目5番1号 | 12,000株 | 50.0% |

<訂正後>

(略)

ファミリーファンド方式とは

(略)



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社
 本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成23年8月31日現在）

（略）

大株主の状況

（平成23年8月31日現在）

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

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<訂正前>

（略）

上記体制は平成23年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

（略）

上記体制は平成23年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

<基準価額の主な変動要因>

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

(1)株式投資リスク

（略）

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

（略）

当ファンドは、各マザーファンドへの投資を通じて合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行いますが、各マザーファンドが各対象インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流入から組入

銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成インデックスが乖離する場合があります。

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

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

(略)

注意事項

- イ. 当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって元本が保証されているものではありません。
- ロ. 証券投資信託は、預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ. 証券投資信託は金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ. 証券投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

リスク管理体制

< 運用評価・運用リスク管理体制 >

(略)

上記体制は平成23年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

< 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動きのほか、為替変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

(1) 株式投資リスク

(略)

< 分配金に関する留意点 >

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

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

す。

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

<その他の留意点>

(略)

当ファンドは、各マザーファンドへの投資を通じて合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。各マザーファンドが各対象インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成インデックスが乖離する場合があります。

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

(略)

注意事項

- イ. 当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ. 投資信託は、預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ. 投資信託は金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります。これによる損失は購入者が負担することとなります。

リスク管理体制

<運用評価・運用リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成23年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

(略)

信託報酬の総額は、日々の基準価額に反映され、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日。）および毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

<訂正後>

(略)

信託報酬の総額は、日々の基準価額に反映され、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日。）および毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

法人の受益者に対する課税

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

(略)

<訂正後>

(略)

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一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成26年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。

(略)

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

平成23年8月31日現在

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 4,466,836,434 | 97.02 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 137,380,630 | 2.98 |
| 合 計（純資産総額） | | 4,604,217,064 | 100.00 |

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

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型

平成23年8月31日現在

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率(%) |
|---------------------|----|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 10,320,460,401 | 97.03 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 316,195,210 | 2.97 |
| 合 計（純資産総額） | | 10,636,655,611 | 100.00 |

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

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

平成23年8月31日現在

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 7,961,742,746 | 97.04 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 243,126,748 | 2.96 |
| 合 計（純資産総額） | | 8,204,869,494 | 100.00 |

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

(参考) マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年8月31日現在

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率(%) |
|---------------------|----|-----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 243,364,519,507 | 97.11 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 7,239,890,338 | 2.89 |
| 合 計（純資産総額） | | 250,604,409,845 | 100.00 |

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

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

| | | | |
|---------------------|-----------------|-----------------|-------|
| 株式 | 米国 | 134,333,118,718 | 51.28 |
| | 英国 | 25,513,547,311 | 9.74 |
| | カナダ | 15,593,067,253 | 5.95 |
| | スイス | 11,891,736,622 | 4.54 |
| | スウェーデン | 3,486,078,002 | 1.33 |
| | デンマーク | 1,237,258,640 | 0.47 |
| | ノルウェー | 973,585,129 | 0.37 |
| | アイルランド | 1,576,469,884 | 0.60 |
| | オランダ | 3,122,494,012 | 1.19 |
| | ベルギー | 1,203,624,872 | 0.46 |
| | ルクセンブルク | 606,137,886 | 0.23 |
| | フランス | 11,089,264,501 | 4.23 |
| | ドイツ | 9,682,394,037 | 3.70 |
| | ポルトガル | 321,544,313 | 0.12 |
| | スペイン | 4,184,937,818 | 1.60 |
| | イタリア | 2,849,657,867 | 1.09 |
| | フィンランド | 1,157,220,799 | 0.44 |
| | オーストリア | 370,936,476 | 0.14 |
| | キプロス | 18,507,789 | 0.01 |
| | ギリシャ | 176,594,320 | 0.07 |
| | 香港 | 3,319,688,611 | 1.27 |
| | シンガポール | 2,095,074,758 | 0.80 |
| | イスラエル | 867,904,645 | 0.33 |
| | オーストラリア | 10,397,531,242 | 3.97 |
| | ニュージーランド | 143,257,615 | 0.05 |
| | パナマ | 193,539,327 | 0.07 |
| | バミューダ諸島 | 632,676,776 | 0.24 |
| | オランダ領キュラソー | 1,268,985,676 | 0.48 |
| | ケイマン諸島 | 180,143,832 | 0.07 |
| | ガーンジー・チャンネル諸島 | 76,930,984 | 0.03 |
| | ジャージー・チャンネル諸島 | 721,673,691 | 0.28 |
| | マン島 | 94,296,181 | 0.04 |
| | リベリア | 44,372,732 | 0.02 |
| モーリシャス | 49,645,925 | 0.02 | |
| 小計 | 249,473,898,242 | 95.23 | |
| 投資信託受益証券 | シンガポール | 74,032,758 | 0.03 |
| | オーストラリア | 771,135,192 | 0.29 |
| | 小計 | 845,167,949 | 0.32 |
| 投資証券 | 米国 | 2,850,134,298 | 1.09 |
| | 英国 | 336,562,587 | 0.13 |
| | カナダ | 88,542,789 | 0.03 |
| | オランダ | 53,746,994 | 0.02 |
| | フランス | 365,973,481 | 0.14 |
| | 香港 | 99,065,676 | 0.04 |
| | 小計 | 3,794,025,824 | 1.45 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | 7,858,748,490 | 3.00 | |
| 合計（純資産総額） | 261,971,840,505 | 100.00 | |

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率(%) |
|-------|----|-----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 316,963,770,900 | 76.15 |

| | | | |
|---------------------|----|-----------------|--------|
| 地方債証券 | 日本 | 28,294,931,477 | 6.80 |
| 特殊債券 | 日本 | 37,684,310,489 | 9.05 |
| 社債券 | 日本 | 30,340,610,460 | 7.29 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 2,929,258,978 | 0.70 |
| 合計（純資産総額） | | 416,212,882,304 | 100.00 |

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率(%) |
|---------------------|---------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 米国 | 141,667,624,370 | 37.69 |
| | 英国 | 30,264,739,809 | 8.05 |
| | カナダ | 10,975,064,627 | 2.92 |
| | スウェーデン | 2,617,048,643 | 0.70 |
| | デンマーク | 3,453,825,990 | 0.92 |
| | ノルウェー | 1,145,172,060 | 0.30 |
| | アイルランド | 2,401,806,952 | 0.64 |
| | オランダ | 9,908,639,104 | 2.64 |
| | ベルギー | 10,474,103,160 | 2.79 |
| | フランス | 38,780,383,373 | 10.32 |
| | ドイツ | 37,050,448,287 | 9.86 |
| | ポルトガル | 1,760,815,980 | 0.47 |
| | スペイン | 16,486,353,080 | 4.39 |
| | イタリア | 36,427,487,546 | 9.69 |
| | フィンランド | 2,661,631,697 | 0.71 |
| | ポーランド | 3,071,571,018 | 0.82 |
| | オーストリア | 6,766,384,851 | 1.80 |
| | シンガポール | 1,624,625,880 | 0.43 |
| | マレーシア | 1,896,687,063 | 0.50 |
| | オーストラリア | 4,835,709,161 | 1.29 |
| メキシコ | 3,221,063,670 | 0.86 | |
| 小計 | | 367,491,186,318 | 97.77 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 8,388,644,953 | 2.23 |
| 合計（純資産総額） | | 375,879,831,271 | 100.00 |

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

(2)【投資資産】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型

【投資有価証券の主要銘柄】

平成23年8月31日現在

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 口数 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率(%) |
|----|-----------------------------|-----------|----|---------------|-----------|---------------|-----------|---------------|---------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | 単価(円) | 金額(円) | |
| 1 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 2,685,483,532 | 11,130.88 | 2,989,179,886 | 11,309.00 | 3,037,013,326 | 65.96 |
| 2 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 828,507,354 | 11,986.92 | 993,125,438 | 10,171.00 | 842,674,829 | 18.30 |

| | | | | | | | | | |
|---|-----------------------|-----------|----|-------------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 3 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 328,551,212 | 11,455.24 | 376,363,365 | 11,616.00 | 381,645,087 | 8.29 |
| 4 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 178,403,674 | 13,357.48 | 238,302,334 | 11,519.00 | 205,503,192 | 4.46 |

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

(注2)簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3)投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 97.02 |
| 合計 | 97.02 |

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 口数 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率(%) |
|----|-----------------------------|-----------|----|---------------|-----------|---------------|-----------|---------------|---------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | 単価(円) | 金額(円) | |
| 1 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 4,181,323,755 | 11,127.81 | 4,652,897,467 | 11,309.00 | 4,728,659,034 | 44.46 |
| 2 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 3,029,711,771 | 12,084.55 | 3,661,269,535 | 10,171.00 | 3,081,519,842 | 28.97 |
| 3 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 1,148,708,135 | 11,455.26 | 1,315,874,913 | 11,616.00 | 1,334,339,369 | 12.54 |
| 4 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 1,020,871,739 | 13,350.82 | 1,362,947,818 | 11,519.00 | 1,175,942,156 | 11.06 |

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

(注2)簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3)投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 97.03 |
| 合計 | 97.03 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 口数 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率 (%) |
|----|-----------------------------|-----------|----|---------------|-----------|---------------|-----------|---------------|----------|
| | | | | | 単価 (円) | 金額 (円) | 単価 (円) | 金額 (円) | |
| 1 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 3,142,612,735 | 12,111.20 | 3,806,082,230 | 10,171.00 | 3,196,351,412 | 38.96 |
| 2 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 1,674,634,173 | 11,127.45 | 1,863,440,681 | 11,309.00 | 1,893,843,786 | 23.08 |
| 3 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 1,275,100,631 | 13,319.60 | 1,698,383,238 | 11,519.00 | 1,468,788,416 | 17.90 |
| 4 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 1,207,609,446 | 11,451.31 | 1,382,870,559 | 11,616.00 | 1,402,759,132 | 17.10 |

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

(注2)簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3)投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|-----------|----------|
| 親投資信託受益証券 | 97.04 |
| 合計 | 97.04 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考)マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 業種 | 株数又は券面総額 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率 (%) |
|----|--------|----|----|-------|-----------|----------|----------------|----------|---------------|----------|
| | | | | | | 単価 (円) | 金額 (円) | 単価 (円) | 金額 (円) | |
| 1 | トヨタ自動車 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 3,008,800 | 3,442.41 | 10,357,517,300 | 2,734.00 | 8,226,059,200 | 3.28 |

| | | | | | | | | | | |
|----|-------------------|----|----|------------|------------|------------|---------------|------------|---------------|------|
| 2 | 三菱UFJ フィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 17,497,200 | 436.95 | 7,645,406,116 | 344.00 | 6,019,036,800 | 2.40 |
| 3 | キヤノン | 株式 | 日本 | 電気機器 | 1,454,800 | 3,901.15 | 5,675,398,416 | 3,595.00 | 5,230,006,000 | 2.09 |
| 4 | 本田技研 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 1,975,800 | 3,432.37 | 6,781,680,200 | 2,474.00 | 4,888,129,200 | 1.95 |
| 5 | 三井住友フィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1,762,100 | 2,850.37 | 5,022,639,127 | 2,255.00 | 3,973,535,500 | 1.59 |
| 6 | 武田薬品 | 株式 | 日本 | 医薬品 | 918,800 | 3,983.77 | 3,660,287,814 | 3,695.00 | 3,394,966,000 | 1.35 |
| 7 | みずほフィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 28,762,200 | 158.84 | 4,568,679,539 | 116.00 | 3,336,415,200 | 1.33 |
| 8 | 三菱商事 | 株式 | 日本 | 卸売業 | 1,803,700 | 2,328.49 | 4,199,905,486 | 1,827.00 | 3,295,359,900 | 1.31 |
| 9 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 868,100 | 3,841.05 | 3,334,411,490 | 3,555.00 | 3,086,095,500 | 1.23 |
| 10 | ファナック | 株式 | 日本 | 電気機器 | 243,800 | 12,388.02 | 3,020,198,960 | 12,620.00 | 3,076,756,000 | 1.23 |
| 11 | ソフトバンク | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1,047,100 | 2,972.85 | 3,112,871,858 | 2,527.00 | 2,646,021,700 | 1.06 |
| 12 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 19,046 | 148,482.63 | 2,828,000,219 | 138,600.00 | 2,639,775,600 | 1.05 |
| 13 | 三井物産 | 株式 | 日本 | 卸売業 | 1,995,300 | 1,474.20 | 2,941,476,659 | 1,302.00 | 2,597,880,600 | 1.04 |
| 14 | 小松製作所 | 株式 | 日本 | 機械 | 1,161,900 | 2,547.45 | 2,959,880,765 | 2,025.00 | 2,352,847,500 | 0.94 |
| 15 | パナソニック | 株式 | 日本 | 電気機器 | 2,727,000 | 1,063.99 | 2,901,497,839 | 809.00 | 2,206,143,000 | 0.88 |
| 16 | ソニー | 株式 | 日本 | 電気機器 | 1,314,900 | 2,796.52 | 3,677,144,088 | 1,665.00 | 2,189,308,500 | 0.87 |
| 17 | 日立 | 株式 | 日本 | 電気機器 | 5,258,000 | 488.52 | 2,568,655,320 | 413.00 | 2,171,554,000 | 0.87 |
| 18 | 日産自動車 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 2,958,400 | 849.02 | 2,511,728,004 | 697.00 | 2,062,004,800 | 0.82 |
| 19 | KDDI | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 3,587 | 485,934.40 | 1,743,046,706 | 570,000.00 | 2,044,590,000 | 0.82 |
| 20 | 三菱地所 | 株式 | 日本 | 不動産業 | 1,618,000 | 1,572.35 | 2,544,062,080 | 1,254.00 | 2,028,972,000 | 0.81 |
| 21 | セブン&アイ・HLDGS | 株式 | 日本 | 小売業 | 966,800 | 2,151.92 | 2,080,478,728 | 2,018.00 | 1,951,002,400 | 0.78 |
| 22 | 東日本旅客鉄道 | 株式 | 日本 | 陸運業 | 407,200 | 5,233.19 | 2,130,953,963 | 4,575.00 | 1,862,940,000 | 0.74 |
| 23 | 東京海上HD | 株式 | 日本 | 保険業 | 877,500 | 2,465.91 | 2,163,836,240 | 2,073.00 | 1,819,057,500 | 0.73 |
| 24 | 任天堂 | 株式 | 日本 | その他製品 | 133,900 | 22,370.30 | 2,995,383,376 | 13,400.00 | 1,794,260,000 | 0.72 |
| 25 | 日本たばこ産業 | 株式 | 日本 | 食料品 | 5,454 | 330,454.19 | 1,802,297,161 | 328,500.00 | 1,791,639,000 | 0.71 |
| 26 | 三菱電機 | 株式 | 日本 | 電気機器 | 2,342,000 | 991.51 | 2,322,127,300 | 760.00 | 1,779,920,000 | 0.71 |
| 27 | 信越化学 | 株式 | 日本 | 化学 | 408,400 | 4,733.98 | 1,933,357,291 | 3,850.00 | 1,572,340,000 | 0.63 |
| 28 | アステラス製薬 | 株式 | 日本 | 医薬品 | 544,500 | 3,214.28 | 1,750,172,858 | 2,878.00 | 1,567,071,000 | 0.63 |
| 29 | 野村ホールディングス | 株式 | 日本 | 証券、商品先物取引業 | 4,867,000 | 505.40 | 2,459,787,862 | 321.00 | 1,562,307,000 | 0.62 |
| 30 | 東芝 | 株式 | 日本 | 電気機器 | 4,622,000 | 505.36 | 2,335,766,760 | 331.00 | 1,529,882,000 | 0.61 |

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

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----------|------------|----------|
| 株式 | 電気機器 | 13.50 |
| | 輸送用機器 | 9.29 |
| | 銀行業 | 8.97 |
| | 情報・通信業 | 6.09 |
| | 化学 | 5.87 |
| | 卸売業 | 5.38 |
| | 機械 | 4.93 |
| | 医薬品 | 4.91 |
| | 小売業 | 3.96 |
| | 陸運業 | 3.77 |
| | 食料品 | 3.30 |
| | 電気・ガス業 | 3.25 |
| | 保険業 | 2.37 |
| | 建設業 | 2.34 |
| | 不動産業 | 2.28 |
| | 鉄鋼 | 2.04 |
| | サービス業 | 1.87 |
| | その他製品 | 1.72 |
| | 精密機器 | 1.43 |
| | 非鉄金属 | 1.31 |
| | ガラス・土石製品 | 1.19 |
| | 証券、商品先物取引業 | 1.18 |
| | 繊維製品 | 0.96 |
| | 石油・石炭製品 | 0.88 |
| | その他金融業 | 0.77 |
| | 金属製品 | 0.73 |
| | ゴム製品 | 0.72 |
| | 鉱業 | 0.63 |
| | 海運業 | 0.42 |
| | パルプ・紙 | 0.42 |
| 空運業 | 0.32 | |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.23 | |
| 水産・農林業 | 0.11 | |
| 合計 | | 97.11 |

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

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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 業種 | 株数又は 券面総額 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資 比率 (%) |
|----|------------------------------------|----|-----------------|--|--------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------------|
| | | | | | | 単価 (円) | 金額 (円) | 単価 (円) | 金額 (円) | |
| 1 | EXXON MOBIL CO RP | 株式 | 米国 | 石油・ ガス・ 消耗燃 料 | 783,958 | 6,472.66 | 5,074,290,354 | 5,671.85 | 4,446,494,848 | 1.70 |
| 2 | APPLE INC | 株式 | 米国 | コンピ ュータ ・周辺 機器 | 147,583 | 27,693.24 | 4,087,051,321 | 29,927.83 | 4,416,839,319 | 1.69 |
| 3 | NESTLE SA-REGI STERED | 株式 | スイ ス | 食品 | 549,023 | 4,839.26 | 2,656,865,466 | 4,638.70 | 2,546,751,727 | 0.97 |
| 4 | INTL BUSINESS MACHINES CORP | 株式 | 米国 | 情報技 術サー ビス | 191,754 | 12,559.81 | 2,408,392,925 | 13,229.98 | 2,536,900,818 | 0.97 |
| 5 | MICROSOFT CORP | 株式 | 米国 | ソフト ウェア | 1,200,454 | 2,083.21 | 2,500,802,719 | 2,012.89 | 2,416,382,092 | 0.92 |
| 6 | CHEVRON CORP | 株式 | 米国 | 石油・ ガス・ 消耗燃 料 | 318,104 | 7,461.00 | 2,373,374,217 | 7,551.22 | 2,402,072,014 | 0.92 |
| 7 | PROCTER & GAMB LE CO | 株式 | 米国 | 家庭用 品 | 453,371 | 4,942.29 | 2,240,692,670 | 4,872.99 | 2,209,272,349 | 0.84 |
| 8 | JOHNSON & JOHN SON | 株式 | 米国 | 医薬品 | 433,272 | 4,679.01 | 2,027,284,486 | 5,047.19 | 2,186,806,019 | 0.83 |
| 9 | AT&T INC | 株式 | 米国 | 各種電 気通信 サービ ス | 943,553 | 2,190.53 | 2,066,881,207 | 2,273.04 | 2,144,732,579 | 0.82 |
| 10 | GENERAL ELECTR IC CO | 株式 | 米国 | コング ロマリ ット | 1,724,090 | 1,614.34 | 2,783,265,522 | 1,237.05 | 2,132,783,466 | 0.81 |
| 11 | HSBC HOLDINGS PLC | 株式 | 英国 | 商業銀 行 | 2,808,944 | 873.79 | 2,454,417,106 | 657.07 | 1,845,672,328 | 0.70 |
| 12 | PFIZER INC | 株式 | 米国 | 医薬品 | 1,244,648 | 1,460.87 | 1,818,268,658 | 1,449.62 | 1,804,264,891 | 0.69 |
| 13 | JPMORGAN CHASE & CO | 株式 | 米国 | 各種金 融サー ビス | 625,969 | 3,531.32 | 2,210,496,054 | 2,843.98 | 1,780,246,071 | 0.68 |
| 14 | COCA-COLA CO/T HE | 株式 | 米国 | 飲料 | 324,485 | 4,867.00 | 1,579,268,883 | 5,361.06 | 1,739,582,386 | 0.66 |
| 15 | VODAFONE GROUP PLC | 株式 | 英国 | 無線通 信サー ビス | 8,360,176 | 223.64 | 1,869,670,279 | 203.42 | 1,700,606,101 | 0.65 |
| 16 | BHP BILLITON L TD | 株式 | オース トラリ ア | 金属・ 鉱業 | 524,057 | 3,814.79 | 1,999,168,719 | 3,221.98 | 1,688,500,125 | 0.64 |
| 17 | NOVARTIS AG-RE G SHS | 株式 | スイ ス | 医薬品 | 380,734 | 5,000.93 | 1,904,023,173 | 4,358.45 | 1,659,408,199 | 0.63 |
| 18 | GOOGLE INC | 株式 | 米国 | インタ ーネット ソフト ウェア・ サービ ス | 39,800 | 47,700.75 | 1,898,489,778 | 41,493.32 | 1,651,434,056 | 0.63 |
| 19 | WELLS FARGO & CO | 株式 | 米国 | 商業銀 行 | 789,613 | 2,560.19 | 2,021,560,644 | 1,949.20 | 1,539,110,501 | 0.59 |
| 20 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I | 株式 | 米国 | タバコ | 281,033 | 4,625.03 | 1,299,787,217 | 5,381.01 | 1,512,241,046 | 0.58 |
| 21 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 株式 | スイ ス | 医薬品 | 114,834 | 13,180.22 | 1,513,537,337 | 13,019.10 | 1,495,034,985 | 0.57 |

| | | | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|----|------|--------------|-----------|----------|---------------|----------|---------------|------|
| 22 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 株式 | 英国 | 石油・ガス・消耗燃料 | 588,155 | 2,638.46 | 1,551,825,752 | 2,509.86 | 1,476,186,120 | 0.56 |
| 23 | BP PLC | 株式 | 英国 | 石油・ガス・消耗燃料 | 2,962,956 | 596.70 | 1,767,981,699 | 497.72 | 1,474,709,660 | 0.56 |
| 24 | ORACLE CORP | 株式 | 米国 | ソフトウェア | 636,480 | 2,534.39 | 1,613,087,453 | 2,137.98 | 1,360,779,219 | 0.52 |
| 25 | INTEL CORP | 株式 | 米国 | 半導体・半導体製造装置 | 847,503 | 1,655.71 | 1,403,215,936 | 1,553.22 | 1,316,356,576 | 0.50 |
| 26 | GLAXOSMITHKLINE PLC | 株式 | 英国 | 医薬品 | 808,511 | 1,481.56 | 1,197,857,145 | 1,610.44 | 1,302,059,020 | 0.50 |
| 27 | TOTAL SA | 株式 | フランス | 石油・ガス・消耗燃料 | 348,269 | 4,693.17 | 1,634,484,139 | 3,671.14 | 1,278,545,510 | 0.49 |
| 28 | MERCK & CO. INC. | 株式 | 米国 | 医薬品 | 506,584 | 2,518.23 | 1,275,693,838 | 2,509.40 | 1,271,220,876 | 0.49 |
| 29 | SCHLUMBERGER LTD | 株式 | オランダ | エネルギー設備・サービス | 213,839 | 7,044.86 | 1,506,465,756 | 5,934.30 | 1,268,985,676 | 0.48 |
| 30 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 株式 | 米国 | 各種電気通信サービス | 442,585 | 2,754.16 | 1,218,950,712 | 2,786.43 | 1,233,231,856 | 0.47 |

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

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|----------------|----------|
| 株式 | 石油・ガス・消耗燃料 | 10.25 |
| | 商業銀行 | 7.20 |
| | 医薬品 | 6.34 |
| | 金属・鉱業 | 4.42 |
| | 保険 | 3.88 |
| | 各種電気通信サービス | 3.27 |
| | 食品 | 2.92 |
| | 化学 | 2.88 |
| | コンピュータ・周辺機器 | 2.44 |
| | ソフトウェア | 2.38 |
| | メディア | 2.36 |
| | 食品・生活必需品小売り | 2.28 |
| | 飲料 | 2.26 |
| | 各種金融サービス | 2.23 |
| | 情報技術サービス | 2.12 |
| | コングロマリット | 2.01 |
| | 電力 | 1.92 |
| | 資本市場 | 1.86 |
| | 機械 | 1.75 |
| | 航空宇宙・防衛 | 1.71 |
| | エネルギー設備・サービス | 1.68 |
| | ホテル・レストラン・レジャー | 1.60 |

| | |
|-------------------------|-------|
| タバコ | 1.60 |
| 半導体・半導体製造装置 | 1.53 |
| 家庭用品 | 1.49 |
| 総合公益事業 | 1.42 |
| 通信機器 | 1.41 |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 1.32 |
| 専門小売り | 1.31 |
| ヘルスケア機器・用品 | 1.27 |
| 無線通信サービス | 1.06 |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | 0.98 |
| インターネットソフトウェア・サービス | 0.96 |
| 自動車 | 0.94 |
| バイオテクノロジー | 0.85 |
| 陸運・鉄道 | 0.77 |
| 電気設備 | 0.77 |
| 不動産管理・開発 | 0.64 |
| インターネット販売・カタログ販売 | 0.60 |
| 複合小売り | 0.56 |
| 航空貨物・物流サービス | 0.54 |
| 建設・土木 | 0.46 |
| 消費者金融 | 0.46 |
| 商業サービス・用品 | 0.45 |
| 自動車部品 | 0.36 |
| 専門サービス | 0.33 |
| ライフサイエンス・ツール/サービス | 0.33 |
| 電子装置・機器・部品 | 0.32 |
| 建設資材 | 0.29 |
| パーソナル用品 | 0.25 |
| 商社・流通業 | 0.20 |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.20 |
| 運送インフラ | 0.19 |
| 家庭用耐久財 | 0.18 |
| 紙製品・林産品 | 0.17 |
| 建設関連製品 | 0.17 |
| ガス | 0.16 |
| 容器・包装 | 0.16 |
| 海運業 | 0.12 |
| 販売 | 0.10 |
| 旅客航空輸送業 | 0.10 |
| 水道 | 0.08 |
| レジャー用品 | 0.07 |
| 事務用電子機器 | 0.06 |
| 各種消費者サービス | 0.06 |
| 貯蓄・抵当・不動産金融 | 0.06 |
| 不動産投資信託 | 0.05 |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.04 |
| 株式 計 | 95.23 |
| 投資信託受益証券 | 0.32 |
| 投資証券 | 1.45 |
| 合計 | 97.00 |

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

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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 株数又は 券面総額 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 利率 (%) | 償還 期限 | 投資 比率 (%) |
|----|-------------------------|----------|----|---------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|----------------|-----------------|
| | | | | | 単価 (円) | 金額 (円) | 単価 (円) | 金額 (円) | | | |
| 1 | 313回利付 国庫債券 (10年) | 国債 証券 | 日本 | 7,000,000,000 | 101.15 | 7,080,330,000 | 102.75 | 7,192,220,000 | 1.30 | 2021/ 3/20 | 1.73 |
| 2 | 312回利付 国庫債券 (10年) | 国債 証券 | 日本 | 6,200,000,000 | 99.48 | 6,168,022,000 | 102.13 | 6,332,308,000 | 1.20 | 2020/ 12/20 | 1.52 |
| 3 | 93回利付 国庫債券(5 年) | 国債 証券 | 日本 | 5,800,000,000 | 99.87 | 5,792,410,000 | 100.85 | 5,849,126,000 | 0.50 | 2015/ 12/20 | 1.41 |
| 4 | 310回利付 国庫債券 (10年) | 国債 証券 | 日本 | 5,500,000,000 | 97.56 | 5,366,010,000 | 100.67 | 5,536,685,000 | 1.00 | 2020/ 9/20 | 1.33 |
| 5 | 306回利付 国庫債券 (10年) | 国債 証券 | 日本 | 5,200,000,000 | 101.56 | 5,280,860,000 | 104.63 | 5,440,604,000 | 1.40 | 2020/ 3/20 | 1.31 |
| 6 | 293回利付 国庫債券 (10年) | 国債 証券 | 日本 | 5,000,000,000 | 105.90 | 5,295,100,000 | 108.25 | 5,412,550,000 | 1.80 | 2018/ 6/20 | 1.30 |
| 7 | 315回利付 国庫債券 (10年) | 国債 証券 | 日本 | 5,000,000,000 | 101.27 | 5,063,360,000 | 101.56 | 5,077,800,000 | 1.20 | 2021/ 6/20 | 1.22 |
| 8 | 70回利付 国庫債券(5 年) | 国債 証券 | 日本 | 4,900,000,000 | 101.14 | 4,955,860,000 | 101.04 | 4,951,107,000 | 0.80 | 2013/ 3/20 | 1.19 |
| 9 | 285回利付 国庫債券 (10年) | 国債 証券 | 日本 | 4,400,000,000 | 105.76 | 4,653,499,000 | 107.04 | 4,709,848,000 | 1.70 | 2017/ 3/20 | 1.13 |
| 10 | 75回利付 国庫債券(5 年) | 国債 証券 | 日本 | 4,600,000,000 | 102.03 | 4,693,334,000 | 101.96 | 4,690,344,000 | 1.10 | 2013/ 9/20 | 1.13 |
| 11 | 289回利付 国庫債券 (10年) | 国債 証券 | 日本 | 4,400,000,000 | 104.24 | 4,586,397,000 | 106.20 | 4,672,580,000 | 1.50 | 2017/ 12/20 | 1.12 |
| 12 | 81回利付 国庫債券(5 年) | 国債 証券 | 日本 | 4,500,000,000 | 101.28 | 4,557,600,000 | 101.63 | 4,573,305,000 | 0.80 | 2014/ 3/20 | 1.10 |
| 13 | 88回利付 国庫債券(5 年) | 国債 証券 | 日本 | 4,500,000,000 | 99.96 | 4,498,155,000 | 100.93 | 4,541,805,000 | 0.50 | 2015/ 3/20 | 1.09 |
| 14 | 89回利付 国庫債券(5 年) | 国債 証券 | 日本 | 4,500,000,000 | 99.47 | 4,476,220,000 | 100.54 | 4,524,480,000 | 0.40 | 2015/ 6/20 | 1.09 |
| 15 | 97回利付 国庫債券(5 年) | 国債 証券 | 日本 | 4,500,000,000 | 100.24 | 4,510,605,000 | 100.28 | 4,512,690,000 | 0.40 | 2016/ 6/20 | 1.08 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|--------------------------|----------|----|---------------|--------|---------------|--------|---------------|------|----------------|------|
| 16 | 83回 利付 国庫債券（5 年） | 国債 証券 | 日本 | 4,400,000,000 | 101.60 | 4,470,224,000 | 102.04 | 4,489,760,000 | 0.90 | 2014/ 6/20 | 1.08 |
| 17 | 305回 利 付国庫債券 （10年） | 国債 証券 | 日本 | 4,300,000,000 | 100.96 | 4,341,280,000 | 104.05 | 4,474,107,000 | 1.30 | 2019/ 12/20 | 1.07 |
| 18 | 290回 利 付国庫債券 （10年） | 国債 証券 | 日本 | 4,200,000,000 | 103.45 | 4,345,032,000 | 105.60 | 4,435,032,000 | 1.40 | 2018/ 3/20 | 1.07 |
| 19 | 72回 利付 国庫債券（5 年） | 国債 証券 | 日本 | 4,200,000,000 | 102.81 | 4,317,920,000 | 102.45 | 4,302,690,000 | 1.50 | 2013/ 6/20 | 1.03 |
| 20 | 299回 利 付国庫債券 （10年） | 国債 証券 | 日本 | 4,100,000,000 | 101.82 | 4,174,800,000 | 104.71 | 4,292,987,000 | 1.30 | 2019/ 3/20 | 1.03 |
| 21 | 296回 利 付国庫債券 （10年） | 国債 証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 103.56 | 4,142,520,000 | 106.26 | 4,250,360,000 | 1.50 | 2018/ 9/20 | 1.02 |
| 22 | 87回 利付 国庫債券（5 年） | 国債 証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 100.05 | 4,002,120,000 | 100.95 | 4,037,880,000 | 0.50 | 2014/ 12/20 | 0.97 |
| 23 | 301回 利 付国庫債券 （10年） | 国債 証券 | 日本 | 3,800,000,000 | 103.02 | 3,914,570,000 | 106.03 | 4,028,988,000 | 1.50 | 2019/ 6/20 | 0.97 |
| 24 | 92回 利付 国庫債券（5 年） | 国債 証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 98.81 | 3,952,520,000 | 100.08 | 4,003,160,000 | 0.30 | 2015/ 9/20 | 0.96 |
| 25 | 286回 利 付国庫債券 （10年） | 国債 証券 | 日本 | 3,700,000,000 | 106.26 | 3,931,435,000 | 107.77 | 3,987,416,000 | 1.80 | 2017/ 6/20 | 0.96 |
| 26 | 288回 利 付国庫債券 （10年） | 国債 証券 | 日本 | 3,600,000,000 | 105.57 | 3,800,412,000 | 107.32 | 3,863,484,000 | 1.70 | 2017/ 9/20 | 0.93 |
| 27 | 266回 利 付国庫債券 （10年） | 国債 証券 | 日本 | 3,700,000,000 | 103.47 | 3,828,279,000 | 103.91 | 3,844,485,000 | 1.40 | 2014/ 12/20 | 0.92 |
| 28 | 69回 利付 国庫債券（5 年） | 国債 証券 | 日本 | 3,800,000,000 | 101.24 | 3,846,930,000 | 101.01 | 3,838,418,000 | 0.90 | 2012/ 12/20 | 0.92 |
| 29 | 78回 利付 国庫債券（5 年） | 国債 証券 | 日本 | 3,500,000,000 | 101.62 | 3,556,540,000 | 101.72 | 3,560,305,000 | 0.90 | 2013/ 12/20 | 0.86 |
| 30 | 85回 利付 国庫債券（5 年） | 国債 証券 | 日本 | 3,500,000,000 | 100.94 | 3,532,935,000 | 101.56 | 3,554,495,000 | 0.70 | 2014/ 9/20 | 0.85 |

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

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|-------|---------|
| 国債証券 | 76.15 |
| 地方債証券 | 6.80 |
| 特殊債券 | 9.05 |
| 社債券 | 7.29 |
| 合計 | 99.30 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 株数又は 券面総額 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 利率 (%) | 償還 期限 | 投資 比率 (%) |
|----|---------------------------------|----------|----------|---------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|----------------|-----------------|
| | | | | | 単価 (円) | 金額 (円) | 単価 (円) | 金額 (円) | | | |
| 1 | US T N/B 4.0 11/15/12 | 国債 証券 | 米国 | 3,376,560,000 | 105.79 | 3,572,029,058 | 104.70 | 3,535,089,492 | 4.00 | 2012/ 11/15 | 0.94 |
| 2 | US T N/B 4.0 02/15/14 | 国債 証券 | 米国 | 3,069,600,000 | 108.13 | 3,319,005,000 | 109.18 | 3,351,358,584 | 4.00 | 2014/ 2/15 | 0.89 |
| 3 | US T N/B 4.25 11/15/13 | 国債 証券 | 米国 | 3,069,600,000 | 108.55 | 3,331,928,016 | 108.89 | 3,342,487,440 | 4.25 | 2013/ 11/15 | 0.89 |
| 4 | US T N/B 1.0 07/15/13 | 国債 証券 | 米国 | 3,069,600,000 | 101.13 | 3,104,174,693 | 101.52 | 3,116,104,440 | 1.00 | 2013/ 7/15 | 0.83 |
| 5 | US T N/B 4.75 05/15/14 | 国債 証券 | 米国 | 2,685,900,000 | 110.70 | 2,973,157,005 | 112.16 | 3,012,398,004 | 4.75 | 2014/ 5/15 | 0.80 |
| 6 | US T N/B 4.25 08/15/13 | 国債 証券 | 米国 | 2,685,900,000 | 107.98 | 2,900,342,256 | 107.91 | 2,898,462,126 | 4.25 | 2013/ 8/15 | 0.77 |
| 7 | US T N/B 1.125 12/15/12 | 国債 証券 | 米国 | 2,685,900,000 | 100.75 | 2,706,044,250 | 101.27 | 2,719,984,071 | 1.13 | 2012/ 12/15 | 0.72 |
| 8 | US T N/B 3.5 05/31/13 | 国債 証券 | 米国 | 2,455,680,000 | 105.84 | 2,599,067,680 | 105.77 | 2,597,348,179 | 3.50 | 2013/ 5/31 | 0.69 |
| 9 | US T N/B 3.875 02/15/13 | 国債 証券 | 米国 | 2,455,680,000 | 106.23 | 2,608,767,091 | 105.41 | 2,588,434,061 | 3.88 | 2013/ 2/15 | 0.69 |
| 10 | US T N/B 4.25 11/15/14 | 国債 証券 | 米国 | 2,302,200,000 | 109.63 | 2,523,947,904 | 112.27 | 2,584,749,006 | 4.25 | 2014/ 11/15 | 0.69 |
| 11 | US T N/B 1.375 09/15/12 | 国債 証券 | 米国 | 2,532,420,000 | 101.27 | 2,564,455,113 | 101.30 | 2,565,240,163 | 1.38 | 2012/ 9/15 | 0.68 |
| 12 | US T N/B 2.625 06/30/14 | 国債 証券 | 米国 | 2,302,200,000 | 103.81 | 2,389,959,864 | 106.55 | 2,452,994,100 | 2.63 | 2014/ 6/30 | 0.65 |
| 13 | US T N/B 4.25 08/15/14 | 国債 証券 | 米国 | 2,148,720,000 | 109.34 | 2,349,303,012 | 111.53 | 2,396,488,903 | 4.25 | 2014/ 8/15 | 0.64 |
| 14 | US T N/B 3.625 05/15/13 | 国債 証券 | 米国 | 2,225,460,000 | 106.11 | 2,361,413,351 | 105.88 | 2,356,205,775 | 3.63 | 2013/ 5/15 | 0.63 |
| 15 | FRANCE OAT 4.0 04/25/13 | 国債 証券 | フラン ス | 2,214,200,000 | 104.83 | 2,321,075,891 | 104.97 | 2,324,245,740 | 4.00 | 2013/ 4/25 | 0.62 |
| 16 | US T N/B 0.5 10/15/13 | 国債 証券 | 米国 | 2,302,200,000 | 98.41 | 2,265,687,108 | 100.60 | 2,316,036,222 | 0.50 | 2013/ 10/15 | 0.62 |
| 17 | DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14 | 国債 証券 | ドイ ツ | 2,103,490,000 | 107.72 | 2,265,879,428 | 109.55 | 2,304,268,121 | 4.25 | 2014/ 7/4 | 0.61 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|---------------------------------|----------|----------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|------|----------------|------|
| 18 | US T N/B 2.375 09/30/14 | 国債 証券 | 米国 | 2,148,720,000 | 102.64 | 2,205,532,157 | 106.17 | 2,281,317,511 | 2.38 | 2014/ 9/30 | 0.61 |
| 19 | FRANCE OAT 4.0 10/25/13 | 国債 証券 | フラン ス | 2,103,490,000 | 105.39 | 2,216,931,880 | 105.95 | 2,228,647,655 | 4.00 | 2013/ 10/25 | 0.59 |
| 20 | US T N/B 1.375 03/15/13 | 国債 証券 | 米国 | 2,148,720,000 | 101.14 | 2,173,129,459 | 101.84 | 2,188,234,961 | 1.38 | 2013/ 3/15 | 0.58 |
| 21 | DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14 | 国債 証券 | ドイ ツ | 1,992,780,000 | 106.94 | 2,131,078,932 | 108.30 | 2,158,081,101 | 4.25 | 2014/ 1/4 | 0.57 |
| 22 | DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15 | 国債 証券 | ドイ ツ | 1,992,780,000 | 104.61 | 2,084,547,519 | 108.25 | 2,157,084,711 | 3.25 | 2015/ 7/4 | 0.57 |
| 23 | ITALY BTPS 4.25 08/01/14 | 国債 証券 | イタ リア | 2,103,490,000 | 102.91 | 2,164,701,559 | 101.13 | 2,127,259,437 | 4.25 | 2014/ 8/1 | 0.57 |
| 24 | US T N/B 3.625 02/15/20 | 国債 証券 | 米国 | 1,841,760,000 | 101.66 | 1,872,259,546 | 114.09 | 2,101,171,896 | 3.63 | 2020/ 2/15 | 0.56 |
| 25 | US T N/B 3.625 02/15/21 | 国債 証券 | 米国 | 1,841,760,000 | 102.06 | 1,879,682,591 | 113.22 | 2,085,203,837 | 3.63 | 2021/ 2/15 | 0.55 |
| 26 | FRANCE OAT 4.0 10/25/14 | 国債 証券 | フラン ス | 1,882,070,000 | 106.30 | 2,000,697,979 | 107.72 | 2,027,365,804 | 4.00 | 2014/ 10/25 | 0.54 |
| 27 | US T N/B 2.125 11/30/14 | 国債 証券 | 米国 | 1,918,500,000 | 101.55 | 1,948,160,010 | 105.55 | 2,024,900,010 | 2.13 | 2014/ 11/30 | 0.54 |
| 28 | US T N/B 2.625 08/15/20 | 国債 証券 | 米国 | 1,918,500,000 | 92.67 | 1,777,893,135 | 105.26 | 2,019,355,545 | 2.63 | 2020/ 8/15 | 0.54 |
| 29 | ITALY BTPS 3.75 12/15/13 | 国債 証券 | イタ リア | 1,992,780,000 | 101.69 | 2,026,497,838 | 100.19 | 1,996,566,282 | 3.75 | 2013/ 12/15 | 0.53 |
| 30 | US T N/B 1.75 03/31/14 | 国債 証券 | 米国 | 1,918,500,000 | 102.90 | 1,974,047,762 | 103.86 | 1,992,611,655 | 1.75 | 2014/ 3/31 | 0.53 |

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

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.77 |
| 合計 | 97.77 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成23年8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。

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

| | 純資産総額 (百万円) | | 1口当たり純資産額 (円) | |
|---------------------|----------------|-------|------------------|--------|
| | 分配落 | 分配付 | 分配落 | 分配付 |
| 第1期末 (平成16年2月25日現在) | 150 | 150 | 1.0666 | 1.0666 |
| 第2期末 (平成17年2月25日現在) | 969 | 969 | 1.1019 | 1.1019 |
| 第3期末 (平成18年2月27日現在) | 2,058 | 2,058 | 1.1990 | 1.1990 |
| 第4期末 (平成19年2月26日現在) | 2,669 | 2,669 | 1.2585 | 1.2585 |
| 第5期末 (平成20年2月25日現在) | 3,305 | 3,305 | 1.2076 | 1.2076 |
| 第6期末 (平成21年2月25日現在) | 3,259 | 3,259 | 1.0599 | 1.0599 |
| 第7期末 (平成22年2月25日現在) | 3,884 | 3,884 | 1.1365 | 1.1365 |
| 第8期末 (平成23年2月25日現在) | 4,419 | 4,419 | 1.1651 | 1.1651 |
| 平成22年8月末 | 4,136 | | 1.1303 | |
| 9月末 | 4,221 | | 1.1464 | |
| 10月末 | 4,225 | | 1.1360 | |
| 11月末 | 4,266 | | 1.1419 | |
| 12月末 | 4,335 | | 1.1547 | |
| 平成23年1月末 | 4,388 | | 1.1565 | |
| 2月末 | 4,424 | | 1.1672 | |
| 3月末 | 4,482 | | 1.1546 | |
| 4月末 | 4,522 | | 1.1558 | |
| 5月末 | 4,506 | | 1.1513 | |
| 6月末 | 4,586 | | 1.1547 | |
| 7月末 | 4,663 | | 1.1501 | |
| 8月末 | 4,604 | | 1.1304 | |

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型

| | 純資産総額 (百万円) | | 1口当たり純資産額 (円) | |
|---------------------|----------------|--------|------------------|--------|
| | 分配落 | 分配付 | 分配落 | 分配付 |
| 第1期末 (平成16年2月25日現在) | 184 | 184 | 1.1111 | 1.1111 |
| 第2期末 (平成17年2月25日現在) | 1,668 | 1,668 | 1.1715 | 1.1715 |
| 第3期末 (平成18年2月27日現在) | 5,022 | 5,022 | 1.3523 | 1.3523 |
| 第4期末 (平成19年2月26日現在) | 6,979 | 6,979 | 1.4627 | 1.4627 |
| 第5期末 (平成20年2月25日現在) | 8,199 | 8,199 | 1.3419 | 1.3419 |
| 第6期末 (平成21年2月25日現在) | 7,395 | 7,395 | 1.0433 | 1.0433 |
| 第7期末 (平成22年2月25日現在) | 9,529 | 9,529 | 1.1659 | 1.1659 |
| 第8期末 (平成23年2月25日現在) | 10,826 | 10,826 | 1.2065 | 1.2065 |
| 平成22年8月末 | 9,717 | | 1.1316 | |
| 9月末 | 10,060 | | 1.1604 | |
| 10月末 | 9,992 | | 1.1465 | |
| 11月末 | 10,165 | | 1.1646 | |
| 12月末 | 10,447 | | 1.1827 | |
| 平成23年1月末 | 10,674 | | 1.1906 | |
| 2月末 | 10,859 | | 1.2104 | |
| 3月末 | 10,844 | | 1.1911 | |
| 4月末 | 10,941 | | 1.1917 | |
| 5月末 | 10,854 | | 1.1799 | |
| 6月末 | 10,999 | | 1.1825 | |
| 7月末 | 10,951 | | 1.1705 | |
| 8月末 | 10,636 | | 1.1317 | |

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

| | 純資産総額 (百万円) | | 1口当たり純資産額 (円) | |
|--------------------|----------------|-------|------------------|--------|
| | 分配落 | 分配付 | 分配落 | 分配付 |
| 第1期末（平成16年2月25日現在） | 130 | 130 | 1.1555 | 1.1555 |
| 第2期末（平成17年2月25日現在） | 1,197 | 1,197 | 1.2420 | 1.2420 |
| 第3期末（平成18年2月27日現在） | 4,156 | 4,156 | 1.5136 | 1.5136 |
| 第4期末（平成19年2月26日現在） | 6,033 | 6,033 | 1.6848 | 1.6848 |
| 第5期末（平成20年2月25日現在） | 7,103 | 7,103 | 1.4810 | 1.4810 |
| 第6期末（平成21年2月25日現在） | 5,656 | 5,656 | 1.0219 | 1.0219 |
| 第7期末（平成22年2月25日現在） | 7,667 | 7,667 | 1.1890 | 1.1890 |
| 第8期末（平成23年2月25日現在） | 8,673 | 8,673 | 1.2395 | 1.2395 |
| 平成22年8月末 | 7,596 | | 1.1262 | |
| 9月末 | 7,929 | | 1.1677 | |
| 10月末 | 7,853 | | 1.1503 | |
| 11月末 | 8,086 | | 1.1799 | |
| 12月末 | 8,316 | | 1.2027 | |
| 平成23年1月末 | 8,522 | | 1.2166 | |
| 2月末 | 8,703 | | 1.2450 | |
| 3月末 | 8,626 | | 1.2200 | |
| 4月末 | 8,701 | | 1.2204 | |
| 5月末 | 8,578 | | 1.2015 | |
| 6月末 | 8,676 | | 1.2031 | |
| 7月末 | 8,571 | | 1.1837 | |
| 8月末 | 8,204 | | 1.1266 | |

【分配の推移】

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型

| | 1口当たりの分配額（円） |
|-----|--------------|
| 第1期 | - |
| 第2期 | - |
| 第3期 | - |
| 第4期 | - |
| 第5期 | - |
| 第6期 | - |
| 第7期 | - |
| 第8期 | - |

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

| | 1口当たりの分配額（円） |
|-----|--------------|
| 第1期 | - |
| 第2期 | - |
| 第3期 | - |
| 第4期 | - |
| 第5期 | - |
| 第6期 | - |
| 第7期 | - |
| 第8期 | - |

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型

| | 1口当たりの分配額（円） |
|--|--------------|
| | |

| | |
|-----|---|
| 第1期 | - |
| 第2期 | - |
| 第3期 | - |
| 第4期 | - |
| 第5期 | - |
| 第6期 | - |
| 第7期 | - |
| 第8期 | - |

【収益率の推移】

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

| | 収益率 (%) |
|-----------|---------|
| 第1期 | 6.66 |
| 第2期 | 3.31 |
| 第3期 | 8.81 |
| 第4期 | 4.96 |
| 第5期 | 4.04 |
| 第6期 | 12.23 |
| 第7期 | 7.23 |
| 第8期 | 2.52 |
| 第9期中間計算期間 | 3.54 |

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

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型

| | 収益率 (%) |
|-----------|---------|
| 第1期 | 11.11 |
| 第2期 | 5.44 |
| 第3期 | 15.43 |
| 第4期 | 8.16 |
| 第5期 | 8.26 |
| 第6期 | 22.25 |
| 第7期 | 11.75 |
| 第8期 | 3.48 |
| 第9期中間計算期間 | 7.10 |

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

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

| | 収益率 (%) |
|-----|---------|
| 第1期 | 15.55 |
| 第2期 | 7.49 |
| 第3期 | 21.87 |
| 第4期 | 11.31 |
| 第5期 | 12.10 |
| 第6期 | 31.00 |
| 第7期 | 16.35 |
| 第8期 | 4.25 |

| | |
|-----------|-------|
| 第9期中間計算期間 | 10.32 |
|-----------|-------|

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

<< 参考情報 >>

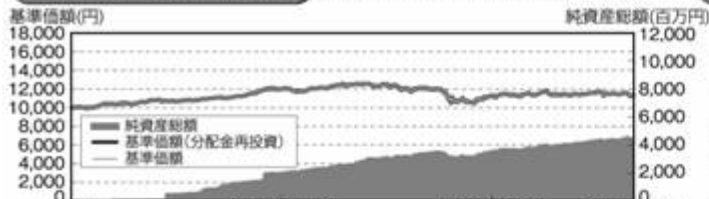
データの基準日:2011年8月31日

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

基準価額・純資産の推移

(設定日(2002年12月13日)~2011年8月31日)

分配の推移(税引前)



| 期 | 日 | 金額 |
|-------|--------------|----|
| 第4期 | (2007.02.26) | 0円 |
| 第5期 | (2008.02.25) | 0円 |
| 第6期 | (2009.02.25) | 0円 |
| 第7期 | (2010.02.25) | 0円 |
| 第8期 | (2011.02.25) | 0円 |
| 設定来累計 | | 0円 |

(注) 分配金は1万円当たりです。

※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:2002年12月13日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

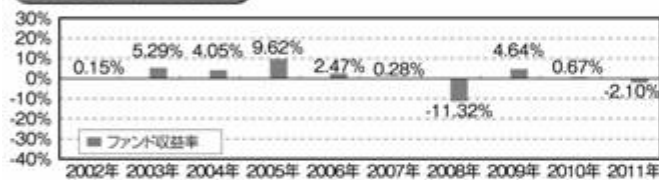
(注) 投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

| 順位 | 銘柄名 | 投資比率(%) |
|----|----------------------------|---------|
| 1 | 国内債券バツシブ・ファンドマザーファンド | 65.96 |
| 2 | 国内株式バツシブ・ファンド(最適化法)マザーファンド | 18.30 |
| 3 | 外国債券バツシブ・ファンドマザーファンド | 8.29 |
| 4 | 外国株式バツシブ・ファンドマザーファンド | 4.46 |

※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



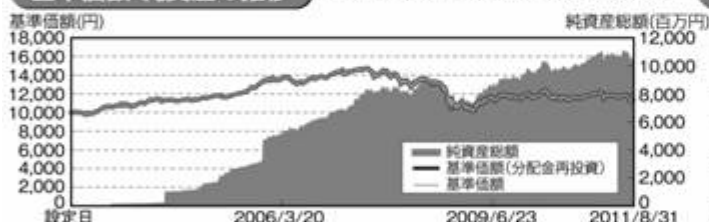
※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2002年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年当初から基準日までの収益率を表示しています。

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

基準価額・純資産の推移

(設定日(2002年12月13日)~2011年8月31日)

分配の推移(税引前)



| 期 | 日 | 金額 |
|-------|--------------|----|
| 第4期 | (2007.02.26) | 0円 |
| 第5期 | (2008.02.25) | 0円 |
| 第6期 | (2009.02.25) | 0円 |
| 第7期 | (2010.02.25) | 0円 |
| 第8期 | (2011.02.25) | 0円 |
| 設定来累計 | | 0円 |

(注) 分配金は1万円当たりです。

※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:2002年12月13日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

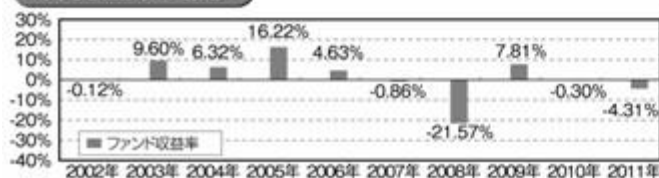
(注) 投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

| 順位 | 銘柄名 | 投資比率(%) |
|----|----------------------------|---------|
| 1 | 国内債券バツシブ・ファンドマザーファンド | 44.46 |
| 2 | 国内株式バツシブ・ファンド(最適化法)マザーファンド | 28.97 |
| 3 | 外国債券バツシブ・ファンドマザーファンド | 12.54 |
| 4 | 外国株式バツシブ・ファンドマザーファンド | 11.06 |

※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算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2002年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年当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。

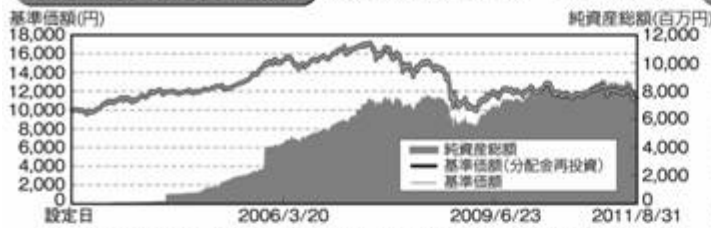
データの基準日:2011年8月31日

DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

基準価額・純資産の推移

(設定日(2002年12月13日)~2011年8月31日)

分配の推移(税引前)



| 期 | 分配日 | 分配金(円) |
|-------|--------------|--------|
| 第4期 | (2007.02.26) | 0円 |
| 第5期 | (2008.02.25) | 0円 |
| 第6期 | (2009.02.25) | 0円 |
| 第7期 | (2010.02.25) | 0円 |
| 第8期 | (2011.02.25) | 0円 |
| 設定来累計 | | 0円 |

(注)分配金は1万円当たりです。

※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2002年12月13日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

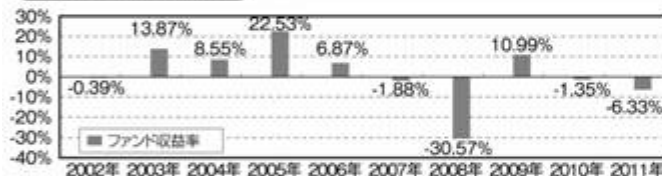
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

| 順位 | 銘柄名 | 投資比率(%) |
|----|----------------------------|---------|
| 1 | 国内株式バシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 38.96 |
| 2 | 国内債券バシブ・ファンド・マザーファンド | 23.08 |
| 3 | 外国株式バシブ・ファンド・マザーファンド | 17.90 |
| 4 | 外国債券バシブ・ファンド・マザーファンド | 17.10 |

※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、2002年は設定日から年末までの収益率、および2011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

■国内株式バシブ・ファンド(最適化法)・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。

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 国名 | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------|
| 株式 | 日本 | 97.11 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 2.89 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

組入上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|---------------|----|----|--------|---------|
| 1 | トヨタ自動車 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 3.28 |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 2.40 |
| 3 | キヤノン | 株式 | 日本 | 電気機器 | 2.09 |
| 4 | 本田技研 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 1.95 |
| 5 | 三井住友フィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.59 |
| 6 | 武田薬品 | 株式 | 日本 | 医薬品 | 1.35 |
| 7 | みずほフィナンシャルG | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.33 |
| 8 | 三菱商事 | 株式 | 日本 | 卸売業 | 1.31 |
| 9 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.23 |
| 10 | ファナック | 株式 | 日本 | 電気機器 | 1.23 |

組入上位5業種(株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|--------|---------|
| 1 | 電気機器 | 13.50 |
| 2 | 輸送用機器 | 9.29 |
| 3 | 銀行業 | 8.97 |
| 4 | 情報・通信業 | 6.09 |
| 5 | 化学 | 5.87 |

○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:2011年8月31日

■外国株式パッシブ・ファンド・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。

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 国名 | 投資比率(%) |
|---------------------|---------|---------|
| 株式 | 米国 | 51.28 |
| | 英国 | 9.74 |
| | カナダ | 5.95 |
| | スイス | 4.54 |
| | フランス | 4.23 |
| | その他 | 19.49 |
| | 小計 | 95.23 |
| 投資信託受益証券 | オーストラリア | 0.29 |
| | シンガポール | 0.03 |
| | 小計 | 0.32 |
| 投資証券 | 米国 | 1.09 |
| | フランス | 0.14 |
| | 英国 | 0.13 |
| | 香港 | 0.04 |
| | カナダ | 0.03 |
| | その他 | 0.02 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1.45 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 3.00 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

組入上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|----------------------------|----|-----|------------|---------|
| 1 | EXXON MOBIL CORP | 株式 | 米国 | 石油・ガス・消耗燃料 | 1.70 |
| 2 | APPLE INC | 株式 | 米国 | コンピュータ周辺機器 | 1.69 |
| 3 | NESTLE SA-REGISTERED | 株式 | スイス | 食品 | 0.97 |
| 4 | NTL BUSINESS MACHINES CORP | 株式 | 米国 | 情報技術サービス | 0.97 |
| 5 | MICROSOFT CORP | 株式 | 米国 | ソフトウェア | 0.92 |
| 6 | CHEVRON CORP | 株式 | 米国 | 石油・ガス・消耗燃料 | 0.92 |
| 7 | PROCTER & GAMBLE CO | 株式 | 米国 | 家庭用品 | 0.84 |
| 8 | JOHNSON & JOHNSON | 株式 | 米国 | 医薬品 | 0.83 |
| 9 | AT&T INC | 株式 | 米国 | 各種電気通信サービス | 0.82 |
| 10 | GENERAL ELECTRIC CO | 株式 | 米国 | コングロマリット | 0.81 |

組入上位5業種(株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|------------|---------|
| 1 | 石油・ガス・消耗燃料 | 10.25 |
| 2 | 商業銀行 | 7.20 |
| 3 | 医薬品 | 6.34 |
| 4 | 金属・鉱業 | 4.42 |
| 5 | 保険 | 3.88 |

■国内債券パッシブ・ファンド・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。

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 国名 | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------|
| 国債証券 | 日本 | 76.15 |
| 地方債証券 | 日本 | 6.80 |
| 特殊債券 | 日本 | 9.05 |
| 社債券 | 日本 | 7.29 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 0.70 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

組入上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|----|------------------|------|----|-------|------------|---------|
| 1 | 313回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.30 | 2021/3/20 | 1.73 |
| 2 | 312回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.20 | 2020/12/20 | 1.52 |
| 3 | 93回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.50 | 2015/12/20 | 1.41 |
| 4 | 310回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.00 | 2020/9/20 | 1.33 |
| 5 | 306回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.40 | 2020/3/20 | 1.31 |
| 6 | 293回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.80 | 2018/6/20 | 1.30 |
| 7 | 315回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.20 | 2021/6/20 | 1.22 |
| 8 | 70回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.80 | 2013/3/20 | 1.19 |
| 9 | 285回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.70 | 2017/3/20 | 1.13 |
| 10 | 75回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 1.10 | 2013/9/20 | 1.13 |

■外国債券パッシブ・ファンド・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。

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 国名 | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------|
| 国債証券 | 米国 | 37.69 |
| | フランス | 10.32 |
| | ドイツ | 9.86 |
| | イタリア | 9.69 |
| | 英国 | 8.05 |
| | その他 | 22.16 |
| | 小計 | 97.77 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 2.23 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

組入上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国名 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|----|-------------------------|------|----|-------|------------|---------|
| 1 | US T N/B 4.0 11/15/12 | 国債証券 | 米国 | 4.00 | 2012/11/15 | 0.94 |
| 2 | US T N/B 4.0 02/15/14 | 国債証券 | 米国 | 4.00 | 2014/2/15 | 0.89 |
| 3 | US T N/B 4.25 11/15/13 | 国債証券 | 米国 | 4.25 | 2013/11/15 | 0.89 |
| 4 | US T N/B 1.0 07/15/13 | 国債証券 | 米国 | 1.00 | 2013/7/15 | 0.83 |
| 5 | US T N/B 4.75 05/15/14 | 国債証券 | 米国 | 4.75 | 2014/5/15 | 0.80 |
| 6 | US T N/B 4.25 08/15/13 | 国債証券 | 米国 | 4.25 | 2013/8/15 | 0.77 |
| 7 | US T N/B 1.125 12/15/12 | 国債証券 | 米国 | 1.13 | 2012/12/15 | 0.72 |
| 8 | US T N/B 3.5 05/31/13 | 国債証券 | 米国 | 3.50 | 2013/5/31 | 0.69 |
| 9 | US T N/B 3.875 02/15/13 | 国債証券 | 米国 | 3.88 | 2013/2/15 | 0.69 |
| 10 | US T N/B 4.25 11/15/14 | 国債証券 | 米国 | 4.25 | 2014/11/15 | 0.69 |

○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】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

| | 設定口数 | 解約口数 |
|-----------|---------------|-------------|
| 第1期 | 144,709,992 | 3,455,800 |
| 第2期 | 783,296,638 | 44,899,767 |
| 第3期 | 1,071,241,518 | 234,014,125 |
| 第4期 | 746,595,858 | 341,955,723 |
| 第5期 | 1,023,536,793 | 407,728,822 |
| 第6期 | 808,835,748 | 470,954,147 |
| 第7期 | 717,089,255 | 374,538,190 |
| 第8期 | 717,088,658 | 341,609,549 |
| 第9期中間計算期間 | 469,250,735 | 222,823,744 |

(注1)本邦外における設定及び解約はございません。

(注2)設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

| | 設定口数 | 解約口数 |
|-----------|---------------|-------------|
| 第1期 | 171,631,847 | 5,928,590 |
| 第2期 | 1,332,596,333 | 74,131,606 |
| 第3期 | 2,610,265,343 | 320,692,996 |
| 第4期 | 1,520,234,750 | 462,264,605 |
| 第5期 | 1,986,010,161 | 647,207,655 |
| 第6期 | 1,694,085,942 | 716,280,777 |
| 第7期 | 1,585,255,449 | 499,713,782 |
| 第8期 | 1,458,689,281 | 659,115,611 |
| 第9期中間計算期間 | 855,031,031 | 490,876,438 |

(注1)本邦外における設定及び解約はございません。

(注2)設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

| | 設定口数 | 解約口数 |
|-----------|---------------|-------------|
| 第1期 | 115,302,114 | 2,576,841 |
| 第2期 | 914,161,482 | 62,918,227 |
| 第3期 | 2,153,330,055 | 371,349,072 |
| 第4期 | 1,327,156,219 | 491,810,911 |
| 第5期 | 1,854,832,281 | 639,682,536 |
| 第6期 | 1,377,219,073 | 638,023,646 |
| 第7期 | 1,360,590,692 | 447,612,668 |
| 第8期 | 1,167,657,064 | 618,314,729 |
| 第9期中間計算期間 | 606,093,508 | 373,490,828 |

(注1)本邦外における設定及び解約はございません。

(注2)設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第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>

- (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）ならびに同規則第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、第8期中間計算期間（平成22年2月26日から平成22年8月25日まで）及び第9期中間計算期間（平成23年2月26日から平成23年8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。

中間財務諸表

【D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 8 期中間計算期間末 平成22年 8 月25日現在 | 第 9 期中間計算期間末 平成23年 8 月25日現在 |
|------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 130,006,198 | 145,165,604 |
| 親投資信託受益証券 | 3,998,687,911 | 4,404,285,037 |
| 未収入金 | - | 4,400,000 |
| 流動資産合計 | 4,128,694,109 | 4,553,850,641 |
| 資産合計 | 4,128,694,109 | 4,553,850,641 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 170,562 | 7,517,023 |
| 未払受託者報酬 | 635,215 | 703,472 |
| 未払委託者報酬 | 4,870,241 | 5,393,594 |
| その他未払費用 | 105,786 | 111,298 |
| 流動負債合計 | 5,781,804 | 13,725,387 |
| 負債合計 | 5,781,804 | 13,725,387 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,637,104,888 | 4,039,665,328 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金 () | 485,807,417 | 500,459,926 |
| (分配準備積立金) | 141,944,320 | 128,500,386 |
| 元本等合計 | 4,122,912,305 | 4,540,125,254 |
| 純資産合計 | 4,122,912,305 | 4,540,125,254 |
| 負債純資産合計 | 4,128,694,109 | 4,553,850,641 |

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第 8 期中間計算期間 自 平成22年 2 月26日 至 平成22年 8 月25日 | 第 9 期中間計算期間 自 平成23年 2 月26日 至 平成23年 8 月25日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 49,521 | 49,996 |
| 有価証券売買等損益 | 7,274,460 | 158,942,040 |
| 営業収益合計 | 7,224,939 | 158,892,044 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 635,215 | 703,472 |
| 委託者報酬 | 4,870,241 | 5,393,594 |
| その他費用 | 105,786 | 111,298 |
| 営業費用合計 | 5,611,242 | 6,208,364 |
| 営業損失（ ） | 12,836,181 | 165,100,408 |
| 経常損失（ ） | 12,836,181 | 165,100,408 |
| 中間純損失（ ） | 12,836,181 | 165,100,408 |
| 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（ ） | 1,821,568 | 3,436,675 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 466,419,621 | 626,328,196 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 58,839,094 | 72,489,451 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 58,839,094 | 72,489,451 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 24,793,549 | 36,693,988 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 24,793,549 | 36,693,988 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 485,807,417 | 500,459,926 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分 | 第8期中間計算期間 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 第9期中間計算期間 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|-----------------|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

（追加情報）

| 第8期中間計算期間 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 第9期中間計算期間 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|---|--|
| | 当中間計算期間より、「金融商品に 関する会計基準」（企業会計基準第 10号 平成20年3月10日）及び「金融 商品の時価等の開示に関する適用指 針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しており ます。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区分 | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8月25日現在 |
|---------------------------|----------------------------|----------------------------|
| *1 期首元本額 | 3,417,759,228円 | 3,793,238,337円 |
| 期中追加設定元本額 | 399,889,083円 | 469,250,735円 |
| 期中解約元本額 | 180,543,423円 | 222,823,744円 |
| *2 中間計算期間末日における受 益権の総数 | 3,637,104,888口 | 4,039,665,328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

| 区分 | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8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)親投資信託受益証券 「中間注記表（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)コール・ローン等の金銭債権 及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済さ 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8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8月25日現在 |
|--------------|----------------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,1336円 | 1,1239円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,336円) | (11,239円) |

【D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 8 期中間計算期間末 平成22年 8 月25日現在 | 第 9 期中間計算期間末 平成23年 8 月25日現在 |
|------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 309,485,138 | 340,229,234 |
| 親投資信託受益証券 | 9,373,650,726 | 10,150,354,945 |
| 流動資産合計 | 9,683,135,864 | 10,490,584,179 |
| 資産合計 | 9,683,135,864 | 10,490,584,179 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 1,491,313 | 8,711,782 |
| 未払受託者報酬 | 1,545,440 | 1,686,285 |
| 未払委託者報酬 | 13,394,256 | 14,614,773 |
| その他未払費用 | 257,486 | 266,917 |
| 流動負債合計 | 16,688,495 | 25,279,757 |
| 負債合計 | 16,688,495 | 25,279,757 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 8,527,783,958 | 9,337,588,077 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金 () | 1,138,663,411 | 1,127,716,345 |
| (分配準備積立金) | 655,878,276 | 605,338,861 |
| 元本等合計 | 9,666,447,369 | 10,465,304,422 |
| 純資産合計 | 9,666,447,369 | 10,465,304,422 |
| 負債純資産合計 | 9,683,135,864 | 10,490,584,179 |

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第 8 期中間計算期間 自 平成22年 2 月26日 至 平成22年 8 月25日 | 第 9 期中間計算期間 自 平成23年 2 月26日 至 平成23年 8 月25日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 121,097 | 120,414 |
| 有価証券売買等損益 | 268,454,066 | 782,185,114 |
| 営業収益合計 | 268,332,969 | 782,064,700 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,545,440 | 1,686,285 |
| 委託者報酬 | 13,394,256 | 14,614,773 |
| その他費用 | 257,486 | 266,917 |
| 営業費用合計 | 15,197,182 | 16,567,975 |
| 営業損失（ ） | 283,530,151 | 798,632,675 |
| 経常損失（ ） | 283,530,151 | 798,632,675 |
| 中間純損失（ ） | 283,530,151 | 798,632,675 |
| 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（ ） | 4,276,008 | 17,252,958 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 1,356,098,843 | 1,853,258,580 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 141,104,646 | 156,866,760 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 141,104,646 | 156,866,760 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 70,733,919 | 101,029,278 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 70,733,919 | 101,029,278 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,138,663,411 | 1,127,716,345 |

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分 | 第8期中間計算期間 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 第9期中間計算期間 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|-----------------|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

（追加情報）

| 第8期中間計算期間 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 第9期中間計算期間 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|---|--|
| | 当中間計算期間より、「金融商品に 関する会計基準」（企業会計基準第 10号 平成20年3月10日）及び「金融 商品の時価等の開示に関する適用指 針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しており ます。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区分 | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8月25日現在 |
|---------------------------|----------------------------|----------------------------|
| *1 期首元本額 | 8,173,859,814円 | 8,973,433,484円 |
| 期中追加設定元本額 | 776,624,243円 | 855,031,031円 |
| 期中解約元本額 | 422,700,099円 | 490,876,438円 |
| *2 中間計算期間末日における受 益権の総数 | 8,527,783,958口 | 9,337,588,077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

| 区分 | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8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ぬ。 |

| | | |
|----------------------------|--|--|
| 2. 時価の算定方法 | | <p>(1)親投資信託受益証券 「中間注記表（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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。</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）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8月25日現在 |
|---------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.1335円 (11,335円) | 1.1208円 (11,208円) |

【D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3成長型】
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8月25日現在 |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 247,726,305 | 268,237,884 |
| 親投資信託受益証券 | 7,306,401,832 | 7,797,813,601 |
| 未収入金 | 1,000,000 | 3,800,000 |
| 流動資産合計 | 7,555,128,137 | 8,069,851,485 |
| 資産合計 | 7,555,128,137 | 8,069,851,485 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 6,091,154 | 17,912,892 |
| 未払受託者報酬 | 1,242,306 | 1,329,143 |
| 未払委託者報酬 | 12,009,456 | 12,848,775 |
| その他未払費用 | 206,974 | 210,364 |
| 流動負債合計 | 19,549,890 | 32,301,174 |
| 負債合計 | 19,549,890 | 32,301,174 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 6,687,460,026 | 7,230,563,030 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 848,118,221 | 806,987,281 |
| （分配準備積立金） | 654,786,562 | 598,391,587 |
| 元本等合計 | 7,535,578,247 | 8,037,550,311 |
| 純資産合計 | 7,535,578,247 | 8,037,550,311 |
| 負債純資産合計 | 7,555,128,137 | 8,069,851,485 |

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第 8 期中間計算期間 自 平成22年 2 月26日 至 平成22年 8 月25日 | 第 9 期中間計算期間 自 平成23年 2 月26日 至 平成23年 8 月25日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 97,632 | 94,918 |
| 有価証券売買等損益 | 409,544,201 | 906,727,155 |
| 営業収益合計 | 409,446,569 | 906,632,237 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,242,306 | 1,329,143 |
| 委託者報酬 | 12,009,456 | 12,848,775 |
| その他費用 | 206,974 | 210,364 |
| 営業費用合計 | 13,458,736 | 14,388,282 |
| 営業損失（ ） | 422,905,305 | 921,020,519 |
| 経常損失（ ） | 422,905,305 | 921,020,519 |
| 中間純損失（ ） | 422,905,305 | 921,020,519 |
| 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（ ） | 1,893,986 | 18,267,415 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 1,218,600,555 | 1,675,911,403 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 122,772,002 | 122,887,037 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 122,772,002 | 122,887,037 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 68,455,045 | 89,058,055 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 68,455,045 | 89,058,055 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 848,118,221 | 806,987,281 |

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分 | 第8期中間計算期間 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 第9期中間計算期間 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|-----------------|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

（追加情報）

| 第8期中間計算期間 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 第9期中間計算期間 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|---|--|
| | 当中間計算期間より、「金融商品に 関する会計基準」（企業会計基準第 10号 平成20年3月10日）及び「金融 商品の時価等の開示に関する適用指 針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しており ます。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区分 | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8月25日現在 |
|---------------------------|----------------------------|----------------------------|
| *1 期首元本額 | 6,448,618,015円 | 6,997,960,350円 |
| 期中追加設定元本額 | 597,413,013円 | 606,093,508円 |
| 期中解約元本額 | 358,571,002円 | 373,490,828円 |
| *2 中間計算期間末日における受 益権の総数 | 6,687,460,026口 | 7,230,563,030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

| 区分 | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8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ぬ。 |

| | | |
|----------------------------|--|--|
| 2. 時価の算定方法 | | <p>(1)親投資信託受益証券 「中間注記表（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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。</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）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 第8期中間計算期間末 平成22年8月25日現在 | 第9期中間計算期間末 平成23年8月25日現在 |
|---------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.1268円 (11,268円) | 1.1116円 (11,116円) |

（参考）

D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型、D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型、D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型は「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・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。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況
貸借対照表

| 科目 | 注記 番号 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| | | 金額 (円) | 金額 (円) |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 8,414,575,985 | 5,852,229,923 |
| 株式 | *2 | 242,894,933,230 | 226,946,453,054 |
| 派生商品評価勘定 | | - | 726,723 |
| 未収配当金 | | 209,047,650 | 209,481,650 |
| 前払金 | | 299,040,000 | 705,855,000 |
| 流動資産合計 | | 251,817,596,865 | 233,714,746,350 |
| 資産合計 | | 251,817,596,865 | 233,714,746,350 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 412,702,395 | 638,435,173 |
| 未払金 | | 2,315,294 | - |
| 未払解約金 | | 64,773,000 | 33,721,000 |
| 流動負債合計 | | 479,790,689 | 672,156,173 |
| 負債合計 | | 479,790,689 | 672,156,173 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 241,138,664,200 | 234,952,841,260 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | *4 | 10,199,141,976 | 1,910,251,083 |
| 元本等合計 | | 251,337,806,176 | 233,042,590,177 |
| 純資産合計 | | 251,337,806,176 | 233,042,590,177 |
| 負債純資産合計 | | 251,817,596,865 | 233,714,746,350 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分 | 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|--------------------|--|----------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 | 株式 同左 |

| | | |
|----------------------------|--|---|
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引 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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 | 先物取引 同左 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月9日から平成23年2月7日までとなっております。 | 計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月8日から平成24年2月7日までとなっております。 |

(追加情報)

| | |
|----------------------------|---|
| 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
| | 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|---|------------------|------------------|
| *1 本半期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 | 233,574,423,007円 | 220,196,722,346円 |
| 同期中追加設定元本額 | 23,914,440,098円 | 36,040,801,217円 |
| 同期中解約元本額 | 16,350,198,905円 | 21,284,682,303円 |
| 同中間期末における元本の内訳 | | |
| D I A M D C 国内株式インデックスファンド | 1,517,478,992円 | 1,882,694,256円 |
| D I A M国内株式パッシブ・ファンド | 790,549,137円 | 1,137,065,242円 |
| D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金> | 29,675,502,988円 | 32,531,169,574円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 | 723,549,533円 | 792,651,229円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 | 2,700,027,535円 | 2,960,901,224円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型 | 2,837,201,884円 | 3,093,476,611円 |
| D I A M D C バランス30インデックスファンド | 443,108,711円 | 476,389,961円 |
| D I A M D C バランス50インデックスファンド | 1,330,727,214円 | 1,441,408,544円 |
| D I A M D C バランス70インデックスファンド | 1,021,178,757円 | 1,097,603,346円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 155,533,904円 | 140,899,989円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 1,324,211,291円 | 1,429,546,829円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 6,934,919円 | 19,101,935円 |
| D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定） | 279,982,449円 | 259,835,407円 |

| | | |
|---|-----------------|-----------------|
| D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA（適格機関投 資家限定） | 11,510,319,984円 | 10,451,406,780円 |
| D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA（適格機関投 資家限定） | 1,878,746,522円 | 1,769,741,583円 |
| D I A M国際分散バランスファ ンド30VA（適格機関投資家 限定） | 219,146,139円 | 205,820,466円 |
| D I A M国際分散バランスファ ンド50VA（適格機関投資家 限定） | 813,337,539円 | 786,237,556円 |
| D I A M国内重視バランスファ ンド30VA（適格機関投資家 限定） | 233,198,025円 | 214,838,379円 |
| D I A M国内重視バランスファ ンド50VA（適格機関投資家 限定） | 311,914,913円 | 288,707,842円 |
| D I A M世界バランスファンド 40VA（適格機関投資家限 定） | 20,952,892,777円 | 19,659,845,170円 |
| D I A M世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限 定） | 6,868,574,732円 | 6,531,889,893円 |
| D I A Mバランスファンド25 VA（適格機関投資家限定） | 5,511,476,890円 | 5,082,993,875円 |
| D I A Mバランスファンド3 7.5VA（適格機関投資家限 定） | 3,707,930,908円 | 3,393,836,502円 |
| D I A Mバランスファンド50 VA（適格機関投資家限定） | 8,616,670,784円 | 7,941,750,425円 |
| D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA（適格機関投 資家限定） | 1,260,833,811円 | 1,200,585,606円 |
| D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA2（適格機関投 資家限定） | 2,714,944,525円 | 2,593,655,924円 |
| D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30VA（適格 機関投資家限定） | 2,817,802,976円 | 2,641,971,684円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンドVA（適格機関投資家 向け） | 15,065,538,870円 | 14,321,092,541円 |
| D I A Mグローバル 私募ファ ンド（適格機関投資家向け） | 243,609,429円 | 222,287,324円 |
| D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け） | 282,809,995円 | 円 |
| D I A M世界バランスファンド 55VA（適格機関投資家限 定） | 4,968,322,480円 | 4,806,764,914円 |
| D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド35VA（適格機 関投資家限定） | 9,448,119,328円 | 9,443,941,995円 |
| D I A Mグローバル分散ファン ドVA（適格機関投資家限定） | 455,563,938円 | 471,577,180円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド2VA（適格機関投資 家限定） | 42,813,305,776円 | 40,788,788,234円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド40VA（適格機関投 資家限定） | 2,917,398,303円 | 2,707,459,431円 |

| | | |
|---|-------------------|---|
| D I A M世界アセットバランス ファンド25VA（適格機関投資 家限定） | 5,226,304,463円 | 5,015,717,046円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド3VA（適格機関投資 家限定） | 26,127,952,533円 | 24,740,338,839円 |
| D I A Mバランス30VA（適 格機関投資家限定） | 295,835,571円 | 285,026,726円 |
| D I A Mバランス50VA（適 格機関投資家限定） | 95,046円 | 97,608円 |
| D I A Mバランス70VA（適 格機関投資家限定） | 146,126円 | 152,446円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド4VA（適格機関投資 家限定） | 22,612,632,288円 | 21,577,153,813円 |
| D I A M世界バランス25VA （適格機関投資家限定） | 202,095,677円 | 250,073,265円 |
| D I A M国内バランス30VA （適格機関投資家限定） | 65,768,125円 | 80,080,932円 |
| D I A Mバランス20VA（適 格機関投資家限定） | 189,163,697円 | 216,032,037円 |
| D I A Mバランス40VA（適 格機関投資家限定） | 90,207円 | 91,090円 |
| D I A Mバランス60VA（適 格機関投資家限定） | 134,509円 | 140,007円 |
| （合 計） | 241,138,664,200円 | 234,952,841,260円 |
| *2 差入代用有価証券 | 株式 1,455,000,000円 | 株式 1,382,000,000円 |
| *3 本半期報告書における開示対 象ファンドの中間計算期間末日 における受益権総数 | 241,138,664,200口 | 234,952,841,260口 |
| *4 元本の欠損 | | 貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額は 1,910,251,083円であります。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8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)株式 「注記表（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)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等 に関する注記）」にて記載して おります。 (3)コール・ローン等の金銭債権 及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済さ 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）

（株式関連）

| 平成22年8月25日現在 | | | | | |
|--------------|---------------------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| 区分 | 種類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 TOPIX先物 | 8,808,165,000 | - | 8,396,150,000 | 412,702,395 |
| 合計 | | 8,808,165,000 | - | 8,396,150,000 | 412,702,395 |

| 平成23年8月25日現在 | | | | | |
|--------------|---------------------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| 区分 | 種類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 TOPIX先物 | 6,976,365,000 | - | 6,339,360,000 | 637,708,450 |
| 合計 | | 6,976,365,000 | - | 6,339,360,000 | 637,708,450 |

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0423円 | 0.9919円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,423円） | （9,919円） |

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

| 科目 | 注記 番号 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| | | 金額 (円) | 金額 (円) |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 2,582,016,528 | 3,907,332,151 |
| コール・ローン | | 44,765,136 | 64,007,229 |
| 株式 | | 247,153,514,250 | 232,800,400,232 |
| 投資信託受益証券 | | 839,790,405 | 764,598,041 |
| 投資証券 | | 3,158,701,273 | 3,532,057,567 |
| 派生商品評価勘定 | | 53,742,702 | 10,205,219 |
| 未収入金 | | 1,499,944 | 5,661 |
| 未収配当金 | | 610,254,795 | 577,023,132 |
| 差入委託証拠金 | | 1,573,506,147 | 2,894,137,849 |
| 流動資産合計 | | 256,017,791,180 | 244,549,767,081 |
| 資産合計 | | 256,017,791,180 | 244,549,767,081 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 74,737,856 | 514,871,993 |
| 未払解約金 | | 53,069,000 | 24,173,000 |
| 流動負債合計 | | 127,806,856 | 539,044,993 |
| 負債合計 | | 127,806,856 | 539,044,993 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 232,065,705,527 | 216,220,957,186 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 23,824,278,797 | 27,789,764,902 |
| 元本等合計 | | 255,889,984,324 | 244,010,722,088 |
| 純資産合計 | | 255,889,984,324 | 244,010,722,088 |
| 負債純資産合計 | | 256,017,791,180 | 244,549,767,081 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|-----------------------|---|----------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 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、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。 | 株式、投資信託受益証券及び投資証券 同左 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引 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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 | (1)先物取引 同左 |

| | | |
|--------------------------------|---|--|
| | (2)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。 | (2)為替予約取引 同左 |
| 3. その他財務諸表作成のための 基本となる重要な事項 | (1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の 対顧客電信売買相場の仲値によ り円貨に換算するほか、「投資信 託財産の計算に関する規則」 （平成12年総理府令第133号）第 60条及び同第61条にしたがって 換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 半期報告書における開示対象 ファンドと異なり、平成22年2月 16日から平成23年2月15日までと なっております。 | (1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 半期報告書における開示対象 ファンドと異なり、平成23年2月 16日から平成24年2月15日までと なっております。 |

(追加情報)

| | |
|----------------------------|--|
| 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
| | 当計算期間より、「金融商品に関す る会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品 の時価等の開示に関する適用指針」 （企業会計基準適用指針第19号 平 成20年3月10日）を適用しておりま す。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|--|------------------|------------------|
| *1 本半期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 | 230,889,417,193円 | 211,463,838,388円 |
| 同期中追加設定元本額 | 33,976,912,738円 | 21,024,969,412円 |
| 同期中解約元本額 | 32,800,624,404円 | 16,267,850,614円 |
| 同中間期末における元本の内訳 | | |
| D I A M 外国株式パッシブ・ ファンド | 571,887,334円 | 1,243,216,609円 |
| D I A M 外国株式インデックス ファンド< D C 年金 > | 26,835,875,099円 | 30,762,313,318円 |
| D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型 | 174,372,607円 | 178,403,674円 |
| D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型 | 988,648,856円 | 1,020,871,739円 |
| D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型 | 1,244,095,656円 | 1,266,539,139円 |
| D I A M D C バランス 3 0 イ ンデックスファンド | 203,510,852円 | 202,568,861円 |
| D I A M D C バランス 5 0 イ ンデックスファンド | 522,865,707円 | 524,098,483円 |
| D I A M D C バランス 7 0 イ ンデックスファンド | 376,585,619円 | 378,238,569円 |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 > | 88,492,070円 | 78,525,044円 |
| マネックス資産設計ファンド< 育成型 > | 755,039,055円 | 798,231,888円 |

| | | |
|---|-----------------|-----------------|
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 56,652,961円 | 142,196,098円 |
| D I A M外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用) | 639,862,538円 | 606,957,679円 |
| D I A M外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け) | 6,068,153,416円 | 5,946,543,316円 |
| D I A M為替リスクコントロール型グローバル株式私募ファンド(適格機関投資家限定) | 17,296,875,235円 | 16,543,915,689円 |
| D I A Mワールドバランス25V A (適格機関投資家限定) | 110,620,797円 | 96,449,740円 |
| D I A Mグローバル・バランスファンド25V A (適格機関投資家限定) | 10,631,528,997円 | 9,058,913,764円 |
| D I A Mグローバル・バランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 1,735,251,460円 | 1,533,869,888円 |
| D I A M国際分散バランスファンド30V A (適格機関投資家限定) | 202,446,519円 | 178,406,441円 |
| D I A M国際分散バランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 1,127,007,476円 | 1,022,321,654円 |
| D I A M国内重視バランスファンド30V A (適格機関投資家限定) | 107,652,069円 | 93,066,019円 |
| D I A M国内重視バランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 192,041,060円 | 166,811,308円 |
| D I A M世界バランスファンド40V A (適格機関投資家限定) | 19,353,275,603円 | 17,040,488,327円 |
| D I A M世界バランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 9,517,713,040円 | 8,493,730,617円 |
| D I A Mバランスファンド25V A (適格機関投資家限定) | 3,393,054,100円 | 2,936,447,977円 |
| D I A Mバランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定) | 2,996,676,384円 | 2,573,694,184円 |
| D I A Mバランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 7,959,024,549円 | 6,883,461,897円 |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定) | 5,838,651,267円 | 5,223,378,788円 |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定) | 7,545,848,056円 | 6,761,314,648円 |
| D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定) | 5,207,986,108円 | 4,594,703,364円 |
| D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け) | 4,620,577,243円 | 4,124,635,914円 |
| D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け) | 78,999,091円 | 57,674,003円 |
| D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け) | 266,449,308円 | 円 |
| D I A M世界バランスファンド55V A (適格機関投資家限定) | 20,832,200,653円 | 18,975,466,809円 |

| | | |
|---|------------------|------------------|
| D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定） | 3,542,060,658円 | 3,320,645,105円 |
| D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定） | 144,568,545円 | 138,134,775円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定） | 26,342,647,297円 | 23,561,343,588円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定） | 2,694,766,075円 | 2,350,728,160円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定） | 4,827,720,035円 | 4,347,519,920円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定） | 16,087,465,129円 | 14,291,770,267円 |
| D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定） | 176,452円 | 169,277円 |
| D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定） | 270,748円 | 264,644円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定） | 20,885,859,485円 | 18,702,684,808円 |
| D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定） | 83,044円 | 79,542円 |
| D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定） | 167,274円 | 161,652円 |
| （合計） | 232,065,705,527円 | 216,220,957,186円 |
| *2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権総数 | 232,065,705,527口 | 216,220,957,186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

| 区分 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8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)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（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)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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）

（株式関連）

| 平成22年8月25日現在 | | | | | |
|--------------|----------------------------------|---------------|-------|---------------|------------|
| 区分 | 種類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | オーストラリアドル SPI 200 FUTURES | 178,426,920 | - | 179,356,188 | 929,268 |
| | カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT | 287,271,067 | - | 288,393,145 | 1,122,078 |
| | ユーロ DJ EURO STOXX 50 | 899,300,677 | - | 889,735,022 | 9,565,655 |
| | 英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE | 469,310,733 | - | 476,320,632 | 7,009,900 |
| | 米ドル S&P 500 FUTURE | 2,278,816,470 | - | 2,258,041,065 | 20,775,405 |
| | 合計 | 4,113,125,867 | - | 4,091,846,053 | 21,279,814 |

| 平成23年8月25日現在 | | | | | |
|--------------|----|---------|-------|-------|---------|
| 区分 | 種類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | うち1年超 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|------|----------------------------------|---------------|---|---------------|-------------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | オーストラリアドル SPI 200 FUTURES | 341,618,591 | - | 327,339,090 | 14,279,501 |
| | カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT | 438,474,704 | - | 428,172,358 | 10,302,346 |
| | ユーロ DJ EURO STOXX 50 | 1,492,379,093 | - | 1,307,533,392 | 184,845,701 |
| | 英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE | 759,768,530 | - | 707,039,377 | 52,729,153 |
| | 米ドル S&P 500 FUTURE | 3,782,759,084 | - | 3,540,236,960 | 242,522,124 |
| | 合 計 | 6,815,000,002 | - | 6,310,321,177 | 504,678,825 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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。

(通貨関連)

| 平成22年8月25日現在 | | | | | |
|--------------|--------------|------------|-------|------------|---------|
| 区分 | 種 類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | | | | |
| | オーストラリアドル | 6,056,720 | - | 5,970,400 | 86,320 |
| | ユーロ | 7,468,720 | - | 7,468,300 | 420 |
| | 英ポンド | 13,008,350 | - | 13,008,000 | 350 |
| | 米ドル | 30,559,970 | - | 30,362,400 | 197,570 |
| 合 計 | | 57,093,760 | - | 56,809,100 | 284,660 |

| 平成23年8月25日現在 | | | | | |
|--------------|--------------|------------|-------|------------|---------|
| 区分 | 種 類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | 米ドル | 15,377,950 | - | 15,390,000 | 12,050 |
| 合 計 | | 15,377,950 | - | 15,390,000 | 12,050 |

(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22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1027円 | 1.1285円 |
| （1万口当たり純資産額） | （11,027円） | （11,285円） |

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

| 科目 | 注記 番号 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| | | 金額 （円） | 金額 （円） |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 1,606,407,580 | 1,642,265,385 |
| 国債証券 | | 326,105,438,500 | 315,421,272,400 |
| 地方債証券 | | 28,611,720,015 | 28,302,102,001 |
| 特殊債券 | | 39,772,438,800 | 37,691,011,464 |
| 社債券 | | 34,032,721,740 | 30,345,399,100 |
| 未収入金 | | - | 8,261,114,128 |
| 未収利息 | | 1,696,614,403 | 1,658,554,314 |
| 前払費用 | | 60,228,968 | 58,734,575 |
| 流動資産合計 | | 431,885,570,006 | 423,380,453,367 |
| 資産合計 | | 431,885,570,006 | 423,380,453,367 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払解約金 | | 126,204,000 | 210,500,000 |
| 流動負債合計 | | 126,204,000 | 210,500,000 |
| 負債合計 | | 126,204,000 | 210,500,000 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 381,090,770,620 | 374,439,446,023 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 50,668,595,386 | 48,730,507,344 |
| 元本等合計 | | 431,759,366,006 | 423,169,953,367 |
| 純資産合計 | | 431,759,366,006 | 423,169,953,367 |
| 負債純資産合計 | | 431,885,570,006 | 423,380,453,367 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分 | 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|----|----------------------------|----------------------------|
| | | |

| | | |
|----------------------------|--|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月14日までとなっております。 | 計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月15日から平成24年2月14日までとなっております。 |

(追加情報)

| | |
|----------------------------|---|
| 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
| | 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日)を適用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|---|------------------|------------------|
| *1 本半期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 | 392,786,689,803円 | 385,632,006,164円 |
| 同期中追加設定元本額 | 32,592,070,176円 | 20,106,467,979円 |
| 同期中解約元本額 | 44,287,989,359円 | 31,299,028,120円 |
| 同中間期末における元本の内訳 | | |
| D I A M国内債券パッシブ・ファンド | 2,463,518,674円 | 5,566,674,413円 |
| D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金> | 6,955,524,575円 | 7,939,305,966円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 | 2,406,045,530円 | 2,685,616,264円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 | 3,801,540,628円 | 4,182,651,229円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型 | 1,537,540,126円 | 1,678,704,610円 |
| D I A M DC バランス30インデックスファンド | 1,159,505,105円 | 1,208,542,326円 |
| D I A M DC バランス50インデックスファンド | 1,174,341,573円 | 1,212,111,006円 |
| D I A M DC バランス70インデックスファンド | 151,274,801円 | 152,558,937円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 235,767,690円 | 199,505,378円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 2,011,490,436円 | 2,023,403,929円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 1,286,745円 | 4,618,906円 |

| | | |
|---|-----------------|-----------------|
| みずほエマージングボンドオープン | 10,801,911円 | 10,801,911円 |
| D I A M高金利通貨ファンド | 9,608,918円 | 9,608,918円 |
| D I A Mエマージング債券ファンド | 9,450,010円 | 9,450,010円 |
| D I A Mロシア株式ファンド | 10,126,042円 | 10,126,042円 |
| D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け) | 14,855,804,543円 | 20,137,464,584円 |
| D I A M国内債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家限定) | 111,456,240円 | 110,596,194円 |
| D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) | 901,520,367円 | 840,004,173円 |
| D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 13,512,569,886円 | 12,308,638,381円 |
| D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 734,613,366円 | 695,282,167円 |
| D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 500,494,130円 | 472,280,626円 |
| D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 1,193,497,737円 | 1,159,871,021円 |
| D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 570,499,742円 | 528,329,280円 |
| D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 406,871,772円 | 378,632,552円 |
| D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 30,748,414,846円 | 28,997,791,335円 |
| D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 10,083,019,947円 | 9,634,815,462円 |
| D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 14,383,181,365円 | 13,325,619,776円 |
| D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定) | 5,441,647,448円 | 5,005,525,015円 |
| D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 8,428,690,940円 | 7,805,963,762円 |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定) | 1,851,928,056円 | 1,774,694,667円 |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定) | 6,653,299,627円 | 6,390,462,274円 |
| D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 8,276,576,684円 | 7,811,741,256円 |
| D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け) | 14,741,726,844円 | 14,112,131,719円 |
| D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け) | 812,270,396円 | 708,137,610円 |
| D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け) | 563,400,695円 | 円 |
| D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定) | 14,600,508,930円 | 14,212,076,050円 |

| | | |
|---|------------------|------------------|
| D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定） | 7,496,739,803円 | 7,010,138,340円 |
| D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定） | 1,552,967,291円 | 1,468,268,176円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定） | 111,716,358,059円 | 106,951,162,473円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定） | 2,853,611,294円 | 2,659,579,469円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定） | 10,229,158,820円 | 9,873,573,711円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定） | 34,081,592,538円 | 32,420,871,375円 |
| D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定） | 2,318,247,966円 | 2,247,430,797円 |
| D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定） | 233,937円 | 240,292円 |
| D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定） | 143,171円 | 149,489円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定） | 36,877,952,167円 | 35,382,969,038円 |
| D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定） | 649,844,861円 | 807,727,664円 |
| D I A M国内バランス30VA（適格機関投資家限定） | 150,157,574円 | 183,923,974円 |
| D I A Mバランス20VA（適格機関投資家限定） | 1,853,416,382円 | 2,129,126,796円 |
| D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定） | 309,623円 | 316,855円 |
| D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定） | 220,809円 | 229,825円 |
| （合計） | 381,090,770,620円 | 374,439,446,023円 |
| *2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権総数 | 381,090,770,620口 | 374,439,446,023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

| 区分 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8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)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「注記表（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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1330円 | 1.1301円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,330円) | (11,301円) |

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

| 科目 | 注記 番号 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| | | 金額 (円) | 金額 (円) |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 4,216,886,961 | 3,321,560,716 |
| コール・ローン | | 255,257,609 | 471,775,266 |
| 国債証券 | | 384,134,109,537 | 367,717,447,170 |
| 派生商品評価勘定 | | 269,940 | 764,748 |
| 未収入金 | | - | 10,855,061,654 |
| 未収利息 | | 4,332,702,420 | 4,309,633,788 |
| 前払費用 | | 204,747,255 | 262,208,650 |
| 流動資産合計 | | 393,143,973,722 | 386,938,451,992 |
| 資産合計 | | 393,143,973,722 | 386,938,451,992 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 25,068 | 251,993 |
| 未払解約金 | | 112,314,000 | 451,455,000 |
| 流動負債合計 | | 112,339,068 | 451,706,993 |
| 負債合計 | | 112,339,068 | 451,706,993 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 337,629,285,459 | 332,647,893,276 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 55,402,349,195 | 53,838,851,723 |
| 元本等合計 | | 393,031,634,654 | 386,486,744,999 |
| 純資産合計 | | 393,031,634,654 | 386,486,744,999 |
| 負債純資産合計 | | 393,143,973,722 | 386,938,451,992 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|----------------------------|---|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 | 国債証券 同左 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 | 為替予約取引 同左 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | (1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。 | (1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月22日から平成24年2月21日までとなっております。 |

(追加情報)

| 自平成22年2月26日 至平成22年8月25日 | 自平成23年2月26日 至平成23年8月25日 |
|----------------------------|---|
| | 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|---|------------------|------------------|
| *1 本半期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 | 340,044,873,488円 | 345,284,212,026円 |
| 同期中追加設定元本額 | 18,641,046,232円 | 18,179,185,241円 |
| 同期中解約元本額 | 21,056,634,261円 | 30,815,503,991円 |
| 同中間期末における元本の内訳 | | |
| D I A M外国債券パッシブ・ファンド | 3,515,913,351円 | 2,154,244,509円 |
| D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金> | 3,152,490,399円 | 3,810,202,479円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 | 280,218,173円 | 328,551,212円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 | 998,267,678円 | 1,148,708,135円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型 | 1,061,153,740円 | 1,207,609,446円 |
| D I A M DC バランス30インデックスファンド | 303,836,700円 | 339,634,869円 |
| D I A M DC バランス50インデックスファンド | 590,203,139円 | 670,636,125円 |
| D I A M DC バランス70インデックスファンド | 390,777,092円 | 431,790,355円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 187,391,841円 | 171,226,226円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 1,599,137,062円 | 1,738,124,061円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 4,146,765円 | 11,284,799円 |
| D I A Mパッシブ資産分散ファンド | 10,856,362,996円 | 6,765,907,276円 |
| D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け) | 3,976,439,062円 | 7,847,972,490円 |
| D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け) | 7,836,773,028円 | 7,533,251,767円 |
| 外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定) | 948,036,288円 | 946,676,260円 |
| D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) | 259,207,377円 | 253,406,824円 |
| D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 51,168,099,336円 | 48,871,135,752円 |
| D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 2,782,536,054円 | 2,758,108,596円 |
| D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 473,548,777円 | 468,085,935円 |
| D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 752,695,160円 | 766,532,092円 |
| D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 215,861,509円 | 209,393,809円 |
| D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 96,138,003円 | 93,801,182円 |
| D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 29,094,065,731円 | 28,698,297,978円 |
| D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 6,354,180,952円 | 6,367,468,942円 |
| D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 11,907,741,594円 | 11,544,013,888円 |
| D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定) | 5,578,077,477円 | 5,369,668,241円 |
| D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 7,975,171,433円 | 7,727,595,706円 |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定) | 2,921,164,063円 | 2,932,629,853円 |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定) | 8,808,681,602円 | 8,888,041,104円 |

| | | |
|---|------------------|------------------|
| D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定） | 10,432,669,614円 | 10,322,875,417円 |
| D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け） | 51,179,502,847円 | 51,231,587,733円 |
| D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け） | 261,397,379円 | 267,315,107円 |
| D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け） | 528,817,558円 | 円 |
| D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定） | 6,903,137,509円 | 7,053,725,381円 |
| D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定） | 15,887,855,861円 | 15,061,844,607円 |
| D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定） | 284,501,018円 | 288,588,800円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定） | 26,371,011,659円 | 26,485,082,949円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定） | 32,246,883,657円 | 32,153,447,829円 |
| D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定） | 822,241,513円 | 833,537,369円 |
| D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定） | 221,987円 | 238,668円 |
| D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定） | 135,204円 | 148,407円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定） | 27,909,431,609円 | 28,019,692,554円 |
| D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定） | 187,015,043円 | 243,715,053円 |
| D I A Mバランス20VA（適格機関投資家限定） | 525,811,757円 | 631,733,094円 |
| D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定） | 209,715円 | 223,848円 |
| D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定） | 125,147円 | 136,549円 |
| （合計） | 337,629,285,459円 | 332,647,893,276円 |
| *2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権総数 | 337,629,285,459口 | 332,647,893,276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

| 区分 | 平成22年8月25日現在 | 平成23年8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)国債証券 「注記表（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)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。</p> <p>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）

| 平成22年8月25日現在 | | | | | |
|--------------|--------------|-------------|-------|-------------|---------|
| 区分 | 種 類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | 35,477,640 | - | 35,207,700 | 269,940 |
| | ユーロ | | | | |
| | 買建 | 193,338,225 | - | 193,322,280 | 15,945 |
| | ユーロ | | | | |
| | 米ドル | 82,746,663 | - | 82,737,540 | 9,123 |
| 合 計 | | 311,562,528 | - | 311,267,520 | 244,872 |

| 平成23年8月25日現在 | | | | | |
|--------------|-----|---------|-------|-------|---------|
| 区分 | 種 類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | うち1年超 | | |

| | | | | | |
|-----------|----------------|---------------|----------------|---------------|---------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | | | | |
| | オーストラリアドル | 103,290,481 | - | 103,281,500 | 8,981 |
| | カナダドル | 361,865,124 | - | 361,860,480 | 4,644 |
| | スウェーデンクローネ | 103,285,870 | - | 103,226,300 | 59,570 |
| | デンマーククローネ | 103,342,588 | - | 103,287,020 | 55,568 |
| | ポーランドズロチ | 103,171,914 | - | 103,338,840 | 166,926 |
| | ユーロ | 4,533,823,673 | - | 4,533,842,440 | 18,767 |
| | 英ポンド | 1,007,752,000 | - | 1,007,600,000 | 152,000 |
| | 米ドル | 4,223,511,450 | - | 4,223,093,765 | 417,685 |
| 合 計 | 10,540,043,100 | - | 10,539,530,345 | 512,755 | |

(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22年8月25日現在 | 平成23年8月25日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1641円 | 1.1618円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,641円) | (11,618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>

【純資産額計算書】

D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

平成23年8月31日現在

| 項 目 | 金額又は口数 |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 4,605,331,941円 |
| 負債総額 | 1,114,877円 |
| 純資産総額 (-) | 4,604,217,064円 |
| 発行済数量 | 4,072,958,259口 |
| 1口当たり純資産額 (/) | 1.1304円 |

D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

平成23年8月31日現在

| 項 目 | 金額又は口数 |
|-----|--------|
|-----|--------|

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 10,639,991,605円 |
| 負債総額 | 3,335,994円 |
| 純資産総額（ - ） | 10,636,655,611円 |
| 発行済数量 | 9,399,142,952口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1317円 |

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型

平成23年8月31日現在

| 項 目 | 金額又は口数 |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 8,205,760,808円 |
| 負債総額 | 891,314円 |
| 純資産総額（ - ） | 8,204,869,494円 |
| 発行済数量 | 7,282,609,123口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1266円 |

（参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年8月31日現在

| 項 目 | 金額又は口数 |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 261,645,411,446円 |
| 負債総額 | 11,041,001,601円 |
| 純資産総額（ - ） | 250,604,409,845円 |
| 発行済数量 | 246,393,884,687口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0171円 |

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

| 項 目 | 金額又は口数 |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 274,349,606,097円 |
| 負債総額 | 12,377,765,592円 |
| 純資産総額（ - ） | 261,971,840,505円 |
| 発行済数量 | 227,429,630,174口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1519円 |

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

| 項 目 | 金額又は口数 |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 426,624,157,304円 |
| 負債総額 | 10,411,275,000円 |
| 純資産総額（ - ） | 416,212,882,304円 |
| 発行済数量 | 368,044,141,949口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1309円 |

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

| 項 目 | 金額又は口数 |
|------|------------------|
| 資産総額 | 375,985,327,271円 |
| 負債総額 | 105,496,000円 |

| | |
|----------------|------------------|
| 純資産総額（ - ） | 375,879,831,271円 |
| 発行済数量 | 323,584,370,149口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1616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>

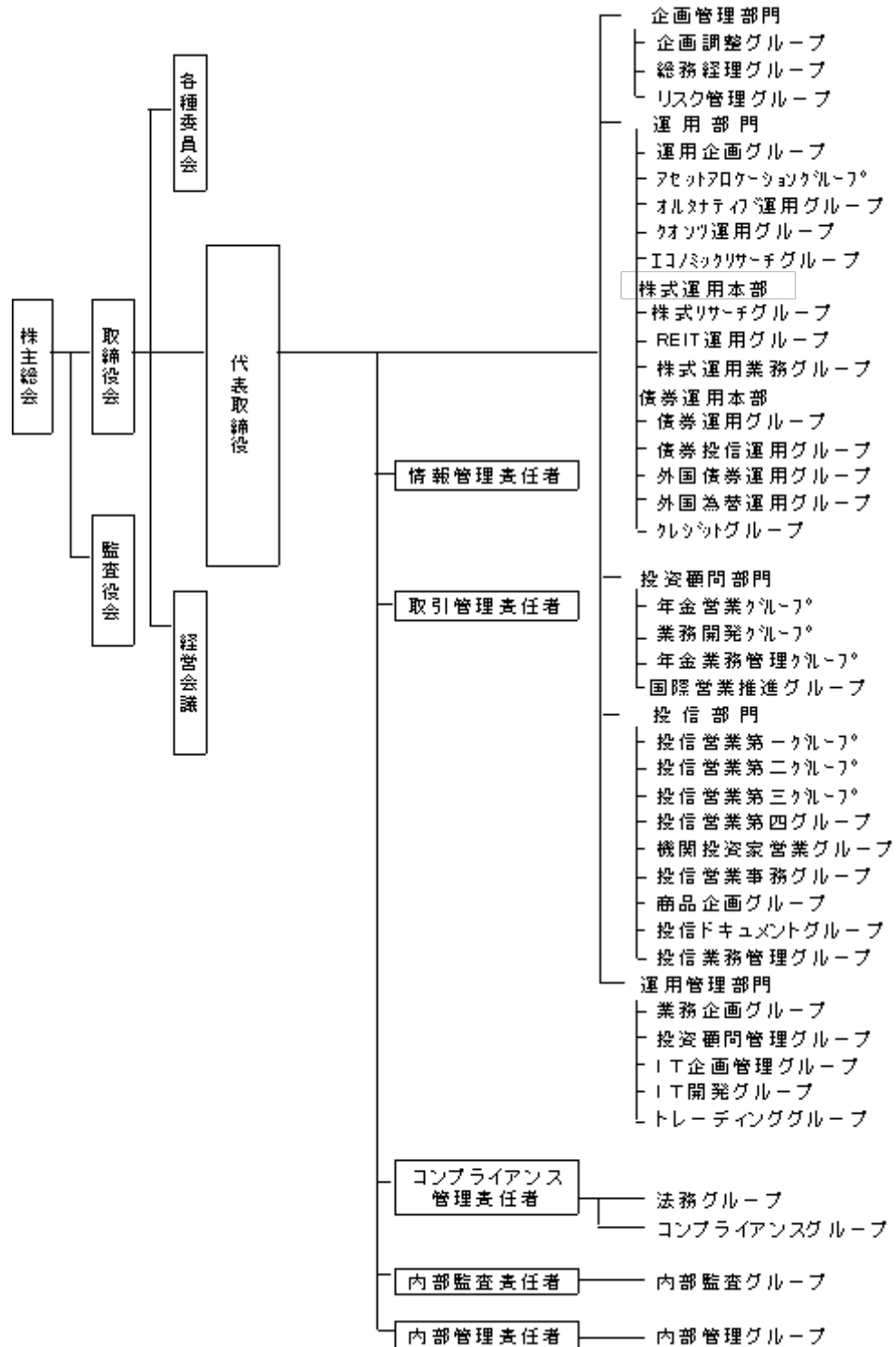
(1) 資本金の額

| | |
|---------------|---------|
| 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

会社の組織図



上記組織は、平成23年8月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

会社の意思決定機構

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

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

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

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

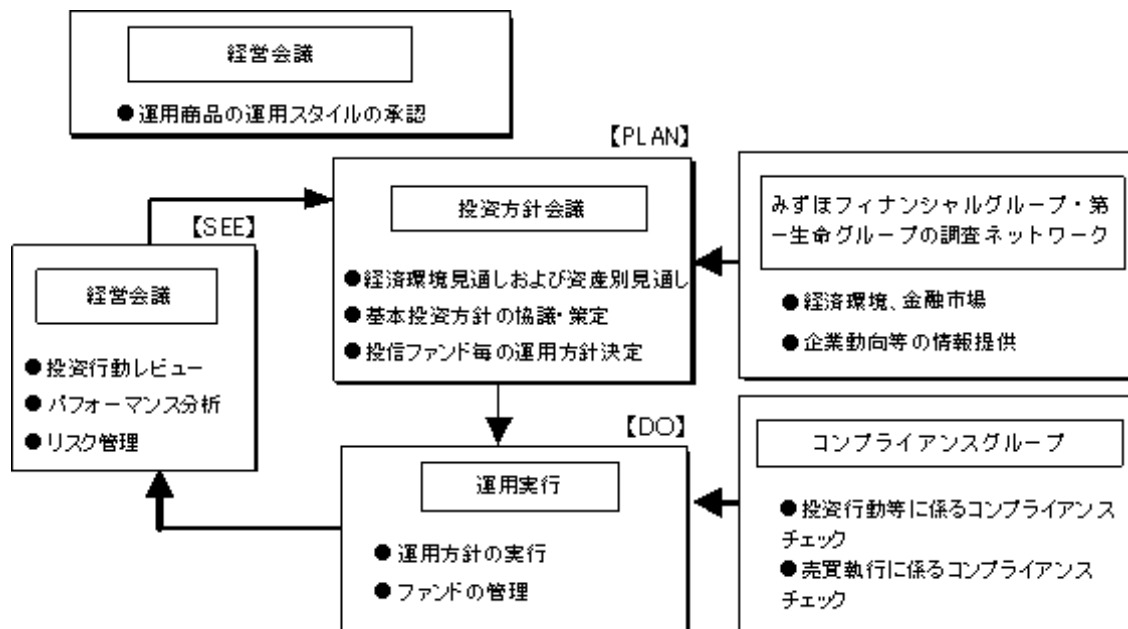
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成23年8月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は280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 | 16 | 31,401,449,278 |
| 追加型株式投資信託 | 251 | 4,097,938,081,757 |
| 単位型公社債投資信託 | 12 | 76,337,182,227 |
| 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 | 301,610,059 |
| 合計 | 280 | 4,205,978,323,321 |

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。
なお、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23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ております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 第25期 (平成22年3月31日現在) | 第26期 (平成23年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 13,820,588 | 12,220,759 |
| 金銭の信託 | 399,833 | 5,967,344 |
| 前払費用 | 33,221 | 27,593 |
| 未収委託者報酬 | 3,169,323 | 2,942,180 |
| 未収運用受託報酬 | 1,000,785 | 1,061,935 |
| 未収投資助言報酬 | 2 271,577 | 2 267,240 |
| 未収収益 | 247,552 | 186,483 |
| 繰延税金資産 | 383,608 | 403,201 |
| その他 | 21,009 | 102,404 |
| 流動資産計 | 19,347,501 | 23,179,143 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1 237,642 | 1 183,704 |
| 器具備品 | 1 351,237 | 1 206,306 |
| 建設仮勘定 | 10,541 | 10,956 |
| 無形固定資産 | | |
| 商標権 | 1 804 | 1 510 |
| ソフトウェア | 1 557,870 | 1 780,190 |
| ソフトウェア仮勘定 | 397,829 | 478,971 |
| 電話加入権 | 7,148 | 7,148 |
| 電話施設利用権 | 1 531 | 1 451 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 1,194,081 | 604,498 |
| 関係会社株式 | 2,161,144 | 2,457,319 |
| 繰延税金資産 | 403,908 | 402,191 |
| 長期差入保証金 | 1,187,070 | 702,696 |
| その他 | 328,612 | 85,690 |
| 貸倒引当金 | 26,925 | - |
| 固定資産計 | 6,811,497 | 5,920,638 |
| 資産合計 | 26,158,999 | 29,099,782 |

（単位：千円）

| | 第25期 （平成22年3月31日現在） | 第26期 （平成23年3月31日現在） |
|--------------|------------------------|------------------------|
| （負債の部） | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 119,466 | 120,910 |
| 未払金 | 1,526,031 | 1,479,756 |
| 未払収益分配金 | 7,837 | 3,223 |
| 未払償還金 | 96,340 | 98,362 |
| 未払手数料 | 1,206,815 | 1,134,992 |
| その他未払金 | 215,038 | 243,178 |
| 未払費用 | 2 1,522,325 | 2 1,226,658 |
| 未払法人税等 | 1,283,275 | 1,706,391 |
| 未払消費税等 | 113,923 | 143,728 |
| 賞与引当金 | 572,614 | 575,326 |
| その他 | 38,231 | 10,000 |
| 流動負債計 | 5,175,867 | 5,262,771 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 488,790 | 579,063 |
| 役員退職慰労引当金 | 96,342 | 100,260 |
| 固定負債計 | 585,133 | 679,324 |
| 負債合計 | 5,761,000 | 5,942,095 |
| （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 | 15,737,995 | 18,512,674 |
| 利益準備金 | 123,293 | 123,293 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 11,650,000 | 13,430,000 |
| 研究開発積立金 | 300,000 | 300,000 |
| 運用責任準備積立金 | 200,000 | 200,000 |
| 繰越利益剰余金 | 3,464,702 | 4,459,380 |
| 株主資本計 | 20,166,473 | 22,941,152 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 231,525 | 216,534 |
| 評価・換算差額等計 | 231,525 | 216,534 |
| 純資産合計 | 20,397,999 | 23,157,686 |
| 負債・純資産合計 | 26,158,999 | 29,099,782 |

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

| | 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | | 第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) | |
|-------------|-------------------------------------|------------|-------------------------------------|------------|
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | | 26,734,588 | | 24,367,005 |
| 運用受託報酬 | | 4,297,349 | | 4,458,894 |
| 投資助言報酬 | | 1,027,153 | | 1,019,727 |
| その他営業収益 | | 723,055 | | 789,867 |
| 営業収益計 | | 32,782,146 | | 30,635,495 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | | 13,000,141 | | 10,405,593 |
| 広告宣伝費 | | 218,782 | | 272,928 |
| 公告費 | | 1,767 | | 2,297 |
| 調査費 | | 5,056,427 | | 4,755,890 |
| 調査費 | | 2,555,070 | | 2,611,173 |
| 委託調査費 | | 2,501,356 | | 2,144,716 |
| 委託計算費 | | 351,370 | | 338,206 |
| 営業雑経費 | | 679,608 | | 671,721 |
| 通信費 | | 32,088 | | 30,286 |
| 印刷費 | | 613,198 | | 585,041 |
| 協会費 | | 21,225 | | 23,561 |
| 諸会費 | | 41 | | 38 |
| 支払販売手数料 | | 13,054 | | 32,794 |
| 営業費用計 | | 19,308,097 | | 16,446,637 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | | 4,678,614 | | 4,576,265 |
| 役員報酬 | 1 | 244,725 | 1 | 235,289 |
| 給料・手当 | | 3,840,052 | | 3,768,114 |
| 賞与 | | 593,836 | | 572,860 |
| 交際費 | | 45,342 | | 38,997 |
| 寄付金 | | 3,450 | | 13,335 |
| 旅費交通費 | | 269,516 | | 255,190 |
| 租税公課 | | 85,030 | | 89,571 |
| 不動産賃借料 | | 791,980 | | 718,929 |
| 退職給付費用 | | 132,513 | | 139,773 |
| 固定資産減価償却費 | | 397,252 | | 486,987 |
| 福利厚生費 | | 22,233 | | 20,476 |
| 修繕費 | | 5,615 | | 20,842 |
| 賞与引当金繰入 | | 572,614 | | 575,326 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | | 45,086 | | 42,036 |
| 役員退職金 | | 18,129 | | 13,140 |
| 機器リース料 | | 2,191 | | 1,951 |
| 事務委託費 | | 285,449 | | 331,935 |
| 消耗品費 | | 78,753 | | 70,952 |
| 器具備品費 | | 2,046 | | 575 |
| 諸経費 | | 88,728 | | 124,218 |
| 一般管理費計 | | 7,524,549 | | 7,520,506 |
| 営業利益 | | 5,949,500 | | 6,668,351 |

（単位：千円）

| | 第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日） | | 第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日） | |
|--------------|-------------------------------------|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 営業外収益 | | | | |
| 受取配当金 | 5,287 | | 4 | 341,775 |
| 受取利息 | 18,745 | | | 9,168 |
| 時効成立分配金 | 157 | | | 2,574 |
| 投資信託解約益 | 559,971 | | | 157,213 |
| 先物利益 | - | | | 9,816 |
| 金銭の信託運用益 | - | | | 69,014 |
| 雑収入 | 3,431 | | | 8,602 |
| 営業外収益計 | | 587,592 | | 598,165 |
| 営業外費用 | | | | |
| 為替差損 | 17,771 | | | 755 |
| 時効成立後支払分配金 | 444 | | | - |
| 先物損失 | 719,577 | | | - |
| 金銭の信託運用損 | 1,116 | | | - |
| 雑損失 | - | | | 6,089 |
| 営業外費用計 | | 738,911 | | 6,844 |
| 経常利益 | | 5,798,181 | | 7,259,672 |
| 特別利益 | | | | |
| 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 |
| 特別損失 | | | | |
| 固定資産除却損 | 2 | 21,626 | 2 | 31,419 |
| 固定資産売却損 | | 2,464 | | 1,440 |
| 関係会社株式評価損 | | - | | 3,825 |
| 特別損失計 | | 24,090 | | 36,684 |
| 税引前当期純利益 | | 5,774,091 | | 7,332,518 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 2,508,095 | | 2,885,426 |
| 法人税等調整額 | | 135,267 | | 7,586 |
| 法人税等合計 | | 2,372,828 | | 2,877,839 |
| 当期純利益 | | 3,401,263 | | 4,454,678 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

| | 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | 第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 前期末残高 | 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 | | |
| 前期末残高 | 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 | | |
| 前期末残高 | 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 | | |
| 前期末残高 | 10,040,000 | 11,650,000 |
| 当期変動額 | 1,610,000 | 1,780,000 |
| 当期末残高 | 11,650,000 | 13,430,000 |
| 研究開発積立金 | | |
| 前期末残高 | 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 | | |
| 前期末残高 | 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 | | |
| 前期末残高 | 3,299,438 | 3,464,702 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,626,000 | 1,680,000 |
| 別途積立金の積立 | 1,610,000 | 1,780,000 |
| 当期純利益 | 3,401,263 | 4,454,678 |
| 当期末残高 | 3,464,702 | 4,459,380 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 前期末残高 | 13,962,732 | 15,737,995 |
| 当期変動額 | 1,775,263 | 2,774,678 |
| 当期末残高 | 15,737,995 | 18,512,674 |
| 株主資本合計 | | |
| 前期末残高 | 18,391,210 | 20,166,473 |
| 当期変動額 | 1,775,263 | 2,774,678 |
| 当期末残高 | 20,166,473 | 22,941,152 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 前期末残高 | 1,547 | 231,525 |
| 当期変動額(純額) | 233,073 | 14,991 |
| 当期末残高 | 231,525 | 216,534 |
| 純資産合計 | | |
| 前期末残高 | 18,389,662 | 20,397,999 |
| 当期変動額 | 2,008,336 | 2,759,687 |
| 当期末残高 | 20,397,999 | 23,157,686 |

[次へ](#)

重要な会計方針

| <p style="text-align: center;">第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）</p> | <p style="text-align: center;">第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）</p> |
|---|--|
| <p>1.有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法</p> <p>（2）其他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2.金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>3.デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>4.固定資産の減価償却の方法</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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</p> <p>5.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>6.引当金の計上基準</p> <p>（1）貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>（2）賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> | <p>1.有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式 同左</p> <p>（2）其他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2.金銭の信託の評価基準及び評価方法 同左</p> <p>3.デリバティブの評価基準及び評価方法 同左</p> <p>4.固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>（2）無形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>（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） 同左</p> <p>5.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>6.引当金の計上基準</p> <p>（1）同左</p> <p>（2）同左</p> |

| | |
|--|--|
| <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準委員会平成20年7月31日 企業会計基準第19号)を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>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日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>8. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p> | <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <hr/> <p>(4) 同左</p> <p>7. リース取引の処理方法 同左</p> <p>8. 消費税等の処理方法 同左</p> |
|--|--|

追加情報

| 第25期（平成22年3月31日現在） | 第26期（平成23年3月31日現在） |
|--|--------------------|
| <p>当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p> | <hr/> |

注記事項

(貸借対照表関係)

| 第25期（平成22年3月31日現在） | | | 第26期（平成23年3月31日現在） | | |
|--|-----------|-----------|--|-----------|-----------|
| 1. 固定資産の減価償却累計額 | | | 1. 固定資産の減価償却累計額 | | |
| 建物 | 471,484千円 | | 建物 | 484,832千円 | |
| 器具備品 | 356,326千円 | | 器具備品 | 499,620千円 | |
| 商標権 | 6,882千円 | | 商標権 | 2,428千円 | |
| ソフトウェア | 684,370千円 | | ソフトウェア | 809,403千円 | |
| 電話施設利用権 | 1,065千円 | | 電話施設利用権 | 1,145千円 | |
| 2. 関係会社項目 | | | 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。 | | | 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。 | | |
| 流動資産 | 未収投資助言報酬 | 270,492千円 | 流動資産 | 未収投資助言報酬 | 266,194千円 |
| 流動負債 | 未払費用 | 400,075千円 | 流動負債 | 未払費用 | 291,628千円 |

(損益計算書関係)

| 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | 第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) |
|-------------------------------------|---|
| 1. 役員報酬の限度額 | 1. 役員報酬の限度額 |
| 取締役 年額250,000千円 | 同左 |
| 監査役 年額 50,000千円 | |
| 2. 固定資産除却損の内訳 | 2. 固定資産除却損の内訳 |
| 建物 1,199千円 | 建物 15,317千円 |
| 器具備品 15,159千円 | 器具備品 3,597千円 |
| ソフトウェア 5,267千円 | ソフトウェア 12,503千円 |
| | 3. 過年度損益修正益の内訳 |
| | 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。 |
| | 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。 |
| | 受取配当金 331,240千円 |
| | 過年度損益修正益 105,241千円 |

（株主資本等変動計算書関係）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の 種類 | 配当金の 総額 (千円) | 1株当たり 配当額 (円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-----------|--------------------|---------------------|------------|------------|
| 平成21年6月29日 定時株主総会 | 普通 株式 | 1,626,000 | 67,750 | 平成21年3月31日 | 平成21年6月30日 |

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

| 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22年6月30日 定時株主総会 | 普通 株式 | 利益剰 余金 | 1,680,000 | 70,000 | 平成22年3月31日 | 平成22年7月1日 |

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 | 前事業年度末 株式数（株） | 当事業年度 増加株式数（株） | 当事業年度 減少株式数（株） | 当事業年度末 株式数（株） |
|----------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式 | 24,000 | - | - | 24,000 |
| 合計 | 24,000 | - | - | 24,000 |

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

平成23年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(リース取引関係)

| 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | | | | 第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) | | | |
|---|----------|----------|----------|--|----------|----------|----------|
| 1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 | | | | 1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 | | | |
| | 器具備品 | その他 | 合計 | | 器具備品 | その他 | 合計 |
| 取得価額相当額 | 90,601千円 | - | 90,601千円 | 取得価額相当額 | 46,681千円 | - | 46,681千円 |
| 減価償却累計額 相当額 | 75,063千円 | - | 75,063千円 | 減価償却累計額 相当額 | 46,138千円 | - | 46,138千円 |
| 期末残高相当額 | 15,538千円 | - | 15,538千円 | 期末残高相当額 | 543千円 | - | 543千円 |
| 未経過リース料期末残高相当額 | | | | 未経過リース料期末残高相当額 | | | |
| | 1年以内 | 1年超 | 合計 | | 1年以内 | 1年超 | 合計 |
| 未経過リース料 期末残高相当額 | 15,764千円 | 586千円 | 16,350千円 | 未経過リース料 期末残高相当額 | 586千円 | - | 586千円 |
| 当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額 | | | | 当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額 | | | |
| 支払リース料 | | 24,096千円 | | 支払リース料 | | 15,998千円 | |
| 減価償却費相当額 | | 22,727千円 | | 減価償却費相当額 | | 14,995千円 | |
| 支払利息相当額 | | 845千円 | | 支払利息相当額 | | 234千円 | |
| 減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする 定額法によっております。 | | | | 減価償却費相当額の算定方法 同左 | | | |
| 利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との 差額を利息相当額とし、各期への配分方法につい ては、利息法によっております。 | | | | 利息相当額の算定方法 同左 | | | |
| 2. オペレーティング・リース取引 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 | | | | 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 | | | |
| | 1年以内 | 1年超 | 合計 | | 1年以内 | 1年超 | 合計 |
| | 1,609千円 | 1,475千円 | 3,084千円 | | 1,475千円 | - | 1,475千円 |

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(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

投資有価証券及び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であり、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貸契約に基づき差し入れた敷金・保証金であります。

デリバティブ取引は、投資有価証券及び金銭の信託に係る為替及び市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引及び株価指数先物取引等であります。

(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。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|-----------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金 | 13,820,588 | 13,820,588 | - |
| (2) 金銭の信託 | 399,833 | 399,833 | - |
| (3) 投資有価証券 その他有価証券 | 1,111,335 | 1,111,335 | - |
| (4) 長期差入保証金 | 61,485 | 61,485 | - |
| 資産計 | 15,393,243 | 15,393,243 | - |
| (1) 未払法人税等 | 1,283,275 | 1,283,275 | - |
| 負債計 | 1,283,275 | 1,283,275 | - |
| デリバティブ取引(*) | (38,094) | (38,094) | - |

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

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。

(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。

(4) 長期差入保証金

長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、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。

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）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（貸借対照表計上額2,161,144千円）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。

長期差入保証金のうち、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・保証金等（貸借対照表計上額1,125,584千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

| | 1年以内 (千円) | 1年超5年以内 (千円) | 5年超10年以内 (千円) | 10年超 (千円) |
|-------------------------------------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| (1) 預金 | 13,819,459 | - | - | - |
| (2) 投資有価証券 その他有価証券のうち 満期があるもの | - | - | - | - |
| (3) 長期差入保証金(*) | 61,485 | - | - | - |
| 合計 | 13,880,945 | - | - | - |

(*) 長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である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・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

(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。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(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

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

| | 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 | - |

(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

非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）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（貸借対照表計上額2,457,319千円）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。

長期差入保証金のうち、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（貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

| | 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 | - | - | - |

(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)

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

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（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

| 区分 | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円） | 取得原価（千円） | 差額（千円） |
|--------------------------|----------------------------|----------|---------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | | | |
| 株式 | 368,968 | 146,101 | 222,866 |
| 債券 | - | - | - |
| その他（投資信託） | 716,414 | 544,802 | 171,611 |
| 小計 | 1,085,382 | 690,904 | 394,477 |
| 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） | 25,953 | 30,000 | 4,047 |
| 小計 | 25,953 | 30,000 | 4,047 |
| 合計 | 1,111,335 | 720,904 | 390,430 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

| 売却額（千円） | 売却益の合計（千円） | 売却損の合計（千円） |
|-----------|------------|------------|
| 2,070,000 | 563,988 | 4,017 |

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

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（貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

| 区 分 | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円） | 取得原価（千円） | 差額（千円） |
|--------------------------|----------------------------|----------|---------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | | | |
| 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。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

| 売却額（千円） | 売却益の合計（千円） | 売却損の合計（千円） |
|---------|------------|------------|
| 719,016 | 162,043 | 4,830 |

（金銭の信託関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

| | 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 | 399,833 | 838 |

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。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

| | 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 |

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）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

| 区分 | 種類 | 第25期(平成22年3月31日現在) | | | |
|-------------------|--------------|--------------------|-------------------|------------|--------------|
| | | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超(千円) | 時価 (千円) | 評価損益 (千円) |
| 市場取引 以外の 取引 | 為替予約取引 売建 | | | | |
| | 米ドル | 22,960 | - | 743 | 743 |
| | 香港ドル | 27,416 | - | 264 | 264 |
| | 豪ドル | 101,481 | - | 1,076 | 1,076 |
| | シンガポールドル | 14,547 | - | 154 | 154 |
| | 合計 | 166,405 | - | 2,238 | 2,238 |

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

| 区分 | 種類 | 第25期(平成22年3月31日現在) | | | |
|----------|----------------|--------------------|-------------------|------------|--------------|
| | | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超(千円) | 時価 (千円) | 評価損益 (千円) |
| 市場 取引 | 株価指数先物取引 売建 | 561,971 | - | 29,413 | 29,413 |
| | 合計 | 561,971 | - | 29,413 | 29,413 |

（注2）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 不動産投資信託関連

| 区分 | 種類 | 第25期(平成22年3月31日現在) | | | |
|------|------------------|--------------------|-------------------|------------|--------------|
| | | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超(千円) | 時価 (千円) | 評価損益 (千円) |
| 市場取引 | REIT指数先物取引 売建 | 104,418 | - | 6,442 | 6,442 |
| 合計 | | 104,418 | - | 6,442 | 6,442 |

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

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。

第26期（平成23年3月31日現在）

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）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

| | 第25期 (平成22年3月31日現在) | (千円) |
|-----------------|------------------------|------|
| (1) 退職給付債務 | 530,305 | |
| (2) 未認識数理計算上の差異 | 41,515 | |
| 退職給付引当金 | 488,790 | |

3. 退職給付費用に関する事項

| | 第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | (千円) |
|--------------------|-------------------------------------|------|
| (1) 勤務費用 | 82,653 | |
| (2) 利息費用 | 6,471 | |
| (3) 数理計算上の差異の費用処理額 | 5,402 | |
| (4) 確定拠出年金 拠出額 | 37,987 | |
| 退職給付費用 | 132,513 | |

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

| | 第25期 (平成22年3月31日) |
|----------------------|----------------------|
| (1) 割引率(%) | 1.5 |
| (2) 退職給付見込額の期間配分方法 | 期間定額基準 |
| (3) 数理計算上の差異の処理年数(年) | 5 |

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

| | 第26期 (平成23年3月31日現在) (千円) | |
|-----------------|-----------------------------|--|
| (1) 退職給付債務 | 636,624 | |
| (2) 未認識数理計算上の差異 | 57,560 | |
| | <hr/> | |
| 退職給付引当金 | 579,063 | |

3. 退職給付費用に関する事項

| | 第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) (千円) | |
|--------------------|--|--|
| (1) 勤務費用 | 85,216 | |
| (2) 利息費用 | 7,954 | |
| (3) 数理計算上の差異の費用処理額 | 9,383 | |
| (4) 確定拠出年金 拠出額 | 37,218 | |
| | <hr/> | |
| 退職給付費用 | 139,773 | |

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

| | 第26期 (平成23年3月31日) |
|----------------------|----------------------|
| (1) 割引率(%) | 1.5 |
| (2) 退職給付見込額の期間配分方法 | 期間定額基準 |
| (3) 数理計算上の差異の処理年数(年) | 5 |

（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25期 | 第26期 |
|-----------------|----------------|----------------|
| | (平成22年3月31日現在) | (平成23年3月31日現在) |
| | (千円) | (千円) |
| 繰延税金資産 | | |
| 未払事業税 | 108,541 | 128,299 |
| 未払事業所税 | 6,290 | 6,141 |
| 賞与引当金 | 233,054 | 234,157 |
| 未払法定福利費 | 26,912 | 28,823 |
| 未払確定拠出年金掛金 | 2,712 | 2,739 |
| 減価償却超過額 | 17,598 | 36,256 |
| 減価償却超過額（一括償却資産） | 6,098 | 3,039 |
| 繰延資産償却超過額（税法上） | 89,657 | 139,027 |
| 退職給付引当金 | 198,937 | 235,678 |
| 役員退職慰労引当金 | 39,211 | 40,806 |
| ゴルフ会員権評価損 | 5,577 | 5,577 |
| 投資有価証券評価損 | 66,421 | 763 |
| 関係会社株式評価損 | - | 1,556 |
| 貸倒引当金繰入額 | 14,840 | - |
| 繰延税金資産合計 | 815,851 | 862,867 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 28,334 | 57,474 |
| 繰延税金負債合計 | 28,334 | 57,474 |
| 差引繰延税金資産の純額 | 787,517 | 805,393 |

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

第25期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第26期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(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。

(追加情報)

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

(関連当事者との取引)

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主等

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容又 は職業 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引 金額 (千円) | 科目 | 期末 残高 (千円) |
|----------------------|--------------------|-----------------|--------------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------|------------------|------------------|
| | | | | | | 役員の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| その 他の 関係 会社 | 第一生命 保険相互 会社 | 東京都 千代田 区 | 4,200億円 (基金償却 積立金) | 生命保 険業 | (被所有) 直接50% | 兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名 | 資産の運 用及び助 言、当社 設定投信 の販売 | 資産運用の 助言の顧問 料の受入 | 711,279 | 未収投 資助言 報酬 | 190,025 |
| | | | | | | | | 販売手数料 の支払 | 13,054 | | |
| | | | | | | | | 保険料の支 払 | 6,572 | | |

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

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

(注5) 平成22年4月1日付にて、第一生命保険相互会社は、相互会社から株式会社へ組織変更しております。新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

(2)子会社等

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容又 は職業 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引 金額 (千円) | 科目 | 期末 残高 (千円) |
|-------------|------------------------------|-----------------------------|------------------|-------------------|----------------------------|------------|-------------------|------------------------------|------------------|----------|------------------|
| | | | | | | 役員の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 子 会 社 | DIAM International Ltd | London United kingdom | 4,000 千GBP | 資産の 運用 | (所有) 直接100% | 兼務 2名 | 当社預 り資産 の運用 | 当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 | 785,924 | 未払 費用 | 296,169 |
| | 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 | 244,629 | 未払 費用 | 98,673 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

| 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 | 1,434,905 | 未払手 数料 | 122,995 |
| | | | | | | | | 預金の預入 (純額) | 90,148 | 現金・ 預金 | 412,513 |
| | | | | | | | | 受取利息 | 199 | 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 | 613,204 | 未払手 数料 | 104,436 |
| | | | | | | | | 預金の預入 (純額) | 1,133,958 | 現金・ 預金 | 12,572,634 |
| | | | | | | | | 受取利息 | 16,966 | 未収 収益 | 1,071 |
| | みずほ第 一ファイ ンシャル テクノロ ジー株式 会社 | 東京都 千代田 区 | 2億円 | 金融 技術 研究等 | - | - | 当社預り 資産の運 用 | 当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 | 247,604 | 未払 費用 | 113,245 |
| | | | | | | | | 業務委託料 の支払 | 48,770 | 未払 費用 | 36,277 |
| | 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) | 401,000 | 金銭の 信託 | 399,833 |
| 信託報酬の 支払 | | | | | | | | 130 | | | |

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

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

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

(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。

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主等

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容又 は職業 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末 残高 (千円) |
|--------------|--------------------|-----------------|------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------|-----------------|------------------------|--------------|--------------|------------------|
| | | | | | | 役員の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 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 |

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

| 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 | - | - |

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

| 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 一ファイ ンシャル テクノロ ジー株式 会社 | 東京都 千代田 区 | 2億円 | 金融 技術 研究等 | - | - | 当社預り 資産の運 用 | 当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 | 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 | | | |

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

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

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税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25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日） | 第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日） |
|---|---|
| 1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債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。 | 1株当たり純資産額 964,903円60銭 1株当たり当期純利益金額 185,611円60銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債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）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25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日） | 第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日） |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益 | 3,401,263千円 | 4,454,678千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益 | 3,401,263千円 | 4,454,678千円 |
| 期中平均株式数 | 24,000株 | 24,000株 |

（重要な後発事象）

| 第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日） | 第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日） |
|-------------------------------------|-------------------------------------|
| _____ | _____ |

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1 名称、資本金の額及び事業の内容」につきまして、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1)受託会社

- a. 名称
みずほ信託銀行株式会社
- b. 資本金の額
平成23年3月31日現在 247,303百万円
- c. 事業の内容
日本において信託銀行業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

(平成23年3月末日現在)

| 名 称 | 資本金の額 (単位:百万円) | 事 業 の 内 容 |
|-------------------|-------------------|----------------------------------|
| 株式会社みずほコーポレート銀行 | 1,404,065 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 労働金庫連合会 | (1) 120,000 | 労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央機関です。 |
| 第一生命保険株式会社 | 210,200 | 日本において保険業務を営んでおります。 |
| 損保ジャパン D C 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)出資の総額

独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月12日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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バランス・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成23年2月26日から平成23年8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。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成23年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年2月26日から平成23年8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。

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23年10月12日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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バランス・ファンド< D C年金 > 2安定・成長型の平成23年2月26日から平成23年8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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2安定・成長型の平成23年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年2月26日から平成23年8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。

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3へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月12日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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バランス・ファンド< D C年金> 3成長型の平成23年2月26日から平成23年8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。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型の平成23年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年2月26日から平成23年8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。

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23年6月10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 | 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22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[ファンド監査報告書3へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月13日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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バランス・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成22年2月26日から平成22年8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。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1安定型の平成22年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年2月26日から平成22年8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。

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22年10月13日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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バランス・ファンド< D C年金 > 2安定・成長型の平成22年2月26日から平成22年8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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2安定・成長型の平成22年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年2月26日から平成22年8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。

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3へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月13日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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バランス・ファンド< D C年金> 3成長型の平成22年2月26日から平成22年8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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型の平成22年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年2月26日から平成22年8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。

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\(前期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30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 | 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21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[ファンド監査報告書3へ](#)