

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成28年11月25日
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 西 恵正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	上野 圭子
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【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】</b>	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
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】</b>	各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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28年5月25日付をもって提出した有価証券届出書（平成28年9月30日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書で訂正済。以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

## 2【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 3【投資リスク】

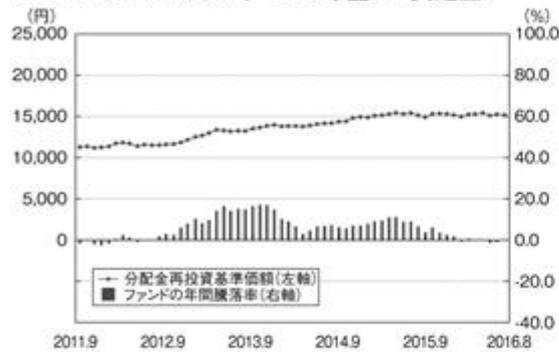
原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク（参考情報）」につきまして、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

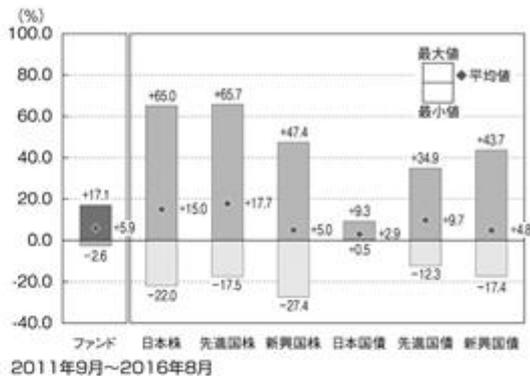
#### （参考情報）

##### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

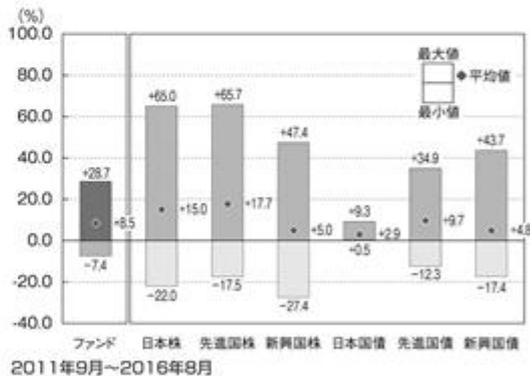
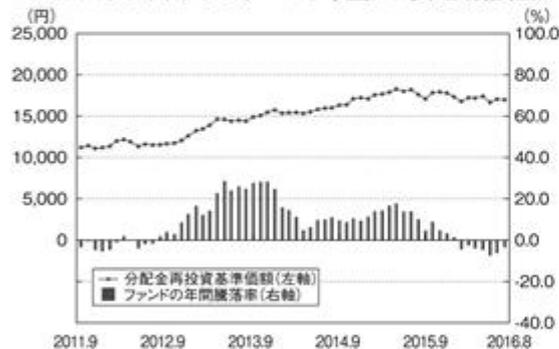
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型



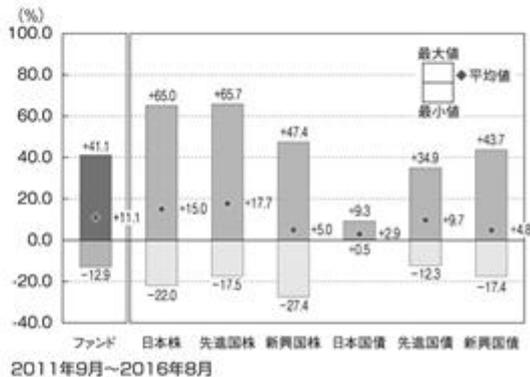
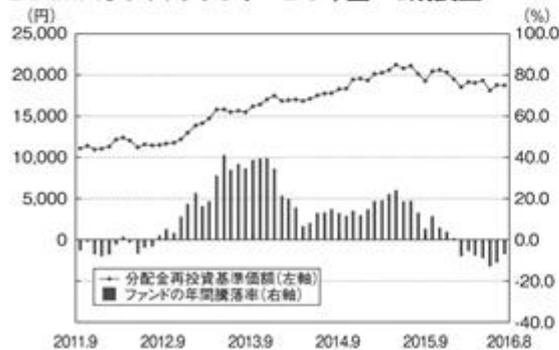
##### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型



DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型



\* ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。  
\* ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\* 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。  
\* 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

●各資産クラスの指数  
 日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)  
 先進国株……MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)  
 新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)  
 日本国債……NOMURA-BPI国債  
 先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)  
 (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

法人の受益者に対する課税

(略)

上記は、平成28年4月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

(略)

<訂正後>

(略)

法人の受益者に対する課税

(略)

上記は、平成28年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

(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・訂正いたします。

<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28年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	8,943,780,241	97.02
内 日本	8,943,780,241	97.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	274,249,140	2.98
純資産総額	9,218,029,381	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	19,367,843,099	97.04
内 日本	19,367,843,099	97.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	589,767,117	2.96
純資産総額	19,957,610,216	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	14,814,662,664	97.06
内 日本	14,814,662,664	97.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	448,132,511	2.94
純資産総額	15,262,795,175	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

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28年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	278,721,714,360	98.69
内 日本	278,721,714,360	98.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,704,639,094	1.31
純資産総額	282,426,353,454	100.00

その他資産の投資状況

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3,499,215,000	1.24
内 日本	3,499,215,000	1.24

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(注3) 先物取引の時価は、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で評価しています。

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	320,317,847,500	83.26
内 日本	320,317,847,500	83.26
地方債証券	23,784,731,349	6.18
内 日本	23,784,731,349	6.18
特殊債券	20,196,467,712	5.25
内 日本	20,196,467,712	5.25
社債券	18,359,961,280	4.77
内 日本	18,058,974,280	4.69
内 オランダ	201,118,000	0.05
内 イギリス	99,869,000	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,061,885,190	0.54
純資産総額	384,720,893,031	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	244,387,672,396	95.36
内 アメリカ	150,318,594,693	58.65
内 イギリス	18,351,240,402	7.16
内 スイス	9,910,234,608	3.87
内 カナダ	9,817,015,907	3.83
内 ドイツ	9,202,365,048	3.59
内 フランス	8,924,354,739	3.48
内 オーストラリア	6,508,489,973	2.54
内 オランダ	4,458,159,763	1.74
内 アイルランド	4,220,652,829	1.65
内 スペイン	3,052,958,605	1.19
内 スウェーデン	2,808,120,151	1.10
内 香港	2,390,423,833	0.93
内 デンマーク	1,876,158,460	0.73
内 イタリア	1,770,660,161	0.69
内 シンガポール	1,743,702,362	0.68
内 ジャージー	1,498,885,112	0.58
内 ベルギー	1,360,179,591	0.53
内 パミュータ	1,038,855,600	0.41

内	フィンランド	990,234,432	0.39
内	オランダ領キュラソー	921,230,264	0.36
内	イスラエル	686,705,793	0.27
内	ノルウェー	637,656,907	0.25
内	ケイマン諸島	637,614,456	0.25
内	ルクセンブルグ	281,610,890	0.11
内	オーストリア	189,332,939	0.07
内	ニュージーランド	185,788,781	0.07
内	パナマ	165,038,327	0.06
内	ポルトガル	156,506,524	0.06
内	リベリア	98,170,993	0.04
内	イギリス領バージン諸島	73,612,274	0.03
内	パプアニューギニア	62,477,893	0.02
内	マン島	32,052,148	0.01
内	モーリシャス	18,587,938	0.01
投資信託受益証券		875,029,212	0.34
内	オーストラリア	756,373,800	0.30
内	シンガポール	118,655,412	0.05
投資証券		6,161,237,997	2.40
内	アメリカ	5,333,909,289	2.08
内	フランス	374,452,870	0.15
内	イギリス	265,010,148	0.10
内	香港	134,086,610	0.05
内	カナダ	53,779,080	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,859,538,517	1.90
純資産総額		256,283,478,122	100.00

#### その他資産の投資状況

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	40,639,900	0.02
-	40,639,900	0.02
株価指数先物取引（買建）	4,736,589,028	1.85
内 アメリカ	3,198,229,188	1.25
内 ドイツ	822,798,306	0.32
内 イギリス	349,940,043	0.14
内 オーストラリア	190,407,190	0.07
内 カナダ	175,214,301	0.07

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（注4）先物取引の時価は、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で評価しています。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	254,100,288,436	97.36
内 アメリカ	109,276,805,463	41.87
内 フランス	25,852,755,585	9.91
内 イタリア	25,193,508,403	9.65
内 イギリス	20,838,249,322	7.98
内 ドイツ	19,068,710,058	7.31
内 スペイン	14,129,969,642	5.41
内 ベルギー	6,597,448,452	2.53
内 オランダ	5,942,751,534	2.28
内 カナダ	5,277,735,805	2.02
内 オーストラリア	4,849,450,152	1.86
内 オーストリア	3,890,318,515	1.49
内 メキシコ	2,132,647,378	0.82
内 アイルランド	1,945,156,020	0.75
内 デンマーク	1,623,218,827	0.62
内 フィンランド	1,450,605,312	0.56
内 ポーランド	1,385,119,237	0.53
内 スウェーデン	1,151,161,857	0.44
内 マレーシア	1,124,173,443	0.43
内 南アフリカ	1,014,423,449	0.39
内 シンガポール	811,786,824	0.31
内 ノルウェー	544,293,158	0.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,894,127,616	2.64
純資産総額	260,994,416,052	100.00

## その他資産の投資状況

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	8,563,110	0.00
-	8,563,110	0.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(注3) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	4,558,855,060	1.2843 5,855,163,793	1.3014 5,932,893,975	- -	64.36%
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	921,848,056	1.8882 1,740,637,051	1.9476 1,795,391,273	- -	19.48%
3	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	441,245,181	1.7642 778,452,568	1.6916 746,410,348	- -	8.10%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	183,832,208	2.4360 447,816,351	2.5517 469,084,645	- -	5.09%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28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) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	6,491,172,492	1.2835 8,331,857,041	1.3014 8,447,611,881	- -	42.33%
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	3,129,777,926	1.8916 5,920,320,597	1.9476 6,095,555,488	- -	30.54%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	948,006,195	2.4343 2,307,780,182	2.5517 2,419,027,407	- -	12.12%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,422,114,166	1.7664 2,512,098,709	1.6916 2,405,648,323	- -	12.05%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28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) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 3成長型

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,165,563,184	1.8952 5,999,595,402	1.9476 6,165,250,857	- -	40.39%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,554,420,292	1.2830 3,277,495,064	1.3014 3,324,322,568	- -	21.78%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,136,234,337	2.4381 2,770,314,331	2.5517 2,899,329,157	- -	19.00%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,434,003,359	1.7692 2,537,163,084	1.6916 2,425,760,082	- -	15.89%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.06%
合計	97.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 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28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,805,300	6,489.85 11,716,136,836	6,238.00 11,261,461,400	- -	3.99%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	11,214,900	534.86 5,998,455,918	564.10 6,326,325,090	- -	2.24%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	792,000	5,150.50 4,079,197,434	6,756.00 5,350,752,000	- -	1.89%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,080,500	5,282.81 5,708,076,661	4,546.00 4,911,953,000	- -	1.74%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,382,800	3,195.64 4,418,936,889	3,036.00 4,198,180,800	- -	1.49%
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,119,200	3,397.39 3,802,363,731	3,621.00 4,052,623,200	- -	1.43%

7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,274,500	3,106.46 3,959,193,600	3,170.00 4,040,165,000	- -	1.43%
8	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	20,091,300	180.08 3,618,209,584	179.70 3,610,406,610	- -	1.28%
9	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	879,400	4,635.41 4,076,388,197	4,008.00 3,524,635,200	- -	1.25%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	999,400	2,584.05 2,582,507,576	3,325.00 3,323,005,000	- -	1.18%
11	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,044,500	2,834.82 2,960,978,696	2,603.00 2,718,833,500	- -	0.96%
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	590,800	5,780.65 3,415,209,710	4,560.00 2,694,048,000	- -	0.95%
13	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	584,700	5,108.70 2,987,060,804	4,361.00 2,549,876,700	- -	0.90%
14	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,609,900	1,658.53 2,670,073,678	1,580.50 2,544,446,950	- -	0.90%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	143,600	16,400.39 2,355,096,206	17,630.00 2,531,668,000	- -	0.90%
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	32,100	58,581.30 1,880,459,996	72,530.00 2,328,213,000	- -	0.82%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	566,300	3,927.24 2,224,001,260	4,064.00 2,301,443,200	- -	0.81%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	256,800	10,802.28 2,774,025,608	8,860.00 2,275,248,000	- -	0.81%
19	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,048,800	1,871.61 1,962,954,713	2,155.50 2,260,688,400	- -	0.80%
20	キヤノン 日本	株式 電気機器	762,400	3,349.96 2,554,014,116	2,964.00 2,259,753,600	- -	0.80%
21	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	126,800	22,228.54 2,818,579,524	16,990.00 2,154,332,000	- -	0.76%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	149,400	13,863.72 2,071,239,782	13,905.00 2,077,407,000	- -	0.74%
23	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,511,000	1,146.04 1,731,681,480	1,350.50 2,040,605,500	- -	0.72%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,039,000	2,236.36 2,323,583,200	1,957.00 2,033,323,000	- -	0.72%
25	花王 日本	株式 化学	376,700	6,189.12 2,331,444,652	5,377.00 2,025,515,900	- -	0.72%
26	信越化学工業 日本	株式 化学	266,000	5,982.11 1,591,241,686	7,594.00 2,020,004,000	- -	0.72%
27	任天堂 日本	株式 その他製品	87,200	17,229.54 1,502,416,552	22,675.00 1,977,260,000	- -	0.70%
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	206,200	7,741.00 1,596,195,040	9,589.00 1,977,251,800	- -	0.70%
29	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,930,500	1,075.90 2,077,026,483	1,015.00 1,959,457,500	- -	0.69%
30	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	447,500	4,148.02 1,856,242,867	4,098.00 1,833,855,000	- -	0.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
株式	98.69%
合計	98.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成28年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.20%
輸送用機器		9.86%
情報・通信業		8.29%
銀行業		7.95%
化学		6.39%
医薬品		5.12%
機械		4.94%
食料品		4.65%
小売業		4.54%
卸売業		4.17%
陸運業		4.10%
サービス業		3.77%
建設業		2.99%
不動産業		2.50%
保険業		2.41%
電気・ガス業		1.81%
その他製品		1.80%
精密機器		1.50%
その他金融業		1.28%
鉄鋼		1.25%
証券、商品先物取引業		1.01%
ガラス・土石製品		0.91%
非鉄金属		0.91%
ゴム製品		0.86%
繊維製品		0.74%
金属製品		0.65%
空運業		0.57%
石油・石炭製品		0.45%
鉱業		0.31%
パルプ・紙		0.25%
海運業	0.22%	
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.09%	
合計		98.69%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資 比率
1	341回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	4,500,000,000	103.47 4,656,285,000	103.70 4,666,725,000	0.300000 2025/12/20	1.21%
2	343回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	4,500,000,000	102.99 4,634,870,000	101.67 4,575,465,000	0.100000 2026/6/20	1.19%

3	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	101.02 4,546,125,000	101.08 4,549,005,000	0.100000 2020/6/20	1.18%
4	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	100.96 4,543,290,000	0.100000 2019/12/20	1.18%
5	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	100.93 4,239,270,000	0.200000 2018/12/20	1.10%
6	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	102.02 4,081,115,000	101.73 4,069,240,000	0.100000 2026/3/20	1.06%
7	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.62 4,065,155,000	101.35 4,054,160,000	0.100000 2021/6/20	1.05%
8	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.06 4,042,440,000	101.16 4,046,480,000	0.100000 2020/9/20	1.05%
9	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.10 4,044,000,000	101.01 4,040,400,000	0.200000 2019/3/20	1.05%
10	366回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.57 4,023,110,000	100.58 4,023,200,000	0.100000 2018/7/15	1.05%
11	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	103.19 3,611,720,000	104.61 3,661,455,000	0.400000 2025/9/20	0.95%
12	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,650,000	101.11 3,538,850,000	0.200000 2019/6/20	0.92%
13	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	101.03 3,536,365,000	0.300000 2018/9/20	0.92%
14	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.00 3,535,210,000	101.03 3,536,225,000	0.100000 2020/3/20	0.92%
15	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,300,000,000	100.64 3,321,285,000	100.55 3,318,249,000	0.200000 2017/12/20	0.86%
16	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	103.03 3,297,024,000	102.24 3,271,872,000	1.500000 2017/12/20	0.85%
17	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,200,000,000	101.37 3,244,044,000	101.23 3,239,488,000	0.100000 2020/12/20	0.84%
18	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	106.73 3,201,990,000	1.300000 2021/3/20	0.83%
19	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	103.25 3,097,560,000	104.53 3,135,900,000	0.400000 2025/6/20	0.82%

20	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	101.57 3,047,255,000	101.28 3,038,490,000	0.100000 2021/3/20	0.79%
21	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	104.76 3,038,243,000	1.500000 2019/6/20	0.79%
22	310回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	104.83 2,935,352,000	1.000000 2020/9/20	0.76%
23	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	106.82 2,670,535,000	106.57 2,664,475,000	1.000000 2022/3/20	0.69%
24	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	105.48 2,637,240,000	105.69 2,642,250,000	0.600000 2023/12/20	0.69%
25	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	104.92 2,623,200,000	1.300000 2019/12/20	0.68%
26	143回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	2,100,000,000	116.03 2,436,735,000	123.11 2,585,331,000	1.600000 2033/3/20	0.67%
27	149回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	2,100,000,000	113.46 2,382,670,000	122.02 2,562,546,000	1.500000 2034/6/20	0.67%
28	365回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.84 2,521,025,000	100.55 2,513,850,000	0.100000 2018/6/15	0.65%
29	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	105.26 2,421,080,000	105.91 2,436,091,000	0.600000 2024/6/20	0.63%
30	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	104.41 2,401,614,000	103.68 2,384,686,000	1.400000 2018/12/20	0.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	83.26%
地方債証券	6.18%
特殊債券	5.25%
社債券	4.77%
合計	99.46%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	443,951	9,704.99 4,308,541,394	10,937.07 4,855,527,603	- -	1.89%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	601,435	5,212.96 3,135,262,336	5,973.09 3,592,425,504	- -	1.40%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	332,419	8,410.80 2,795,912,817	9,030.31 3,001,847,816	- -	1.17%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	221,142	10,574.51 2,338,469,536	12,326.91 2,725,998,548	- -	1.06%
5	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・カタ ログ販売	32,021	53,153.83 1,702,039,006	79,198.90 2,536,028,117	- -	0.99%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	746,641	2,926.83 2,185,296,973	3,236.75 2,416,695,184	- -	0.94%
7	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	183,515	10,634.94 1,951,671,555	12,984.17 2,382,790,177	- -	0.93%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	255,377	7,552.74 1,928,796,584	8,216.56 2,098,321,592	- -	0.82%
9	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	492,775	3,781.45 1,863,407,311	4,219.03 2,079,032,606	- -	0.81%
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	293,456	5,947.73 1,745,399,729	6,964.64 2,043,818,330	- -	0.80%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	386,036	4,877.59 1,882,927,777	5,222.97 2,016,255,064	- -	0.79%
12	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	24,944	70,521.55 1,759,089,548	79,354.70 1,979,423,791	- -	0.77%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	216,693	8,371.47 1,814,040,262	9,032.37 1,957,252,912	- -	0.76%
14	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	23,367	73,009.30 1,706,008,494	81,710.30 1,909,324,710	- -	0.75%
15	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	494,350	3,051.94 1,508,727,216	3,598.91 1,779,125,311	- -	0.69%
16	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	325,987	5,190.72 1,692,110,280	5,393.21 1,758,119,151	- -	0.69%

17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	150,426	8,899.24 1,338,677,652	10,493.40 1,578,481,090	- -	0.62%
18	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	182,053	7,493.98 1,364,302,726	8,190.34 1,491,077,242	- -	0.58%
19	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	95,531	13,294.97 1,270,082,118	15,500.73 1,480,800,371	- -	0.58%
20	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	329,545	4,453.67 1,467,685,576	4,461.50 1,470,266,072	- -	0.57%
21	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	222,237	5,091.16 1,131,446,039	6,470.41 1,437,966,240	- -	0.56%
22	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	56,214	25,650.32 1,441,907,113	25,472.92 1,431,934,893	- -	0.56%
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	101,309	12,105.88 1,226,435,467	13,836.43 1,401,755,697	- -	0.55%
24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	377,945	2,976.13 1,124,816,092	3,683.52 1,392,170,234	- -	0.54%
25	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	824,162	1,236.00 1,018,667,709	1,670.48 1,376,749,599	- -	0.54%
26	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	194,702	5,887.00 1,146,212,395	6,763.44 1,316,857,047	- -	0.51%
27	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	401,169	2,601.89 1,043,797,857	3,254.29 1,305,523,153	- -	0.51%
28	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	153,349	7,278.26 1,116,115,169	8,375.12 1,284,316,368	- -	0.50%
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	115,706	10,187.22 1,178,723,558	11,061.92 1,279,931,418	- -	0.50%
30	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	123,943	9,229.12 1,143,885,445	10,314.90 1,278,460,220	- -	0.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
株式	95.36%
投資信託受益証券	0.34%
投資証券	2.40%
合計	98.10%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成28年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	8.21%
医薬品		6.33%
石油・ガス・消耗燃料		6.32%
保険		3.91%
ソフトウェア		3.36%
インターネットソフトウェア・サービス		2.89%
各種電気通信サービス		2.77%
化学		2.64%
情報技術サービス		2.62%
メディア		2.53%
バイオテクノロジー		2.46%
食品		2.42%
飲料		2.41%
コンピュータ・周辺機器		2.40%
半導体・半導体製造装置		2.37%
食品・生活必需品小売り		2.07%
航空宇宙・防衛		2.03%
ヘルスケア機器・用品		1.99%
コングロマリット		1.97%
専門小売り		1.90%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.90%
電力		1.88%
資本市場		1.88%
ホテル・レストラン・レジャー		1.77%
タバコ		1.61%
家庭用品		1.59%
各種金融サービス		1.51%
インターネット販売・カタログ販売		1.46%
機械		1.39%
金属・鉱業		1.34%
繊維・アパレル・贅沢品		1.20%
総合公益事業		1.14%
自動車		0.94%
通信機器		0.87%
陸運・鉄道		0.84%
電気設備		0.76%
エネルギー設備・サービス		0.72%
パーソナル用品		0.70%
専門サービス		0.64%
航空貨物・物流サービス		0.59%
不動産管理・開発		0.56%
自動車部品		0.55%
消費者金融		0.51%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.48%
複合小売り		0.46%
家庭用耐久財		0.46%
商業サービス・用品		0.44%

電子装置・機器・部品	0.40%
無線通信サービス	0.39%
建設資材	0.36%
建設・土木	0.33%
容器・包装	0.32%
商社・流通業	0.31%
建設関連製品	0.28%
運送インフラ	0.24%
ガス	0.21%
旅客航空輸送業	0.13%
販売	0.10%
水道	0.10%
レジャー用品	0.08%
紙製品・林産品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
海運業	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.05%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
合計	95.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	2,115,190,000	101.46 2,146,214,678	101.14 2,139,303,166	1.375000 2018/9/30	0.82%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,857,240,000	109.69 2,037,299,418	108.84 2,021,475,733	3.625000 2020/2/15	0.77%
3	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,960,420,000	99.98 1,960,027,916	99.99 1,960,341,583	0.750000 2017/12/31	0.75%
4	US T N/B 1.875 09/30/17 アメリカ	国債証券	1,857,240,000	101.71 1,889,135,001	101.29 1,881,309,830	1.875000 2017/9/30	0.72%
5	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,702,470,000	106.17 1,807,529,423	105.89 1,802,745,483	2.625000 2020/8/15	0.69%
6	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,754,060,000	101.72 1,784,335,075	101.50 1,780,493,684	1.500000 2018/12/31	0.68%
7	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,754,060,000	99.70 1,748,920,604	99.88 1,751,990,209	0.500000 2017/7/31	0.67%
8	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	105.93 1,639,525,041	103.89 1,607,967,438	4.750000 2017/8/15	0.62%
9	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	103.65 1,604,231,290	102.87 1,592,242,806	2.375000 2018/6/30	0.61%
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	101.82 1,575,868,140	102.50 1,586,392,500	1.750000 2022/5/15	0.61%
11	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	102.58 1,587,768,921	102.17 1,581,424,383	1.750000 2023/5/15	0.61%
12	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,547,700,000	100.54 1,556,107,106	101.70 1,574,057,331	1.625000 2022/8/15	0.60%
13	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,444,520,000	109.57 1,582,760,564	108.83 1,572,143,342	3.500000 2020/5/15	0.60%
14	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,444,520,000	105.34 1,521,758,484	103.96 1,501,722,992	3.500000 2018/2/15	0.58%
15	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,379,400,000	108.32 1,494,193,553	106.55 1,469,805,876	4.500000 2018/2/1	0.56%
16	US T N/B 1.875 08/31/17 アメリカ	国債証券	1,444,520,000	101.71 1,469,279,072	101.20 1,461,955,356	1.875000 2017/8/31	0.56%
17	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,392,930,000	102.29 1,424,911,672	103.71 1,444,607,703	2.000000 2025/2/15	0.55%
18	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,341,340,000	106.89 1,433,865,633	105.96 1,421,283,864	3.125000 2019/5/15	0.54%
19	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,341,340,000	104.20 1,397,698,979	105.85 1,419,929,110	2.250000 2025/11/15	0.54%
20	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,392,930,000	100.85 1,404,783,834	101.14 1,408,809,402	1.375000 2020/5/31	0.54%
21	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,392,930,000	99.95 1,392,331,556	99.98 1,392,651,414	0.750000 2018/2/28	0.53%
22	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,310,386,000	104.09 1,364,020,098	104.44 1,368,632,657	2.125000 2021/12/31	0.52%
23	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,341,340,000	101.06 1,355,665,511	101.23 1,357,945,789	1.375000 2019/2/28	0.52%

24	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,310,386,000	101.79 1,333,900,102	101.35 1,328,089,314	1.500000 2018/8/31	0.51%
25	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	108.00 1,337,212,800	106.33 1,316,597,436	4.000000 2018/8/15	0.50%
26	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	105.27 1,303,528,657	104.60 1,295,177,268	2.750000 2019/2/15	0.50%
27	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	103.48 1,281,347,020	103.72 1,284,293,841	2.000000 2021/5/31	0.49%
28	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	101.92 1,262,019,343	103.68 1,283,810,959	2.000000 2025/8/15	0.49%
29	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,238,160,000	100.88 1,249,068,189	101.17 1,252,757,906	1.375000 2020/4/30	0.48%
30	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,186,570,000	104.38 1,238,566,013	104.80 1,243,572,822	2.250000 2021/3/31	0.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.36%
合計	97.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型  
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  
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  
該当事項はありません。

(参考)

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28年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	T O P I X 先物 2 8 0 9月	買建	263	3,430,173,812	3,499,215,000	1.24%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、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で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
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

平成28年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	オーストラリア・ドル 売/円買2016年0 9月	売建	380,000	29,449,240	29,446,200	0.01%
		ユーロ売/円買201 6年09月	売建	70,000	8,046,514	8,046,500	0.00%
		カナダ・ドル売/円買 2016年09月	売建	40,000	3,147,320	3,147,200	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 5 0 0 F U T U R E S e p 1 6	買建	57	3,179,630,993	3,198,229,188	1.25%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 S e p 1 6	買建	236	805,892,609	822,798,306	0.32%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E S e p 1 6	買建	38	343,315,778	349,940,043	0.14%
	シドニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S S e p 1 6	買建	18	188,591,518	190,407,190	0.07%
	モントリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T S e p 1 6	買建	13	172,680,483	175,214,301	0.07%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、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で評価しています。

(注3) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。  
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年09月	買建	83,000	8,563,151	8,563,110	0.00%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。  
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(平成28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。

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	2,669	2,669	1.2585	1.2585
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	3,305	3,305	1.2076	1.2076
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	3,259	3,259	1.0599	1.0599
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	3,884	3,884	1.1365	1.1365
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	4,419	4,419	1.1651	1.1651
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	4,993	4,993	1.1720	1.1720
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	5,846	5,846	1.2689	1.2689
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	6,797	6,797	1.3874	1.3874
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	8,185	8,185	1.5056	1.5056
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	8,608	8,608	1.4954	1.4954
平成27年8月末日	8,633	-	1.5133	-
9月末日	8,552	-	1.4896	-
10月末日	8,757	-	1.5289	-
11月末日	8,796	-	1.5335	-
12月末日	8,823	-	1.5301	-
平成28年1月末日	8,767	-	1.5156	-
2月末日	8,607	-	1.4963	-
3月末日	8,825	-	1.5237	-
4月末日	8,887	-	1.5265	-
5月末日	9,043	-	1.5402	-
6月末日	8,968	-	1.5096	-
7月末日	9,233	-	1.5247	-
8月末日	9,218	-	1.5154	-

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 2 安定・成長型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	6,979	6,979	1.4627	1.4627
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	8,199	8,199	1.3419	1.3419
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	7,395	7,395	1.0433	1.0433
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	9,529	9,529	1.1659	1.1659
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	10,826	10,826	1.2065	1.2065
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	11,905	11,905	1.1984	1.1984
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	14,251	14,251	1.3506	1.3506
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	16,454	16,454	1.5495	1.5495
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	19,545	19,545	1.7503	1.7503
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	18,932	18,932	1.6738	1.6738
平成27年8月末日	19,851	-	1.7597	-
9月末日	19,246	-	1.7084	-
10月末日	20,089	-	1.7827	-
11月末日	20,089	-	1.7921	-
12月末日	19,975	-	1.7779	-
平成28年1月末日	19,636	-	1.7326	-
2月末日	18,973	-	1.6770	-
3月末日	19,663	-	1.7215	-
4月末日	19,658	-	1.7177	-
5月末日	19,979	-	1.7393	-
6月末日	19,273	-	1.6659	-
7月末日	19,965	-	1.7047	-
8月末日	19,957	-	1.6980	-

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 3成長型

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (平成19年2月26日)	6,033	6,033	1.6848	1.6848
第5計算期間末 (平成20年2月25日)	7,103	7,103	1.4810	1.4810
第6計算期間末 (平成21年2月25日)	5,656	5,656	1.0219	1.0219
第7計算期間末 (平成22年2月25日)	7,667	7,667	1.1890	1.1890
第8計算期間末 (平成23年2月25日)	8,673	8,673	1.2395	1.2395
第9計算期間末 (平成24年2月27日)	9,234	9,234	1.2166	1.2166
第10計算期間末 (平成25年2月25日)	11,326	11,326	1.4236	1.4236
第11計算期間末 (平成26年2月25日)	13,230	13,230	1.7075	1.7075
第12計算期間末 (平成27年2月25日)	15,889	15,889	2.0030	2.0030
第13計算期間末 (平成28年2月25日)	14,524	14,524	1.8463	1.8463
平成27年8月末日	15,707	-	2.0121	-
9月末日	15,070	-	1.9266	-
10月末日	16,015	-	2.0446	-
11月末日	16,026	-	2.0598	-
12月末日	15,861	-	2.0321	-
平成28年1月末日	15,352	-	1.9481	-
2月末日	14,573	-	1.8523	-
3月末日	15,255	-	1.9151	-
4月末日	15,213	-	1.9032	-
5月末日	15,502	-	1.9333	-
6月末日	14,547	-	1.8113	-
7月末日	15,220	-	1.8770	-
8月末日	15,262	-	1.8733	-

## 【分配の推移】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 1 安定型

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	-

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 2 安定・成長型

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	-

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 3成長型

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	-

## 【収益率の推移】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 1安定型

	収益率(%)
第4計算期間	5.0
第5計算期間	4.0
第6計算期間	12.2
第7計算期間	7.2
第8計算期間	2.5
第9計算期間	0.6
第10計算期間	8.3
第11計算期間	9.3
第12計算期間	8.5
第13計算期間	0.7
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	1.0

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 2 安定・成長型

	収益率(%)
第4計算期間	8.2
第5計算期間	8.3
第6計算期間	22.3
第7計算期間	11.8
第8計算期間	3.5
第9計算期間	0.7
第10計算期間	12.7
第11計算期間	14.7
第12計算期間	13.0
第13計算期間	4.4
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	0.5

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金 &gt; 3 成長型

	収益率(%)
第4計算期間	11.3
第5計算期間	12.1
第6計算期間	31.0
第7計算期間	16.4
第8計算期間	4.2
第9計算期間	1.8
第10計算期間	17.0
第11計算期間	19.9
第12計算期間	17.3
第13計算期間	7.8
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	0.0

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型

	設定口数	解約口数
第4計算期間	746,595,858	341,955,723
第5計算期間	1,023,536,793	407,728,822
第6計算期間	808,835,748	470,954,147
第7計算期間	717,089,255	374,538,190
第8計算期間	717,088,658	341,609,549
第9計算期間	891,096,153	423,802,872
第10計算期間	792,020,789	445,175,024
第11計算期間	1,211,792,457	920,086,264
第12計算期間	1,286,101,728	748,268,806
第13計算期間	1,428,568,208	1,108,983,410
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	593,292,118	300,567,693

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型

	設定口数	解約口数
第4計算期間	1,520,234,750	462,264,605
第5計算期間	1,986,010,161	647,207,655
第6計算期間	1,694,085,942	716,280,777
第7計算期間	1,585,255,449	499,713,782
第8計算期間	1,458,689,281	659,115,611
第9計算期間	1,799,986,538	838,294,174
第10計算期間	1,442,236,754	824,908,601
第11計算期間	1,713,460,271	1,646,999,165
第12計算期間	1,739,079,770	1,190,841,426
第13計算期間	1,697,863,637	1,553,640,036
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	766,569,826	374,242,992

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型

	設定口数	解約口数
第4計算期間	1,327,156,219	491,810,911
第5計算期間	1,854,832,281	639,682,536
第6計算期間	1,377,219,073	638,023,646
第7計算期間	1,360,590,692	447,612,668
第8計算期間	1,167,657,064	618,314,729
第9計算期間	1,241,120,741	648,446,247
第10計算期間	1,210,113,248	844,741,332
第11計算期間	1,548,578,623	1,756,263,299
第12計算期間	1,448,206,115	1,263,916,173
第13計算期間	1,425,335,822	1,490,982,099
平成28年2月26日～ 平成28年8月25日	548,616,446	305,571,526

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2016年8月31日

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 1 安定型

## 基準価額・純資産の推移

(2006年8月31日~2016年8月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年12月13日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

期	日	金額
第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	64.36%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	19.48%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	8.10%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	5.09%

※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

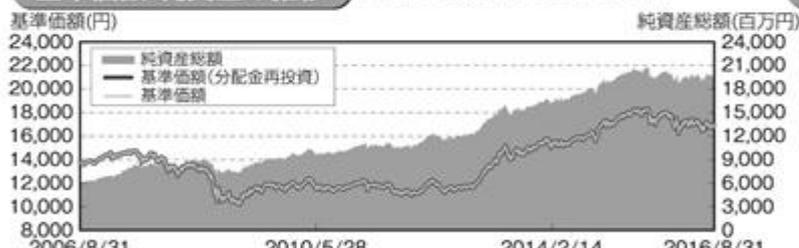


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。  
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 2 安定・成長型

## 基準価額・純資産の推移

(2006年8月31日~2016年8月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年12月13日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

期	日	金額
第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	42.33%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	30.54%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	12.12%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	12.05%

※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、2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

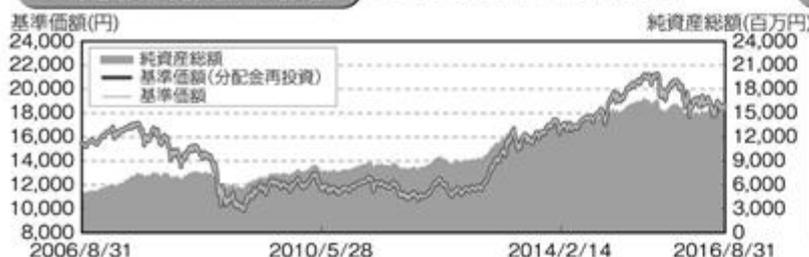
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2016年8月31日

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 3 成長型

基準価額・純資産の推移 (2006年8月31日～2016年8月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日2002年12月13日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

期	日付	金額
第9期	(2012.02.27)	0円
第10期	(2013.02.25)	0円
第11期	(2014.02.25)	0円
第12期	(2015.02.25)	0円
第13期	(2016.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

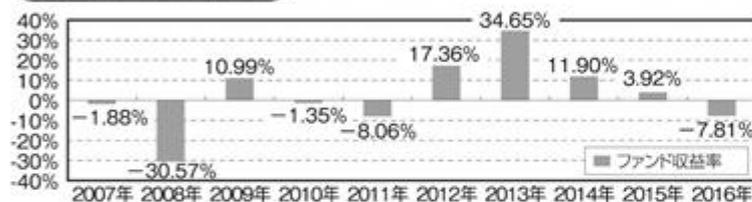
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	40.39%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.78%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.00%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.89%

※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、2016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

## ■国内株式パッシブ・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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.69
内 日本	98.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.31
純資産総額	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.24

## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.20%
2	輸送用機器	9.86%
3	情報・通信業	8.29%
4	銀行業	7.95%
5	化学	6.39%

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.99%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.24%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.89%
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.74%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.49%
6	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.43%
7	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.43%
8	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.28%
9	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.25%
10	ソニー	株式	日本	電気機器	1.18%

○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:2016年8月31日

## ■外国株式バッシュ・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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.36
内 アメリカ	58.65
内 イギリス	7.16
内 スイス	3.87
内 カナダ	3.83
内 ドイツ	3.59
内 その他	18.26
投資信託受益証券	0.34
内 オーストラリア	0.30
内 シンガポール	0.05
投資証券	2.40
内 アメリカ	2.08
内 フランス	0.15
内 イギリス	0.10
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.90
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	1.89%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.40%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油ガス・消耗燃料	1.17%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.06%
5	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・カタログ販売	0.99%
6	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.94%
7	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	0.93%
8	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.82%
9	AT&T INC	株式	アメリカ	各種電気通信サービス	0.81%
10	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.80%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	8.21%
2	医薬品	6.33%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.32%
4	保険	3.91%
5	ソフトウェア	3.36%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△0.02
株価指数先物取引(買建)	1.85

## ■国内債券バッシュ・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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	83.26
内 日本	83.26
地方債証券	6.18
内 日本	6.18
特殊債券	5.25
内 日本	5.25
社債券	4.77
内 日本	4.69
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.03
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.54
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	1.21%
2	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/6/20	1.19%
3	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.18%
4	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.18%
5	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.10%
6	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/3/20	1.06%
7	128回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2021/6/20	1.05%
8	125回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/20	1.05%
9	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.05%
10	366回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2018/7/15	1.05%

## ■外国債券バッシュ・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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.36
内 アメリカ	41.87
内 フランス	9.91
内 イタリア	9.65
内 イギリス	7.98
内 ドイツ	7.31
内 その他	20.64
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.64
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	0.82%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.77%
3	US T N/B 0.75 12/31/17	国債証券	アメリカ	0.750000	2017/12/31	0.75%
4	US T N/B 1.875 09/30/17	国債証券	アメリカ	1.875000	2017/9/30	0.72%
5	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.69%
6	US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	アメリカ	1.500000	2018/12/31	0.68%
7	US T N/B 0.5 07/31/17	国債証券	アメリカ	0.500000	2017/7/31	0.67%
8	US T N/B 4.75 08/15/17	国債証券	アメリカ	4.750000	2017/8/15	0.62%
9	US T N/B 2.375 06/30/18	国債証券	アメリカ	2.375000	2018/6/30	0.61%
10	US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	アメリカ	1.750000	2022/5/15	0.61%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.00

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

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、以下の内容を追加いたします。

<追加>

#### DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月26日から平成28年8月25日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任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】

## 【DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	281,775,214	-
コール・ローン	-	290,118,135
親投資信託受益証券	8,351,998,256	8,859,703,115
未収入金	11,082,000	-
流動資産合計	8,644,855,470	9,149,821,250
資産合計	8,644,855,470	9,149,821,250
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	23,791,516	3,962,669
未払受託者報酬	1,418,199	1,437,042
未払委託者報酬	10,873,110	11,017,607
その他未払費用	224,467	217,739
流動負債合計	36,307,292	16,635,057
負債合計	36,307,292	16,635,057
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 5,756,501,296	1 6,049,225,721
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,852,046,882	3,083,960,472
（分配準備積立金）	1,137,498,160	1,080,746,974
元本等合計	8,608,548,178	9,133,186,193
純資産合計	8,608,548,178	9,133,186,193
負債純資産合計	8,644,855,470	9,149,821,250

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第13期中間計算期間		第14期中間計算期間	
	自 平成27年2月26日	至 平成27年8月25日	自 平成28年2月26日	至 平成28年8月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		74,388		221
有価証券売買等損益		76,446,368		91,575,859
営業収益合計		76,371,980		91,576,080
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		78,334
受託者報酬		1,362,276		1,437,042
委託者報酬		10,444,338		11,017,607
その他費用		215,599		218,025
営業費用合計		12,022,213		12,751,008
営業利益又は営業損失( )		88,394,193		78,825,072
経常利益又は経常損失( )		88,394,193		78,825,072
中間純利益又は中間純損失( )		88,394,193		78,825,072
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( )		12,477,400		6,435,399
期首剰余金又は期首欠損金( )		2,748,864,299		2,852,046,882
剰余金増加額又は欠損金減少額		457,213,544		308,762,234
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		457,213,544		308,762,234
剰余金減少額又は欠損金増加額		307,944,943		149,238,317
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		307,944,943		149,238,317
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金( )		2,797,261,307		3,083,960,472

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. 1 期首元本額	5,436,916,498円	5,756,501,296円
期中追加設定元本額	1,428,568,208円	593,292,118円
期中一部解約元本額	1,108,983,410円	300,567,693円
2. 受益権の総数	5,756,501,296口	6,049,225,721口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

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13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,4954円	1,5098円
（1万口当たり純資産額）	（14,954円）	（15,098円）

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月26日から平成28年8月25日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	607,708,568	-
コール・ローン	-	625,647,244
親投資信託受益証券	18,367,994,608	19,104,248,101
未収入金	1,757,000	-
流動資産合計	18,977,460,176	19,729,895,345
資産合計	18,977,460,176	19,729,895,345
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,962,513	5,231,292
未払受託者報酬	3,206,512	3,145,251
未払委託者報酬	27,790,146	27,259,200
その他未払費用	507,606	476,713
流動負債合計	44,466,777	36,112,456
負債合計	44,466,777	36,112,456
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,311,377,052	11,703,703,886
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	7,621,616,347	7,990,079,003
(分配準備積立金)	4,205,323,682	4,070,447,767
元本等合計	18,932,993,399	19,693,782,889
純資産合計	18,932,993,399	19,693,782,889
負債純資産合計	18,977,460,176	19,729,895,345

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間		第14期中間計算期間	
	自	平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	自	平成28年2月26日 至 平成28年8月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		173,467		486
有価証券売買等損益		384,549,047		123,631,493
営業収益合計		384,375,580		123,631,979
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		168,322
受託者報酬		3,244,746		3,145,251
委託者報酬		28,121,487		27,259,200
その他費用		513,670		477,333
営業費用合計		31,879,903		31,050,106
営業利益又は営業損失（ ）		416,255,483		92,581,873
経常利益又は経常損失（ ）		416,255,483		92,581,873
中間純利益又は中間純損失（ ）		416,255,483		92,581,873
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（ ）		38,078,952		8,087,611
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,378,221,947		7,621,616,347
剰余金増加額又は欠損金減少額		785,575,035		536,475,032
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		785,575,035		536,475,032
剰余金減少額又は欠損金増加額		642,587,040		252,506,638
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		642,587,040		252,506,638
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		8,066,875,507		7,990,079,003

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	11,167,153,451円 1,697,863,637円 1,553,640,036円	11,311,377,052円 766,569,826円 374,242,992円
2. 受益権の総数	11,311,377,052口	11,703,703,886口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

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13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,6738円	1,6827円
（1万口当たり純資産額）	（16,738円）	（16,827円）

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月26日から平成28年8月25日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	469,831,116	-
コール・ローン	-	476,356,241
親投資信託受益証券	14,090,232,030	14,531,697,654
流動資産合計	14,560,063,146	15,008,053,895
資産合計	14,560,063,146	15,008,053,895
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,908,084	1,671,870
未払受託者報酬	2,529,402	2,413,858
未払委託者報酬	24,451,297	23,334,373
その他未払費用	400,401	365,866
流動負債合計	35,289,184	27,785,967
負債合計	35,289,184	27,785,967
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,866,965,749	18,110,010,669
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,657,808,213	6,870,257,259
(分配準備積立金)	3,708,200,293	3,569,194,509
元本等合計	14,524,773,962	14,980,267,928
純資産合計	14,524,773,962	14,980,267,928
負債純資産合計	14,560,063,146	15,008,053,895

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期中間計算期間 自 平成27年2月26日 至 平成27年8月25日	第14期中間計算期間 自 平成28年2月26日 至 平成28年8月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	144,180	375
有価証券売買等損益	475,538,698	20,432,624
営業収益合計	475,394,518	20,432,999
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	130,875
受託者報酬	2,639,864	2,413,858
委託者報酬	25,519,104	23,334,373
その他費用	417,892	366,351
営業費用合計	28,576,860	26,245,457
営業利益又は営業損失( )	503,971,378	5,812,458
経常利益又は経常損失( )	503,971,378	5,812,458
中間純利益又は中間純損失( )	503,971,378	5,812,458
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( )	64,349,765	5,057,217
期首剰余金又は期首欠損金( )	7,956,536,137	6,657,808,213
剰余金増加額又は欠損金減少額	874,170,692	482,395,660
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	874,170,692	482,395,660
剰余金減少額又は欠損金増加額	919,273,316	259,076,939
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	919,273,316	259,076,939
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	7,343,112,370	6,870,257,259

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1. 1 期首元本額	7,932,612,026円	7,866,965,749円
期中追加設定元本額	1,425,335,822円	548,616,446円
期中一部解約元本額	1,490,982,099円	305,571,526円
2. 受益権の総数	7,866,965,749口	8,110,010,669口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

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13期 平成28年2月25日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,8463円	1,8471円
(1万口当たり純資産額)	(18,463円)	(18,471円)

(参考)

「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「DIAMバランス・ファンド<DC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」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「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あります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		3,319,697,186	-
コール・ローン		-	2,285,763,314
株式	2	266,950,636,500	273,315,370,850
派生商品評価勘定		16,762,460	298,380
未収配当金		477,553,356	350,878,962
前払金		256,490,000	10,273,600
流動資産合計		271,021,139,502	275,962,585,106
資産合計		271,021,139,502	275,962,585,106
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		199,635,772	12,533,540
未払解約金		131,488,000	146,669,000
流動負債合計		331,123,772	159,202,540
負債合計		331,123,772	159,202,540
純資産の部			
元本等			
元本	1	142,969,149,329	144,400,734,532
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		127,720,866,401	131,402,648,034
元本等合計		270,690,015,730	275,803,382,566
純資産合計		270,690,015,730	275,803,382,566
負債純資産合計		271,021,139,502	275,962,585,106

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	155,777,350,252円 39,180,158,135円 51,988,359,058円	142,969,149,329円 22,502,376,020円 21,070,790,817円
元本の内訳 ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	5,696,126,195円	6,423,707,483円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,699,376,937円	1,536,876,971円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	6,524,503円	9,265,861円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	13,299,631円	17,855,870円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	31,387,977円	37,506,678円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	15,547,145円	19,473,677円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,269,512円	15,821,313円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,755,011円	16,384,830円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	38,084,258,210円	38,931,214,865円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	856,679,246円	909,614,339円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,984,860,292円	3,115,930,744円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,003,978,386円	3,160,745,088円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	368,862,991円	408,716,759円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,225,176,057円	1,312,232,391円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,095,709,664円	1,142,165,568円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	60,788,627円	64,124,991円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,229,112,654円	1,355,771,901円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	27,113,958円	31,261,205円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	25,953,986円	34,679,539円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	51,128,058円	69,618,343円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	108,496,820円	134,257,227円
投資のソムリエ	1,057,072,049円	1,108,515,481円
クルーズコントロール	292,854,639円	979,491,190円
投資のソムリエ<DC年金>	20,915,913円	28,922,895円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	76,867,727円	107,114,949円
DIAM DC バランス・F(成長型)	60,755,446円	81,334,337円
クルーズコントロール<DC年金>	73,605円	380,482円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,971,426円	16,719,561円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	7,035,679円	46,793,768円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	762,065円	3,885,943円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	497,322円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	199,876,126円	174,944,494円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	113,636,589円	117,339,447円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	492,301,556円	273,900,140円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	474,003,080円	457,247,022円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	39,526,570円	35,558,614円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	166,681,120円	141,842,511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)	39,752,947円	37,322,761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)	58,181,496円	48,997,248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)	5,219,612,585円	3,354,560,573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)	1,982,163,464円	1,132,981,860円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,997,353,962円	1,866,566,486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)	1,598,529,122円	1,547,973,027円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,159,227,906円	4,094,747,610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)	319,046,954円	342,933,197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)	847,270,983円	843,348,091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)	999,463,797円	978,554,556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)	4,058,272,373円	3,995,531,779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)	46,003,219円	51,147,517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)	1,326,335,640円	1,407,500,666円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	5,832,541,011円	5,531,171,471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)	20,951,975,557円	21,791,461,352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)	793,931,787円	798,051,519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)	2,393,749,966円	2,492,557,857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)	13,362,055,990円	13,755,337,783円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	4,455,809円	7,974,250円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	7,115,578円	761,002円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	5,949,384円	5,724,599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)	12,007,265,860円	12,368,104,415円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	112,585,022円	111,779,801円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	42,353,931円	43,892,220円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	39,006,138円	26,228,863円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	12,076,611円	40,046,439円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	120,493円	131,089円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	670,998,289円	729,123,003円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,887,540,594円	1,971,158,603円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,485,634,300円	2,597,804,800円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	94,839,111円	105,546,296円
	計	142,969,149,329円	144,400,734,532円
2 .	受益権の総数	142,969,149,329口	144,400,734,532口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 2,965,500,000円	株式 3,058,000,000円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

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

種類	平成28年2月25日 現在				平成28年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,945,500,000	-	3,762,720,000	182,780,000	2,486,923,600	-	2,474,750,000	12,173,600
合計	3,945,500,000	-	3,762,720,000	182,780,000	2,486,923,600	-	2,474,750,000	12,173,600

(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28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1.8933円	1.9100円
(1万口当たり純資産額)	(18,933円)	(19,100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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		5,472,962,846	-
コール・ローン		-	2,145,350,595
国債証券		323,036,447,800	320,717,185,000
地方債証券		26,836,345,819	23,811,045,755
特殊債券		22,621,064,661	20,211,226,128
社債券		20,858,587,300	18,361,049,020
未収入金		5,561,648,080	1,490,683,400
未収利息		1,289,905,463	1,183,662,464
前払費用		21,283,042	10,304,086
流動資産合計		405,698,245,011	387,930,506,448
資産合計		405,698,245,011	387,930,506,448
負債の部			
流動負債			
未払金		-	4,090,310,000
未払解約金		6,394,594,000	552,031,000
流動負債合計		6,394,594,000	4,642,341,000
負債合計		6,394,594,000	4,642,341,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	311,246,557,550	293,322,586,786
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		88,057,093,461	89,965,578,662
元本等合計		399,303,651,011	383,288,165,448
純資産合計		399,303,651,011	383,288,165,448
負債純資産合計		405,698,245,011	387,930,506,448

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、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。
--------------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	345,746,995,990円 87,184,744,613円 121,685,183,053円	311,246,557,550円 31,467,790,280円 49,391,761,044円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	9,175,982,314円	10,103,767,469円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	184,519,752円	174,842,311円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	135,188,893円	121,867,322円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	55,433,709円	35,866,940円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	439,534,915円	367,269,645円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	113,983,594円	107,651,144円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	20,718,437円	15,647,878円
たわらノーロード 国内債券	352,758,070円	890,980,674円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	- 円	755,274円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	11,609,907,063円	12,261,382,870円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	4,397,137,375円	4,552,232,888円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	6,424,462,977円	6,491,172,492円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,637,655,262円	2,554,420,292円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,668,885,289円	1,616,740,563円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,829,884,341円	1,716,557,175円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	275,586,880円	239,516,995円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	118,176,862円	106,519,798円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,437,259,337円	2,248,236,465円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	7,449,695円	5,859,192円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	223,190,480円	288,234,534円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	166,232,315円	211,832,153円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	41,960,388円	49,295,583円
投資のソムリエ	5,533,410,782円	4,989,277,922円
クルーズコントロール	604,204,415円	1,685,775,728円
投資のソムリエ<DC年金>	99,483,266円	130,158,493円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	706,595,262円	889,101,210円
DIAM DC バランス・F(成長型)	50,283,533円	65,750,112円
クルーズコントロール<DC年金>	151,948円	659,560円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,220,634円	7,729,708円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,942,514円	21,556,556円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,975,697円	37,868,678円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	1,445,892円
みずほエマージング債券オープン	10,801,911円	10,801,911円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券バッシブファンド(適格機関投資家向け)	31,110,776,277円	31,064,453,322円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	925,357,458円	1,302,703,663円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	598,181,155円	568,274,260円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	890,668,185円	484,269,033円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	295,141,650円	269,285,475円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	145,393,586円	122,287,293円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	396,454,681円	313,566,755円

DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	158,862,523円	137,516,139円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	122,661,862円	96,262,182円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	12,416,124,695円	7,332,535,891円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,716,711,039円	2,476,500,279円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	8,456,183,355円	7,335,136,097円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,795,959,754円	3,421,753,737円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,570,343,905円	6,029,577,784円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	787,739,006円	757,730,885円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	3,456,549,937円	3,103,032,469円
DIAM 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)	4,821,704,426円	4,331,363,618円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	6,663,294,119円	5,843,289,923円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	839,267,900円	812,385,968円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,555,700,476円	6,252,621,067円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	6,940,477,535円	6,389,387,464円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	89,526,721,508円	85,545,143,036円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,276,115,973円	1,175,876,654円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,766,460,038円	7,347,795,635円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	28,803,192,292円	27,024,083,226円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	58,681,744円	94,176,422円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	29,226,882円	2,802,834円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	9,770,347円	8,430,190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)	32,292,361,602円	30,379,068,748円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	593,551,673円	539,740,633円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	158,113,403円	151,004,336円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	641,936,416円	383,593,137円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	69,505,002円	206,783,882円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	330,308円	320,394円
	計	311,246,557,550円	293,322,586,786円
2.	受益権の総数	311,246,557,550口	293,322,586,786口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月25日現在	平成28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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

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28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,2829円	1,3067円
（1万口当たり純資産額）	（12,829円）	（13,067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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		805,145,627	2,596,581,721
金銭信託		85,897,312	-
コール・ローン		-	86,902,389
株式		236,834,617,141	239,112,128,356
投資信託受益証券		789,271,471	872,514,559
投資証券		5,598,714,114	6,007,560,268
派生商品評価勘定		29,661,401	40,443,198
未収入金		159,029,454	1,117,292
未収配当金		490,890,995	516,333,299
差入委託証拠金		1,511,748,469	1,155,724,413
流動資産合計		246,304,975,984	250,389,305,495
資産合計		246,304,975,984	250,389,305,495
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		29,068,874	1,034,102
未払解約金		550,706,000	116,596,000
流動負債合計		579,774,874	117,630,102
負債合計		579,774,874	117,630,102
純資産の部			
元本等			
元本	1	101,062,929,782	100,289,360,294
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		144,662,271,328	149,982,315,099
元本等合計		245,725,201,110	250,271,675,393
純資産合計		245,725,201,110	250,271,675,393
負債純資産合計		246,304,975,984	250,389,305,495

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>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。</p> <p>投資証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	109,314,267,788円	101,062,929,782円
同期中追加設定元本額	20,720,942,880円	10,777,449,334円
同期中一部解約元本額	28,972,280,886円	11,551,018,822円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,265,346,668円	1,885,865,866円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	5,067,406円	7,181,511円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,330,738円	16,077,859円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	24,590,871円	36,837,702円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	12,074,361円	15,083,867円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	8,743,829円	14,242,184円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	9,184,637円	16,098,392円
たわらノーロード 先進国株式	826,190,880円	1,780,579,780円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	- 円	426,031円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	34,283,257,934円	35,388,002,795円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	169,874,284円	180,412,814円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	905,415,134円	935,896,872円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,068,407,169円	1,121,704,085円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	140,986,314円	146,392,355円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	406,671,520円	410,806,415円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	338,651,848円	344,162,987円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	43,215,717円	45,391,084円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	874,460,875円	958,076,304円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	242,048,956円	236,734,710円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	19,784,452円	26,518,123円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	39,211,766円	53,198,477円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	83,633,667円	102,429,349円

投資のソムリエ	477,923,774円	381,820,394円
クルーズコントロール	116,268,511円	373,432,127円
投資のソムリエ<DC年金>	9,139,329円	10,195,908円
DIAM 8資産バランスファン ドN<DC年金>	60,602,702円	83,194,086円
DIAM DC バランス・F (成長型)	21,789,339円	29,515,916円
クルーズコントロール<DC年 金>	29,118円	144,987円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,060,414円	4,264,805円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	1,885,928円	11,938,064円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	389,909円	1,980,539円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	879,618円
DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用)	246,302,019円	204,554,102円
DIAM外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,399,312,717円	3,239,660,527円
DIAMアクティブアロケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	117,716,486円	109,792,772円
DIAM先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	- 円	392,381円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	38,663,574円	38,055,376円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	380,345,852円	207,425,551円
DIAMグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	374,359,591円	346,296,546円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	31,054,047円	26,932,972円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	198,593,205円	161,322,522円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	15,800,472円	14,126,448円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	30,800,758円	24,735,172円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	4,146,137,174円	2,564,941,915円

D I A M世界バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	2,361,996,766円	1,299,656,432円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,057,860,672円	942,160,195円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	1,111,132,004円	1,025,727,779円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	3,303,720,878円	3,101,085,306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 )	1,243,117,731円	1,314,101,642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 )	1,975,013,508円	1,939,460,157円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,590,347,521円	1,483,700,093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 )	1,062,501,229円	999,974,970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 )	12,333,699円	13,494,600円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	4,679,814,254円	4,881,115,646円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	1,794,957,557円	1,727,954,755円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A ( 適格機関投資 家限定 )	11,097,820,859円	11,000,313,965円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	630,608,542円	604,405,763円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A ( 適格機関投 資家限定 )	1,901,357,227円	1,887,705,576円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A ( 適格機関投資 家限定 )	7,078,616,550円	6,943,701,949円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	17,738,254円	30,217,326円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	22,620,054円	2,304,631円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	17,318,549円	15,885,893円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A ( 適格機関投資 家限定 )	9,537,135,837円	9,366,800,018円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	92,569,470円	60,124,924円

	D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	28,741,863円	91,450,334円
	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	282,813円	296,050円
	計	101,062,929,782円	100,289,360,294円
2.	受益権の総数	101,062,929,782口	100,289,360,294口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成28年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	534,711,398	-	535,463,600	752,202	152,157,444	-	152,223,500	66,056
アメリカ・ドル	362,801,552	-	363,395,200	593,648	91,418,750	-	91,449,000	30,250
イギリス・ポンド	43,862,032	-	43,721,600	140,432	13,272,064	-	13,326,000	53,936
オーストラリア・ドル	19,353,404	-	19,324,400	29,004	7,654,600	-	7,662,400	7,800
カナダ・ドル	18,676,884	-	18,816,300	139,416	4,664,070	-	4,666,200	2,130
ユーロ	90,017,526	-	90,206,100	188,574	35,147,960	-	35,119,900	28,060
合計	534,711,398	-	535,463,600	752,202	152,157,444	-	152,223,500	66,056

(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。

## 株式関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成28年8月25日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	2,204,383,417	-	2,205,728,146	1,344,729	4,061,720,771	-	4,101,195,923	39,475,152
合計	2,204,383,417	-	2,205,728,146	1,344,729	4,061,720,771	-	4,101,195,923	39,475,152

## (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はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	2.4314円	2.4955円
(1万口当たり純資産額)	(24,314円)	(24,955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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,674,514,331	3,917,423,603
金銭信託		273,381,282	-
コール・ローン		-	250,702,544
国債証券		258,776,560,149	249,457,211,643
派生商品評価勘定		325,815	45,478
未収利息		2,367,321,596	1,993,798,760
前払費用		46,246,607	90,518,939
流動資産合計		265,138,349,780	255,709,700,967
資産合計		265,138,349,780	255,709,700,967
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,539,709	-
未払解約金		936,520,000	67,543,000
流動負債合計		938,059,709	67,543,000
負債合計		938,059,709	67,543,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	149,167,353,470	153,987,236,214
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		115,032,936,601	101,654,921,753
元本等合計		264,200,290,071	255,642,157,967
純資産合計		264,200,290,071	255,642,157,967
負債純資産合計		265,138,349,780	255,709,700,967

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	183,852,928,058円  22,714,623,570円 57,400,198,158円	149,167,353,470円  19,990,216,220円 15,170,333,476円
元本の内訳 ファンド名 D I A M外国債券パッシブ・ファンド M I T O ラップ型ファンド（安定型） M I T O ラップ型ファンド（中立型） M I T O ラップ型ファンド（積極型） グローバル8資産ラップファンド（安定型） グローバル8資産ラップファンド（中立型） グローバル8資産ラップファンド（積極型） たわらノーロード 先進国債券 たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け> D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金> D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	4,608,868,777円 17,135,667円 49,601,868円 84,885,603円 40,812,730円 41,966,921円 31,685,325円 154,189,800円 - 円 4,589,345,800円 381,621,256円	4,734,991,628円 18,742,650円 49,229,931円 74,374,850円 39,368,616円 43,608,079円 32,497,829円 390,642,897円 606,412円 4,704,426,879円 435,921,478円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	1,283,530,211円	1,406,622,480円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	1,366,997,870円	1,420,070,472円
D I A M D C バランス30 インデックスファンド	325,115,189円	338,907,679円
D I A M D C バランス50 インデックスファンド	702,091,373円	706,238,360円
D I A M D C バランス70 インデックスファンド	505,339,054円	515,422,473円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	27,849,563円	27,624,031円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	568,221,729円	579,380,141円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,844,770円	15,280,613円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	8,241,243円	11,934,817円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	14,982,115円	21,120,737円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	29,626,646円	38,281,227円
クルーズコントロール D I A M 8資産バランスマ ンドN<D C年金>	416,028,978円 25,339,893円	1,361,582,815円 34,924,753円
D I A M D C バランス・F (成長型)	25,127,893円	37,284,488円
クルーズコントロール<D C年 金>	104,666円	530,346円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	3,004,878円	12,415,786円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	5,367,737円	34,857,452円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	495,798円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,803,256,689円	1,681,199,585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)	6,936,738,041円	7,840,256,212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)	4,671,354,435円	4,290,559,339円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	2,389,669,712円	4,758,540,866円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	195,054,050円	182,836,916円
D I A Mワールドバランス25 V A(適格機関投資家限定)	125,179,732円	133,408,183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)	2,536,469,224円	1,495,700,651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)	833,903,203円	832,079,876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)	100,546,922円	94,577,123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)	183,536,447円	161,289,570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)	43,892,957円	42,434,281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)	21,332,413円	18,556,524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)	8,626,781,465円	5,776,686,399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)	2,181,728,841円	1,300,468,992円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	5,129,506,277円	4,953,852,079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)	2,858,417,978円	2,860,534,037円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,576,434,371円	4,655,595,218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)	881,138,244円	974,202,071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)	3,273,256,957円	3,354,342,863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)	4,397,691,775円	4,483,555,025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)	16,100,828,427円	16,880,654,371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)	56,954,254円	64,131,288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)	2,193,691,472円	2,406,308,062円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	10,833,445,814円	11,168,532,699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)	15,360,947,657円	16,514,948,859円

D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	19,589,996,575円	20,855,041,860円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	14,748,909円	27,238,496円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	19,587,305円	2,162,904円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	6,546,806円	6,506,045円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	17,612,128,830円	18,752,930,259円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	124,173,768円	127,071,862円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	129,091,817円	89,579,154円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	33,261,642円	113,920,521円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	132,906円	148,307円
計	149,167,353,470円	153,987,236,214円
2 . 受益権の総数	149,167,353,470口	153,987,236,214口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成28年2月25日 現在				平成28年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	973,770,226	-	974,984,120	1,213,894	246,163,188	-	246,117,710	45,478
アメリカ・ドル	486,997,104	-	487,778,840	781,736	112,558,880	-	112,548,800	10,080
イギリス・ポンド	86,047,075	-	85,726,350	320,725	-	-	-	-
ユーロ	400,726,047	-	401,478,930	752,883	133,604,308	-	133,568,910	35,398
合計	973,770,226	-	974,984,120	1,213,894	246,163,188	-	246,117,710	45,478

(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28年2月25日現在	平成28年8月25日現在
1口当たり純資産額	1.7712円	1.6602円
(1万口当たり純資産額)	(17,712円)	(16,602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・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## 【純資産額計算書】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 1 安定型

平成28年8月31日現在

資産総額	9,219,072,128円
負債総額	1,042,747円
純資産総額（ - ）	9,218,029,381円
発行済数量	6,082,864,267口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5154円

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 2 安定・成長型

平成28年8月31日現在

資産総額	19,965,638,016円
負債総額	8,027,800円
純資産総額（ - ）	19,957,610,216円
発行済数量	11,753,685,826口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6980円

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 3 成長型

平成28年8月31日現在

資産総額	15,266,902,967円
負債総額	4,107,792円
純資産総額（ - ）	15,262,795,175円
発行済数量	8,147,481,441口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8733円

（参考）

## 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28年8月31日現在

資産総額	282,706,870,254円
負債総額	280,516,800円
純資産総額（ - ）	282,426,353,454円
発行済数量	145,011,552,087口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9476円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産総額	394,493,662,031円
負債総額	9,772,769,000円
純資産総額（ - ）	384,720,893,031円
発行済数量	295,615,138,455口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3014円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産総額	256,591,738,240円
負債総額	308,260,118円
純資産総額( - )	256,283,478,122円
発行済数量	100,436,350,060口
1口当たり純資産額( / )	2.5517円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産総額	261,290,759,093円
負債総額	296,343,041円
純資産総額( - )	260,994,416,052円
発行済数量	154,288,070,704口
1口当たり純資産額( / )	1.6916円

## 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】

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

#### <更新・訂正後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

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

平成28年8月31日現在、D I A Mアセットマネジメント株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	392	5,889,391,856,643
単位型公社債投資信託	49	344,511,981,244
単位型株式投資信託	7	79,197,511,703
合計	448	6,313,101,349,590

#### （ご参考）

平成28年8月31日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

#### ・みずほ投信投資顧問株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	13	263,953,485,574
追加型株式投資信託	232	2,245,140,638,646
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,483,762,979
合計	248	2,510,577,887,199

#### ・新光投信株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
-------	----	----------

追加型公社債投資信託	25	645,515,628,611
追加型株式投資信託	243	3,151,408,584,879
単位型公社債投資信託	6	40,509,834,945
単位型株式投資信託	78	282,536,779,714
合計	352	4,119,970,828,149

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成28年2月26日から平成28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。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型の平成28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28年2月26日から平成28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。

#### 利害関係

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

以上

---

上記は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。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫 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<DC年金>2安定・成長型の平成28年2月26日から平成28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。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の平成28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28年2月26日から平成28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。

#### 利害関係

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

以上

---

上記は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。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月12日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光夫 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28年2月26日から平成28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。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3成長型の平成28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28年2月26日から平成28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。

## 利害関係

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

以 上

---

上記は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。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。