

【表紙】	
【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成23年11月25日
【計算期間】	第9期中（自 平成23年2月26日 至 平成23年8月25日） 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
【ファンド名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【発行者名】	代表取締役社長 中島 敬雄
【代表者の役職氏名】	
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	大楽 信雄
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【電話番号】	03-3287-3110
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1 【ファンドの運用状況】

(1) 【投資状況】

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

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＜DC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＜DC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・チャネル諸島	76,930,984	0.03
	ジャージー・チャネル諸島	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) 【運用実績】

① 【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＜DC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＜DC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＜DC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	—

②【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	-

③【収益率の推移】

D I A Mバランス・ファンド＜DC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＜DC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＜DC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

2【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＜DC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＜DC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＜DC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。

3【ファンドの経理状況】

- (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＜DC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

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＜DC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

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	1.1335円	1.1208円
（1万口当たり純資産額）	(11,335円)	(11,208円)

【D I A Mバランス・ファンド＜DC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

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	1.1268円	1.1116円
（1万口当たり純資産額）	(11,268円)	(11,116円)

(参考)

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	*2	8,414,575,985	5,852,229,923
株式		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 3 0 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 5 0 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 7 0 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 2 5 V A （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 2 5 V A（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 5 0 V A（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 3 0 V A（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 5 0 V A（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 3 0 V A（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 5 0 V A（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 4 0 V A（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 5 0 V A（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 2 5 V A（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. 5 V A（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 5 0 V A（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 V A（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 V A 2（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 3 0 V A（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 V A（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β 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 5 5 V A（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 3 5 V A（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 V A（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 2 V A（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 4 0 V A（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 2 5 V A （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 3 V A （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 3 0 V A （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 5 0 V A （適 格機関投資家限定）	95,046円	97,608円
D I A Mバランス 7 0 V A （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 4 V A （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 2 5 V A （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 3 0 V A （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 2 0 V A （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 4 0 V A （適 格機関投資家限定）	90,207円	91,090円
D I A Mバランス 6 0 V A （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。 (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。	(1)先物取引 同左 (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<DC年金>	26,835,875,099円	30,762,313,318円
D I A Mバランス・ファンド<DC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<DC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<DC年金> 3 成長型	1,244,095,656円	1,266,539,139円
D I A M DC 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 DC 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 DC 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 2 5 V 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 2 5 V 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 5 0 V 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 3 0 V 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 5 0 V 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 3 0 V 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 5 0 V 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 4 0 V 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 5 0 V 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 2 5 V 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 3 7. 5 V 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 5 0 V 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β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35V A（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V A（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2V A（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40V A（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25V A（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3V A（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50V A（適格機関投資家限定）	176,452円	169,277円
D I A Mバランス70V A（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4V A（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40V A（適格機関投資家限定）	83,044円	79,542円
D I A Mバランス60V A（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）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
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			
		契約額等（円）	

区分	種 類		うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
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）	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				
	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）	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 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。

① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該

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

(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 3 0 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 5 0 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 7 0 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 2 5 V A（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 2 5 V A（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 5 0 V A（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 3 0 V A（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 5 0 V A（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 3 0 V A（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 5 0 V A（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 4 0 V A（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 5 0 V A（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 2 5 V A（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 3 7. 5 V A（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 5 0 V A（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 V A（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 V A 2（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 3 0 V A（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 V A（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β 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 5 5 V A（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 3 5 V A（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 V A（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 2 V A（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 4 0 V A（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 3 0 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 5 0 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 7 0 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 2 5 V A（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 2 5 V A（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 5 0 V A（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β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	_____	(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。 (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）

（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				
	ユーロ	35,477,640	-	35,207,700	269,940
	買建				
	ユーロ	193,338,225	-	193,322,280	△ 15,945
	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。
 - ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
 2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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）

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

(1) 定款の変更等

平成21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・株券不発行に伴う対応および役付取締役（取締役会長職）追加に伴う変更

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

5【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「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	599,421	400,967
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	964,184	1,267,273
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	5,247,891	4,252,397
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

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.有価証券の評価基準及び評価方法 (1) 子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法 2.金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法 3.デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法 4.固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法 5.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 6.引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。	1.有価証券の評価基準及び評価方法 (1) 子会社株式及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左 2.金銭の信託の評価基準及び評価方法 同左 3.デリバティブの評価基準及び評価方法 同左 4.固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 同左 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 同左 (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 5.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左 6.引当金の計上基準 (1) 同左 (2) 同左

(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。 (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。 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。 7. リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日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。 8. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。	(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。 (4) 同左 7. リース取引の処理方法 同左 8. 消費税等の処理方法 同左
--	--

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）
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。	

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 建物 471,484千円 器具備品 356,326千円 商標権 6,882千円 ソフトウエア 684,370千円 電話施設利用権 1,065千円	※1. 固定資産の減価償却累計額 建物 484,832千円 器具備品 499,620千円 商標権 2,428千円 ソフトウエア 809,403千円 電話施設利用権 1,145千円												
※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。	※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。												
<table><tr><td>流動資産</td><td>未収投資助言報酬</td><td>270,492千円</td></tr><tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td>400,075千円</td></tr></table>	流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動負債	未払費用	400,075千円	<table><tr><td>流動資産</td><td>未収投資助言報酬</td><td>266,194千円</td></tr><tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td>291,628千円</td></tr></table>	流動資産	未収投資助言報酬	266,194千円	流動負債	未払費用	291,628千円
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円											
流動負債	未払費用	400,075千円											
流動資産	未収投資助言報酬	266,194千円											
流動負債	未払費用	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 取締役 年額250,000千円 監査役 年額 50,000千円 ※2. 固定資産除却損の内訳 建物 1,199千円 器具備品 15,159千円 ソフトウェア 5,267千円	※1. 役員報酬の限度額 同左 ※2. 固定資産除却損の内訳 建物 15,317千円 器具備品 3,597千円 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				1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引			
①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額				①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額			
	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				減価償却累計額			
相当額	75,063千円	—	75,063千円	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
②未経過リース料期末残高相当額				②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				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	期末残高相当額	586千円	—	586千円
③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				③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	
④減価償却費相当額の算定方法				④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。				同左			
⑤利息相当額の算定方法				⑤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。				同左			
2. オペレーティング・リース取引				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				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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

- ①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。
- ②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。
- ③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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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 その他有価証券	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

①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 その他有価証券」には含めておりません。

②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。

③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			
①株式	368,968	146,101	222,866
②債券	—	—	—
③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			
①株式	—	—	—
②債券	—	—	—
③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			
①株式	513,129	146,101	367,027
②債券	—	—	—
③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			
①株式	—	—	—
②債券	—	—	—
③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
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
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 (平成22年3月31日現在)	第26期 (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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（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 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	—	—	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	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 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	—	—	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	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)
_____	_____

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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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＜DC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XBRL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 公認会計士 浅野 功 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 近藤 敏弘 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成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](#)