

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成23年11月25日

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 中島 敬雄

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 大楽 信雄

【電話番号】 03-3287-3110

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 D I A M D C バランス30インデックスファンド
D I A M D C バランス50インデックスファンド
D I A M D C バランス70インデックスファンド

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

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、平成23年5月25日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を訂正するため、また、記載事項の一部を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(略)

ファンドの特色

1

●ライフサイクルにあわせた分散投資

●主としてマザーファンド*を通じて実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券の4つのアセット(資産)に投資します。

*国内株式/パッシブファンド(最適化法)-マザーファンド、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

●個々のアセット(資産)において、数多くの銘柄に分散して投資することにより、より一層の分散投資効果を追求します。

●基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス^(注)に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

●各資産につき、基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。

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

●売買組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

(注)当社が独自に指数化した合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMU RA-BIP総合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティグループ世界債券インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト利率を、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

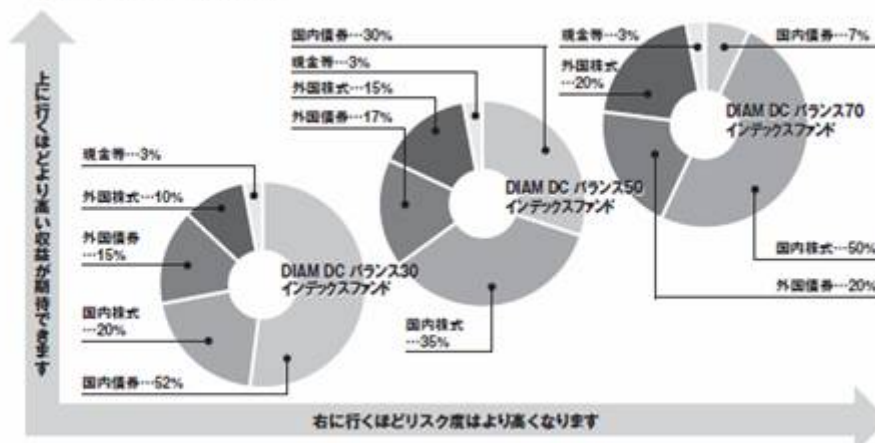
2

●ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

ご投資家の皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じて、3種類の組み合わせ(資産配分)からご選択いただけます。

3ファンドの基本アロケーション

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



各ファンドは、同一のマザーファンドに投資を行うため、流動性の大きい株式・外国証券への投資割合が高いほど、リスク・リターンともより高くなります。

- DIAM DC バランス30インデックスファンド
比較的低リスクの低い資産(国内債券)を中心に組入れ、安定運用を行います。
- DIAM DC バランス50インデックスファンド
各資産をバランスよく組入れ、ミドルリスクミドルリターンをめざします。
- DIAM DC バランス70インデックスファンド
株式・外国証券等のリスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。

分配方針

年1回(毎年2月25日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。
 ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
 ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

(略)

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

「ファミリーファンド方式」とは

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

(略)

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

委託会社の概況

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

資本金の額

20億円（平成23年2月28日現在）

(略)

大株主の状況

(平成23年2月28日現在)

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

<訂正後>

(略)

「ファミリーファンド方式」とは

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

(略)

委託会社の概況

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

資本金の額

20億円（平成23年8月31日現在）

（略）

大株主の状況

（平成23年8月31日現在）

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

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<訂正前>

（略）

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

<訂正後>

（略）

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

3【投資リスク】

<訂正前>

<基準価額の主な変動要因>

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

(1)株式投資リスク

（略）

(3)為替リスク

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

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

（略）

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

(略)

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

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

資金動向、市場動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

(略)

注意事項

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

<運用評価・運用リスク管理体制>

(略)

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

<訂正後>

<基準価額の主な変動要因>

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

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

(1)株式投資リスク

(略)

(3)為替リスク

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

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

(略)

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

(略)

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

資金動向、市場動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

(略)

注意事項

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

<運用評価・運用リスク管理体制>

(略)

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

確定拠出年金の加入者におかれましては、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。なお、上記以外の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

法人の受益者に対する課税

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

(略)

<訂正後>

確定拠出年金の加入者におかれましては、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。なお、上記以外の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

法人の受益者に対する課税

平成25年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7%(所得税7%)の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成26年1月1日からは、15%(所得税15%)となる予定です。

(略)

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

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(%)
親投資信託受益証券	日本	2,492,990,431	97.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		76,600,436	2.98
合 計（純資産総額）		2,569,590,867	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 D C バランス50インデックスファンド

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(%)
親投資信託受益証券	日本	4,250,200,611	97.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		130,219,129	2.97
合 計（純資産総額）		4,380,419,740	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 D C バランス70インデックスファンド

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(%)
親投資信託受益証券	日本	2,243,955,355	97.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		68,425,995	2.96
合 計（純資産総額）		2,312,381,350	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)【投資資産】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

【投資有価証券の主要銘柄】

平成23年8月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,208,276,815	11,128.45	1,344,624,570	11,309.00	1,366,440,250	53.18
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	487,175,940	12,104.10	589,682,572	10,171.00	495,506,648	19.28
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	339,634,869	11,458.02	389,154,192	11,616.00	394,519,863	15.35
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	205,333,510	13,332.04	273,751,498	11,519.00	236,523,670	9.20

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

(注2)簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3)投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.02
合計	97.02

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,465,682,854	12,139.46	1,779,259,161	10,171.00	1,490,746,030	34.03
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,212,111,006	11,128.68	1,348,919,028	11,309.00	1,370,776,336	31.29
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	670,636,125	11,456.31	768,301,627	11,616.00	779,010,922	17.78
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	529,271,051	13,347.64	706,452,054	11,519.00	609,667,323	13.92

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

(注2)簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3)投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.03
合計	97.03

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

D I A M D C バランス70インデックスファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,113,582,574	12,161.71	1,354,306,952	10,171.00	1,132,624,836	48.98
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	431,790,355	11,449.68	494,386,248	11,616.00	501,567,676	21.69
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	379,576,302	13,353.75	506,876,650	11,519.00	437,233,942	18.91
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	152,558,937	11,124.55	169,715,025	11,309.00	172,528,901	7.46

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

(注2)簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3)投資有価証券は4銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.04
合計	97.04

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	3,008,800	3,442.41	10,357,517,300	2,734.00	8,226,059,200	3.28
2	三菱UFJ フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	17,497,200	436.95	7,645,406,116	344.00	6,019,036,800	2.40
3	キヤノン	株式	日本	電気機 器	1,454,800	3,901.15	5,675,398,416	3,595.00	5,230,006,000	2.09
4	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,975,800	3,432.37	6,781,680,200	2,474.00	4,888,129,200	1.95
5	三井住友 フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,762,100	2,850.37	5,022,639,127	2,255.00	3,973,535,500	1.59
6	武田薬品	株式	日本	医薬品	918,800	3,983.77	3,660,287,814	3,695.00	3,394,966,000	1.35
7	みずほフィ ナンシャル G	株式	日本	銀行業	28,762,200	158.84	4,568,679,539	116.00	3,336,415,200	1.33
8	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,803,700	2,328.49	4,199,905,486	1,827.00	3,295,359,900	1.31
9	日本電信電 話	株式	日本	情報・ 通信業	868,100	3,841.05	3,334,411,490	3,555.00	3,086,095,500	1.23
10	ファナック	株式	日本	電気機 器	243,800	12,388.02	3,020,198,960	12,620.00	3,076,756,000	1.23
11	ソフトバン ク	株式	日本	情報・ 通信業	1,047,100	2,972.85	3,112,871,858	2,527.00	2,646,021,700	1.06
12	エヌ・ティ ・ティ・ド コモ	株式	日本	情報・ 通信業	19,046	148,482.63	2,828,000,219	138,600.00	2,639,775,600	1.05
13	三井物産	株式	日本	卸売業	1,995,300	1,474.20	2,941,476,659	1,302.00	2,597,880,600	1.04
14	小松製作所	株式	日本	機械	1,161,900	2,547.45	2,959,880,765	2,025.00	2,352,847,500	0.94
15	パナソニッ ク	株式	日本	電気機 器	2,727,000	1,063.99	2,901,497,839	809.00	2,206,143,000	0.88
16	ソニー	株式	日本	電気機 器	1,314,900	2,796.52	3,677,144,088	1,665.00	2,189,308,500	0.87
17	日立	株式	日本	電気機 器	5,258,000	488.52	2,568,655,320	413.00	2,171,554,000	0.87
18	日産自動車	株式	日本	輸送用 機器	2,958,400	849.02	2,511,728,004	697.00	2,062,004,800	0.82
19	KDDI	株式	日本	情報・ 通信業	3,587	485,934.40	1,743,046,706	570,000.00	2,044,590,000	0.82
20	三菱地所	株式	日本	不動産 業	1,618,000	1,572.35	2,544,062,080	1,254.00	2,028,972,000	0.81
21	セブン&ア イ・HLD GS	株式	日本	小売業	966,800	2,151.92	2,080,478,728	2,018.00	1,951,002,400	0.78

22	東日本旅客 鉄道	株式	日本	陸運業	407,200	5,233.19	2,130,953,963	4,575.00	1,862,940,000	0.74
23	東京海上H D	株式	日本	保険業	877,500	2,465.91	2,163,836,240	2,073.00	1,819,057,500	0.73
24	任 天 堂	株式	日本	その他 製品	133,900	22,370.30	2,995,383,376	13,400.00	1,794,260,000	0.72
25	日本たばこ 産業	株式	日本	食料品	5,454	330,454.19	1,802,297,161	328,500.00	1,791,639,000	0.71
26	三菱電機	株式	日本	電気機 器	2,342,000	991.51	2,322,127,300	760.00	1,779,920,000	0.71
27	信越化学	株式	日本	化学	408,400	4,733.98	1,933,357,291	3,850.00	1,572,340,000	0.63
28	アステラス 製薬	株式	日本	医薬品	544,500	3,214.28	1,750,172,858	2,878.00	1,567,071,000	0.63
29	野村ホール ディングス	株式	日本	証券、 商品先 物取引 業	4,867,000	505.40	2,459,787,862	321.00	1,562,307,000	0.62
30	東 芝	株式	日本	電気機 器	4,622,000	505.36	2,335,766,760	331.00	1,529,882,000	0.61

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

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	13.50
	輸送用機器	9.29
	銀行業	8.97
	情報・通信業	6.09
	化学	5.87
	卸売業	5.38
	機械	4.93
	医薬品	4.91
	小売業	3.96
	陸運業	3.77
	食料品	3.30
	電気・ガス業	3.25
	保険業	2.37
	建設業	2.34
	不動産業	2.28
	鉄鋼	2.04
	サービス業	1.87
	その他製品	1.72
	精密機器	1.43
	非鉄金属	1.31
	ガラス・土石製品	1.19
	証券、商品先物取引業	1.18
	繊維製品	0.96
石油・石炭製品	0.88	
その他金融業	0.77	
金属製品	0.73	

	ゴム製品	0.72
	鉱業	0.63
	海運業	0.42
	パルプ・紙	0.42
	空運業	0.32
	倉庫・運輸関連業	0.23
	水産・農林業	0.11
合計		97.11

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃料	783,958	6,472.66	5,074,290,354	5,671.85	4,446,494,848	1.70
2	APPLE INC	株式	米国	コンピ ュータ ・周辺 機器	147,583	27,693.24	4,087,051,321	29,927.83	4,416,839,319	1.69
3	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイ ス	食品	549,023	4,839.26	2,656,865,466	4,638.70	2,546,751,727	0.97
4	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技 術サー ビス	191,754	12,559.81	2,408,392,925	13,229.98	2,536,900,818	0.97
5	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	1,200,454	2,083.21	2,500,802,719	2,012.89	2,416,382,092	0.92
6	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃料	318,104	7,461.00	2,373,374,217	7,551.22	2,402,072,014	0.92
7	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用 品	453,371	4,942.29	2,240,692,670	4,872.99	2,209,272,349	0.84
8	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	433,272	4,679.01	2,027,284,486	5,047.19	2,186,806,019	0.83
9	AT&T INC	株式	米国	各種電 気通信 サービ ス	943,553	2,190.53	2,066,881,207	2,273.04	2,144,732,579	0.82

10	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロメレート	1,724,090	1,614.34	2,783,265,522	1,237.05	2,132,783,466	0.81
11	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	2,808,944	873.79	2,454,417,106	657.07	1,845,672,328	0.70
12	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,244,648	1,460.87	1,818,268,658	1,449.62	1,804,264,891	0.69
13	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	625,969	3,531.32	2,210,496,054	2,843.98	1,780,246,071	0.68
14	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	324,485	4,867.00	1,579,268,883	5,361.06	1,739,582,386	0.66
15	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	8,360,176	223.64	1,869,670,279	203.42	1,700,606,101	0.65
16	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	524,057	3,814.79	1,999,168,719	3,221.98	1,688,500,125	0.64
17	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	380,734	5,000.93	1,904,023,173	4,358.45	1,659,408,199	0.63
18	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	39,800	47,700.75	1,898,489,778	41,493.32	1,651,434,056	0.63
19	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	789,613	2,560.19	2,021,560,644	1,949.20	1,539,110,501	0.59
20	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	株式	米国	タバコ	281,033	4,625.03	1,299,787,217	5,381.01	1,512,241,046	0.58
21	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	114,834	13,180.22	1,513,537,337	13,019.10	1,495,034,985	0.57
22	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	588,155	2,638.46	1,551,825,752	2,509.86	1,476,186,120	0.56
23	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	2,962,956	596.70	1,767,981,699	497.72	1,474,709,660	0.56
24	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	636,480	2,534.39	1,613,087,453	2,137.98	1,360,779,219	0.52
25	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	847,503	1,655.71	1,403,215,936	1,553.22	1,316,356,576	0.50
26	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	英国	医薬品	808,511	1,481.56	1,197,857,145	1,610.44	1,302,059,020	0.50

27	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	348,269	4,693.17	1,634,484,139	3,671.14	1,278,545,510	0.49
28	MERCK & CO. INC.	株式	米国	医薬品	506,584	2,518.23	1,275,693,838	2,509.40	1,271,220,876	0.49
29	SCHLUMBERGER LTD	株式	オランダ	エネルギー設備・サービス	213,839	7,044.86	1,506,465,756	5,934.30	1,268,985,676	0.48
30	VERIZON COMM INC	株式	米国	各種電気通信サービス	442,585	2,754.16	1,218,950,712	2,786.43	1,233,231,856	0.47

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

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.25
	商業銀行	7.20
	医薬品	6.34
	金属・鉱業	4.42
	保険	3.88
	各種電気通信サービス	3.27
	食品	2.92
	化学	2.88
	コンピュータ・周辺機器	2.44
	ソフトウェア	2.38
	メディア	2.36
	食品・生活必需品小売り	2.28
	飲料	2.26
	各種金融サービス	2.23
	情報技術サービス	2.12
	コングロマリット	2.01
	電力	1.92
	資本市場	1.86
	機械	1.75
	航空宇宙・防衛	1.71
	エネルギー設備・サービス	1.68
	ホテル・レストラン・レジャー	1.60
	タバコ	1.60
	半導体・半導体製造装置	1.53
	家庭用品	1.49
	総合公益事業	1.42
	通信機器	1.41
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.32
	専門小売り	1.31
	ヘルスケア機器・用品	1.27
無線通信サービス	1.06	

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	313回 利付 国庫債券（1 0年）	国債 証券	日本	7,000,000,000	101.15	7,080,330,000	102.75	7,192,220,000	1.30	2021/ 3/20	1.73
2	312回 利付 国庫債券（1 0年）	国債 証券	日本	6,200,000,000	99.48	6,168,022,000	102.13	6,332,308,000	1.20	2020/ 12/20	1.52
3	93回 利付国 庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,800,000,000	99.87	5,792,410,000	100.85	5,849,126,000	0.50	2015/ 12/20	1.41
4	310回 利付 国庫債券（1 0年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	97.56	5,366,010,000	100.67	5,536,685,000	1.00	2020/ 9/20	1.33
5	306回 利付 国庫債券（1 0年）	国債 証券	日本	5,200,000,000	101.56	5,280,860,000	104.63	5,440,604,000	1.40	2020/ 3/20	1.31
6	293回 利付 国庫債券（1 0年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	105.90	5,295,100,000	108.25	5,412,550,000	1.80	2018/ 6/20	1.30
7	315回 利付 国庫債券（1 0年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	101.27	5,063,360,000	101.56	5,077,800,000	1.20	2021/ 6/20	1.22
8	70回 利付国 庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,900,000,000	101.14	4,955,860,000	101.04	4,951,107,000	0.80	2013/ 3/20	1.19
9	285回 利付 国庫債券（1 0年）	国債 証券	日本	4,400,000,000	105.76	4,653,499,000	107.04	4,709,848,000	1.70	2017/ 3/20	1.13
10	75回 利付国 庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,600,000,000	102.03	4,693,334,000	101.96	4,690,344,000	1.10	2013/ 9/20	1.13
11	289回 利付 国庫債券（1 0年）	国債 証券	日本	4,400,000,000	104.24	4,586,397,000	106.20	4,672,580,000	1.50	2017/ 12/20	1.12
12	81回 利付国 庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	101.28	4,557,600,000	101.63	4,573,305,000	0.80	2014/ 3/20	1.10
13	88回 利付国 庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	99.96	4,498,155,000	100.93	4,541,805,000	0.50	2015/ 3/20	1.09
14	89回 利付国 庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	99.47	4,476,220,000	100.54	4,524,480,000	0.40	2015/ 6/20	1.09

15	97回 利付国 庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	100.24	4,510,605,000	100.28	4,512,690,000	0.40	2016/ 6/20	1.08
16	83回 利付国 庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,400,000,000	101.60	4,470,224,000	102.04	4,489,760,000	0.90	2014/ 6/20	1.08
17	305回 利付 国庫債券(1 0年)	国債 証券	日本	4,300,000,000	100.96	4,341,280,000	104.05	4,474,107,000	1.30	2019/ 12/20	1.07
18	290回 利付 国庫債券(1 0年)	国債 証券	日本	4,200,000,000	103.45	4,345,032,000	105.60	4,435,032,000	1.40	2018/ 3/20	1.07
19	72回 利付国 庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,200,000,000	102.81	4,317,920,000	102.45	4,302,690,000	1.50	2013/ 6/20	1.03
20	299回 利付 国庫債券(1 0年)	国債 証券	日本	4,100,000,000	101.82	4,174,800,000	104.71	4,292,987,000	1.30	2019/ 3/20	1.03
21	296回 利付 国庫債券(1 0年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	103.56	4,142,520,000	106.26	4,250,360,000	1.50	2018/ 9/20	1.02
22	87回 利付国 庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	100.05	4,002,120,000	100.95	4,037,880,000	0.50	2014/ 12/20	0.97
23	301回 利付 国庫債券(1 0年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	103.02	3,914,570,000	106.03	4,028,988,000	1.50	2019/ 6/20	0.97
24	92回 利付国 庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	98.81	3,952,520,000	100.08	4,003,160,000	0.30	2015/ 9/20	0.96
25	286回 利付 国庫債券(1 0年)	国債 証券	日本	3,700,000,000	106.26	3,931,435,000	107.77	3,987,416,000	1.80	2017/ 6/20	0.96
26	288回 利付 国庫債券(1 0年)	国債 証券	日本	3,600,000,000	105.57	3,800,412,000	107.32	3,863,484,000	1.70	2017/ 9/20	0.93
27	266回 利付 国庫債券(1 0年)	国債 証券	日本	3,700,000,000	103.47	3,828,279,000	103.91	3,844,485,000	1.40	2014/ 12/20	0.92
28	69回 利付国 庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	101.24	3,846,930,000	101.01	3,838,418,000	0.90	2012/ 12/20	0.92
29	78回 利付国 庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	101.62	3,556,540,000	101.72	3,560,305,000	0.90	2013/ 12/20	0.86
30	85回 利付国 庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	100.94	3,532,935,000	101.56	3,554,495,000	0.70	2014/ 9/20	0.85

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

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年8月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US T N/B 4.0 11/15/12	国債 証券	米国	3,376,560,000	105.79	3,572,029,058	104.70	3,535,089,492	4.00	2012/ 11/15	0.94
2	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米国	3,069,600,000	108.13	3,319,005,000	109.18	3,351,358,584	4.00	2014/ 2/15	0.89
3	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,069,600,000	108.55	3,331,928,016	108.89	3,342,487,440	4.25	2013/ 11/15	0.89
4	US T N/B 1.0 07/15/13	国債 証券	米国	3,069,600,000	101.13	3,104,174,693	101.52	3,116,104,440	1.00	2013/ 7/15	0.83
5	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	2,685,900,000	110.70	2,973,157,005	112.16	3,012,398,004	4.75	2014/ 5/15	0.80
6	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	2,685,900,000	107.98	2,900,342,256	107.91	2,898,462,126	4.25	2013/ 8/15	0.77
7	US T N/B 1.125 12/15/12	国債 証券	米国	2,685,900,000	100.75	2,706,044,250	101.27	2,719,984,071	1.13	2012/ 12/15	0.72
8	US T N/B 3.5 05/31/13	国債 証券	米国	2,455,680,000	105.84	2,599,067,680	105.77	2,597,348,179	3.50	2013/ 5/31	0.69
9	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,455,680,000	106.23	2,608,767,091	105.41	2,588,434,061	3.88	2013/ 2/15	0.69
10	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,302,200,000	109.63	2,523,947,904	112.27	2,584,749,006	4.25	2014/ 11/15	0.69
11	US T N/B 1.375 09/15/12	国債 証券	米国	2,532,420,000	101.27	2,564,455,113	101.30	2,565,240,163	1.38	2012/ 9/15	0.68
12	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,302,200,000	103.81	2,389,959,864	106.55	2,452,994,100	2.63	2014/ 6/30	0.65
13	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,148,720,000	109.34	2,349,303,012	111.53	2,396,488,903	4.25	2014/ 8/15	0.64
14	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,225,460,000	106.11	2,361,413,351	105.88	2,356,205,775	3.63	2013/ 5/15	0.63
15	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債 証券	フラ ンス	2,214,200,000	104.83	2,321,075,891	104.97	2,324,245,740	4.00	2013/ 4/25	0.62
16	US T N/B 0.5 10/15/13	国債 証券	米国	2,302,200,000	98.41	2,265,687,108	100.60	2,316,036,222	0.50	2013/ 10/15	0.62
17	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイ ツ	2,103,490,000	107.72	2,265,879,428	109.55	2,304,268,121	4.25	2014/ 7/4	0.61
18	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,148,720,000	102.64	2,205,532,157	106.17	2,281,317,511	2.38	2014/ 9/30	0.61
19	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債 証券	フラ ンス	2,103,490,000	105.39	2,216,931,880	105.95	2,228,647,655	4.00	2013/ 10/25	0.59

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

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

種類別業種別投資比率

平成23年8月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.77
合計	97.77

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成23年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

D I A M D C バランス30インデックスファンド

	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20年2月25日現在）	2,675	2,675	0.9710	0.9710
第2期末（平成21年2月25日現在）	2,141	2,141	0.8095	0.8095
第3期末（平成22年2月25日現在）	2,414	2,414	0.8824	0.8824
第4期末（平成23年2月25日現在）	2,558	2,558	0.9041	0.9041
平成22年8月末	2,435		0.8670	
9月末	2,482		0.8847	
10月末	2,458		0.8750	
11月末	2,483		0.8821	
12月末	2,499		0.8909	
平成23年1月末	2,538		0.8954	
2月末	2,564		0.9058	
3月末	2,562		0.8980	
4月末	2,579		0.9008	
5月末	2,573		0.8938	
6月末	2,631		0.8950	
7月末	2,620		0.8869	
8月末	2,569		0.8673	

D I A M D C バランス50インデックスファンド

	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20年2月25日現在）	4,722	4,722	0.9331	0.9331
第2期末（平成21年2月25日現在）	3,473	3,473	0.6847	0.6847
第3期末（平成22年2月25日現在）	4,138	4,138	0.7770	0.7770
第4期末（平成23年2月25日現在）	4,500	4,500	0.8051	0.8051
平成22年8月末	4,121		0.7438	
9月末	4,250		0.7669	
10月末	4,181		0.7559	
11月末	4,282		0.7717	
12月末	4,343		0.7842	
平成23年1月末	4,433		0.7920	
2月末	4,517		0.8081	
3月末	4,470		0.7929	
4月末	4,492		0.7938	
5月末	4,457		0.7833	
6月末	4,577		0.7844	
7月末	4,541		0.7735	
8月末	4,380		0.7427	

D I A M D C バランス70インデックスファンド

	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20年2月25日現在）	2,611	2,611	0.8961	0.8961
第2期末（平成21年2月25日現在）	1,747	1,747	0.5753	0.5753
第3期末（平成22年2月25日現在）	2,234	2,234	0.6792	0.6792
第4期末（平成23年2月25日現在）	2,479	2,479	0.7105	0.7105
平成22年8月末	2,186		0.6329	
9月末	2,280		0.6597	
10月末	2,244		0.6480	
11月末	2,318		0.6698	
12月末	2,360		0.6843	
平成23年1月末	2,423		0.6944	
2月末	2,491		0.7142	
3月末	2,450		0.6948	
4月末	2,460		0.6945	
5月末	2,431		0.6815	
6月末	2,465		0.6825	
7月末	2,436		0.6693	
8月末	2,312		0.6311	

【分配の推移】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-

D I A M D C バランス50インデックスファンド

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-

D I A M D C バランス70インデックスファンド

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-

【収益率の推移】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

	収益率（％）
第1期	2.90
第2期	16.63
第3期	9.01
第4期	2.46
第5期中間計算期間	4.75

(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 D C バランス50インデックスファンド

	収益率（％）
第1期	6.69
第2期	26.62
第3期	13.48
第4期	3.62
第5期中間計算期間	8.81

(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 D C バランス70インデックスファンド

	収益率（％）
第1期	10.39
第2期	35.80
第3期	18.06
第4期	4.61
第5期中間計算期間	12.58

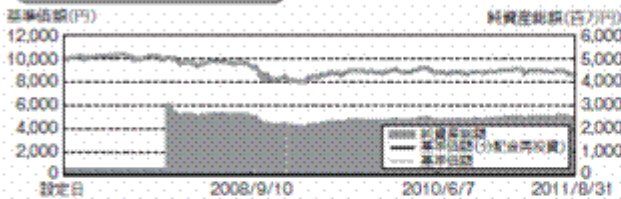
(注)収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

<< 参考情報 >>

データの基準日:2011年8月31日

DIAM DC バランス30インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (設定日(2006年12月27日)～2011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円に設定まで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:2006年12月27日)
 ※基準価額は償付金繰入後の値です。

分配の推移(税引前)

第1期	(2008.02.25)	0円
第2期	(2009.02.25)	0円
第3期	(2010.02.25)	0円
第4期	(2011.02.25)	0円
設定未累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

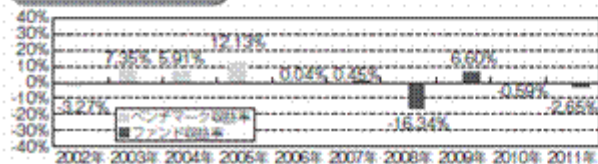
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内債券バランファンド(マザーファンド)	53.18
2	国内株式バランファンド(最適化法)マザーファンド	19.28
3	外国債券バランファンド(マザーファンド)	15.35
4	外国株式バランファンド(マザーファンド)	9.20

※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」をご確認ください。

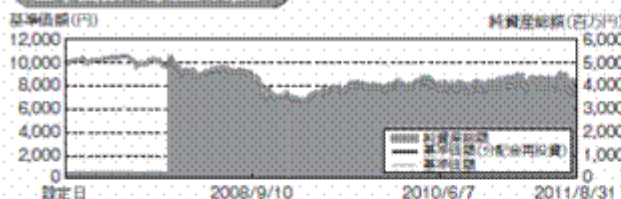
年間収益率の推移



※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、毎年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドのベンチマークは、当社が独自に構築した合成インデックスです。国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BP組合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティグループ世界債券インデックス(除日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコールローンのオーバーナイト物レート。当ファンドの基本アロケーション(国内株式:20.0%、国内債券:52.0%、外国株式:10.0%、外国債券:15.0%、短期金融資産:3.0%)に基づいて合成したものです。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (設定日(2006年12月27日)～2011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円に設定まで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:2006年12月27日)
 ※基準価額は償付金繰入後の値です。

分配の推移(税引前)

第1期	(2008.02.25)	0円
第2期	(2009.02.25)	0円
第3期	(2010.02.25)	0円
第4期	(2011.02.25)	0円
設定未累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

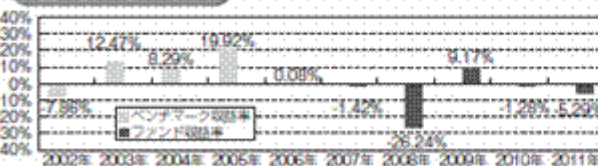
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内株式バランファンド(最適化法)マザーファンド	34.03
2	国内債券バランファンド(マザーファンド)	31.29
3	外国債券バランファンド(マザーファンド)	17.78
4	外国株式バランファンド(マザーファンド)	13.92

※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」をご確認ください。

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、毎年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドのベンチマークは、当社が独自に構築した合成インデックスです。国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BP組合、外国株式についてはMSCIコクサイインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティグループ世界債券インデックス(除日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコールローンのオーバーナイト物レート。当ファンドの基本アロケーション(国内株式:35.0%、国内債券:30.0%、外国株式:15.0%、外国債券:17.0%、短期金融資産:3.0%)に基づいて合成したものです。

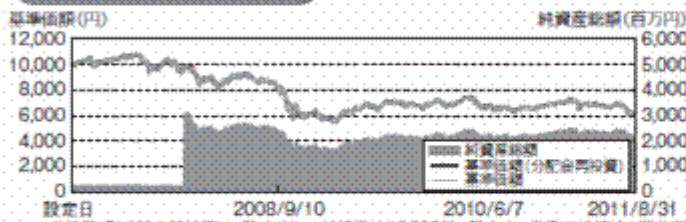
- 掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- 委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2011年8月31日

DIAM DC バランス70インデックスファンド

基準価額・純資産の推移

(設定日(2006年12月27日)～2011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:2006年12月27日)
 ※基準価額は隔年調整除後です。

分配の推移(税引前)

期	日	金額
第1期	(2008.02.25)	0円
第2期	(2009.02.25)	0円
第3期	(2010.02.25)	0円
第4期	(2011.02.25)	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

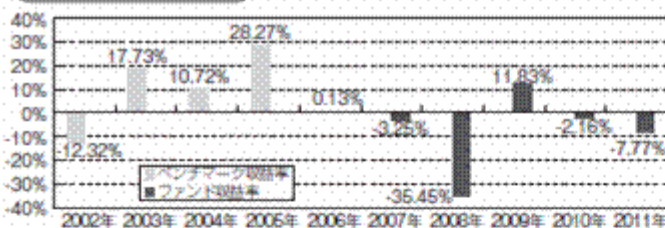
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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	48.98
2	外国債券パッシブファンド・マザーファンド	21.69
3	外国株式パッシブファンド・マザーファンド	18.91
4	国内債券パッシブファンド・マザーファンド	7.48

※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、2006年は設定日から年末までの収益率、および2011年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドのベンチマークは、当社が独自に構築した合成インデックスです。国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローン・オーバーナイト物レートを、当ファンドの基本アロケーション(国内株式:50.0%、国内債券:7.0%、外国株式:20.0%、外国債券:20.0%、短期金融資産:3.0%)に基づいて合成したものです。

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。

ポートフォリオの状況

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

組入上位5業種(株式)

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

組入上位10銘柄

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

○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。

○当該ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2011年8月31日

■外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

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

組入上位10銘柄

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

組入上位5業種(株式)

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

■国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

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

組入上位10銘柄

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

■外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

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

組入上位10銘柄

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

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

○当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が明示されている場合があります。

(4)【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

D I A M D C バランス30インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第1期	3,100,768,537	345,452,038
第2期	229,578,698	339,107,428
第3期	243,751,371	153,541,357
第4期	235,972,752	141,593,022
第5期中間計算期間	173,411,565	57,248,197

(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 D C バランス50インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第1期	5,407,868,136	346,621,435
第2期	439,067,605	427,745,782
第3期	495,694,818	241,797,536
第4期	487,922,998	224,206,853
第5期中間計算期間	362,616,138	95,591,838

(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 D C バランス70インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第1期	3,243,343,171	329,317,247
第2期	362,375,624	238,812,098
第3期	443,121,260	190,773,589
第4期	402,406,730	203,211,017
第5期中間計算期間	216,572,981	72,279,324

(注1)本邦外における設定及び解約はございません。

(注2)設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第3【ファンドの経理状況】

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

< 追加 >

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4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5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 D C バランス30インデックスファンド】
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5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	76,570,810	81,444,616
親投資信託受益証券	2,353,679,210	2,461,491,633
流動資産合計	2,430,250,020	2,542,936,249
資産合計	2,430,250,020	2,542,936,249
負債の部		
流動負債		
未払解約金	204,056	1,970,188
未払受託者報酬	385,019	400,969
未払委託者報酬	2,695,419	2,807,062
その他未払費用	64,095	63,403
流動負債合計	3,348,589	5,241,622
負債合計	3,348,589	5,241,622
純資産の部		
元本等		
元本	2,793,855,662	2,946,540,881
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	* ₃ 366,954,231	* ₃ 408,846,254
（分配準備積立金）	96,497,023	133,906,505
元本等合計	2,426,901,431	2,537,694,627
純資産合計	2,426,901,431	2,537,694,627
負債純資産合計	2,430,250,020	2,542,936,249

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 4 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 5 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	29,539	27,828
有価証券売買等損益	35,883,313	121,759,690
営業収益合計	35,853,774	121,731,862
営業費用		
受託者報酬	385,019	400,969
委託者報酬	2,695,419	2,807,062
その他費用	64,095	63,403
営業費用合計	3,144,533	3,271,434
営業損失（ ）	38,998,307	125,003,296
経常損失（ ）	38,998,307	125,003,296
中間純損失（ ）	38,998,307	125,003,296
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（ ）	403,044	838,118
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	321,627,614	271,454,443
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,184,898	5,504,286
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,184,898	5,504,286
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,110,164	18,730,919
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,110,164	18,730,919
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	366,954,231	408,846,254

（ 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4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5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4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5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4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5期中間計算期間末 平成23年8月25日現在
*1 期首元本額	2,735,997,783円	2,830,377,513円
期中追加設定元本額	119,106,449円	173,411,565円
期中解約元本額	61,248,570円	57,248,197円
*2 中間計算期間末日における受 益権の総数	2,793,855,662口	2,946,540,881口
*3 元本の欠損	中間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366,954,231円であります。	中間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408,846,254円であります。

（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4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5期中間計算期間末 平成23年8月25日現在

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5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	0.8687円	0.8612円
（1万口当たり純資産額）	（8,687円）	（8,612円）

【D I A M D C バランス50インデックスファンド】
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5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	132,444,331	137,167,950
親投資信託受益証券	3,981,165,466	4,170,129,969
未収入金	400,000	-
流動資産合計	4,114,009,797	4,307,297,919
資産合計	4,114,009,797	4,307,297,919
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,003,111	573,574
未払受託者報酬	666,866	694,650
未払委託者報酬	5,335,274	5,557,409
その他未払費用	111,065	109,900
流動負債合計	8,116,316	6,935,533
負債合計	8,116,316	6,935,533
純資産の部		
元本等		
元本	5,514,191,379	5,857,206,251
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	* ₃ 1,408,297,898	* ₃ 1,556,843,865
（分配準備積立金）	182,985,871	255,807,968
元本等合計	4,105,893,481	4,300,362,386
純資産合計	4,105,893,481	4,300,362,386
負債純資産合計	4,114,009,797	4,307,297,919

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 4 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 5 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	50,968	48,273
有価証券売買等損益	174,083,577	402,724,890
営業収益合計	174,032,609	402,676,617
営業費用		
受託者報酬	666,866	694,650
委託者報酬	5,335,274	5,557,409
その他費用	111,065	109,900
営業費用合計	6,113,205	6,361,959
営業損失（ ）	180,145,814	409,038,576
経常損失（ ）	180,145,814	409,038,576
中間純損失（ ）	180,145,814	409,038,576
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（ ）	202,870	2,354,688
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,187,743,583	1,089,745,123
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,395,856	18,673,215
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,395,856	18,673,215
剰余金減少額又は欠損金増加額	52,601,487	79,088,069
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	52,601,487	79,088,069
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,408,297,898	1,556,843,865

（ 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4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5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4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5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4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5期中間計算期間末 平成23年8月25日現在
*1 期首元本額	5,326,465,806円	5,590,181,951円
期中追加設定元本額	243,412,258円	362,616,138円
期中解約元本額	55,686,685円	95,591,838円
*2 中間計算期間末日における受 益権の総数	5,514,191,379口	5,857,206,251口
*3 元本の欠損	中間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1,408,297,898円でありま す。	中間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1,556,843,865円でありま す。

（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4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5期中間計算期間末 平成23年8月25日現在

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5期中間計算期間末 平成23年8月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7446円 (7,446円)	0.7342円 (7,342円)

【D I A M D C バランス70インデックスファンド】
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5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	70,541,143	73,454,640
親投資信託受益証券	2,105,933,541	2,189,615,871
未収入金	300,000	500,000
流動資産合計	2,176,774,684	2,263,570,511
資産合計	2,176,774,684	2,263,570,511
負債の部		
流動負債		
未払解約金	720,613	3,101,748
未払受託者報酬	362,014	376,558
未払委託者報酬	3,258,525	3,389,399
その他未払費用	60,255	59,540
流動負債合計	4,401,407	6,927,245
負債合計	4,401,407	6,927,245
純資産の部		
元本等		
元本	3,432,338,671	3,633,426,491
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	* ₃ 1,259,965,394	* ₃ 1,376,783,225
（分配準備積立金）	108,077,039	150,549,728
元本等合計	2,172,373,277	2,256,643,266
純資産合計	2,172,373,277	2,256,643,266
負債純資産合計	2,176,774,684	2,263,570,511

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 4 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 5 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	27,849	26,453
有価証券売買等損益	156,892,680	317,767,197
営業収益合計	156,864,831	317,740,744
営業費用		
受託者報酬	362,014	376,558
委託者報酬	3,258,525	3,389,399
その他費用	60,255	59,540
営業費用合計	3,680,794	3,825,497
営業損失（ ）	160,545,625	321,566,241
経常損失（ ）	160,545,625	321,566,241
中間純損失（ ）	160,545,625	321,566,241
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（ ）	914,869	2,924,309
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,055,295,578	1,010,106,709
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,945,866	20,968,032
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,945,866	20,968,032
剰余金減少額又は欠損金増加額	64,155,188	69,002,616
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	64,155,188	69,002,616
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,259,965,394	1,376,783,225

（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4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5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4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5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4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5期中間計算期間末 平成23年8月25日現在
*1 期首元本額	3,289,937,121円	3,489,132,834円
期中追加設定元本額	207,878,417円	216,572,981円
期中解約元本額	65,476,867円	72,279,324円
*2 中間計算期間末日における受 益権の総数	3,432,338,671口	3,633,426,491口
*3 元本の欠損	中間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1,259,965,394円でありま す。	中間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1,376,783,225円でありま す。

（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4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5期中間計算期間末 平成23年8月25日現在

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期中間計算期間末 平成22年8月25日現在	第5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	0.6329円	0.6211円
（1万口当たり純資産額）	（6,329円）	（6,211円）

（参考）

D I A M D C バランス30インデックスファンド、D I A M D C バランス50インデックスファンド、D I A M D C バランス70インデックスファンドは「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成23年2月26日 至平成23年8月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月9日から平成23年2月7日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月8日から平成24年2月7日までとなっております。

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年8月25日現在	平成23年8月25日現在
*1 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	233,574,423,007円	220,196,722,346円
同期中追加設定元本額	23,914,440,098円	36,040,801,217円
同期中解約元本額	16,350,198,905円	21,284,682,303円
同中間期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,517,478,992円	1,882,694,256円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	790,549,137円	1,137,065,242円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	29,675,502,988円	32,531,169,574円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	723,549,533円	792,651,229円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,700,027,535円	2,960,901,224円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,837,201,884円	3,093,476,611円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	443,108,711円	476,389,961円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,330,727,214円	1,441,408,544円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,021,178,757円	1,097,603,346円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	155,533,904円	140,899,989円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,324,211,291円	1,429,546,829円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,934,919円	19,101,935円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	279,982,449円	259,835,407円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	11,510,319,984円	10,451,406,780円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,878,746,522円	1,769,741,583円
D I A M国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	219,146,139円	205,820,466円
D I A M国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	813,337,539円	786,237,556円
D I A M国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	233,198,025円	214,838,379円

D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	311,914,913円	288,707,842円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,952,892,777円	19,659,845,170円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,868,574,732円	6,531,889,893円
D I A Mバランスファンド25VA(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37.5VA(適格機関投資家限定)	3,707,930,908円	3,393,836,502円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,616,670,784円	7,941,750,425円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	1,260,833,811円	1,200,585,606円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	2,714,944,525円	2,593,655,924円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,817,802,976円	2,641,971,684円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	15,065,538,870円	14,321,092,541円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	243,609,429円	222,287,324円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け)	282,809,995円	円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,968,322,480円	4,806,764,914円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	9,448,119,328円	9,443,941,995円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	455,563,938円	471,577,180円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	42,813,305,776円	40,788,788,234円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,917,398,303円	2,707,459,431円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,226,304,463円	5,015,717,046円

D I A M世界アセットバランス ファンド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30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50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70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VA（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 3 0 V A（適格 機関投資家限定）	5,207,986,108円	4,594,703,364円
D I A M世界アセットバランス ファンド V A（適格機関投資家 向け）	4,620,577,243円	4,124,635,914円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	78,999,091円	57,674,003円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	266,449,308円	円

D I A M世界バランスファンド 5 5 V 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3 5 V 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2 V 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4 0 V 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2 5 V 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3 V 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5 0 V A（適 格機関投資家限定）	176,452円	169,277円
D I A Mバランス7 0 V 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4 V 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4 0 V A（適 格機関投資家限定）	83,044円	79,542円
D I A Mバランス6 0 V 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		<p>(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。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

（株式関連）

平成22年8月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

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

平成23年8月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	341,618,591	-	327,339,090	14,279,501
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	438,474,704	-	428,172,358	10,302,346
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,492,379,093	-	1,307,533,392	184,845,701
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	759,768,530	-	707,039,377	52,729,153
	米ドル S&P 500 FUTURE	3,782,759,084	-	3,540,236,960	242,522,124
	合 計	6,815,000,002	-	6,310,321,177	504,678,825

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

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

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

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況
貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年2月26日 至平成22年8月25日	自平成23年2月26日 至平成23年8月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月14日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月15日から平成24年2月14日までとなっております。

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年8月25日現在	平成23年8月25日現在
*1 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	392,786,689,803円	385,632,006,164円
同期中追加設定元本額	32,592,070,176円	20,106,467,979円
同期中解約元本額	44,287,989,359円	31,299,028,120円
同中間期末における元本の内訳		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	2,463,518,674円	5,566,674,413円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	6,955,524,575円	7,939,305,966円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	2,406,045,530円	2,685,616,264円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,801,540,628円	4,182,651,229円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,537,540,126円	1,678,704,610円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,159,505,105円	1,208,542,326円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,174,341,573円	1,212,111,006円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	151,274,801円	152,558,937円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	235,767,690円	199,505,378円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,011,490,436円	2,023,403,929円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,286,745円	4,618,906円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	10,126,042円	10,126,042円
D I A M国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	14,855,804,543円	20,137,464,584円
D I A M国内債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）	111,456,240円	110,596,194円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	901,520,367円	840,004,173円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	13,512,569,886円	12,308,638,381円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	734,613,366円	695,282,167円

D I A M国際分散バランスファン ド30VA（適格機関投資家 限定）	500,494,130円	472,280,626円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA（適格機関投資家 限定）	1,193,497,737円	1,159,871,021円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA（適格機関投資家 限定）	570,499,742円	528,329,280円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA（適格機関投資家 限定）	406,871,772円	378,632,552円
D I A M世界バランスファンド 40VA（適格機関投資家限 定）	30,748,414,846円	28,997,791,335円
D I A M世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限 定）	10,083,019,947円	9,634,815,462円
D I A Mバランスファンド25 VA（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 7.5VA（適格機関投資家限 定）	5,441,647,448円	5,005,525,015円
D I A Mバランスファンド50 VA（適格機関投資家限定）	8,428,690,940円	7,805,963,762円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA（適格機関投資 家限定）	1,851,928,056円	1,774,694,667円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA2（適格機関投 資家限定）	6,653,299,627円	6,390,462,274円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30VA（適格 機関投資家限定）	8,276,576,684円	7,811,741,256円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA（適格機関投資家 向け）	14,741,726,844円	14,112,131,719円
D I A Mグローバル 私募ファン ド（適格機関投資家向け）	812,270,396円	708,137,610円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	563,400,695円	円
D I A M世界バランスファンド 55VA（適格機関投資家限 定）	14,600,508,930円	14,212,076,050円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド35VA（適格機 関投資家限定）	7,496,739,803円	7,010,138,340円
D I A Mグローバル分散ファン ドVA（適格機関投資家限定）	1,552,967,291円	1,468,268,176円

D I A M世界アセットバランス ファンド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2 5 V A (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3 V A (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3 0 V A (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5 0 V A (適 格機関投資家限定)	233,937円	240,292円
D I A Mバランス7 0 V A (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4 V A (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2 5 V A (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3 0 V A (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2 0 V A (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4 0 V A (適 格機関投資家限定)	309,623円	316,855円
D I A Mバランス6 0 V A (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< D C年金>	3,152,490,399円	3,810,202,479円
D I A Mバランス・ファンド< D C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< D C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< D C年金> 3 成長型	1,061,153,740円	1,207,609,446円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	303,836,700円	339,634,869円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	590,203,139円	670,636,125円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	390,777,092円	431,790,355円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	187,391,841円	171,226,226円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,599,137,062円	1,738,124,061円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,146,765円	11,284,799円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	10,856,362,996円	6,765,907,276円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	3,976,439,062円	7,847,972,490円
D I A M外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	7,836,773,028円	7,533,251,767円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	948,036,288円	946,676,260円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	259,207,377円	253,406,824円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	51,168,099,336円	48,871,135,752円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,782,536,054円	2,758,108,596円

D I A M国際分散バランスファン ド30VA（適格機関投資家 限定）	473,548,777円	468,085,935円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA（適格機関投資家 限定）	752,695,160円	766,532,092円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA（適格機関投資家 限定）	215,861,509円	209,393,809円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA（適格機関投資家 限定）	96,138,003円	93,801,182円
D I A M世界バランスファンド 40VA（適格機関投資家限 定）	29,094,065,731円	28,698,297,978円
D I A M世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限 定）	6,354,180,952円	6,367,468,942円
D I A Mバランスファンド25 VA（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3 7.5VA（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50 VA（適格機関投資家限定）	7,975,171,433円	7,727,595,706円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA（適格機関投資 家限定）	2,921,164,063円	2,932,629,853円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA2（適格機関投 資家限定）	8,808,681,602円	8,888,041,104円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30VA（適格 機関投資家限定）	10,432,669,614円	10,322,875,417円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA（適格機関投資家 向け）	51,179,502,847円	51,231,587,733円
D I A Mグローバル 私募ファン ド（適格機関投資家向け）	261,397,379円	267,315,107円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	528,817,558円	円
D I A M世界バランスファンド 55VA（適格機関投資家限 定）	6,903,137,509円	7,053,725,381円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド35VA（適格機 関投資家限定）	15,887,855,861円	15,061,844,607円
D I A Mグローバル分散ファン ドVA（適格機関投資家限定）	284,501,018円	288,588,800円

D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（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3 V A（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30 V A（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50 V A（適 格機関投資家限定）	221,987円	238,668円
D I A Mバランス70 V A（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4 V A（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25 V A （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20 V A（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40 V A（適 格機関投資家限定）	209,715円	223,848円
D I A Mバランス60 V A（適 格機関投資家限定）	125,147円	136,549円
（合 計）	337,629,285,459円	332,647,893,276円
*2 本半期報告書における開示対 象ファンドの中間計算期間末日 における受益権総数	337,629,285,459口	332,647,893,276口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年8月25日現在	平成23年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び その差額		貸借対照表上の金融商品は原則 としてすべて時価で評価してい るため、貸借対照表計上額と時価 との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

（通貨関連）

平成22年8月25日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	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。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

平成23年8月31日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	2,570,218,931円
負債総額	628,064円
純資産総額（ - ）	2,569,590,867円
発行済数量	2,962,885,682口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8673円

D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成23年8月31日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	4,380,624,597円
負債総額	204,857円
純資産総額（ - ）	4,380,419,740円
発行済数量	5,898,345,825口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7427円

D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成23年8月31日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	2,312,596,072円
負債総額	214,722円
純資産総額（ - ）	2,312,381,350円
発行済数量	3,663,933,774口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6311円

（参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年8月31日現在

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年8月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	375,985,327,271円
負債総額	105,496,000円
純資産総額（ - ）	375,879,831,271円
発行済数量	323,584,370,149口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1616円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

<更新・訂正後>

(1) 資本金の額

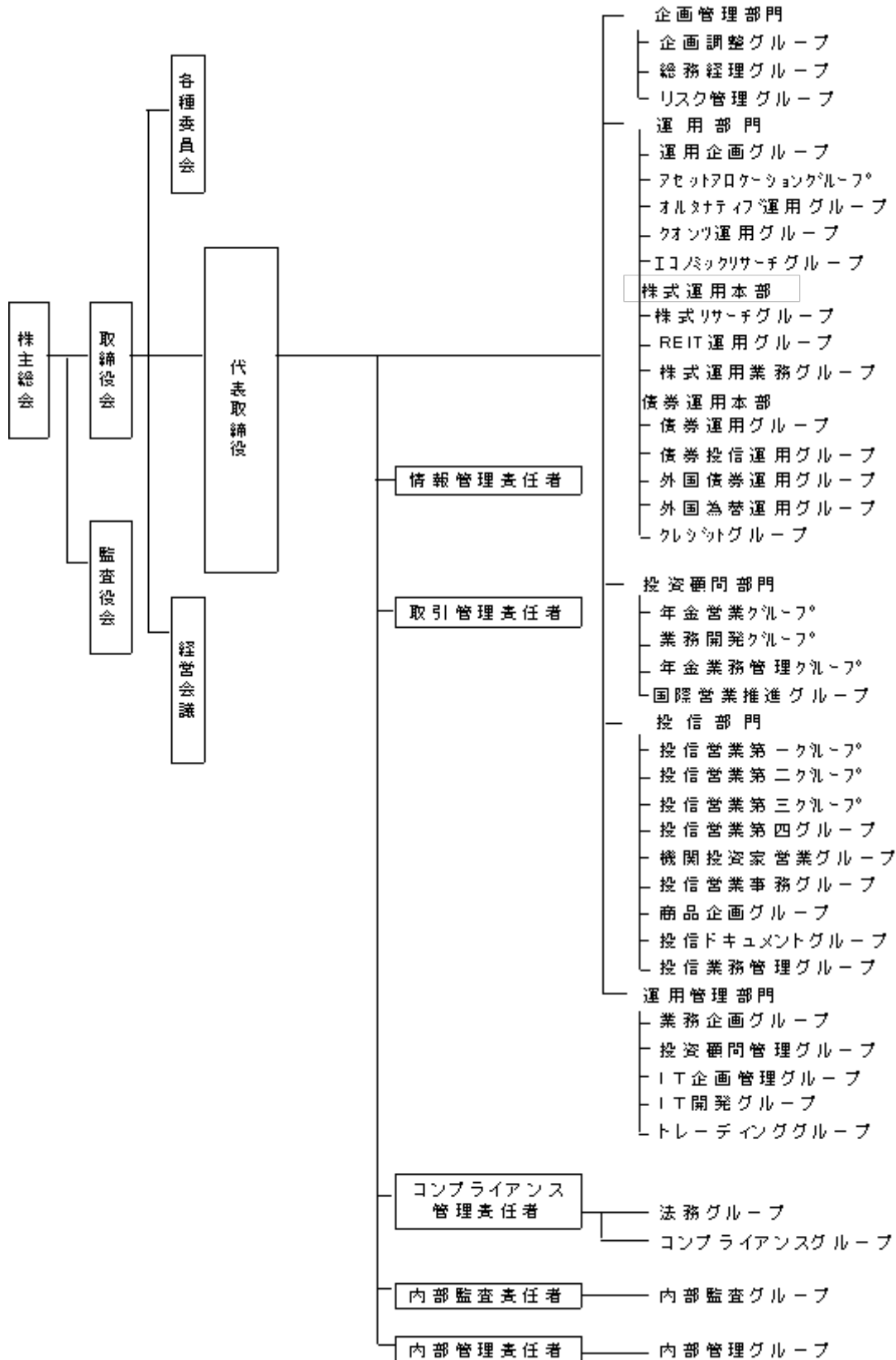
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の組織図



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

会社の意思決定機構

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

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

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

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

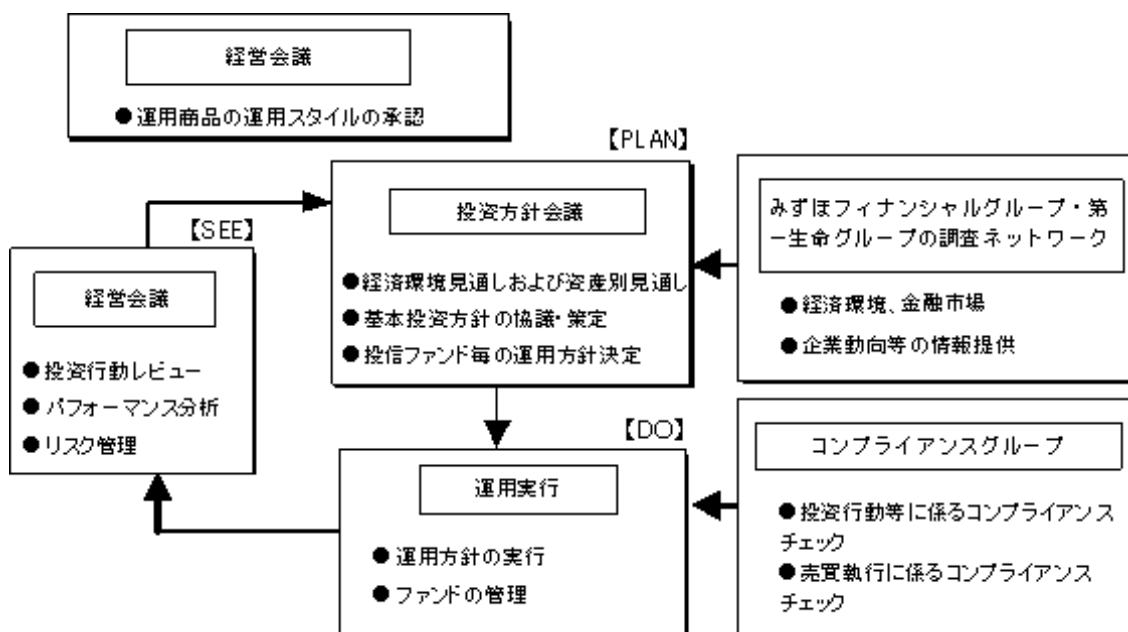
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

平成23年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は280本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	16	31,401,449,278
追加型株式投資信託	251	4,097,938,081,757
単位型公社債投資信託	12	76,337,182,227
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	301,610,059
合計	280	4,205,978,323,321

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
なお、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第25期 （平成22年3月31日現在）	第26期 （平成23年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	119,466	120,910
未払金	1,526,031	1,479,756
未払収益分配金	7,837	3,223
未払償還金	96,340	98,362
未払手数料	1,206,815	1,134,992
その他未払金	215,038	243,178
未払費用	2 1,522,325	2 1,226,658
未払法人税等	1,283,275	1,706,391
未払消費税等	113,923	143,728
賞与引当金	572,614	575,326
その他	38,231	10,000
流動負債計	5,175,867	5,262,771
固定負債		
退職給付引当金	488,790	579,063
役員退職慰労引当金	96,342	100,260
固定負債計	585,133	679,324
負債合計	5,761,000	5,942,095
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	15,737,995	18,512,674
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	11,650,000	13,430,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,464,702	4,459,380
株主資本計	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	231,525	216,534
評価・換算差額等計	231,525	216,534
純資産合計	20,397,999	23,157,686
負債・純資産合計	26,158,999	29,099,782

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）		第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	5,287		4	341,775
受取利息	18,745			9,168
時効成立分配金	157			2,574
投資信託解約益	559,971			157,213
先物利益	-			9,816
金銭の信託運用益	-			69,014
雑収入	3,431			8,602
営業外収益計		587,592		598,165
営業外費用				
為替差損	17,771			755
時効成立後支払分配金	444			-
先物損失	719,577			-
金銭の信託運用損	1,116			-
雑損失	-			6,089
営業外費用計		738,911		6,844
経常利益		5,798,181		7,259,672
特別利益				
貸倒引当金戻入益	-			4,288
過年度損益修正益	-		3,4	105,241
特別利益計		-		109,530
特別損失				
固定資産除却損	2	21,626	2	31,419
固定資産売却損		2,464		1,440
関係会社株式評価損		-		3,825
特別損失計		24,090		36,684
税引前当期純利益		5,774,091		7,332,518
法人税、住民税及び事業税		2,508,095		2,885,426
法人税等調整額		135,267		7,586
法人税等合計		2,372,828		2,877,839
当期純利益		3,401,263		4,454,678

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	10,040,000	11,650,000
当期変動額	1,610,000	1,780,000
当期末残高	11,650,000	13,430,000
研究開発積立金		
前期末残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
前期末残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	3,299,438	3,464,702
当期変動額		
剰余金の配当	1,626,000	1,680,000
別途積立金の積立	1,610,000	1,780,000
当期純利益	3,401,263	4,454,678
当期末残高	3,464,702	4,459,380
利益剰余金合計		
前期末残高	13,962,732	15,737,995
当期変動額	1,775,263	2,774,678
当期末残高	15,737,995	18,512,674
株主資本合計		
前期末残高	18,391,210	20,166,473
当期変動額	1,775,263	2,774,678
当期末残高	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	1,547	231,525
当期変動額(純額)	233,073	14,991
当期末残高	231,525	216,534
純資産合計		
前期末残高	18,389,662	20,397,999
当期変動額	2,008,336	2,759,687
当期末残高	20,397,999	23,157,686

次へ

重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）</p>	<p style="text-align: center;">第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）</p>
<p>1.有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法</p> <p>（2）其他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2.金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>3.デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>4.固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>（2）無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>（3）リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法</p> <p>5.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>6.引当金の計上基準</p> <p>（1）貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>（2）賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p>	<p>1.有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式 同左</p> <p>（2）其他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2.金銭の信託の評価基準及び評価方法 同左</p> <p>3.デリバティブの評価基準及び評価方法 同左</p> <p>4.固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>（2）無形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>（3）リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） 同左</p> <p>5.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>6.引当金の計上基準</p> <p>（1）同左</p> <p>（2）同左</p>

<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準委員会平成20年7月31日 企業会計基準第19号)を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>7. リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>8. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <hr/> <p>(4) 同左</p> <p>7. リース取引の処理方法 同左</p> <p>8. 消費税等の処理方法 同左</p>
--	--

追加情報

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

注記事項

(貸借対照表関係)

第25期（平成22年3月31日現在）			第26期（平成23年3月31日現在）		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物	471,484千円		建物	484,832千円	
器具備品	356,326千円		器具備品	499,620千円	
商標権	6,882千円		商標権	2,428千円	
ソフトウェア	684,370千円		ソフトウェア	809,403千円	
電話施設利用権	1,065千円		電話施設利用権	1,145千円	
2. 関係会社項目			2. 関係会社項目		
関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。			関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。		
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動資産	未収投資助言報酬	266,194千円
流動負債	未払費用	400,075千円	流動負債	未払費用	291,628千円

(損益計算書関係)

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1. 役員報酬の限度額	1. 役員報酬の限度額
取締役 年額250,000千円	同左
監査役 年額 50,000千円	
2. 固定資産除却損の内訳	2. 固定資産除却損の内訳
建物 1,199千円	建物 15,317千円
器具備品 15,159千円	器具備品 3,597千円
ソフトウェア 5,267千円	ソフトウェア 12,503千円
	3. 過年度損益修正益の内訳
	特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。
	4. 関係会社項目
	各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。
	受取配当金 331,240千円
	過年度損益修正益 105,241千円

（株主資本等変動計算書関係）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 投資有価証券

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

(4) 長期差入保証金

長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負債

(1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等（貸借対照表計上額1,125,584千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

(*) 長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,220,759	12,220,759	-
(2) 金銭の信託	5,967,344	5,967,344	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	524,252	524,252	-
資産計	18,712,356	18,712,356	-
(1) 未払法人税等	1,706,391	1,706,391	-
負債計	1,706,391	1,706,391	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金（貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,220,413	-	-	-
合計	12,220,413	-	-	-

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額
該当事項はありません。

(有価証券関係)

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	513,129	146,101	367,027
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,400	3,000	400
小計	516,529	149,101	367,427
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,723	10,000	2,277
小計	7,723	10,000	2,277
合計	524,252	159,101	365,150

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

（金銭の信託関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	399,833	838

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	5,967,344	119,701

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

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

（注2）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 不動産投資信託関連

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

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

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

3. 退職給付費用に関する事項

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

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

3. 退職給付費用に関する事項

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	24,367,005	5,478,622	789,867	30,635,495

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(追加情報)

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

(関連当事者との取引)

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

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

(2)子会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払手 数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払手 数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	みずほ第 一フィナ 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	-
その他の 関係会社 の子会社	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	-
その他の 関係会社 の子会社	みずほ第 一ファイ ナルテ 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
その他の 関係会社 の子会社	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
								信託報酬の 支払	3,163		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 964,903円60銭 1株当たり当期純利益金額 185,611円60銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

<更新・訂正後>

(1) 受託会社

a . 名称

みずほ信託銀行株式会社

b . 資本金の額

平成23年3月末日現在 247,303百万円

c . 事業の内容

日本において信託銀行業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

(平成23年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
第一生命保険株式会社	210,200	日本において保険業務を営んでおります。

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 D C バランス30インデックスファンドの平成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 D C バランス30インデックスファンドの平成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 D C バランス50インデックスファンドの平成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 D C バランス50インデックスファンドの平成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 D C バランス70インデックスファンドの平成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 D C バランス70インデックスファンドの平成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 D C バランス30インデックスファンドの平成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 D C バランス30インデックスファンドの平成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 D C バランス50インデックスファンドの平成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 D C バランス50インデックスファンドの平成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 D C バランス70インデックスファンドの平成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 D C バランス70インデックスファンドの平成22年8月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年2月26日から平成22年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

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

中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

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

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

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

[ファンド監査報告書3へ](#)