

【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27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 西 惠正
【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】	上野 圭子
【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】

半期報告書の提出に伴い、平成27年5月25日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

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】

(3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成27年2月27日現在）

(略)

大株主の状況

（平成27年2月27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	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

< 訂正後 >

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成27年8月31日現在）

(略)

大株主の状況

（平成27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	東京都千代田区大手町一丁目5番5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27年4月13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27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】

< 運用評価・運用リスク管理体制 >

< 訂正前 >

(略)

上記体制は平成27年2月27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27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。

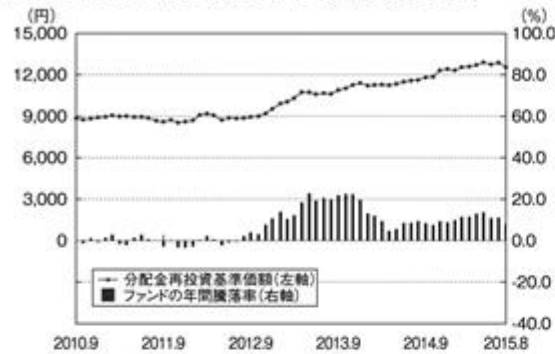
「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

< 更新・訂正後 >

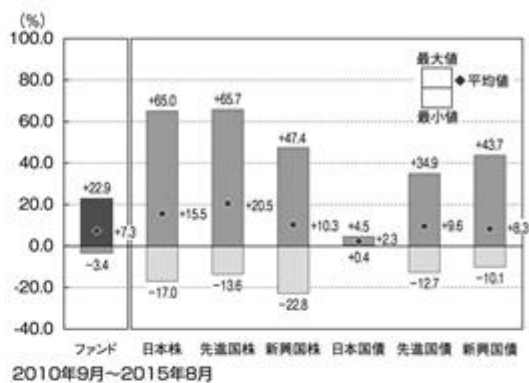
(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

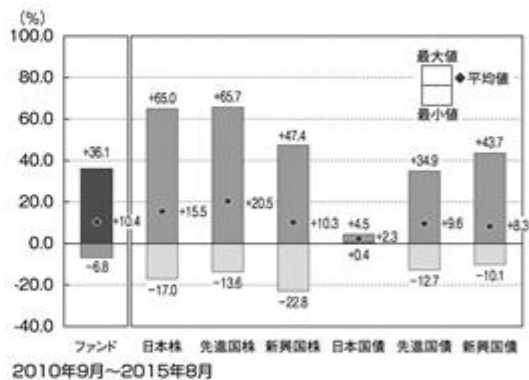
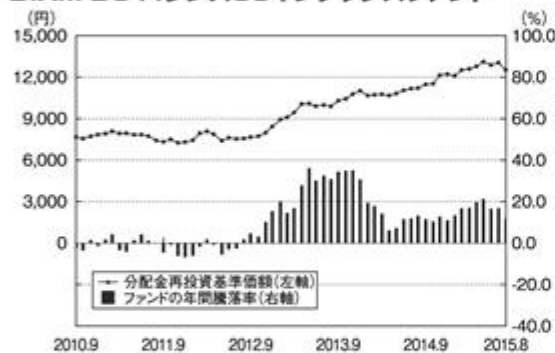
DIAM DC バランス30インデックスファンド



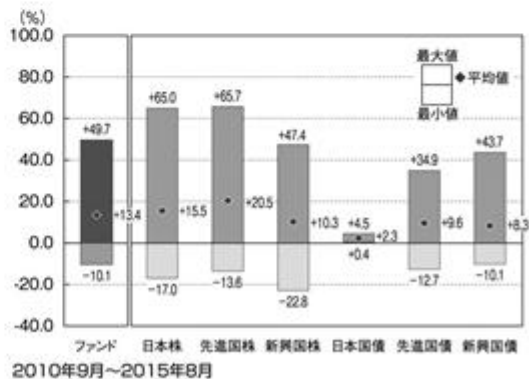
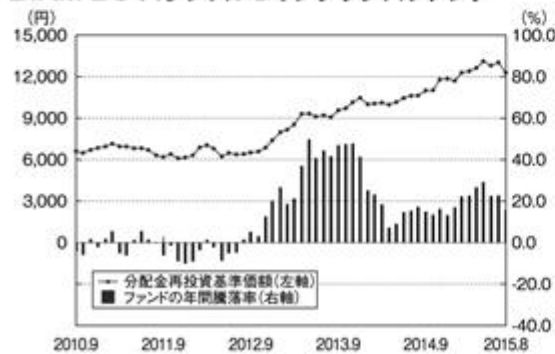
ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



DIAM DC バランス50インデックスファンド



DIAM DC バランス70インデックスファンド



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

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

*各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

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

<更新・訂正後>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等が追加される予定です。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、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。

上記は、平成27年8月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

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

<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27年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,894,121,210	97.03
内 日本	3,894,121,210	97.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	119,173,745	2.97
純資産総額	4,013,294,955	100.00

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

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

D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	7,500,545,278	97.07
内 日本	7,500,545,278	97.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	226,307,192	2.93
純資産総額	7,726,852,470	100.00

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

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

D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,623,833,510	97.01
内 日本	4,623,833,510	97.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	142,663,606	2.99
純資産総額	4,766,497,116	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	295,274,638,680	95.96
内 日本	295,274,638,680	95.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,421,184,175	4.04
純資産総額	307,695,822,855	100.00

その他資産の投資状況

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	13,080,755,000	4.25
内 日本	13,080,755,000	4.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	332,715,652,700	81.59
内 日本	332,715,652,700	81.59
地方債証券	27,620,526,266	6.77
内 日本	27,620,526,266	6.77
特殊債券	24,769,342,548	6.07
内 日本	24,769,342,548	6.07
社債券	21,649,257,500	5.31
内 日本	21,342,447,500	5.23
内 アメリカ	306,810,000	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,010,235,125	0.25
純資産総額	407,765,014,139	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	270,642,224,199	95.72
内 アメリカ	162,180,487,262	57.36
内 イギリス	22,389,084,629	7.92
内 スイス	11,910,498,145	4.21
内 フランス	10,643,973,886	3.76
内 ドイツ	10,524,616,638	3.72
内 カナダ	10,276,832,784	3.63
内 オーストラリア	6,895,313,141	2.44
内 アイルランド	4,954,776,901	1.75
内 オランダ	4,748,667,927	1.68
内 スペイン	4,192,082,434	1.48
内 スウェーデン	3,415,016,867	1.21
内 イタリア	2,714,325,887	0.96
内 香港	2,555,315,108	0.90
内 デンマーク	2,110,377,807	0.75
内 シンガポール	1,690,669,954	0.60
内 ジャージー	1,552,701,045	0.55
内 ベルギー	1,535,980,306	0.54

内	バミューダ	1,033,262,756	0.37
内	フィンランド	995,943,587	0.35
内	オランダ領キュラソー	909,187,677	0.32
内	イスラエル	755,060,720	0.27
内	ケイマン諸島	677,817,099	0.24
内	ノルウェー	642,807,983	0.23
内	ルクセンブルグ	312,244,930	0.11
内	オーストリア	213,366,434	0.08
内	パナマ	194,780,369	0.07
内	ポルトガル	188,450,895	0.07
内	ニュージーランド	160,000,220	0.06
内	リベリア	143,538,170	0.05
内	イギリス領バージン諸島	86,683,313	0.03
内	マン島	38,358,262	0.01
内	モーリシャス	1,063	0.00
投資信託受益証券		801,853,818	0.28
内	オーストラリア	694,575,869	0.25
内	シンガポール	107,277,949	0.04
投資証券		6,086,824,010	2.15
内	アメリカ	5,034,107,158	1.78
内	イギリス	441,049,417	0.16
内	フランス	427,441,906	0.15
内	香港	128,154,942	0.05
内	カナダ	56,070,587	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,201,850,885	1.84
純資産総額		282,732,752,912	100.00

その他資産の投資状況

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	1,360,001,200	0.48
-	1,360,001,200	0.48
株価指数先物取引（買建）	5,727,789,521	2.03
内 アメリカ	3,737,233,613	1.32
内 ドイツ	1,093,044,813	0.39
内 イギリス	487,969,843	0.17
内 オーストラリア	215,176,282	0.08
内 カナダ	194,364,970	0.07

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（注4）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	299,013,631,056	97.81
内 アメリカ	127,763,485,334	41.79
内 イタリア	29,405,631,701	9.62
内 フランス	29,066,680,283	9.51
内 イギリス	25,959,953,410	8.49
内 ドイツ	22,976,201,809	7.52
内 スペイン	16,127,319,143	5.28
内 ベルギー	7,785,884,095	2.55
内 オランダ	7,486,645,285	2.45
内 カナダ	6,315,629,225	2.07
内 オーストラリア	4,904,001,798	1.60
内 オーストリア	4,816,958,148	1.58
内 メキシコ	2,954,121,117	0.97
内 アイルランド	2,254,802,968	0.74
内 デンマーク	2,001,411,507	0.65
内 フィンランド	1,692,963,009	0.55
内 ポーランド	1,651,769,773	0.54
内 南アフリカ	1,457,203,689	0.48
内 マレーシア	1,285,240,072	0.42
内 スウェーデン	1,274,473,899	0.42
内 シンガポール	1,055,682,323	0.35
内 ノルウェー	777,572,468	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,707,540,902	2.19
純資産総額	305,721,171,958	100.00

その他資産の投資状況

平成27年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	615,369,450	0.20
-	615,369,450	0.20
為替予約取引（売建）	96,985,530	0.03
-	96,985,530	0.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,726,372,713	1.2272 2,118,753,822	1.2304 2,124,128,986	- -	52.93%
2	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	355,832,910	2.1434 762,706,057	2.2047 784,504,816	- -	19.55%
3	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	320,520,300	1.8850 604,201,135	1.8840 603,860,245	- -	15.05%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	136,110,694	2.9217 397,675,416	2.8038 381,627,163	- -	9.51%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27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）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,217,726,291	2.1421 2,608,589,341	2.2047 2,684,721,153	- -	34.75%
2	国内債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,922,126,517	1.2272 2,358,946,353	1.2304 2,364,984,466	- -	30.61%
3	外国債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	697,400,784	1.8851 1,314,716,631	1.8840 1,313,903,077	- -	17.00%
4	外国株式パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	405,498,460	2.9206 1,184,306,059	2.8038 1,136,936,582	- -	14.71%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.07%
合計	97.07%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,066,829,670	2.1436 2,286,949,242	2.2047 2,352,039,373	- -	49.35%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	525,578,958	1.8843 990,390,616	1.8840 990,190,756	- -	20.77%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	331,856,954	2.9222 969,769,110	2.8038 930,460,527	- -	19.52%
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	285,389,186	1.2269 350,169,014	1.2304 351,142,854	- -	7.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.01%
合計	97.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,806,100	7,700.00 13,906,970,000	7,192.00 12,989,471,200	- -	4.22%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	10,366,600	679.90 7,048,251,340	800.10 8,294,316,660	- -	2.70%
3	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	977,000	4,177.00 4,080,929,000	4,964.00 4,849,828,000	- -	1.58%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	683,400	7,136.00 4,876,742,400	7,063.00 4,826,854,200	- -	1.57%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,011,100	3,606.00 3,646,026,600	4,629.50 4,680,887,450	- -	1.52%
6	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	18,122,100	200.43 3,632,335,533	248.70 4,506,966,270	- -	1.46%

7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,177,700	3,820.50 4,499,402,850	3,824.00 4,503,524,800	- -	1.46%
8	K D D I 日本	株式 情報・通信業	1,312,700	2,595.33 3,406,894,425	3,018.00 3,961,728,600	- -	1.29%
9	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	867,100	3,525.80 3,057,225,020	4,329.50 3,754,109,450	- -	1.22%
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	513,700	5,922.00 3,042,131,400	5,962.00 3,062,679,400	- -	1.00%
11	ソニー 日本	株式 電気機器	920,100	3,102.36 2,854,488,925	3,162.00 2,909,356,200	- -	0.95%
12	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	540,400	4,386.00 2,370,194,400	5,290.00 2,858,716,000	- -	0.93%
13	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,535,300	1,830.00 2,809,599,000	1,800.00 2,763,540,000	- -	0.90%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	239,900	9,140.00 2,192,686,000	11,205.00 2,688,079,500	- -	0.87%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	136,300	20,035.00 2,730,770,500	19,715.00 2,687,154,500	- -	0.87%
16	キャノン 日本	株式 電気機器	704,400	3,732.50 2,629,173,000	3,707.00 2,611,210,800	- -	0.85%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	523,500	4,076.50 2,134,047,750	4,876.00 2,552,586,000	- -	0.83%
18	N T T ドコモ 日本	株式 情報・通信業	996,400	1,996.50 1,989,312,600	2,538.50 2,529,361,400	- -	0.82%
19	三菱地所 日本	株式 不動産業	960,000	2,514.00 2,413,440,000	2,609.00 2,504,640,000	- -	0.81%
20	村田製作所 日本	株式 電気機器	137,400	12,780.00 1,755,972,000	17,550.00 2,411,370,000	- -	0.78%
21	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	117,200	19,475.00 2,282,470,000	19,885.00 2,330,522,000	- -	0.76%
22	三井不動産 日本	株式 不動産業	685,000	3,126.00 2,141,310,000	3,360.00 2,301,600,000	- -	0.75%
23	三菱商事 日本	株式 卸売業	989,700	2,223.00 2,200,103,100	2,255.00 2,231,773,500	- -	0.73%
24	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,602,700	1,318.46 2,113,109,282	1,337.50 2,143,611,250	- -	0.70%
25	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,142,000	798.70 2,509,515,400	681.80 2,142,215,600	- -	0.70%
26	花王 日本	株式 化学	368,700	5,014.00 1,848,661,800	5,552.00 2,047,022,400	- -	0.67%
27	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	2,640,400	643.40 1,698,833,360	766.10 2,022,810,440	- -	0.66%
28	任天堂 日本	株式 その他製品	80,600	11,740.00 946,244,000	25,010.00 2,015,806,000	- -	0.66%
29	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,837,200	1,064.00 1,954,780,800	1,097.00 2,015,408,400	- -	0.66%
30	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	445,600	3,983.00 1,774,824,800	4,270.50 1,902,934,800	- -	0.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
株式	95.96%
合計	95.96%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.21%
輸送用機器		10.20%
銀行業		9.12%
情報・通信業		7.07%
化学		5.64%
医薬品		5.02%
小売業		4.63%
食料品		4.39%
機械		4.27%
陸運業		4.02%
卸売業		3.91%
サービス業		3.07%
不動産業		2.78%
建設業		2.75%
保険業		2.66%
電気・ガス業		2.23%
その他製品		1.70%
精密機器		1.41%
証券、商品先物取引業		1.29%
その他金融業		1.24%
鉄鋼		1.15%
ガラス・土石製品		0.90%
ゴム製品		0.86%
非鉄金属		0.86%
繊維製品		0.78%
空運業		0.65%
金属製品		0.59%
石油・石炭製品	0.45%	
鉱業	0.35%	
海運業	0.26%	
パルプ・紙	0.25%	
倉庫・運輸関連業	0.19%	
水産・農林業	0.07%	
合計		95.96%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	99.98 4,999,120,000	100.19 5,009,600,000	0.100000 2019/12/20	1.23%
2	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.05 5,002,610,000	100.18 5,009,050,000	0.100000 2020/3/20	1.23%

3	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.80 4,536,370,000	100.88 4,539,780,000	0.300000 2018/9/20	1.11%
4	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.34 4,515,420,000	100.64 4,528,980,000	0.200000 2019/6/20	1.11%
5	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.38 4,517,310,000	100.63 4,528,665,000	0.200000 2019/3/20	1.11%
6	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.42 4,518,900,000	100.60 4,527,405,000	0.200000 2018/12/20	1.11%
7	103回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,523,850,000	100.46 4,520,835,000	0.300000 2017/3/20	1.11%
8	106回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.37 4,516,830,000	100.39 4,517,955,000	0.200000 2017/9/20	1.11%
9	105回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.33 4,515,210,000	100.35 4,516,155,000	0.200000 2017/6/20	1.11%
10	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.39 4,317,028,000	100.44 4,319,264,000	0.200000 2017/12/20	1.06%
11	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.73 4,029,445,000	101.62 4,065,080,000	0.500000 2024/9/20	1.00%
12	338回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.07 4,002,970,000	100.41 4,016,600,000	0.400000 2025/3/20	0.99%
13	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.08 4,003,440,000	100.16 4,006,680,000	0.100000 2020/6/20	0.98%
14	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	106.99 3,744,845,000	106.64 3,732,610,000	1.300000 2021/3/20	0.92%
15	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	105.57 3,694,982,000	105.33 3,686,865,000	1.300000 2019/12/20	0.90%
16	113回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.76 3,526,775,000	100.82 3,528,875,000	0.300000 2018/6/20	0.87%
17	102回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.48 3,517,010,000	100.38 3,513,615,000	0.300000 2016/12/20	0.86%
18	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	104.98 3,464,571,000	104.56 3,450,678,000	1.400000 2018/12/20	0.85%
19	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	101.75 3,357,810,000	102.61 3,386,295,000	0.600000 2024/6/20	0.83%

20	330回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	103.86 3,323,592,000	104.42 3,341,504,000	0.800000 2023/9/20	0.82%
21	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	104.09 3,330,912,000	103.43 3,309,952,000	1.500000 2017/12/20	0.81%
22	333回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	102.03 3,265,025,000	102.71 3,286,816,000	0.600000 2024/3/20	0.81%
23	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	105.40 3,162,060,000	105.68 3,170,400,000	1.000000 2022/3/20	0.78%
24	296回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	105.05 3,151,770,000	104.54 3,136,260,000	1.500000 2018/9/20	0.77%
25	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	101.96 3,059,010,000	102.76 3,082,830,000	0.600000 2023/12/20	0.76%
26	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	105.97 3,073,208,000	105.57 3,061,675,000	1.500000 2019/6/20	0.75%
27	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.11 3,003,380,000	100.23 3,007,080,000	0.400000 2025/6/20	0.74%
28	310回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	104.76 2,933,448,000	104.60 2,928,800,000	1.000000 2020/9/20	0.72%
29	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	103.94 2,910,320,000	104.53 2,926,952,000	0.800000 2022/9/20	0.72%
30	312回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,700,000,000	106.20 2,867,405,000	105.85 2,858,031,000	1.200000 2020/12/20	0.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	81.59%
地方債証券	6.77%
特殊債券	6.07%
社債券	5.31%
合計	99.75%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	450,800	15,394.48 6,939,833,094	13,728.48 6,188,799,775	- -	2.19%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	603,178	5,316.16 3,206,594,737	5,323.43 3,210,980,324	- -	1.14%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	327,485	11,292.20 3,698,028,703	9,096.98 2,979,125,346	- -	1.05%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	217,104	12,060.78 2,618,444,158	11,532.70 2,503,795,431	- -	0.89%
5	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	383,002	6,703.09 2,567,298,686	6,487.97 2,484,908,243	- -	0.88%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	789,495	3,047.44 2,405,943,898	3,048.88 2,407,082,463	- -	0.85%
7	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	252,581	8,877.25 2,242,226,749	8,951.83 2,261,063,183	- -	0.80%
8	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	290,639	7,235.63 2,102,958,694	7,771.27 2,258,635,129	- -	0.80%
9	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	178,538	11,955.78 2,134,561,951	11,893.69 2,123,475,982	- -	0.75%
10	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・カタ ログ販売	30,991	46,495.52 1,440,942,742	62,772.45 1,945,381,053	- -	0.69%
11	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	480,417	4,134.58 1,986,322,615	4,034.08 1,938,041,668	- -	0.69%
12	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	482,211	4,192.26 2,021,558,123	3,957.73 1,908,465,184	- -	0.68%
13	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	167,292	9,296.16 1,555,173,806	11,028.59 1,844,995,179	- -	0.65%

14	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	24,125	66,427.97 1,602,574,893	76,389.44 1,842,895,442	- -	0.65%
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	212,337	10,376.29 2,203,272,272	8,629.22 1,832,304,343	- -	0.65%
16	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	55,102	30,794.82 1,696,856,219	33,231.63 1,831,129,386	- -	0.65%
17	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	22,566	67,100.16 1,514,182,356	79,941.23 1,803,953,890	- -	0.64%
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	318,869	5,969.63 1,903,533,120	5,582.76 1,780,169,927	- -	0.63%
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	822,335	2,012.56 1,654,999,582	1,982.50 1,630,283,084	- -	0.58%
20	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	126,325	12,620.12 1,594,237,198	12,418.52 1,568,770,347	- -	0.55%
21	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	323,827	5,076.66 1,643,960,855	4,780.55 1,548,071,488	- -	0.55%
22	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	237,976	6,208.26 1,477,417,034	6,456.47 1,536,484,999	- -	0.54%
23	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	91,427	17,936.54 1,639,884,714	16,448.97 1,503,880,272	- -	0.53%
24	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノ ロジー	115,132	12,365.78 1,423,697,957	13,060.78 1,503,713,769	- -	0.53%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,531,187	1,113.67 1,705,241,835	969.34 1,484,250,849	- -	0.52%
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	219,478	7,126.59 1,564,130,992	6,709.73 1,472,639,569	- -	0.52%
27	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	101,704	13,576.61 1,380,795,899	14,241.07 1,448,374,149	- -	0.51%
28	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	147,417	13,590.86 2,003,524,807	9,746.50 1,436,800,881	- -	0.51%
29	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	153,153	8,176.34 1,252,231,175	8,780.70 1,344,790,975	- -	0.48%
30	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サー ビス	73,106	19,385.49 1,417,196,082	17,932.21 1,310,952,612	- -	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
株式	95.72%
投資信託受益証券	0.28%
投資証券	2.15%
合計	98.16%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.31%
医薬品		7.70%
石油・ガス・消耗燃料		6.25%
保険		4.25%
メディア		2.99%
ソフトウェア		2.83%
コンピュータ・周辺機器		2.72%
各種電気通信サービス		2.71%
化学		2.62%
情報技術サービス		2.48%
バイオテクノロジー		2.39%
インターネットソフトウェア・サービス		2.37%
食品		2.23%
飲料		2.23%
資本市場		2.17%
食品・生活必需品小売り		2.16%
航空宇宙・防衛		2.08%
専門小売り		1.99%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.91%
コングロマリット		1.91%
ホテル・レストラン・レジャー		1.75%
半導体・半導体製造装置		1.66%
電力		1.63%
ヘルスケア機器・用品		1.61%
タバコ		1.40%
家庭用品		1.39%
各種金融サービス		1.35%
機械		1.35%
繊維・アパレル・贅沢品		1.28%
金属・鉱業		1.20%
総合公益事業		1.19%
インターネット販売・カタログ販売		1.17%
通信機器		1.14%
自動車		1.09%
エネルギー設備・サービス		0.86%
陸運・鉄道		0.85%
電気設備		0.76%
パーソナル用品		0.65%

不動産管理・開発	0.61%
複合小売り	0.59%
自動車部品	0.57%
航空貨物・物流サービス	0.57%
消費者金融	0.52%
専門サービス	0.50%
無線通信サービス	0.48%
家庭用耐久財	0.45%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.44%
商業サービス・用品	0.40%
電子装置・機器・部品	0.33%
建設資材	0.32%
建設・土木	0.31%
商社・流通業	0.31%
容器・包装	0.24%
建設関連製品	0.23%
運送インフラ	0.21%
旅客航空輸送業	0.17%
ガス	0.15%
紙製品・林産品	0.15%
水道	0.09%
海運業	0.09%
販売	0.08%
レジャー用品	0.08%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.05%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.72%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 2.75 11/30/16 アメリカ	国債証券	3,029,500,000	103.43 3,133,649,579	102.81 3,114,810,720	2.750000 2016/11/30	1.02%
2	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	2,665,960,000	103.18 2,750,924,145	103.00 2,745,938,800	2.500000 2024/5/15	0.90%
3	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	2,665,960,000	100.73 2,685,634,784	101.39 2,703,016,844	2.000000 2021/5/31	0.88%
4	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	2,641,724,000	98.42 2,600,203,127	98.38 2,598,980,905	2.000000 2025/2/15	0.85%
5	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	2,508,426,000	101.45 2,544,923,719	101.65 2,550,065,871	2.125000 2021/12/31	0.83%
6	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	2,423,600,000	104.79 2,539,738,912	103.61 2,511,164,668	3.250000 2016/12/31	0.82%
7	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	2,423,600,000	104.58 2,534,649,352	103.60 2,510,970,780	3.000000 2017/2/28	0.82%
8	US T N/B 3.0 09/30/16 アメリカ	国債証券	2,423,600,000	103.92 2,518,726,300	102.75 2,490,249,000	3.000000 2016/9/30	0.81%
9	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	2,363,010,000	101.21 2,391,656,952	100.95 2,385,529,485	2.000000 2022/2/15	0.78%
10	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	2,181,240,000	109.71 2,393,038,404	109.31 2,384,357,068	3.625000 2020/2/15	0.78%
11	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	2,302,420,000	99.17 2,283,425,035	99.69 2,295,397,619	0.750000 2017/12/31	0.75%
12	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	2,181,240,000	105.11 2,292,854,050	104.08 2,270,430,903	3.125000 2017/4/30	0.74%
13	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	2,241,830,000	100.86 2,261,209,061	100.82 2,260,213,006	1.375000 2018/9/30	0.74%
14	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	2,181,240,000	99.59 2,172,449,602	99.92 2,179,604,070	0.625000 2017/5/31	0.71%
15	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	2,181,240,000	99.10 2,161,630,652	99.58 2,172,275,103	0.500000 2017/7/31	0.71%
16	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	2,060,060,000	106.44 2,192,913,269	104.26 2,147,839,156	4.875000 2016/8/15	0.70%
17	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,999,470,000	104.72 2,093,964,952	105.01 2,099,663,441	2.625000 2020/8/15	0.69%
18	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,938,880,000	105.21 2,040,050,758	105.27 2,041,117,142	2.750000 2019/2/15	0.67%
19	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,817,700,000	109.41 1,988,872,809	107.77 1,959,062,529	4.750000 2017/8/15	0.64%
20	US T N/B 0.875 07/31/19 アメリカ	国債証券	1,938,880,000	97.18 1,884,339,305	98.23 1,904,639,379	0.875000 2019/7/31	0.62%
21	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,696,520,000	109.25 1,853,448,100	108.97 1,848,731,774	3.500000 2020/5/15	0.60%
22	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,878,290,000	97.27 1,827,069,031	98.28 1,846,152,458	1.000000 2019/11/30	0.60%
23	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,696,520,000	107.08 1,816,667,546	106.25 1,802,603,395	3.500000 2018/2/15	0.59%

24	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,817,700,000	98.27 1,786,338,616	99.09 1,801,286,169	1.750000 2022/5/15	0.59%
25	US T N/B 4.625 02/15/17 アメリカ	国債証券	1,696,520,000	107.78 1,828,661,942	105.80 1,795,053,881	4.625000 2017/2/15	0.59%
26	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,591,902,000	111.92 1,781,815,908	110.02 1,751,569,770	4.500000 2018/2/1	0.57%
27	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,575,340,000	106.64 1,679,942,576	106.68 1,680,619,972	3.125000 2019/5/15	0.55%
28	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,635,930,000	98.46 1,610,867,552	99.37 1,625,705,437	1.375000 2020/5/31	0.53%
29	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	1,496,660,000	108.35 1,621,750,842	106.45 1,593,299,336	3.750000 2017/4/25	0.52%
30	ITALY BTPS 5.25 08/01/17 イタリア	国債証券	1,442,236,000	111.83 1,612,996,742	109.67 1,581,757,910	5.250000 2017/8/1	0.52%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年8月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.81%
合計	97.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

該当事項はありません。

D I A M D C バランス50インデックスファンド

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

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2709月	買建	853	13,291,083,372	13,080,755,000	4.25%

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

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	イギリス・ポンド買/ 円売2015年09月	買建	4,560,000	851,825,992	852,127,200	0.30%
		アメリカ・ドル買/ 円売2015年09月	買建	2,930,000	355,055,056	355,028,100	0.13%
		ユーロ買/ 円売2015年09月	買建	810,000	110,210,625	110,200,500	0.04%
		オーストラリア・ドル 買/ 円売2015年09月	買建	260,000	22,500,920	22,497,800	0.01%
		カナダ・ドル買/ 円売2015年09月	買建	220,000	20,149,580	20,147,600	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 500 F U T U R E S e p 1 5	買建	62	3,748,318,553	3,737,233,613	1.32%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 S e p 1 5	買建	245	1,100,566,209	1,093,044,813	0.39%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E S e p 1 5	買建	42	486,744,844	487,969,843	0.17%
	シドニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S S e p 1 5	買建	19	214,548,795	215,176,282	0.08%
	モン トリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T S e p 1 5	買建	13	193,390,453	194,364,970	0.07%

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

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売2015年09月	買建	2,219,000	301,960,672	301,894,950	0.10%
		アメリカ・ドル買/円売2015年09月	買建	2,055,000	248,982,393	249,004,350	0.08%
		イギリス・ポンド買/円売2015年09月	買建	345,000	64,442,550	64,470,150	0.02%
		イギリス・ポンド売/円買2015年09月	売建	519,000	96,495,594	96,985,530	0.03%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成27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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	2,675	2,675	0.9710	0.9710
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	2,141	2,141	0.8095	0.8095
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	2,414	2,414	0.8824	0.8824
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	2,558	2,558	0.9041	0.9041
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	2,647	2,647	0.9088	0.9088
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	2,911	2,911	1.0079	1.0079
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	3,332	3,332	1.1304	1.1304
第8計算期間末 (平成27年2月25日)	3,961	3,961	1.2516	1.2516
平成26年8月末日	3,817	-	1.1620	-
9月末日	3,840	-	1.1808	-
10月末日	3,824	-	1.1850	-
11月末日	3,960	-	1.2315	-
12月末日	3,945	-	1.2412	-
平成27年1月末日	3,922	-	1.2316	-
2月末日	3,973	-	1.2545	-
3月末日	3,985	-	1.2589	-
4月末日	4,023	-	1.2703	-
5月末日	4,089	-	1.2896	-
6月末日	4,061	-	1.2743	-
7月末日	4,099	-	1.2865	-
8月末日	4,013	-	1.2553	-

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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	4,722	4,722	0.9331	0.9331
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	3,473	3,473	0.6847	0.6847
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	4,138	4,138	0.7770	0.7770
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	4,500	4,500	0.8051	0.8051
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	4,695	4,695	0.7945	0.7945
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	5,529	5,529	0.9153	0.9153
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	6,284	6,284	1.0798	1.0798
第8計算期間末 (平成27年2月25日)	7,650	7,650	1.2462	1.2462
平成26年8月末日	7,075	-	1.1203	-
9月末日	7,195	-	1.1481	-
10月末日	7,183	-	1.1517	-
11月末日	7,511	-	1.2144	-
12月末日	7,503	-	1.2220	-
平成27年1月末日	7,461	-	1.2098	-
2月末日	7,676	-	1.2515	-
3月末日	7,726	-	1.2595	-
4月末日	7,839	-	1.2771	-
5月末日	8,064	-	1.3115	-
6月末日	7,956	-	1.2878	-
7月末日	8,067	-	1.3050	-
8月末日	7,726	-	1.2522	-

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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	2,611	2,611	0.8961	0.8961
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	1,747	1,747	0.5753	0.5753
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	2,234	2,234	0.6792	0.6792
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	2,479	2,479	0.7105	0.7105
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	2,553	2,553	0.6888	0.6888
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	3,149	3,149	0.8234	0.8234
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	3,784	3,784	1.0149	1.0149
第8計算期間末 (平成27年2月25日)	4,726	4,726	1.2215	1.2215
平成26年8月末日	4,254	-	1.0632	-
9月末日	4,382	-	1.0991	-
10月末日	4,386	-	1.1021	-
11月末日	4,618	-	1.1790	-
12月末日	4,594	-	1.1846	-
平成27年1月末日	4,546	-	1.1704	-
2月末日	4,754	-	1.2289	-
3月末日	4,822	-	1.2402	-
4月末日	4,925	-	1.2632	-
5月末日	5,104	-	1.3115	-
6月末日	4,995	-	1.2802	-
7月末日	5,050	-	1.3021	-
8月末日	4,766	-	1.2295	-

【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口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	-

D I A M D C バランス50インデックスファンド

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	-

D I A M D C バランス70インデックスファンド

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	-

【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計算期間	2.9
第2計算期間	16.6
第3計算期間	9.0
第4計算期間	2.5
第5計算期間	0.5
第6計算期間	10.9
第7計算期間	12.2
第8計算期間	10.7
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	1.5

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A M D C バランス50インデックスファンド

	収益率(%)
第1計算期間	6.7
第2計算期間	26.6
第3計算期間	13.5
第4計算期間	3.6
第5計算期間	1.3
第6計算期間	15.2
第7計算期間	18.0
第8計算期間	15.4
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	2.7

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

D I A M D C バランス70インデックスファンド

	収益率(%)
第1計算期間	10.4
第2計算期間	35.8
第3計算期間	18.1
第4計算期間	4.6
第5計算期間	3.1
第6計算期間	19.5
第7計算期間	23.3
第8計算期間	20.4
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	3.8

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

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計算期間	3,100,768,537	345,452,038
第2計算期間	229,578,698	339,107,428
第3計算期間	243,751,371	153,541,357
第4計算期間	235,972,752	141,593,022
第5計算期間	285,646,931	203,029,716
第6計算期間	225,648,685	250,182,940
第7計算期間	462,391,895	402,339,311
第8計算期間	587,018,593	370,175,319
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	145,305,183	125,414,878

(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計算期間	5,407,868,136	346,621,435
第2計算期間	439,067,605	427,745,782
第3計算期間	495,694,818	241,797,536
第4計算期間	487,922,998	224,206,853
第5計算期間	613,641,679	293,757,615
第6計算期間	463,334,274	332,253,908
第7計算期間	634,765,225	855,483,167
第8計算期間	941,276,993	622,378,462
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	252,955,200	222,948,443

(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計算期間	3,243,343,171	329,317,247
第2計算期間	362,375,624	238,812,098
第3計算期間	443,121,260	190,773,589
第4計算期間	402,406,730	203,211,017
第5計算期間	407,822,179	190,193,682
第6計算期間	402,795,344	284,007,685
第7計算期間	570,595,111	667,503,750
第8計算期間	651,362,252	510,532,126
平成27年2月26日～ 平成27年8月25日	248,340,227	249,732,526

(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。

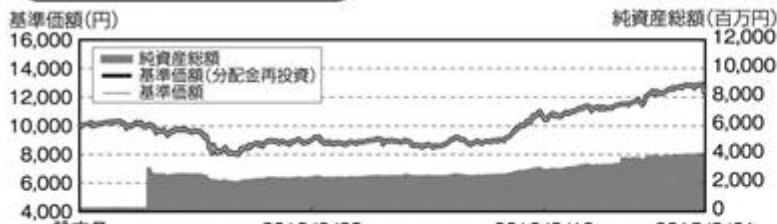
<< 参考情報 >>

データの基準日:2015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)~2015年8月31日)

分配の推移(税引前)



※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)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

第4期	(2011.02.25)	0円
第5期	(2012.02.27)	0円
第6期	(2013.02.25)	0円
第7期	(2014.02.25)	0円
第8期	(2015.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注) 分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

(注) 投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券バシブ・ファンド・マザーファンド	52.93%
2	国内株式バシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.55%
3	外国債券バシブ・ファンド・マザーファンド	15.05%
4	外国株式バシブ・ファンド・マザーファンド	9.51%

※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として算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

DIAM 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)~2015年8月31日)

分配の推移(税引前)



※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)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

第4期	(2011.02.25)	0円
第5期	(2012.02.27)	0円
第6期	(2013.02.25)	0円
第7期	(2014.02.25)	0円
第8期	(2015.02.25)	0円
設定来累計		0円

(注) 分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

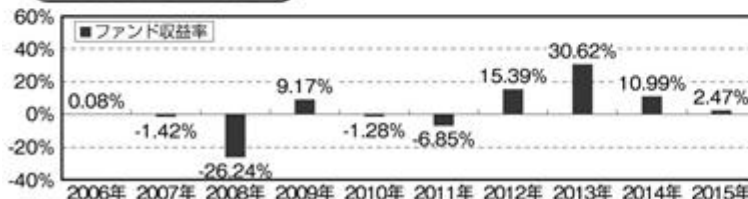
(注) 投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式バシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	34.75%
2	国内債券バシブ・ファンド・マザーファンド	30.61%
3	外国債券バシブ・ファンド・マザーファンド	17.00%
4	外国株式バシブ・ファンド・マザーファンド	14.71%

※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として算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

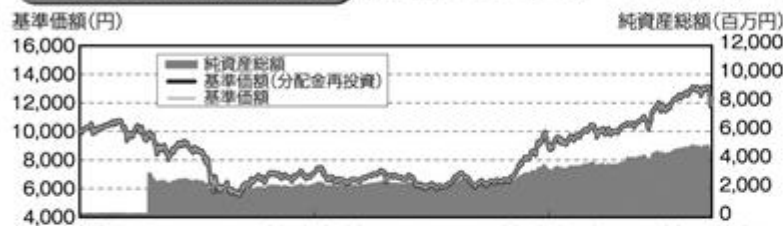
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2015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)~2015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)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第4期	(2011.02.25)	0円
第5期	(2012.02.27)	0円
第6期	(2013.02.25)	0円
第7期	(2014.02.25)	0円
第8期	(2015.02.25)	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

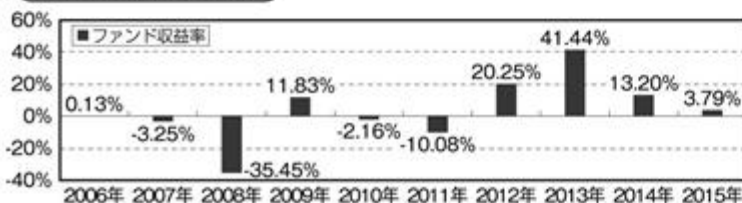
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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	49.35%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.77%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.52%
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.37%

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

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2006年は設定日から年末までの収益率、および2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

各マザーファンドの主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.96
内 日本	95.96
コールローン、その他の資産(負債控除後)	4.04
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	4.25

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.21%
2	輸送用機器	10.20%
3	銀行業	9.12%
4	情報・通信業	7.07%
5	化学	5.64%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.22%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.70%
3	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.58%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.57%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.52%
6	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.46%
7	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.46%
8	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.29%
9	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.22%
10	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.00%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2015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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.72
内 アメリカ	57.36
内 イギリス	7.92
内 スイス	4.21
内 フランス	3.76
内 ドイツ	3.72
内 その他	18.75
投資信託受益証券	0.28
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.15
内 アメリカ	1.78
内 イギリス	0.16
内 フランス	0.15
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.84
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	2.19%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.14%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.05%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.89%
5	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.88%
6	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.85%
7	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.80%
8	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.80%
9	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	0.75%
10	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット・ソフトウェア	0.69%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	9.31%
2	医薬品	7.70%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.25%
4	保険	4.25%
5	メディア	2.99%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.48
株価指数先物取引(買建)	2.03

■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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	81.59
内 日本	81.59
地方債証券	6.77
内 日本	6.77
特殊債券	6.07
内 日本	6.07
社債券	5.31
内 日本	5.23
内 アメリカ	0.08
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.25
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.23%
2	123回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/3/20	1.23%
3	114回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.300000	2018/9/20	1.11%
4	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.11%
5	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.11%
6	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.11%
7	103回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.300000	2017/3/20	1.11%
8	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.11%
9	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.11%
10	107回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/12/20	1.06%

■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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.81
内 アメリカ	41.79
内 イタリア	9.62
内 フランス	9.51
内 イギリス	8.49
内 ドイツ	7.52
内 その他	20.88
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.19
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 2.75 11/30/16	国債証券	アメリカ	2.750000	2016/11/30	1.02%
2	US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	アメリカ	2.500000	2024/5/15	0.90%
3	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2.000000	2021/5/31	0.88%
4	US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	アメリカ	2.000000	2025/2/15	0.85%
5	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/12/31	0.83%
6	US T N/B 3.25 12/31/16	国債証券	アメリカ	3.250000	2016/12/31	0.82%
7	US T N/B 3.0 02/28/17	国債証券	アメリカ	3.000000	2017/2/28	0.82%
8	US T N/B 3.0 09/30/16	国債証券	アメリカ	3.000000	2016/9/30	0.81%
9	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.78%
10	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.78%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.20
為替予約取引(売建)	△0.03

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」につきましては、以下の内容を追加いたします。

<追 加>

D I A M D C バランス30インデックスファンド

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成27年2月26日から平成27年8月25日まで）の中間財務諸表について、P w C 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8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	123,910,918	128,269,696
親投資信託受益証券	3,844,085,759	3,803,875,723
未収入金	6,486,000	599,000
流動資産合計	3,974,482,677	3,932,744,419
資産合計	3,974,482,677	3,932,744,419
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,501,392	1,195,282
未払受託者報酬	632,618	648,415
未払委託者報酬	4,428,653	4,539,214
その他未払費用	100,075	102,584
流動負債合計	12,662,738	6,485,495
負債合計	12,662,738	6,485,495
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,165,356,331	1 3,185,246,636
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	796,463,608	741,012,288
（分配準備積立金）	772,919,753	742,930,785
元本等合計	3,961,819,939	3,926,258,924
純資産合計	3,961,819,939	3,926,258,924
負債純資産合計	3,974,482,677	3,932,744,419

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第8期中間計算期間		第9期中間計算期間	
	自	平成26年2月26日 至 平成26年8月25日	自	平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
営業収益				
受取利息		30,811		33,614
有価証券売買等損益		107,191,985		55,813,036
営業収益合計		107,222,796		55,779,422
営業費用				
受託者報酬		557,971		648,415
委託者報酬		3,906,061		4,539,214
その他費用		88,269		102,584
営業費用合計		4,552,301		5,290,213
営業利益又は営業損失（ ）		102,670,495		61,069,635
経常利益又は経常損失（ ）		102,670,495		61,069,635
中間純利益又は中間純損失（ ）		102,670,495		61,069,635
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		1,211,326		2,439,325
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		384,404,736		796,463,608
剰余金増加額又は欠損金減少額		61,909,837		39,655,282
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		61,909,837		39,655,282
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,028,789		31,597,642
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		14,028,789		31,597,642
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		533,744,953		741,012,288

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1 . 1 期首元本額	2,948,513,057円	3,165,356,331円
期中追加設定元本額	587,018,593円	145,305,183円
期中一部解約元本額	370,175,319円	125,414,878円
2 . 受益権の総数	3,165,356,331口	3,185,246,636口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,2516円	1,2326円
（1万口当たり純資産額）	（12,516円）	（12,326円）

D I A M D C バランス50インデックスファンド

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成27年2月26日から平成27年8月25日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた監査法人による中間監査を受けております。

【D I A M 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8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	236,586,903	253,973,162
親投資信託受益証券	7,426,908,856	7,241,661,660
未収入金	5,090,000	3,486,000
流動資産合計	7,668,585,759	7,499,120,822
資産合計	7,668,585,759	7,499,120,822
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,765,104	6,546,084
未払受託者報酬	1,192,879	1,267,990
未払委託者報酬	9,543,330	10,144,284
その他未払費用	188,787	200,686
流動負債合計	17,690,100	18,159,044
負債合計	17,690,100	18,159,044
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,139,326,970	1 6,169,333,727
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,511,568,689	1,311,628,051
（分配準備積立金）	1,860,430,284	1,794,102,701
元本等合計	7,650,895,659	7,480,961,778
純資産合計	7,650,895,659	7,480,961,778
負債純資産合計	7,668,585,759	7,499,120,822

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第8期中間計算期間		第9期中間計算期間	
	自	平成26年2月26日 至 平成26年8月25日	自	平成27年2月26日 至 平成27年8月25日
営業収益				
受取利息		57,563		65,822
有価証券売買等損益		274,469,128		197,655,196
営業収益合計		274,526,691		197,589,374
営業費用				
受託者報酬		1,042,587		1,267,990
委託者報酬		8,341,028		10,144,284
その他費用		164,998		200,686
営業費用合計		9,548,613		11,612,960
営業利益又は営業損失（ ）		264,978,078		209,202,334
経常利益又は経常損失（ ）		264,978,078		209,202,334
中間純利益又は中間純損失（ ）		264,978,078		209,202,334
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（ ）		2,992,423		7,438,336
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		464,198,788		1,511,568,689
剰余金増加額又は欠損金減少額		67,678,054		71,708,870
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		67,678,054		71,708,870
剰余金減少額又は欠損金増加額		18,703,766		55,008,838
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		18,703,766		55,008,838
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		775,158,731		1,311,628,051

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1 . 1 期首元本額	5,820,428,439円	6,139,326,970円
期中追加設定元本額	941,276,993円	252,955,200円
期中一部解約元本額	622,378,462円	222,948,443円
2 . 受益権の総数	6,139,326,970口	6,169,333,727口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,2462円	1,2126円
（1万口当たり純資産額）	（12,462円）	（12,126円）

D I A M D C バランス70インデックスファンド

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成27年2月26日から平成27年8月25日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた監査法人による中間監査を受けております。

【D I A M 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8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	153,547,696	161,351,702
親投資信託受益証券	4,586,224,193	4,394,521,391
未収入金	2,612,000	-
流動資産合計	4,742,383,889	4,555,873,093
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,422,769	3,458,171
未払受託者報酬	726,772	794,651
未払委託者報酬	6,541,275	7,152,187
その他未払費用	114,986	125,733
流動負債合計	15,805,802	11,530,742
純資産の部		
元本等		
元本	1,386,947,477	1,386,078,178
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	857,107,610	676,264,173
（分配準備積立金）	1,312,715,922	1,230,888,862
元本等合計	4,726,578,087	4,544,342,351
純資産合計	4,726,578,087	4,544,342,351
負債純資産合計	4,742,383,889	4,555,873,093

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第8期中間計算期間		第9期中間計算期間	
	自 平成26年2月26日	至 平成26年8月25日	自 平成27年2月26日	至 平成27年8月25日
営業収益				
受取利息		34,700		42,007
有価証券売買等損益		210,687,276		171,353,802
営業収益合計		210,721,976		171,311,795
営業費用				
受託者報酬		624,604		794,651
委託者報酬		5,621,848		7,152,187
その他費用		98,826		125,733
営業費用合計		6,345,278		8,072,571
営業利益又は営業損失（ ）		204,376,698		179,384,366
経常利益又は経常損失（ ）		204,376,698		179,384,366
中間純利益又は中間純損失（ ）		204,376,698		179,384,366
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（ ）		2,253,965		13,428,652
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		55,711,847		857,107,610
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,657,155		67,629,973
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		14,657,155		67,629,973
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,812,989		55,660,392
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,812,989		55,660,392
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		269,678,746		676,264,173

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1 . 1 期首元本額	3,728,640,351円	3,869,470,477円
期中追加設定元本額	651,362,252円	248,340,227円
期中一部解約元本額	510,532,126円	249,732,526円
2 . 受益権の総数	3,869,470,477口	3,868,078,178口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第8期 平成27年2月25日現在	第9期中間計算期間末 平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,2215円	1,1748円
（1万口当たり純資産額）	（12,215円）	（11,748円）

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,529,907,207	2,385,662,400
株式	2	323,712,344,980	275,189,655,330
派生商品評価勘定		230,359,500	-
未収入金		10,073,456,661	5,645,520,340
未収配当金		480,294,446	283,263,675
前払金		-	296,285,000
流動資産合計		341,026,362,794	283,800,386,745
資産合計		341,026,362,794	283,800,386,745
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	387,876,052
前受金		238,906,000	-
未払金		-	3,661,296
未払解約金		7,100,316,000	2,971,821,000
流動負債合計		7,339,222,000	3,363,358,348
負債合計		7,339,222,000	3,363,358,348
純資産の部			
元本等			
元本	1	155,777,350,252	136,497,198,820
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		177,909,790,542	143,939,829,577
元本等合計		333,687,140,794	280,437,028,397
純資産合計		333,687,140,794	280,437,028,397
負債純資産合計		341,026,362,794	283,800,386,745

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	188,809,272,100円	155,777,350,252円
同期中追加設定元本額	22,731,111,433円	11,506,055,579円
同期中一部解約元本額	55,763,033,281円	30,786,207,011円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	3,916,623,435円	4,437,493,874円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,411,544,861円	1,320,422,995円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	35,645,328,124円	35,531,310,991円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	760,827,655円	704,431,815円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,858,843,867円	2,598,805,856円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,046,248,134円	2,788,344,730円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	384,627,133円	346,931,596円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,297,087,701円	1,207,580,400円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,129,670,818円	1,058,777,000円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	77,696,556円	63,356,486円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,241,110,316円	1,196,348,848円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	28,078,282円	26,508,041円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	16,078,346円	20,095,167円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	32,233,265円	41,301,588円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	81,358,474円	97,907,145円
投資のソムリエ	207,006,506円	771,058,671円
クルーズコントロール	705,575,334円	527,813,300円
投資のソムリエ<DC年金>	3,030,563円	12,289,083円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	34,666,087円	49,253,617円
D I A M D C バランス・F (成長型)	6,788,927円	24,228,117円
クルーズコントロール<DC年 金>	212,653円	170,623円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	317,757,463円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	127,247,686円	107,660,488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)	1,965,284,782円	1,043,855,571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)	586,008,304円	477,959,700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)	64,423,090円	42,983,970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)	281,728,600円	179,208,912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)	56,864,102円	44,219,189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)	109,097,529円	63,413,912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)	9,684,470,541円	6,423,497,488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)	3,420,390,133円	2,452,471,696円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	2,783,902,029円	2,220,049,071円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,923,494,326円	1,569,975,441円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,886,749,268円	4,109,892,357円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	415,360,894円	321,838,690円
D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	1,107,957,901円	843,837,729円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	1,206,730,476円	976,753,724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)	5,254,130,543円	4,000,044,631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)	92,409,818円	41,880,337円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	1,868,209,643円	1,321,005,798円
D I A M世界バランスファンド 35V A (適格機関投資家限 定)	6,273,150,235円	5,261,461,453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)	178,472,559円	22,350,620円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	23,203,221,664円	19,777,230,750円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投 資家限定)	967,970,136円	792,472,631円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	2,677,293,646円	2,272,559,724円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	14,599,521,643円	12,541,554,782円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	38,223円	32,872円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	10,776,546円	79,718円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	47,591,162円	29,914,984円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	13,030,501,833円	11,215,197,712円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	123,934,533円	105,927,553円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	43,783,675円	39,249,485円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	1,718,173円	30,381円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	103,705,160円	86,159,256円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	120,223円	113,487円

	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	818,354,088円	635,502,743円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	2,114,709,804円	1,838,513,776円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	2,751,007,520円	2,406,210,855円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	112,382,727円	89,899,928円
	計	155,777,350,252円	136,497,198,820円
2 .	受益権の総数	155,777,350,252口	136,497,198,820口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 4,063,500,000円	株式 3,362,500,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成27年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	9,219,438,000	-	9,450,000,000	230,562,000	2,847,880,000	-	2,460,060,000	387,820,000
合計	9,219,438,000	-	9,450,000,000	230,562,000	2,847,880,000	-	2,460,060,000	387,820,000

(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27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	2.1421円	2.0545円
(1万口当たり純資産額)	(21,421円)	(20,545円)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,135,975,174	4,372,859,055
国債証券		342,470,616,400	334,723,615,900
地方債証券		27,404,729,235	27,624,504,803
特殊債券		27,546,834,748	25,984,472,026
社債券		23,039,056,100	22,159,043,640
未収入金		-	2,082,420,000
未収利息		1,486,873,383	1,414,172,592
前払費用		29,240,078	20,593,391
流動資産合計		425,113,325,118	418,381,681,407
資産合計		425,113,325,118	418,381,681,407
負債の部			
流動負債			
未払金		712,949,000	-
未払解約金		63,275,000	1,411,263,000
流動負債合計		776,224,000	1,411,263,000
負債合計		776,224,000	1,411,263,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	345,746,995,990	338,751,831,735
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		78,590,105,128	78,218,586,672
元本等合計		424,337,101,118	416,970,418,407
純資産合計		424,337,101,118	416,970,418,407
負債純資産合計		425,113,325,118	418,381,681,407

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
--------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	369,629,287,107円 45,327,581,060円 69,209,872,177円	345,746,995,990円 35,363,421,857円 42,358,586,112円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	8,503,262,466円	10,287,944,270円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C 年金 >	10,825,044,625円	11,079,235,090円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	4,270,992,250円	4,642,707,807円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	6,629,308,611円	7,177,033,463円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	2,732,232,561円	2,947,205,805円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	1,645,584,410円	1,727,441,645円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,795,769,252円	1,932,780,622円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	254,649,242円	285,389,186円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	119,643,701円	123,477,267円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,932,618,795円	2,373,908,841円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	10,557,102円	6,346,875円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 1 0）	156,357,891円	220,877,253円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 2 0）	111,841,764円	163,172,544円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 3 0）	34,671,990円	47,712,169円
投資のソムリエ	1,484,320,221円	8,672,403,415円
クルーズコントロール	1,388,385,757円	1,293,733,284円
投資のソムリエ< D C 年金 >	21,949,338円	139,007,952円

D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	324,888,979円	538,303,042円
D I A M DC バランス・F (成長型)	6,078,776円	25,534,112円
クルーズコントロール<DC年 金>	419,325円	421,771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国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	12,161,340,736円	12,023,761,079円
D I A Mアクティブアロケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	605,801,347円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	708,077,509円	685,250,130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)	4,083,456,644円	2,427,947,721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)	391,300,895円	370,164,307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)	252,489,640円	194,398,107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)	705,807,127円	520,902,901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)	248,091,708円	214,256,520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)	245,121,818円	163,657,360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)	24,499,571,391円	18,677,212,133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)	8,605,785,394円	7,130,717,931円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	12,537,944,510円	11,475,971,731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)	4,852,002,295円	4,564,307,158円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	8,171,451,026円	7,964,018,716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)	1,026,521,106円	935,132,945円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 (適格機 関投資家限定)	4,606,495,216円	4,089,906,473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)	6,060,818,780円	5,673,301,116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)	8,958,285,756円	7,732,149,125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)	495,049,617円	884,082,241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)	9,309,734,048円	7,730,901,339円
D I A M世界バランスファンド 35VA (適格機関投資家限 定)	8,496,097,087円	8,178,293,634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)	1,038,550,408円	139,735,468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)	104,406,638,366円	102,203,369,106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)	1,620,368,453円	1,535,407,934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)	9,010,019,380円	8,809,466,281円
D I A M世界アセットバラン スファンド3VA (適格機関投資 家限定)	32,807,793,993円	32,387,486,223円
D I A Mバランス30VA (適 格機関投資家限定)	494,649円	505,270円
D I A Mバランス50VA (適 格機関投資家限定)	43,932,447円	384,040円
D I A Mバランス70VA (適 格機関投資家限定)	77,804,608円	57,894,209円
D I A M世界アセットバラン スファンド4VA (適格機関投資 家限定)	36,564,549,550円	36,225,181,146円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	687,712,472円	674,625,274円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	171,833,083円	177,467,805円
D I A Mバランス20VA (適 格機関投資家限定)	28,056,951円	581,142円
D I A Mバランス40VA (適 格機関投資家限定)	595,035,375円	582,731,734円
D I A Mバランス60VA (適 格機関投資家限定)	326,057円	364,837円
計	345,746,995,990円	338,751,831,735円
2 . 受益権の総数	345,746,995,990口	338,751,831,735口

--	--	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,2273円	1,2309円
（1万口当たり純資産額）	（12,273円）	（12,309円）

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		7,463,794,011	1,577,887,673
コール・ローン		317,762,461	171,354,230
株式		304,556,404,131	249,987,822,929
投資信託受益証券		931,236,031	752,765,807
投資証券		6,568,436,671	5,699,017,363
派生商品評価勘定		274,115,200	24,944,720
未収入金		18,440	1,948,146,755
未収配当金		540,263,891	580,730,973
差入委託証拠金		1,942,072,454	1,034,855,086
流動資産合計		322,594,103,290	261,777,525,536
資産合計		322,594,103,290	261,777,525,536
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,515,280	198,054,302
未払解約金		3,205,197,000	1,386,005,000
流動負債合計		3,206,712,280	1,584,059,302
負債合計		3,206,712,280	1,584,059,302
純資産の部			
元本等			
元本	1	109,314,267,788	98,885,144,516
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		210,073,123,222	161,308,321,718
元本等合計		319,387,391,010	260,193,466,234
純資産合計		319,387,391,010	260,193,466,234
負債純資産合計		322,594,103,290	261,777,525,536

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>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。</p> <p>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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>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。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	137,116,704,251円	109,314,267,788円
同期中追加設定元本額	10,177,480,079円	5,341,431,401円
同期中一部解約元本額	37,979,916,542円	15,770,554,673円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	973,546,154円	1,069,615,655円
D I A M外国株式インデックス ファンド< D C年金>	34,317,265,356円	33,932,198,839円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	145,630,156円	144,833,070円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	828,101,362円	818,639,464円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,051,813,641円	1,039,995,553円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	140,375,493円	136,110,694円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	403,472,656円	403,472,656円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	323,794,483円	331,856,954円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	50,098,652円	45,083,626円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	795,335,714円	851,021,169円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	217,561,695円	234,044,222円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国1 0）	11,771,139円	15,728,639円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国2 0）	23,300,325円	32,236,553円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国3 0）	58,619,745円	77,127,722円
投資のソムリエ	150,434,088円	255,773,222円
クルーズコントロール	251,262,691円	207,492,775円
投資のソムリエ< D C年金>	2,221,645円	4,088,763円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	25,247,512円	38,764,085円
D I A M D C バランス・F （成長型）	2,351,445円	8,948,521円
クルーズコントロール< D C年 金>	75,719円	67,178円
D I A M外国株式インデックス ファンドV A（適格機関投資家 専用）	347,241,830円	290,725,158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）	3,392,710,883円	3,400,282,661円

D I A Mアクティブアロケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	186,332,189円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	40,541,962円	36,057,835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)	1,438,591,599円	817,399,881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)	429,031,677円	374,147,285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)	47,163,743円	33,648,076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)	308,162,419円	210,489,560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)	20,801,176円	17,284,459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)	53,437,377円	33,036,121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)	7,090,256,484円	5,029,195,733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)	3,741,316,822円	2,880,732,721円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,369,439,114円	1,158,246,984円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,234,248,157円	1,075,614,765円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	3,577,642,164円	3,217,647,744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)	1,516,695,305円	1,258,827,788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)	2,435,074,033円	1,979,613,839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)	1,746,188,035円	1,530,046,089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)	1,321,413,471円	1,025,830,623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)	25,693,500円	11,130,233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)	6,142,740,733円	4,690,129,452円

D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定)	1,850,290,073円	1,648,446,480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)	43,493,404円	5,805,769円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	11,518,510,481円	10,319,683,466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)	708,666,227円	620,341,475円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	1,960,021,605円	1,778,975,191円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	7,251,366,521円	6,540,196,984円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	138,291円	127,638円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	31,289,480円	248,099円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	127,053,691円	85,867,567円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	9,539,533,825円	8,779,498,174円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	3,743,916円	69,952円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	229,228,270円	202,100,272円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	261,849円	264,893円
計	109,314,267,788円	98,885,144,516円
2 . 受益権の総数	109,314,267,788口	98,885,144,516口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成27年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	3,587,754,960	-	3,586,528,000	1,226,960	2,686,451,906	-	2,661,700,500	24,751,406
アメリカ・ドル	2,282,482,980	-	2,280,192,000	2,290,980	1,675,939,370	-	1,657,326,600	18,612,770
イギリス・債券	312,358,160	-	312,273,000	85,160	262,377,130	-	260,597,200	1,779,930
オーストラリア・ドル	157,903,700	-	158,607,000	703,300	80,274,328	-	78,601,400	1,672,928
カナダ・ドル	160,999,840	-	161,806,000	806,160	117,646,720	-	116,402,000	1,244,720
シンガポール・ドル	-	-	-	-	61,640,470	-	61,633,900	6,570
スイス・フラン	-	-	-	-	80,339,805	-	80,337,600	2,205
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	4,609,975	-	4,610,000	25
ユーロ	674,010,280	-	673,650,000	360,280	371,718,156	-	370,305,400	1,412,756
香港・ドル	-	-	-	-	31,905,952	-	31,886,400	19,552
合計	3,587,754,960	-	3,586,528,000	1,226,960	2,686,451,906	-	2,661,700,500	24,751,406

(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はありません。

株式関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成27年8月25日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	6,286,651,477	-	6,558,024,437	271,372,960	2,509,757,481	-	2,311,896,493	197,860,988
合計	6,286,651,477	-	6,558,024,437	271,372,960	2,509,757,481	-	2,311,896,493	197,860,988

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	2.9217円	2.6313円
(1万口当たり純資産額)	(29,217円)	(26,313円)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,369,690,970	2,695,261,185
コール・ローン		374,837,019	375,858,744
国債証券		337,543,101,755	306,386,726,061
派生商品評価勘定		1,800	19,739,154
未収入金		-	4,724,910,843
未収利息		3,230,185,165	2,848,365,626
前払費用		95,848,149	90,997,779
流動資産合計		346,613,664,858	317,141,859,392
資産合計		346,613,664,858	317,141,859,392
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		60,400	-
未払解約金		53,890,000	1,421,002,000
流動負債合計		53,950,400	1,421,002,000
負債合計		53,950,400	1,421,002,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	183,852,928,058	166,810,076,091
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		162,706,786,400	148,910,781,301
元本等合計		346,559,714,458	315,720,857,392
純資産合計		346,559,714,458	315,720,857,392
負債純資産合計		346,613,664,858	317,141,859,392

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	234,028,916,867円	183,852,928,058円
同期中追加設定元本額	13,814,661,751円	10,042,353,827円
同期中一部解約元本額	63,990,650,560円	27,085,205,794円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・		
ファンド	3,781,500,974円	3,783,704,764円
D I A M外国債券インデックス		
ファンド< D C 年金 >	4,544,032,431円	4,551,478,305円
D I A Mバランス・ファンド<		
D C 年金 > 1 安定型	341,847,976円	363,028,975円
D I A Mバランス・ファンド<		
D C 年金 > 2 安定・成長型	1,214,750,317円	1,283,132,992円
D I A Mバランス・ファンド<		
D C 年金 > 3 成長型	1,308,784,784円	1,371,106,627円
D I A M D C バランス 3 0		
インデックスファンド	313,217,589円	320,520,300円
D I A M D C バランス 5 0		
インデックスファンド	671,428,982円	697,400,784円
D I A M D C バランス 7 0		
インデックスファンド	481,588,849円	525,578,958円
マネックス資産設計ファンド<		
隔月分配型 >	31,376,785円	29,114,833円
マネックス資産設計ファンド<		
育成型 >	501,462,033円	553,128,930円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	21,995,765円	17,013,407円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	5,344,612円	7,483,390円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	9,302,206円	13,563,372円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	22,535,569円	30,186,014円
クルーズコントロール	909,075,064円	838,846,931円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	11,234,137円	18,223,178円
D I A M D C バランス・F (成長型)	2,903,738円	11,888,706円
クルーズコントロール<DC年 金>	274,315円	273,171円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	2,195,692,298円	1,964,140,538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)	7,027,645,265円	6,692,849,161円
D I A M外国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	4,732,221,877円	4,915,477,978円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	1,250,447,896円	2,393,316,784円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	389,340,986円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	141,069,091円	134,269,245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)	10,685,215,824円	6,260,172,158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)	1,025,897,488円	954,481,962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)	165,286,091円	125,222,900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)	307,586,013円	223,657,592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)	64,479,077円	55,193,303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)	40,066,465円	26,329,104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)	16,046,248,001円	12,032,024,975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)	3,756,953,586円	3,062,133,067円

D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	7,184,715,005円	6,468,034,922円
D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	3,442,592,042円	3,186,190,191円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	5,346,965,944円	5,130,012,113円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	1,119,757,516円	1,005,777,844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)	4,223,200,090円	3,693,867,660円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	5,299,806,889円	4,865,295,920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)	21,653,398,611円	18,195,055,456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)	100,927,303円	54,973,620円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	3,042,648,599円	2,482,971,988円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	12,468,255,935円	11,647,837,061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)	134,886,348円	17,941,777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)	17,084,379,724円	16,452,304,332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)	21,483,751,875円	20,862,238,529円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	120,615円	122,238円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	28,789,731円	247,475円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	50,952,485円	37,298,481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)	19,153,914,577円	18,665,551,165円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	137,085,607円	132,179,777円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	5,513,095円	112,355円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	279,673,418円	267,638,937円
D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	127,551円	140,860円
計	183,852,928,058円	166,810,076,091円

2 . 受益権の総数	183,852,928,058口	166,810,076,091口
------------	------------------	------------------

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成27年2月25日 現在				平成27年8月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	165,322,800	-	165,321,000	1,800	3,236,146,044	-	3,216,406,890	19,739,154
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,294,867,171	-	1,283,417,550	11,449,621
イギリス・債券	165,322,800	-	165,321,000	1,800	424,438,152	-	422,392,440	2,045,712
カナダ・ドル	-	-	-	-	122,567,443	-	119,267,280	3,300,163
ユーロ	-	-	-	-	1,394,273,278	-	1,391,329,620	2,943,658
買 建	183,750,400	-	183,690,000	60,400	-	-	-	-
イギリス・債券	183,750,400	-	183,690,000	60,400	-	-	-	-
合計	349,073,200	-	349,011,000	58,600	3,236,146,044	-	3,216,406,890	19,739,154

(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27年2月25日現在	平成27年8月25日現在
1口当たり純資産額	1.8850円	1.8927円
(1万口当たり純資産額)	(18,850円)	(18,927円)

2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

D I A M D C バランス30インデックスファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	4,018,246,118円
負債総額	4,951,163円
純資産総額（ - ）	4,013,294,955円
発行済数量	3,197,078,736口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2553円

D I A M D C バランス50インデックスファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	7,750,760,131円
負債総額	23,907,661円
純資産総額（ - ）	7,726,852,470円
発行済数量	6,170,543,163口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2522円

D I A M D C バランス70インデックスファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	4,780,493,247円
負債総額	13,996,131円
純資産総額（ - ）	4,766,497,116円
発行済数量	3,876,642,801口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2295円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	308,388,838,946円
負債総額	693,016,091円
純資産総額（ - ）	307,695,822,855円
発行済数量	139,566,737,180口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2047円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	417,766,057,139円
負債総額	10,001,043,000円
純資産総額（ - ）	407,765,014,139円
発行済数量	331,421,249,359口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2304円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	288,312,937,805円
負債総額	5,580,184,893円
純資産総額(-)	282,732,752,912円
発行済数量	100,839,059,012口
1口当たり純資産額(/)	2.8038円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年8月31日現在

資産総額	306,691,204,973円
負債総額	970,033,015円
純資産総額(-)	305,721,171,958円
発行済数量	162,272,009,703口
1口当たり純資産額(/)	1.8840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・訂正いたします。

<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。

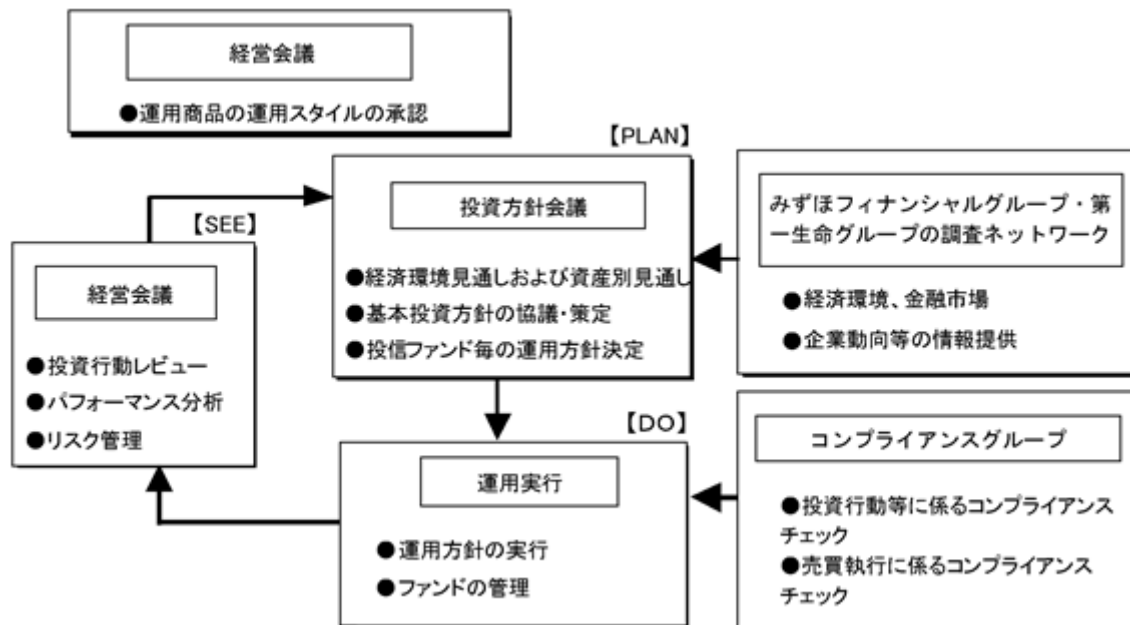
投資運用の意思決定機構

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27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・訂正いたします。

<更新・訂正後>

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成27年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は377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	5	22,940,325,967
追加型株式投資信託	341	5,696,703,539,881
単位型公社債投資信託	31	246,234,027,023
追加型公社債投資信託	0	0
合計	377	5,965,877,892,871

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・訂正いたします。

<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）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。
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30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27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29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	4,178,284	4,343,365
関係会社株式	617,159	613,137
繰延税金資産	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（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	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	15,024		17,346	
受取利息	2,318		2,404	
時効成立分配金・償還金	33,872		974	
為替差益	-		652	
雑収入	4,746		1,822	
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損	7,364		-	
金銭の信託運用損	213,744		163,033	
時効成立後支払分配金・償還金	-		65	
外国税支払損失	-		47,515	
雑損失	10,952		-	
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
会計方針の変 更による累積 的影響額									
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金の 積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
会計方針の変 更による累積 的影響額		
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の配当		3,096,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	139,391	139,391
当期変動額合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変 更による累積 的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の 積立				2,350,000			2,350,000	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変 更による累積 的影響額		131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	243,159	27,291,419
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 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>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<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>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</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>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ9,168千円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

2. 関係会社項目

関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。

（千円）

		第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

（株主資本等変動計算書関係）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26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27年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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、株価指数先物取引及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及び市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,487,360	11,487,360	-
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	536,913	536,913	-
資産計	22,976,732	22,976,732	-
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	-
負債計	1,721,861	1,721,861	-

第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

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

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

当事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第29期（平成26年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	11,486,870	-	-	-
合計	11,486,870	-	-	-

第30期（平成27年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

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

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）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

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	522,887	146,101	376,785
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,551	3,000	1,551
小計	527,439	149,101	378,337
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）	9,474	10,000	526
小計	9,474	10,000	526
合計	536,913	159,101	377,811

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

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
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）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	532,891	159,101	373,789

（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
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,952,459	1,628,835

第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	14,169,657	2,544,066

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度(非積立型制度であります)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. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
会計方針の変更による累積的影響額	-	203,600
会計方針の変更を反映した期首残高	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
過去勤務費用の発生額	24,260	-
退職給付債務の期末残高	1,079,828	973,035

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840	174,402

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり
ます。

（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29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26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	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102 億円	生命保険業	(被所有)直接 50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431 億円	生命保険業	(被所有)直接 50%	兼務2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	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	627,855	未払費用	224,758
	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	251,110	未払費用	97,587

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	658,756	未払費用	235,583
	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	383,980	未払費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000千円	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	増資の引受	400,000	-	-

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その 他 の 関 係 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行 (旧株式 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	1,629,874	未払 手数料	224,525
								預金の預入 (純額)	775,579	現金・ 預金	10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	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	432,201	-	-
							預金の引出 (純額)	203,876			
	みずほ第 一ファイ ナンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	287,136	未払 費用	155,413
							業務委託料 の支払	11,810	未払金	2,646	
	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)	1,000,000	金銭の 信託	10,952,459
							信託報酬の 支払	7,933			

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	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	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	71
	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	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	407,531	未払 費用	240,725
	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)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 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4) 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5) 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29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46銭

（注1）潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（注3）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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・訂正いたします。

<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27年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託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。

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	343,104	日本において保険業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成27年3月末日現在

独立監査人の中間監査報告書

平成27年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	鶴 田 光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス30インデックスファンドの平成27年2月26日から平成27年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A M D C バランス30インデックスファンドの平成27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27年2月26日から平成27年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成27年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス50インデックスファンドの平成27年2月26日から平成27年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A M D C バランス50インデックスファンドの平成27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27年2月26日から平成27年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成27年10月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	鶴 田 光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C バランス70インデックスファンドの平成27年2月26日から平成27年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A M D C バランス70インデックスファンドの平成27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27年2月26日から平成27年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 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26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注1) 上記は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。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。