

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成23年10月11日

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 中島 敬雄

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 大楽 信雄

【電話番号】 03-3287-3110

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 マネックス資産設計ファンド<育成型>

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 3,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

本日、半期報告書を提出いたしましたので、平成23年4月11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】****(1)【ファンドの目的及び基本的性格】**

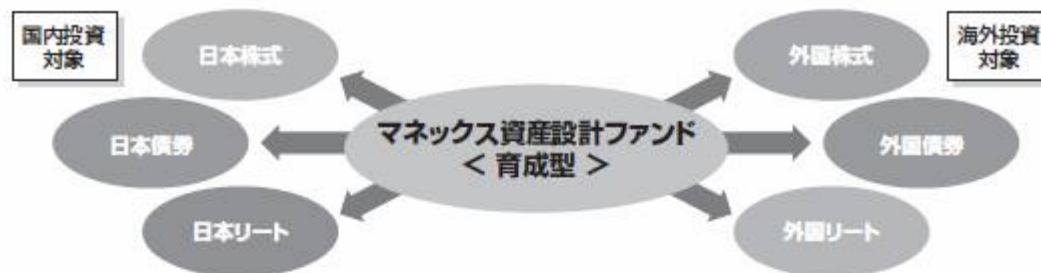
原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

**1 世界の6資産（国内外の株式・債券・リート）に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。**



- 各資産への投資は各資産の市場を代表する指数に連動する投資成果をめざすファンド（マザーファンド）を通じて行います。

投資対象のマザーファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)

※不動産投信等をリート(REIT)と呼びます。また、リート(REIT)はReal Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。

※パッシブ・ファンドとは市場(インデックス)そのものに追随することをめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

※グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用指図等に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。

※当ファンドはファミリーファンド方式により運用します。上記マザーファンドには信託報酬はかかりません。

**2 基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。**

- 基本資産配分比率は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

※分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への基本配分比率は50%以下にします。

※時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。

※ただし、市場動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

**3 購入時手数料、換金手数料がかからないノーロードファンドです。信託報酬は信託財産の純資産総額に対して年率0.9975%(税抜0.95%)と、1%を下回る水準に設定しました。**

- 換金価額は、基準価額から信託財産留保額(換金申込日の翌営業日の基準価額の0.3%)を差し引いた価額となります。

**4 「育成型」(自動けいぞく投資専用)のファンドです。**

**分配方針**

信託財産の成長を重視します。分配金は、決算ごとに原則として経費控除後の利子・配当等収益の範囲内から支払われ、税引後、自動的に無手数料で全額再投資されます。

※決算は原則として毎年1月11日(休業日の場合は翌営業日)です。

- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

**5 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。**

(略)

**(3)【ファンドの仕組み】**

&lt;訂正前&gt;

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成23年1月31日現在）

(略)

大株主の状況

(平成23年1月31日現在)

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

&lt;訂正後&gt;

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成23年7月29日現在）

(略)

大株主の状況

(平成23年7月29日現在)

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

## 2【投資方針】

## (2)【投資対象】

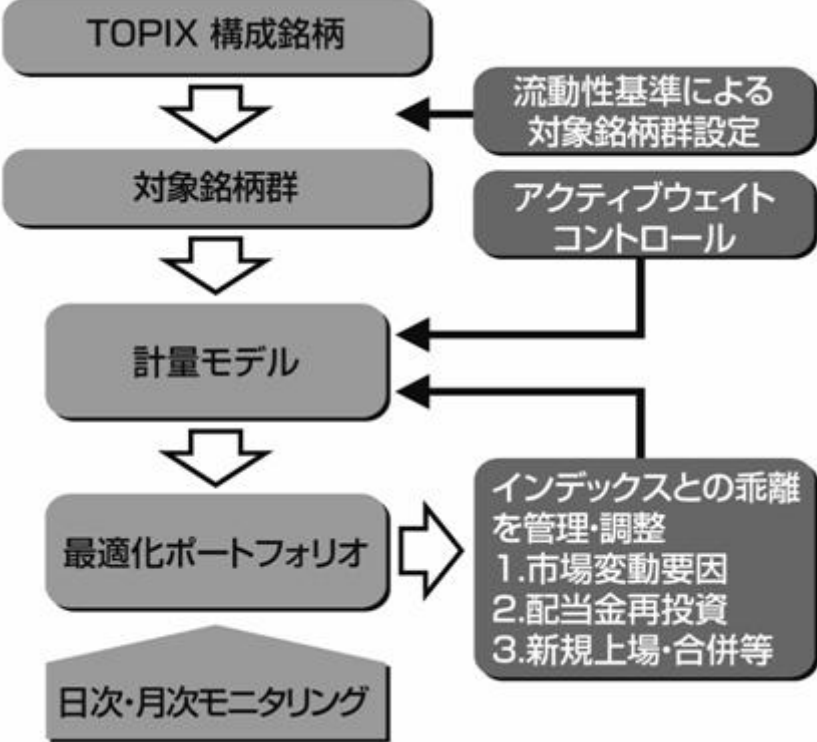
原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (2)投資対象」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

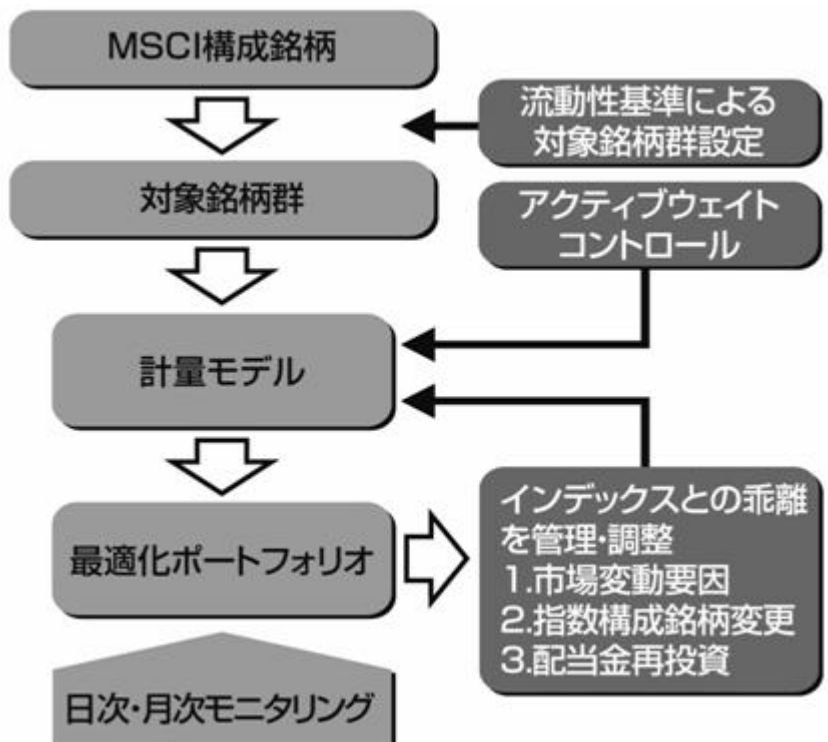
(略)

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>(注) TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東東京証券取引所が有しています。東東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。東東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。東東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、東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ありません。東東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。東東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、東東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資する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、責任を負いません。</p> </div>
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。</p> <p>&lt;運用プロセス&gt;</p>  <p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p>

<p>ファンド名</p>	<p>外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。</p>

主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（注）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div data-bbox="391 235 1372 436" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>（注）MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div> <p>株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <p>&lt;運用プロセス&gt;</p>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]          F[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B     G[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C          D --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整]     H --&gt; C          subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整]         H1[1.市場変動要因]         H2[2.指数構成銘柄変更]         H3[3.配当金再投資]     end </pre>

	<p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>(注)NOMURA - B P I 総合は、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。</p> </div>
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

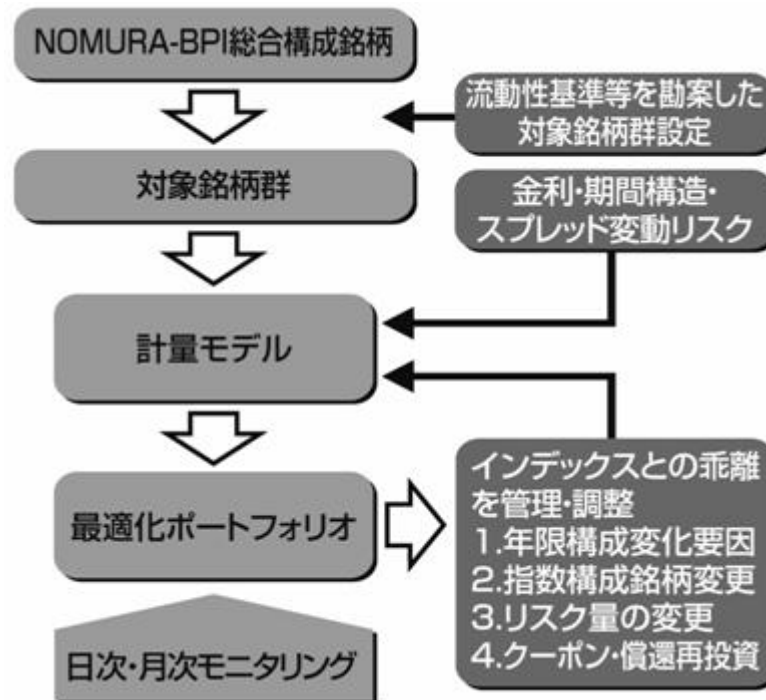


## 投資態度

主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。

公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

<運用プロセス>



1) 流動性基準による対象銘柄群設定

NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2) 最適化法によるポートフォリオの構築

1. 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因
  2. 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因
- 1.、2. が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

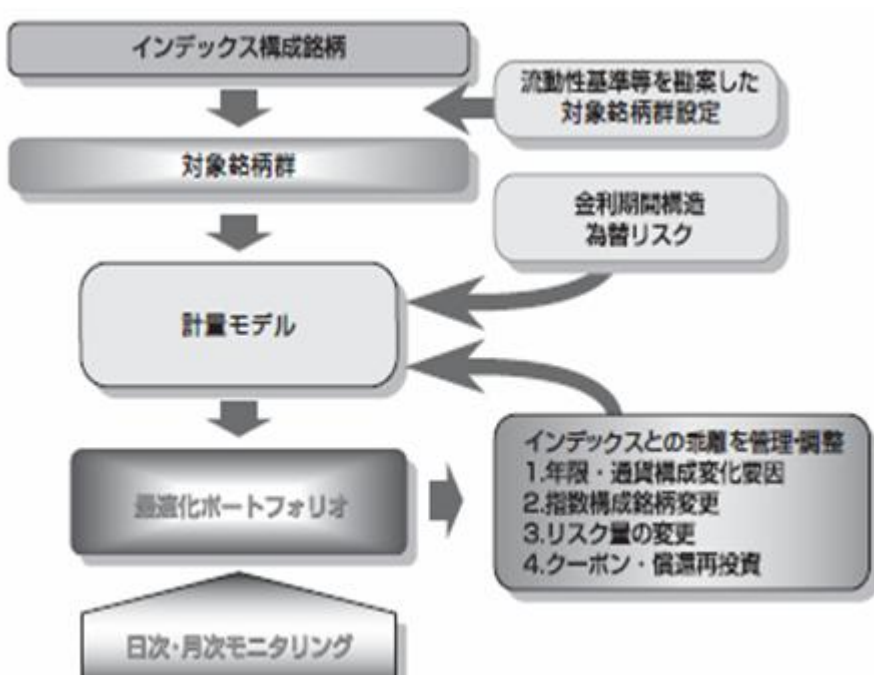
3) インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン、償還再投資

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>
--------	--

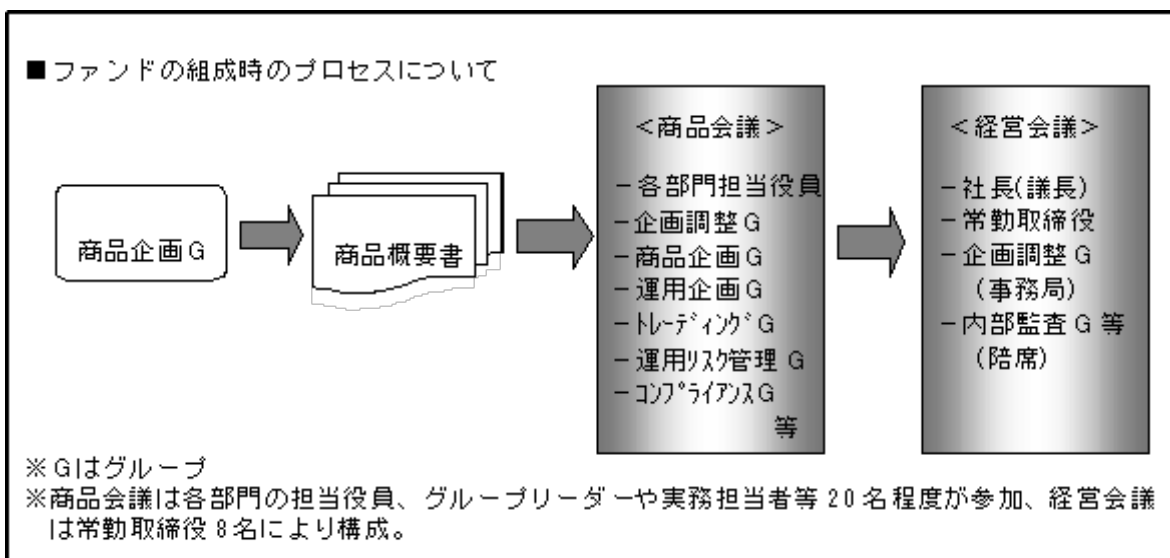
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（注）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>（注）シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。</p> <p>シティグループ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・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。</p> </div> <p>外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <p>&lt;運用プロセス&gt;</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[金利期間構造為替リスク] --&gt; D     D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     G[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限・通貨構成変化要因 2. 指数構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーボン・償還再投資] --&gt; F     F --&gt; H[日々・月次モニタリング]   </pre>

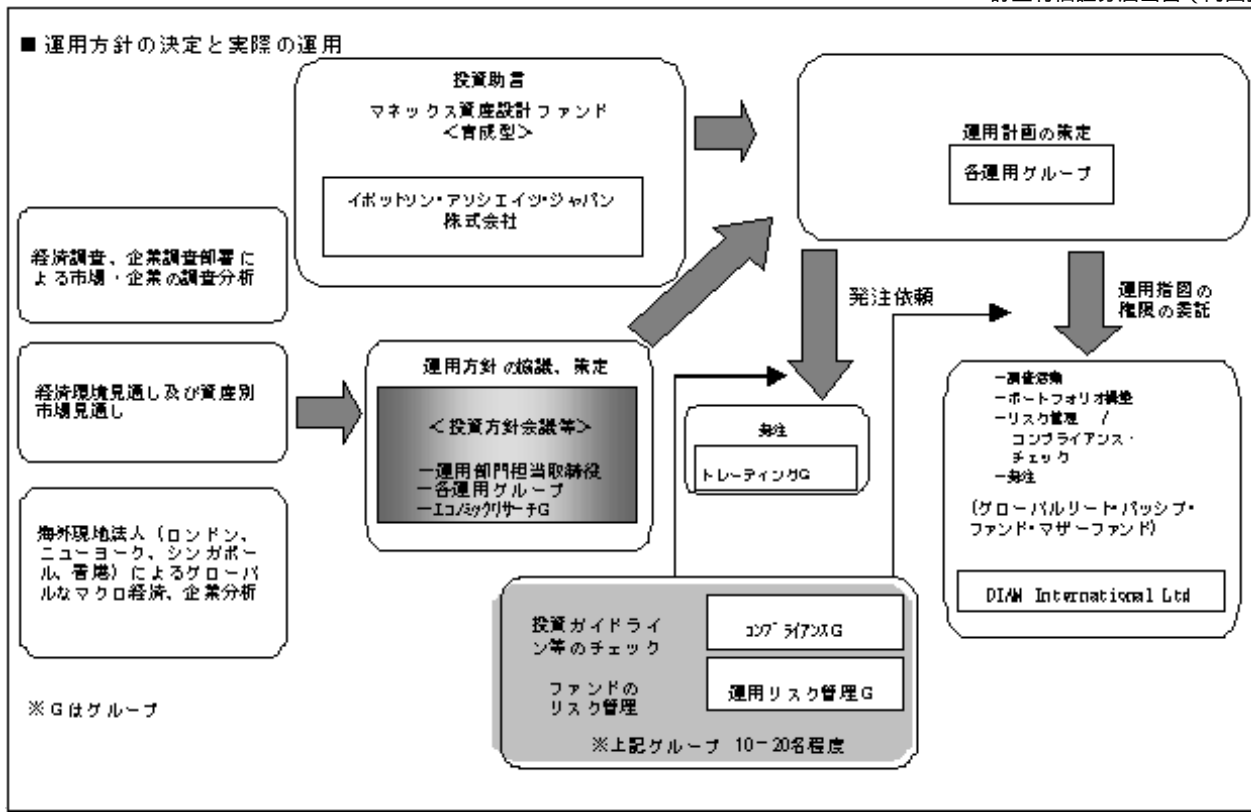
	<p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定 シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 年限・通貨構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン・償還再投資</li> </ul>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

(略)

### (3) 【運用体制】

<訂正前>





運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

<ファンドの組成時のプロセスについて>

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

<運用方針の決定と実際の運用>

経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。

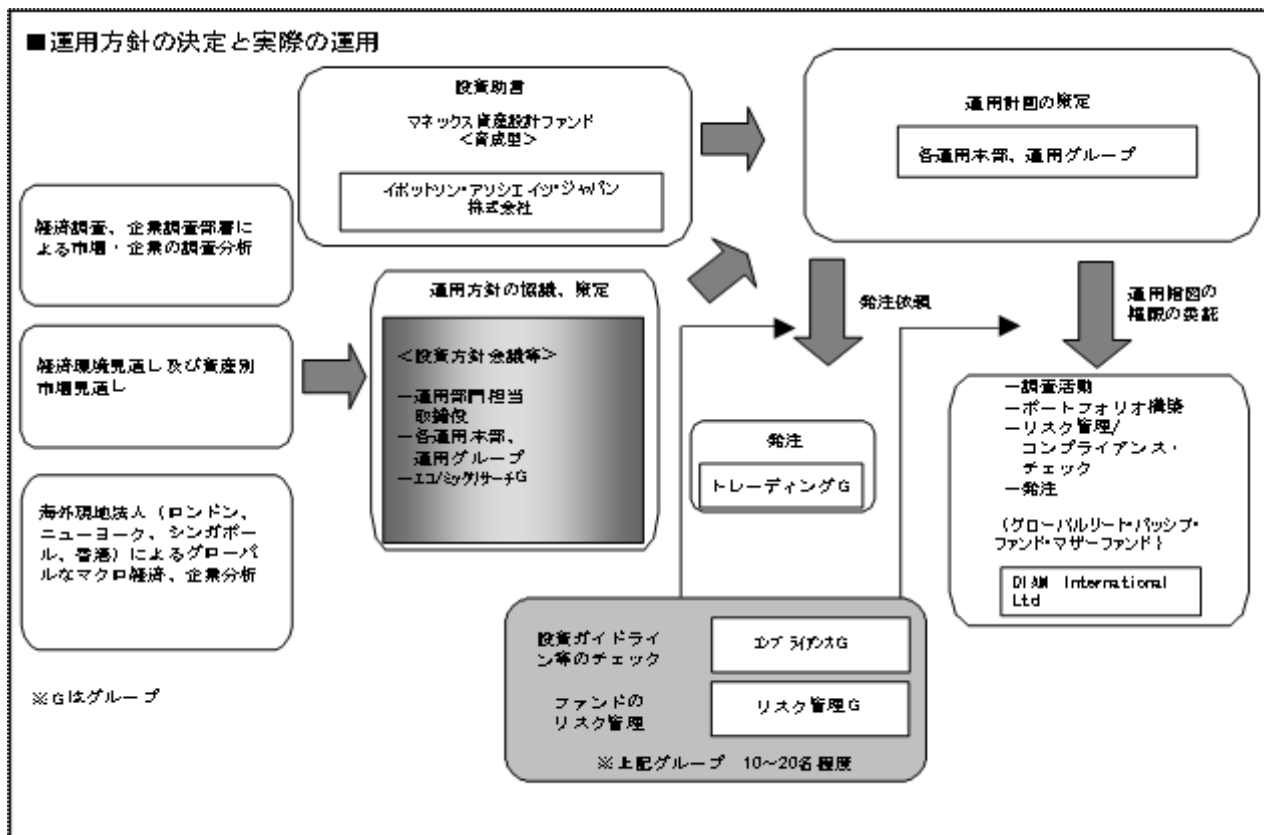
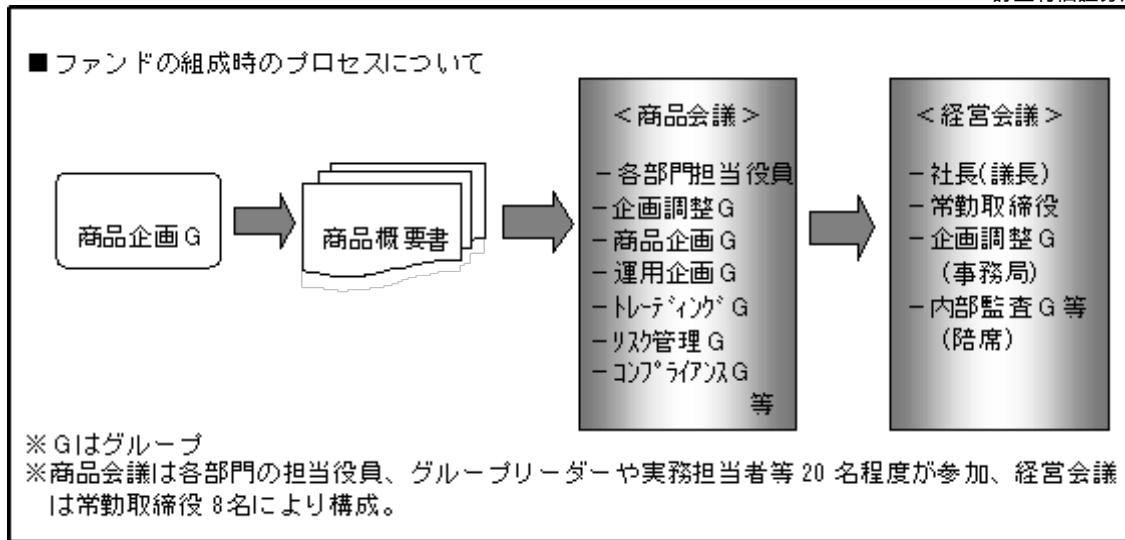
なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、運用リスク管理グループにて行われます。

1)当ファンドは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の運用助言を受けます。

（略）

上記運用体制は、平成23年1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。

<訂正後>



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

#### <ファンドの組成時のプロセスについて>

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

#### <運用方針の決定と実際の運用>

経済環境見直し、資産別市場見直し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部、運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

す。

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

1)当ファンドは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の運用助言を受けます。

（略）

上記運用体制は、平成23年7月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 3【投資リスク】

<訂正前>

<基準価額の主な変動要因>

資産配分リスク

各資産毎（国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート）の資産配分比率は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

（略）

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

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

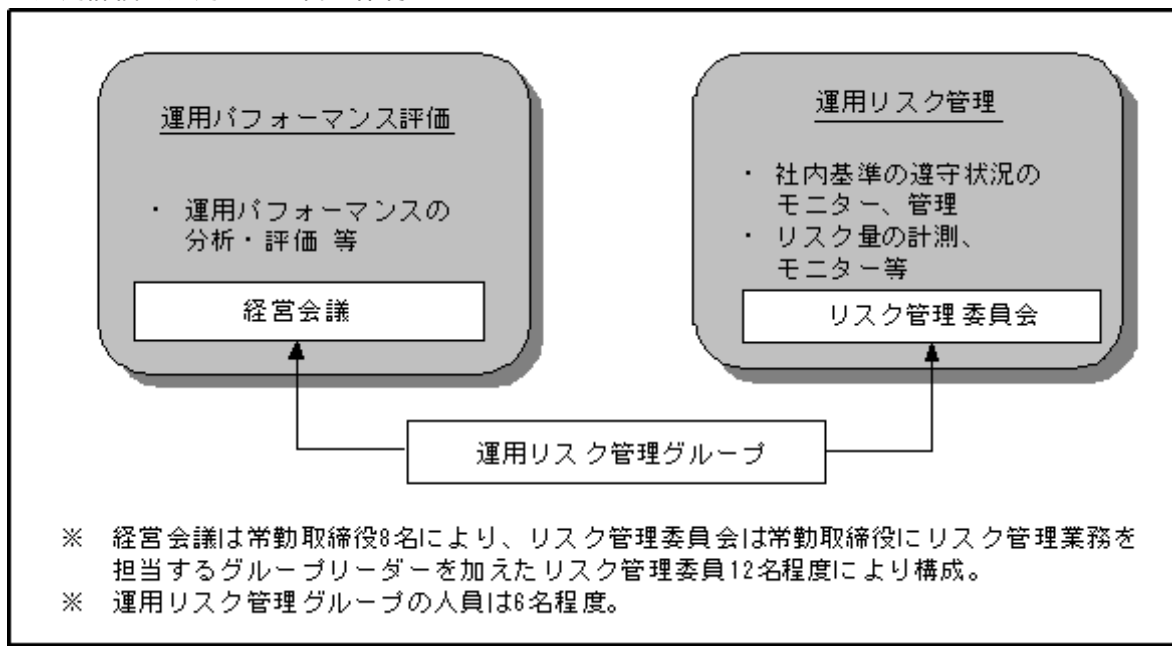
資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

（略）

#### 注意事項

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

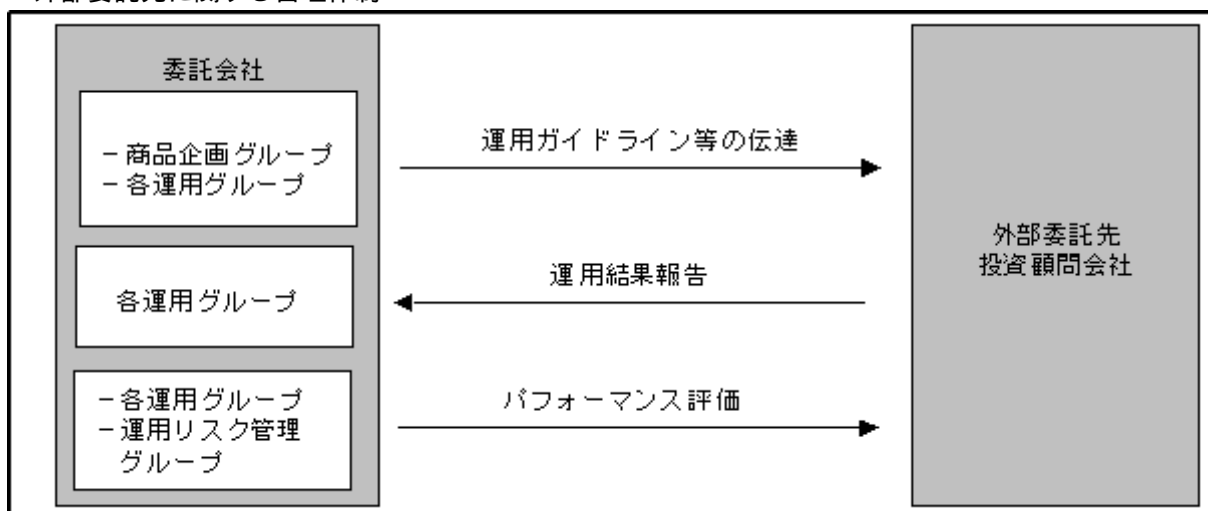
#### < 運用評価・運用リスク管理体制 >



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立した運用リスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、運用リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

#### < 外部委託先に関する管理体制 >



マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、運用リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

上記体制は平成23年1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。

<訂正後>

<基準価額の主な変動要因>

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

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

資産配分リスク

各資産毎（国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート）の資産配分比率は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

（略）

<分配金に関する留意点>

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

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

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

<その他の留意点>

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

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

（略）

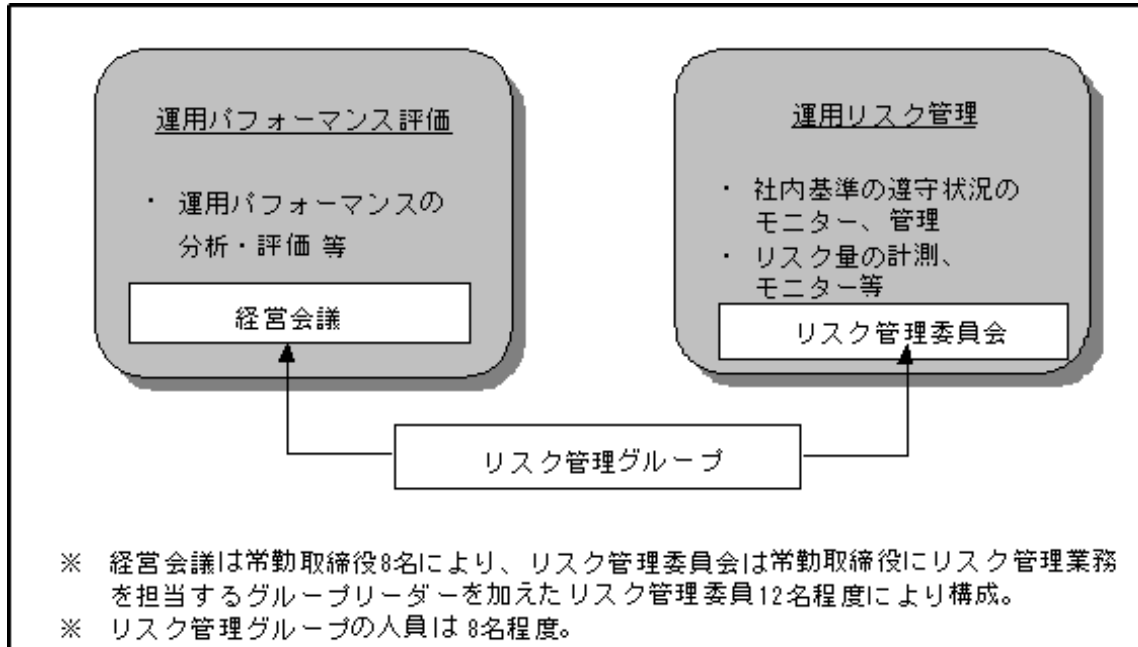
注意事項

- ・当ファンドは、実質的に株式、債券、リートなど値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。



- ・投資信託は、預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります。これによる損失は購入者が負担することとなります。

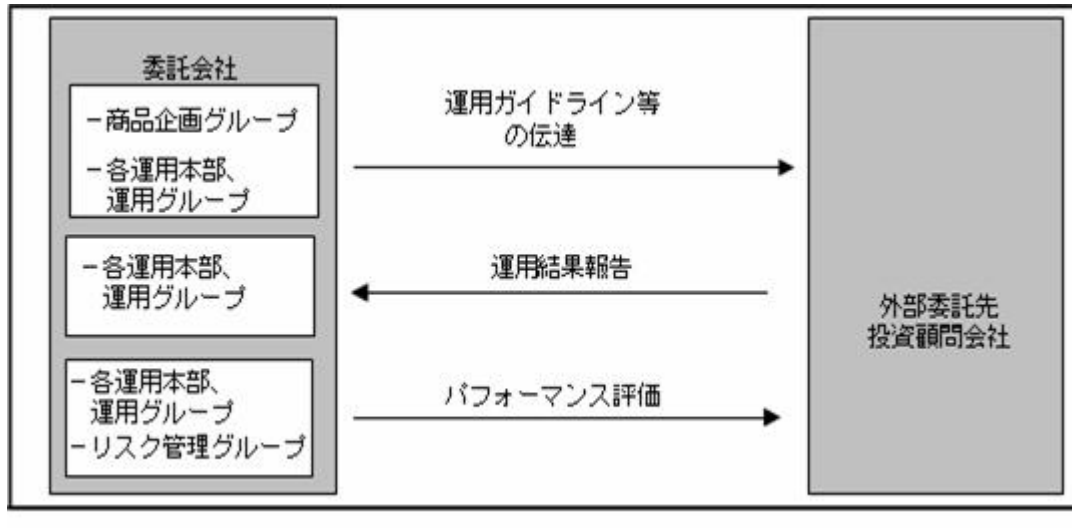
#### <運用評価・運用リスク管理体制>



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

## &lt; 外部委託先に関する管理体制 &gt;



マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用本部、運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

上記体制は平成23年7月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 4【手数料等及び税金】

## (5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

個人の受益者に対する課税

収益分配時

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で、原則として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、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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。

一部解約時および償還時

平成23年12月31日までの間は、一部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、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率により源泉徴収が行われ、原則として申告は不要です。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

一部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。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求時の課税について、詳しく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。

（略）

## &lt;訂正後&gt;

## 個人の受益者に対する課税

## 収益分配時

平成25年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で、原則として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、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。上記10%の税率は平成26年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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。

## 一部解約時および償還時

平成25年12月31日までの間は、一部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、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率により源泉徴収が行われ、原則として申告は不要です。上記10%の税率は平成26年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 損益通算について

一部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。

## 法人の受益者に対する課税

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

買取請求時の課税について、詳しく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。

（略）

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成23年7月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	7,596,731,626	98.53
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		113,285,340	1.47
合 計 （純資産総額）		7,710,016,966	100.00

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

(参考) マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年7月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	253,932,241,869	98.52
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,816,977,416	1.48
合 計 （純資産総額）		257,749,219,285	100.00

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

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

株式	米国	136,205,421,355	49.98
	英国	26,774,163,881	9.82
	カナダ	15,574,537,619	5.71
	スイス	12,535,392,733	4.60
	スウェーデン	3,886,999,512	1.43
	デンマーク	1,368,904,265	0.50
	ノルウェー	995,812,669	0.37
	アイルランド	1,591,386,101	0.58
	オランダ	3,360,993,291	1.23
	ベルギー	1,244,722,916	0.46
	ルクセンブルク	720,321,388	0.26
	フランス	12,056,756,509	4.42
	ドイツ	11,434,185,202	4.20
	ポルトガル	307,421,144	0.11
	スペイン	4,430,261,449	1.63
	イタリア	3,226,770,474	1.18
	フィンランド	1,173,331,774	0.43
	オーストリア	416,050,853	0.15
	キプロス	24,315,635	0.01
	ギリシャ	241,166,284	0.09
	香港	3,382,746,096	1.24
	シンガポール	2,292,013,577	0.84
	イスラエル	916,861,733	0.34
	オーストラリア	10,542,453,265	3.87
	ニュージーランド	141,674,515	0.05
	パナマ	175,997,121	0.06
	バミューダ諸島	655,830,856	0.24
	オランダ領キュラソー	1,440,893,840	0.53
	ケイマン諸島	187,845,267	0.07
	ガーンジー・チャネル諸島	74,702,209	0.03
	ジャージー・チャネル諸島	731,368,593	0.27
	マン島	117,565,217	0.04
リベリア	54,456,466	0.02	
モーリシャス	46,952,391	0.02	
小計	258,330,276,201	94.79	
投資信託受益証券	シンガポール	65,046,531	0.02
	オーストラリア	792,363,480	0.29
	小計	857,410,011	0.31
投資証券	米国	2,792,433,318	1.02
	英国	379,164,612	0.14
	カナダ	83,326,629	0.03
	オランダ	44,653,226	0.02
	フランス	396,995,121	0.15
	香港	101,318,081	0.04
	小計	3,797,890,986	1.39
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,547,338,333	3.50
合 計（純資産総額）		272,532,915,531	100.00

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	日本	326,437,648,500	76.26
地方債証券	日本	29,038,066,581	6.78
特殊債券	日本	38,601,796,530	9.02
社債券	日本	31,414,200,420	7.34
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,551,457,830	0.60
合 計（純資産総額）		428,043,169,861	100.00

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	米国	141,459,732,495	37.26
	英国	29,856,522,175	7.86
	カナダ	11,490,840,925	3.03
	スウェーデン	2,675,451,474	0.70
	デンマーク	3,471,916,091	0.91
	ノルウェー	1,141,558,700	0.30
	アイルランド	2,117,870,323	0.56
	オランダ	10,229,573,054	2.69
	ベルギー	10,355,520,390	2.73
	フランス	39,760,407,088	10.47
	ドイツ	37,942,255,509	9.99
	ポルトガル	1,679,291,134	0.44
	スペイン	16,401,298,633	4.32
	イタリア	36,775,889,705	9.69
	フィンランド	2,560,330,339	0.67
	ポーランド	3,430,402,409	0.90
	オーストリア	7,198,389,387	1.90
	シンガポール	1,624,003,948	0.43
	マレーシア	1,928,341,927	0.51
	オーストラリア	4,937,600,449	1.30
メキシコ	3,367,682,438	0.89	
小計	370,404,878,591	97.55	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,286,292,605	2.45
合 計 （純資産総額）		379,691,171,196	100.00

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
投資証券	日本	3,678,280,740	98.77
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		45,837,929	1.23
合 計 （純資産総額）		3,724,118,669	100.00

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

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	シンガポール	99,968,922	3.09
	オーストラリア	382,903,178	11.83
	小計	482,872,100	14.92
投資証券	米国	2,020,383,661	62.42
	英国	227,781,398	7.04
	カナダ	89,597,208	2.77
	オランダ	61,006,409	1.88
	ベルギー	27,274,265	0.84
	フランス	213,558,495	6.60
	香港	60,669,370	1.87
	ニュージーランド	13,361,200	0.41
	小計	2,713,632,005	83.83
	現金・預金・その他の資産（負債控除後）		40,407,385
合 計（純資産総額）		3,236,911,490	100.00

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成23年7月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率（%）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2,014,179,333	11,156.71	2,247,161,831	11,276.00	2,271,188,615	29.46
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,729,515,807	11,275.77	1,950,162,861	11,375.00	1,967,324,230	25.52
3	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,422,433,505	12,019.05	1,709,629,488	11,099.00	1,578,758,947	20.48
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	793,790,797	12,983.75	1,030,638,265	12,786.00	1,014,940,913	13.16
5	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	492,602,869	7,459.08	367,436,653	7,899.00	389,107,006	5.05
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	470,264,206	8,840.52	415,737,910	7,983.00	375,411,915	4.87

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



(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は6銘柄のみです。

#### 種類別業種別投資比率

平成23年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.53
合計	98.53

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

#### 投資有価証券の主要銘柄

平成23年7月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	2,876,900	3,475.76	9,999,408,800	3,155.00	9,076,619,500	3.52
2	三菱UFJフ ィナンシャル G	株式	日本	銀行業	16,727,100	441.69	7,388,192,716	392.00	6,557,023,200	2.54
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,889,200	3,479.01	6,572,541,200	3,080.00	5,818,736,000	2.26
4	キヤノン	株式	日本	電気機 器	1,391,000	3,917.49	5,449,227,416	3,750.00	5,216,250,000	2.02
5	三井住友フィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,684,900	2,880.77	4,853,802,727	2,434.00	4,101,046,600	1.59
6	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,724,400	2,354.50	4,060,099,586	2,063.00	3,557,437,200	1.38
7	みずほフィナ ンシャルG	株式	日本	銀行業	27,267,300	161.36	4,399,755,839	127.00	3,462,947,100	1.34
8	ファナック	株式	日本	電気機 器	233,100	12,397.11	2,889,765,960	14,610.00	3,405,591,000	1.32
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	878,500	4,000.23	3,514,200,314	3,675.00	3,228,487,500	1.25
10	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	830,000	3,857.16	3,201,442,490	3,800.00	3,154,000,000	1.22
11	ソフトバンク	株式	日本	情報・ 通信業	1,001,300	2,992.51	2,996,402,458	3,010.00	3,013,913,000	1.17
12	三井物産	株式	日本	卸売業	1,907,900	1,484.98	2,833,188,059	1,455.00	2,775,994,500	1.08
13	小松製作所	株式	日本	機械	1,111,000	2,573.08	2,858,691,565	2,407.00	2,674,177,000	1.04

14	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	日本	情報・通信業	18,210	149,078.65	2,714,722,219	141,500.00	2,576,715,000	1.00
15	ソニー	株式	日本	電気機器	1,257,300	2,849.64	3,582,852,888	1,947.00	2,447,963,100	0.95
16	日立	株式	日本	電気機器	5,028,000	492.30	2,475,275,320	479.00	2,408,412,000	0.93
17	パナソニック	株式	日本	電気機器	2,607,500	1,076.27	2,806,375,839	923.00	2,406,722,500	0.93
18	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	2,828,700	857.04	2,424,310,204	822.00	2,325,191,400	0.90
19	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,547,000	1,587.65	2,456,093,080	1,384.00	2,141,048,000	0.83
20	三菱電機	株式	日本	電気機器	2,239,000	1,002.85	2,245,392,300	907.00	2,030,773,000	0.79
21	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	924,300	2,158.77	1,995,351,228	2,195.00	2,028,838,500	0.79
22	KDDI	株式	日本	情報・通信業	3,430	481,903.41	1,652,928,706	572,000.00	1,961,960,000	0.76
23	東京海上HD	株式	日本	保険業	839,000	2,484.35	2,084,372,240	2,275.00	1,908,725,000	0.74
24	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	389,400	5,266.47	2,050,764,963	4,840.00	1,884,696,000	0.73
25	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	5,214	330,452.08	1,722,977,161	350,000.00	1,824,900,000	0.71
26	東芝	株式	日本	電気機器	4,419,000	513.32	2,268,370,760	400.00	1,767,600,000	0.69
27	野村ホールディングス	株式	日本	証券、商品先物取引業	4,654,100	514.11	2,392,724,362	376.00	1,749,941,600	0.68
28	信越化学	株式	日本	化学	390,500	4,776.33	1,865,158,291	4,165.00	1,626,432,500	0.63
29	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	6,153,000	305.09	1,877,219,740	260.00	1,599,780,000	0.62
30	任天堂	株式	日本	その他製品	128,000	22,804.52	2,918,978,376	12,290.00	1,573,120,000	0.61

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

## 種類別業種別投資比率

平成23年7月29日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	電気機器	14.25
	輸送用機器	10.15
	銀行業	8.96
	化学	6.00
	情報・通信業	5.94
	卸売業	5.48
	機械	5.26
	医薬品	4.66
	小売業	3.79
	陸運業	3.50
	食料品	3.19
	電気・ガス業	2.95
	保険業	2.51
	不動産業	2.38
	建設業	2.25
	鉄鋼	2.20
	サービス業	1.75
	その他製品	1.59
	精密機器	1.50
	非鉄金属	1.39
	ガラス・土石製品	1.28
	証券、商品先物取引業	1.24
	繊維製品	0.95
	石油・石炭製品	0.94
	その他金融業	0.79
	ゴム製品	0.74
	金属製品	0.72
	鉱業	0.68
	海運業	0.48
	パルプ・紙	0.36
空運業	0.31	
倉庫・運輸関連業	0.23	
水産・農林業	0.10	
合計		98.52

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成23年7月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	739,793	6,610.24	4,890,211,870	6,341.66	4,691,516,416	1.72
2	APPLE INC	株式	米国	コン ピュ ータ・周 辺機器	137,069	27,946.36	3,830,580,023	30,503.19	4,181,041,339	1.53
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技 術サー ビス	182,302	12,706.68	2,316,452,630	14,153.13	2,580,143,905	0.95
4	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイ ス	食品	514,761	5,022.08	2,585,170,360	4,949.55	2,547,835,308	0.93
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	298,447	7,554.03	2,254,478,074	8,176.59	2,440,277,413	0.90
6	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	1,127,801	2,119.86	2,390,775,153	2,158.00	2,433,796,814	0.89
7	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コング ロマ リット	1,576,874	1,672.32	2,637,037,908	1,409.86	2,223,177,097	0.82
8	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	407,400	4,731.36	1,927,557,390	5,066.48	2,064,083,137	0.76
9	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀 行	2,638,054	899.68	2,373,400,142	772.58	2,038,101,850	0.75
10	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用 品	416,821	5,027.94	2,095,751,577	4,820.47	2,009,273,960	0.74
11	AT&T INC	株式	米国	各種電 気通信 サービ ス	879,659	2,219.24	1,952,170,192	2,277.89	2,003,767,319	0.74
12	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金 融サー ビス	591,948	3,615.76	2,140,343,784	3,166.94	1,874,662,615	0.69
13	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,189,760	1,485.10	1,766,910,380	1,507.18	1,793,177,718	0.66

14	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	37,280	48,728.42	1,816,595,443	47,561.68	1,773,099,393	0.65
15	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	477,030	4,046.21	1,930,165,380	3,599.87	1,717,245,748	0.63
16	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	346,602	5,250.65	1,819,884,317	4,798.15	1,663,049,080	0.61
17	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	307,262	4,916.42	1,510,628,971	5,356.86	1,645,959,056	0.60
18	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	744,907	2,629.67	1,958,861,551	2,203.16	1,641,145,582	0.60
19	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	2,798,487	610.92	1,709,657,813	584.14	1,634,719,837	0.60
20	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	7,703,899	228.96	1,763,855,377	210.59	1,622,343,135	0.60
21	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	533,124	2,688.99	1,433,566,282	2,885.71	1,538,440,085	0.56
22	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	株式	米国	タバコ	266,893	4,654.21	1,242,175,976	5,632.45	1,503,260,811	0.55
23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	104,115	13,691.07	1,425,445,943	13,916.97	1,448,965,332	0.53
24	SCHLUMBERGER LTD	株式	オランダ	エネルギー設備・サービス	202,501	7,173.55	1,452,651,514	7,115.49	1,440,893,840	0.53
25	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	600,612	2,592.82	1,557,280,550	2,387.27	1,433,823,159	0.53
26	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	816,484	1,679.22	1,371,059,937	1,755.52	1,433,351,950	0.53
27	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	英国	医薬品	771,489	1,497.87	1,155,591,111	1,763.38	1,360,429,816	0.50
28	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	314,301	4,816.72	1,513,901,224	4,273.48	1,343,158,204	0.49

29	CITIGROUP INC	株式	米国	各種金融サービス	432,040	3,811.94	1,646,911,466	2,972.31	1,284,158,109	0.47
30	MERCK & CO. INC.	株式	米国	医薬品	459,172	2,560.33	1,175,629,778	2,719.30	1,248,626,649	0.46

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

### 種類別業種別投資比率

平成23年7月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.49
	商業銀行	7.51
	医薬品	6.13
	金属・鉱業	4.41
	保険	3.93
	各種電気通信サービス	2.96
	化学	2.91
	食品	2.77
	メディア	2.51
	コンピュータ・周辺機器	2.41
	各種金融サービス	2.36
	ソフトウェア	2.34
	食品・生活必需品小売り	2.20
	コングロマリット	2.11
	飲料	2.09
	資本市場	2.05
	情報技術サービス	2.02
	電力	1.88
	機械	1.81
	エネルギー設備・サービス	1.81
	航空宇宙・防衛	1.67
	半導体・半導体製造装置	1.53
	ホテル・レストラン・レジャー	1.52
	タバコ	1.49
	家庭用品	1.35
	総合公益事業	1.33
	ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス	1.30
	通信機器	1.30
	専門小売り	1.27
	ヘルスケア機器・用品	1.22
	自動車	1.06
	無線通信サービス	0.98
	繊維・アパレル・贅沢品	0.96
	インターネットソフトウェア・サービス	0.96
バイオテクノロジー	0.82	
電気設備	0.81	
陸運・鉄道	0.78	
不動産管理・開発	0.65	

インターネット販売・カタログ販売	0.58
複合小売り	0.57
航空貨物・物流サービス	0.53
建設・土木	0.48
商業サービス・用品	0.42
消費者金融	0.42
自動車部品	0.39
専門サービス	0.34
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.33
建設資材	0.31
電子装置・機器・部品	0.30
パーソナル用品	0.25
商社・流通業	0.19
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.19
建設関連製品	0.19
家庭用耐久財	0.19
紙製品・林産品	0.18
運送インフラ	0.17
ガス	0.16
容器・包装	0.16
旅客航空輸送業	0.12
海運業	0.11
販売	0.10
水道	0.07
レジャー用品	0.07
事務用電子機器	0.06
各種消費者サービス	0.06
貯蓄・抵当・不動産金融	0.06
不動産投資信託	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
株式計	94.79
投資信託受益証券	0.31
投資証券	1.39
合計	96.50

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成23年7月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	313回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	7,000,000,000	101.15	7,080,330,000	102.36	7,165,480,000	1.30	2021/ 3/20	1.67
2	93回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	6,300,000,000	99.85	6,290,410,000	100.76	6,347,565,000	0.50	2015/ 12/20	1.48
3	312回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	6,200,000,000	99.48	6,168,022,000	101.72	6,306,330,000	1.20	2020/ 12/20	1.47
4	66回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,700,000,000	101.41	5,780,313,000	101.10	5,762,415,000	1.10	2012/ 9/20	1.35
5	89回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,500,000,000	99.46	5,470,400,000	100.44	5,524,255,000	0.40	2015/ 6/20	1.29
6	310回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,500,000,000	97.56	5,366,010,000	100.29	5,516,115,000	1.00	2020/ 9/20	1.29
7	285回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,100,000,000	105.75	5,393,056,000	106.95	5,454,348,000	1.70	2017/ 3/20	1.27
8	306回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,200,000,000	101.56	5,280,860,000	104.30	5,423,340,000	1.40	2020/ 3/20	1.27
9	293回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	105.90	5,295,100,000	108.04	5,401,750,000	1.80	2018/ 6/20	1.26
10	305回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.96	5,048,000,000	103.68	5,184,100,000	1.30	2019/ 12/20	1.21
11	70回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,900,000,000	101.14	4,955,860,000	101.06	4,952,087,000	0.80	2013/ 3/20	1.16
12	75回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,600,000,000	102.03	4,693,334,000	102.00	4,691,816,000	1.10	2013/ 9/20	1.10
13	289回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,400,000,000	104.24	4,586,397,000	105.99	4,663,384,000	1.50	2017/ 12/20	1.09
14	288回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,300,000,000	105.57	4,539,381,000	107.17	4,608,310,000	1.70	2017/ 9/20	1.08



15	81回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	101.28	4,557,600,000	101.59	4,571,730,000	0.80	2014/ 3/20	1.07
16	88回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	99.96	4,498,155,000	100.84	4,537,980,000	0.50	2015/ 3/20	1.06
17	83回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,400,000,000	101.60	4,470,224,000	102.00	4,488,176,000	0.90	2014/ 6/20	1.05
18	290回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	4,200,000,000	103.45	4,345,032,000	105.37	4,425,414,000	1.40	2018/ 3/20	1.03
19	297回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	4,200,000,000	102.65	4,311,132,000	105.21	4,418,736,000	1.40	2018/ 12/20	1.03
20	301回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	4,100,000,000	103.02	4,223,615,000	105.66	4,331,978,000	1.50	2019/ 6/20	1.01
21	72回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,200,000,000	102.81	4,317,920,000	102.53	4,306,260,000	1.50	2013/ 6/20	1.01
22	299回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	4,100,000,000	101.82	4,174,800,000	104.31	4,276,546,000	1.30	2019/ 3/20	1.00
23	296回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	4,000,000,000	103.56	4,142,520,000	105.97	4,238,920,000	1.50	2018/ 9/20	0.99
24	87回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,000,000,000	100.05	4,002,120,000	100.87	4,034,840,000	0.50	2014/ 12/20	0.94
25	92回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,000,000,000	98.81	3,952,520,000	99.98	3,999,160,000	0.30	2015/ 9/20	0.93
26	286回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	3,700,000,000	106.26	3,931,435,000	107.67	3,983,790,000	1.80	2017/ 6/20	0.93
27	266回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	3,700,000,000	103.47	3,828,279,000	103.91	3,844,559,000	1.40	2014/ 12/20	0.90
28	69回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	3,800,000,000	101.24	3,846,930,000	101.05	3,840,052,000	0.90	2012/ 12/20	0.90
29	78回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	3,500,000,000	101.57	3,555,090,000	101.72	3,560,130,000	0.90	2013/ 12/20	0.83
30	85回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	3,500,000,000	100.94	3,532,935,000	101.51	3,552,780,000	0.70	2014/ 9/20	0.83

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

## 種類別業種別投資比率

平成23年7月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	76.26
地方債証券	6.78
特殊債券	9.02
社債券	7.34
合計	99.40

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成23年7月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US T N/B 4.0 11/15/12	国債 証券	米国	3,425,400,000	105.79	3,623,696,406	104.77	3,588,620,310	4.00	2012/ 11/15	0.95
2	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米国	3,114,000,000	108.13	3,367,012,500	108.76	3,386,692,980	4.00	2014/ 2/15	0.89
3	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,114,000,000	108.55	3,380,122,440	108.62	3,382,333,380	4.25	2013/ 11/15	0.89
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	2,724,750,000	110.70	3,016,162,013	111.48	3,037,660,290	4.75	2014/ 5/15	0.80
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	2,724,750,000	107.98	2,942,294,040	107.82	2,937,825,450	4.25	2013/ 8/15	0.77
6	US T N/B 4.375 08/15/12	国債 証券	米国	2,724,750,000	105.69	2,879,706,533	104.30	2,841,805,260	4.38	2012/ 8/15	0.75
7	US T N/B 1.5 07/15/12	国債 証券	米国	2,802,600,000	101.49	2,844,414,792	101.20	2,836,203,174	1.50	2012/ 7/15	0.75
8	US T N/B 1.125 12/15/12	国債 証券	米国	2,724,750,000	100.75	2,745,185,625	101.09	2,754,313,538	1.13	2012/ 12/15	0.73

9	US T N/B 3.5 05/31/13	国債 証券	米国	2,491,200,000	105.84	2,636,661,700	105.71	2,633,372,784	3.50	2013/ 5/31	0.69
10	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,491,200,000	106.23	2,646,501,408	105.45	2,627,045,136	3.88	2013/ 2/15	0.69
11	US T N/B 1.375 09/15/12	国債 証券	米国	2,569,050,000	101.27	2,601,548,483	101.23	2,600,546,553	1.38	2012/ 9/15	0.68
12	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,335,500,000	109.63	2,560,455,360	111.32	2,599,878,600	4.25	2014/ 11/15	0.68
13	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,335,500,000	103.81	2,424,529,260	105.72	2,469,043,890	2.63	2014/ 6/30	0.65
14	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,179,800,000	109.34	2,383,284,330	110.78	2,414,804,238	4.25	2014/ 8/15	0.64
15	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,257,650,000	106.11	2,395,569,839	105.79	2,388,345,359	3.63	2013/ 5/15	0.63
16	US T N/B 0.5 10/15/13	国債 証券	米国	2,335,500,000	98.41	2,298,458,970	100.06	2,336,948,010	0.50	2013/ 10/15	0.62
17	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債 証券	フラン ス	2,227,800,000	104.83	2,335,332,342	104.34	2,324,486,520	4.00	2013/ 4/25	0.61
18	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	国債 証券	フラン ス	2,227,800,000	101.88	2,269,716,614	103.32	2,301,762,960	3.00	2015/ 10/25	0.61
19	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,179,800,000	102.64	2,237,433,912	105.11	2,291,253,174	2.38	2014/ 9/30	0.60
20	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイ ツ	2,116,410,000	107.72	2,279,796,852	108.02	2,286,040,262	4.25	2014/ 7/4	0.60
21	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債 証券	ドイ ツ	2,116,410,000	106.35	2,250,802,035	107.34	2,271,648,674	3.75	2015/ 1/4	0.60
22	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債 証券	フラン ス	2,116,410,000	105.39	2,230,548,660	105.31	2,228,685,551	4.00	2013/ 10/25	0.59
23	US T N/B 1.375 03/15/13	国債 証券	米国	2,179,800,000	101.14	2,204,562,528	101.63	2,215,374,336	1.38	2013/ 3/15	0.58
24	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	国債 証券	ドイ ツ	2,116,410,000	105.67	2,236,410,447	104.66	2,214,928,886	4.50	2013/ 1/4	0.58

25	US T N/B 1.0 07/15/13	国債 証券	米国	2,179,800,000	101.07	2,203,168,906	101.12	2,204,235,558	1.00	2013/ 7/15	0.58
26	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債 証券	ドイツ	2,005,020,000	106.94	2,144,168,388	106.93	2,143,967,886	4.25	2014/ 1/4	0.56
27	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	国債 証券	ドイツ	2,005,020,000	104.61	2,097,351,171	106.03	2,125,922,706	3.25	2015/ 7/4	0.56
28	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債 証券	イタリア	2,116,410,000	102.91	2,177,997,531	98.89	2,092,917,849	4.25	2014/ 8/1	0.55
29	US T N/B 2.125 11/30/14	国債 証券	米国	1,946,250,000	101.55	1,976,339,025	104.39	2,031,768,225	2.13	2014/ 11/30	0.54
30	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	国債 証券	フランス	1,893,630,000	106.30	2,012,986,613	106.70	2,020,408,529	4.00	2014/ 10/25	0.53

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

#### 種類別業種別投資比率

平成23年7月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.55
合計	97.55

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

#### 投資有価証券の主要銘柄

平成23年7月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	日本ビルファンド投資法人	投資 証券	日本	619	804,698.15	498,108,153	789,000.00	488,391,000	13.11
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資 証券	日本	524	781,696.38	409,608,905	773,000.00	405,052,000	10.88
3	日本リテールファンド投資法人	投資 証券	日本	1,807	126,181.24	228,009,502	120,300.00	217,382,100	5.84

4	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	2,251	93,429.12	210,308,945	92,500.00	208,217,500	5.59
5	森トラスト総合リート投資法人	投資証券	日本	259	807,645.29	209,180,130	788,000.00	204,092,000	5.48
6	アドバンス・レジデンス投資法人	投資証券	日本	1,049	169,406.96	177,707,903	162,200.00	170,147,800	4.57
7	野村不動産オフィスファンド投資法人	投資証券	日本	327	541,389.40	177,034,333	505,000.00	165,135,000	4.43
8	日本プライムリアルティ投資法人	投資証券	日本	765	223,903.22	171,285,964	199,200.00	152,388,000	4.09
9	フロンティア不動産投資法人	投資証券	日本	208	741,747.50	154,283,481	699,000.00	145,392,000	3.90
10	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	304	430,290.23	130,808,230	425,000.00	129,200,000	3.47
11	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券	日本	208	601,091.63	125,027,058	597,000.00	124,176,000	3.33
12	大和証券オフィス投資法人	投資証券	日本	424	277,341.06	117,592,608	267,700.00	113,504,800	3.05
13	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券	日本	158	740,268.90	116,962,486	701,000.00	110,758,000	2.97
14	ケネディクス不動産投資法人	投資証券	日本	305	316,654.64	96,579,664	287,400.00	87,657,000	2.35
15	東急リアル・エステート投資法人	投資証券	日本	181	527,452.44	95,468,892	480,500.00	86,970,500	2.34
16	福岡リート投資法人	投資証券	日本	132	588,217.30	77,644,684	597,000.00	78,804,000	2.12
17	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券	日本	202	445,287.18	89,948,010	380,500.00	76,861,000	2.06
18	トップリート投資法人	投資証券	日本	166	470,308.98	78,071,290	428,000.00	71,048,000	1.91
19	グローバル・ワン不動産投資法人	投資証券	日本	104	708,970.40	73,732,922	673,000.00	69,992,000	1.88
20	ビ・ライフ投資法人	投資証券	日本	127	576,773.74	73,250,265	540,000.00	68,580,000	1.84
21	森ヒルズリート投資法人	投資証券	日本	248	281,185.31	69,733,958	258,100.00	64,008,800	1.72
22	野村不動産レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	134	452,913.44	60,690,401	433,000.00	58,022,000	1.56
23	日本賃貸住宅投資法人	投資証券	日本	1,424	37,693.46	53,675,483	36,000.00	51,264,000	1.38
24	プレミア投資法人	投資証券	日本	150	371,140.56	55,671,084	334,500.00	50,175,000	1.35
25	積水ハウス・S I 投資法人	投資証券	日本	123	367,467.47	45,198,499	353,000.00	43,419,000	1.17
26	M I D リート投資法人	投資証券	日本	197	236,280.71	46,547,299	208,900.00	41,153,300	1.11
27	産業ファンド投資法人	投資証券	日本	100	422,561.52	42,256,152	404,000.00	40,400,000	1.08

28	阪急リート投資法人	投資証券	日本	91	418,473.81	38,081,117	399,000.00	36,309,000	0.97
29	平和不動産リート投資法人	投資証券	日本	745	47,740.13	35,566,395	46,350.00	34,530,750	0.93
30	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	投資証券	日本	113	184,615.24	20,861,522	181,900.00	20,554,700	0.55

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

#### 種類別業種別投資比率

平成23年7月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.77
合計	98.77

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

#### 投資有価証券の主要銘柄

平成23年7月29日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	米国	20,804	8,234.19	171,304,182	9,391.82	195,387,506	6.04
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券	フランス	6,220	16,475.69	102,478,822	17,404.69	108,257,156	3.34
3	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	米国	21,000	3,957.89	83,115,774	4,804.90	100,902,942	3.12
4	WESTFIELD GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	145,200	851.77	123,677,409	689.48	100,112,859	3.09
5	PUBLIC STORAGE	投資証券	米国	9,398	8,154.01	76,631,377	9,292.18	87,327,870	2.70
6	PROLOGIS INC	投資証券	米国	31,229	2,467.11	77,045,498	2,747.33	85,796,259	2.65
7	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	米国	11,729	6,994.82	82,042,273	7,296.10	85,575,980	2.64
8	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券	米国	10,150	7,018.18	71,234,502	8,346.30	84,714,930	2.62
9	HCP INC	投資証券	米国	28,200	2,832.96	79,889,514	2,853.20	80,460,311	2.49

10	VENTAS INC	投資証券	米国	18,702	4,183.65	78,242,598	4,202.34	78,592,219	2.43
11	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	投資証券	米国	50,163	1,203.72	60,382,193	1,310.99	65,763,392	2.03
12	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券	米国	49,068	1,332.79	65,397,438	1,257.28	61,692,092	1.91
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	米国	5,868	8,822.74	51,771,841	10,352.49	60,748,429	1.88
14	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資証券	英国	52,600	879.78	46,276,491	1,098.14	57,761,901	1.78
15	BRITISH LAND CO PLC	投資証券	英国	65,200	659.52	43,000,548	752.46	49,060,470	1.52
16	WESTFIELD RETAIL TRUST	投資信託受益証券	オーストラリア	219,200	236.01	51,732,421	212.41	46,560,710	1.44
17	HEALTH CARE REIT INC	投資証券	米国	11,201	3,951.98	44,266,154	4,093.35	45,849,647	1.42
18	LINK REIT/THE	投資証券	香港	162,000	249.25	40,378,581	272.73	44,181,774	1.36
19	STOCKLAND	投資信託受益証券	オーストラリア	158,140	313.48	49,573,569	268.08	42,394,883	1.31
20	THE MACERICH COMPANY	投資証券	米国	9,820	3,845.79	37,765,658	4,159.53	40,846,540	1.26
21	KIMCO REALTY	投資証券	米国	27,299	1,407.53	38,424,107	1,486.16	40,570,586	1.25
22	SL GREEN	投資証券	米国	5,625	5,470.52	30,771,672	6,434.30	36,192,952	1.12
23	GPT GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	137,000	240.68	32,972,681	259.52	35,554,172	1.10
24	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	米国	7,210	4,417.21	31,848,077	4,764.42	34,351,468	1.06
25	GOODMAN GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	527,762	56.10	29,607,844	59.10	31,189,943	0.96
26	UDR INC	投資証券	米国	13,779	1,872.29	25,798,318	2,034.22	28,029,524	0.87
27	CORIO NV	投資証券	オランダ	5,800	5,649.70	32,768,265	4,768.61	27,657,914	0.85
28	HAMMERSON PLC	投資証券	英国	46,200	553.08	25,552,207	595.22	27,499,210	0.85
29	CAMDEN PROPERTY TRUST	投資証券	米国	5,200	4,100.36	21,321,869	5,232.30	27,207,952	0.84

30	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資 証券	米国	4,030	6,425.74	25,895,728	6,742.59	27,172,632	0.84
----	------------------------------	----------	----	-------	----------	------------	----------	------------	------

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

#### 種類別業種別投資比率

平成23年7月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	14.92
投資証券	83.83
合計	98.75

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

直近日（平成23年7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。

	純資産総額 (百万円)		1口当たり純資産額 (円)	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成20年1月11日現在）	7,975	7,975	0.9125	0.9125
第2期末（平成21年1月13日現在）	5,934	5,934	0.6383	0.6383
第3期末（平成22年1月12日現在）	7,473	7,473	0.7361	0.7361
第4期末（平成23年1月11日現在）	7,727	7,727	0.7224	0.7224
平成22年7月末	7,365		0.7005	
8月末	7,249		0.6845	
9月末	7,491		0.7049	
10月末	7,430		0.6969	
11月末	7,565		0.7069	
12月末	7,659		0.7157	
平成23年1月末	7,737		0.7217	
2月末	7,853		0.7315	
3月末	7,780		0.7257	
4月末	7,869		0.7312	
5月末	7,816		0.7218	
6月末	7,811		0.7191	
7月末	7,710		0.7062	

#### 【分配の推移】

	1口当たりの分配額（円）
--	--------------



第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1期	8.75
第2期	30.05
第3期	15.32
第4期	1.86
第5期中間計算期間	0.17

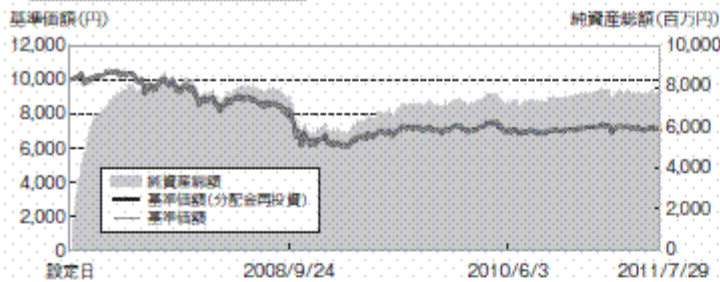
(注) 収益率 = ( 当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額 ) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日: 2011年7月29日

## 基準価額・純資産の推移

(設定日(2007年1月26日)~2011年7月29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:2007年1月26日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第1期	(2008.01.11)	0円
第2期	(2009.01.13)	0円
第3期	(2010.01.12)	0円
第4期	(2011.01.11)	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

## 組入銘柄一覧

(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。

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	29.48
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	25.52
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	20.48
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	13.16
5	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	5.05
6	J-REITインデックスファンド・マザー・ファンド	4.87

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	日本	98.52
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1.48
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	9.52
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	銀行業	2.54
3	本田技研	日本	輸送用機器	2.26
4	キャノン	日本	電気機器	2.02
5	三井住友フィナンシャルG	日本	銀行業	1.59

## 組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	電気機器	14.25
2	輸送用機器	10.15
3	銀行業	8.96
4	化学	6.00
5	情報通信業	5.94

## ■外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	米国	49.98
	英国	9.82
	カナダ	5.71
	スイス	4.60
	フランス	4.42
	その他	20.25
	小計	94.79
投資信託受益証券	オーストラリア	0.29
	シンガポール	0.02
小計		0.31
投資証券	米国	1.02
	フランス	0.15
	英国	0.14
	香港	0.04
	カナダ	0.03
	その他	0.02
	小計	1.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.50
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ガス・ 消耗燃料	1.72
2	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ 周辺機器	1.53
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術 サービス	0.95
4	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.93
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・ 消耗燃料	0.90

## 組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	石油・ガス・ 消耗燃料	10.49
2	商業銀行	7.51
3	医薬品	6.19
4	金属鉱業	4.41
5	保険	3.93

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日: 2011年7月29日

## 主要な資産の状況

## ■国内債券バツシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	日本	76.26
地方債証券	日本	6.78
特殊債証券	日本	9.02
社債証券	日本	7.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.80
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	913回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2021/3/20	1.67
2	93回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.50	2015/12/20	1.48
3	312回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.20	2020/12/20	1.47
4	66回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	1.10	2012/9/20	1.35
5	89回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.40	2015/6/20	1.29

## ■外国債券バツシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	米国	37.26
	フランス	10.47
	ドイツ	9.99
	イタリア	9.69
	英国	7.86
	その他	22.28
小計	97.55	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.45
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	US T N/B 4.0 11/15/12	国債証券	米国	4.00	2012/11/15	0.95
2	US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	米国	4.00	2014/2/15	0.89
3	US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/11/15	0.89
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	米国	4.75	2014/5/15	0.80
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/8/15	0.77

## ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資証券	日本	98.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.23
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	13.11
2	ジャパニリアルエステイト投資法人	日本	10.88
3	日本リアルファンド投資法人	日本	5.84
4	ユナイテッドアーノル投資法人	日本	5.59
5	森トラスト総合リート投資法人	日本	5.48

## ■グローバルリート・バツシブ・ファンド・マザーファンド

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

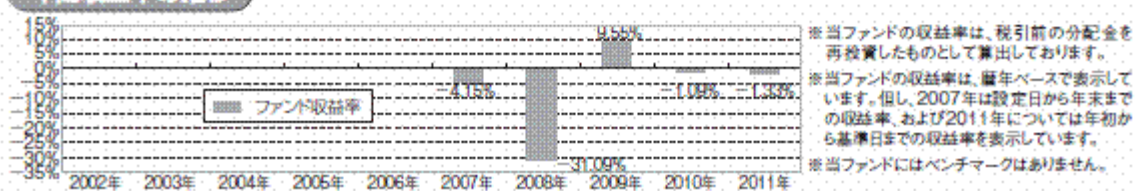
## ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資信託受益証券	オーストラリア	11.83
	シンガポール	3.09
	小計	14.92
投資証券	米国	62.42
	英国	7.04
	フランス	6.60
	カナダ	2.77
	オランダ	1.88
	その他	3.13
	小計	83.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.25
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	6.04
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	3.34
3	EQUITY RESIDENTIAL	米国	3.12
4	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	3.09
5	PUBLIC STORAGE	米国	2.70

## 年間収益率の推移



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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

**(4)【設定及び解約の実績】**

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	12,252,099,717	3,511,628,988
第2期	2,271,286,181	1,714,151,191
第3期	1,780,961,356	925,938,640
第4期	1,561,559,539	1,016,414,248
第5期中間計算期間	745,587,468	592,065,319

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

<追加>

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間（平成22年1月13日から平成22年7月12日まで）及び第5期中間計算期間（平成23年1月12日から平成23年7月11日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

## 中間財務諸表

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;育成型&gt;】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期中間計算期間末 平成22年7月12日現在	第5期中間計算期間末 平成23年7月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	133,021,861	161,186,499
親投資信託受益証券	7,223,860,985	7,739,679,191
未収入金	780,000	9,259,000
流動資産合計	7,357,662,846	7,910,124,690
資産合計	7,357,662,846	7,910,124,690
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,830,784	19,524,281
未払受託者報酬	2,692,638	2,834,764
未払委託者報酬	33,850,882	35,637,576
その他未払費用	192,242	192,275
流動負債合計	41,566,546	58,188,896
負債合計	41,566,546	58,188,896
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,472,111,045	10,851,295,875
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	* <sub>3</sub> 3,156,014,745	* <sub>3</sub> 2,999,360,081
(分配準備積立金)	403,171,215	479,761,569
元本等合計	7,316,096,300	7,851,935,794
純資産合計	7,316,096,300	7,851,935,794
負債純資産合計	7,357,662,846	7,910,124,690

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第 4 期中間計算期間 自 平成22年 1 月13日 至 平成22年 7 月12日	第 5 期中間計算期間 自 平成23年 1 月12日 至 平成23年 7 月11日
<b>営業収益</b>		
受取利息	38,076	40,702
有価証券売買等損益	348,523,427	49,338,457
営業収益合計	348,485,351	49,379,159
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	2,692,638	2,834,764
委託者報酬	*1 33,850,882	*1 35,637,576
その他費用	192,242	192,275
営業費用合計	36,735,762	38,664,615
営業利益又は営業損失 ( )	385,221,113	10,714,544
経常利益又は経常損失 ( )	385,221,113	10,714,544
中間純利益又は中間純損失 ( )	385,221,113	10,714,544
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 ( )	7,231,114	2,614,731
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	2,679,037,589	2,969,962,899
剰余金増加額又は欠損金減少額	141,702,911	164,315,960
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	141,702,911	164,315,960
剰余金減少額又は欠損金増加額	240,690,068	207,042,417
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	240,690,068	207,042,417
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	3,156,014,745	2,999,360,081

## （ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第4期中間計算期間 自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	第5期中間計算期間 自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
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。	親投資信託受益証券 同左
2. その他中間財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	中間計算期間の取扱い 当ファンドの中間計算期間は前 計算期間末日が休業日のため、平 成22年1月13日から平成22年7月 12日までとなっております。	

（追加情報）

第4期中間計算期間 自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	第5期中間計算期間 自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
	当中間計算期間より、「金融商品に 関する会計基準」（企業会計基準第 10号 平成20年3月10日）及び「金融 商品の時価等の開示に関する適用指 針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しており ます。

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	第4期中間計算期間末 平成22年7月12日現在	第5期中間計算期間末 平成23年7月11日現在
*1 期首元本額	10,152,628,435円	10,697,773,726円
期中追加設定元本額	855,419,755円	745,587,468円
期中解約元本額	535,937,145円	592,065,319円
*2 中間計算期間末日における受 益権の総数	10,472,111,045口	10,851,295,875口
*3 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が 元本総額を下回っており、その差 額は3,156,014,745円でありま す。	中間貸借対照表上の純資産額が 元本総額を下回っており、その差 額は2,999,360,081円でありま す。

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）



区分	第4期中間計算期間 自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	第5期中間計算期間 自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
*1 当ファンドの主要投資対象であるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用	479,340円	400,633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

区分	第4期中間計算期間末 平成22年7月12日現在	第5期中間計算期間末 平成23年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額		中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)親投資信託受益証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期中間計算期間末 平成22年7月12日現在	第5期中間計算期間末 平成23年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6986円 (6,986円)	0.7236円 (7,236円)

(参考)

当ファンドは「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」、「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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

科目	注記 番号	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,616,132,805	3,244,828,664
株式	*2	256,024,035,336	267,265,463,999
派生商品評価勘定		138,729,877	185,678,860
未収入金		309,156	4,678,964
未収配当金		194,017,450	231,608,550
流動資産合計		265,973,224,624	270,932,259,037
資産合計		265,973,224,624	270,932,259,037
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,293,694	532,765
前受金		159,089,000	209,520,000
未払解約金		40,723,000	82,518,000
流動負債合計		203,105,694	292,570,765
負債合計		203,105,694	292,570,765
純資産の部			
元本等			
元本		240,027,615,227	235,791,967,318
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		25,742,503,703	34,847,720,954
元本等合計		265,770,118,930	270,639,688,272
純資産合計		265,770,118,930	270,639,688,272
負債純資産合計		265,973,224,624	270,932,259,037

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、金融商品取引所 等における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準 ずる価額）、又は金融商品取引業 者等から提示される気配相場に 基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及 び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価 で評価しております。時価評価に あたっては、原則として、計算日 に知りうる直近の日の主たる金 融商品取引所等の発表する清算 値段又は最終相場によっており ます。	先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための 基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 半期報告書における開示対象 ファンドと異なり、平成22年2月9 日から平成23年2月7日までと なっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 半期報告書における開示対象 ファンドと異なり、平成23年2月8 日から平成24年2月7日までと なっております。

## （追加情報）

自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
	当計算期間より、「金融商品に関す る会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品 の時価等の開示に関する適用指針」 （企業会計基準適用指針第19号 平 成20年3月10日）を適用しておりま す。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
*1 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	234,321,017,334円	228,379,687,941円
同期中追加設定元本額	29,370,880,597円	34,668,043,549円
同期中解約元本額	23,664,282,704円	27,255,764,172円
同中間期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,491,545,766円	1,753,210,296円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	726,877,921円	897,306,358円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	29,539,123,456円	32,159,896,459円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	707,918,692円	781,235,444円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,636,892,571円	2,976,362,415円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,789,464,486円	3,111,356,127円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	432,660,440円	478,156,962円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,307,013,608円	1,448,389,913円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,005,980,075円	1,099,540,249円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	157,988,330円	143,583,118円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,310,268,699円	1,414,000,866円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,016,287円	18,117,671円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	283,618,056円	265,779,784円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	11,489,156,127円	10,653,257,918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）	1,864,817,625円	1,817,583,310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）	222,005,505円	208,729,696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）	803,163,531円	803,143,848円

D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	233,476,177円	214,772,748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)	309,416,744円	289,355,964円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,886,080,814円	19,927,914,568円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,811,790,636円	6,624,548,469円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,514,469,829円	5,169,959,325円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,705,365,289円	3,440,002,533円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,584,051,173円	8,088,319,544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)	1,245,640,965円	1,218,221,055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)	2,704,991,363円	2,620,095,089円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,800,179,515円	2,670,695,704円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	15,068,979,041円	14,391,670,231円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	243,609,429円	204,230,422円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け)	282,809,995円	円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,907,481,680円	4,853,345,843円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	9,256,132,840円	9,305,539,082円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	455,563,938円	452,574,283円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	42,690,390,615円	41,064,695,026円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,914,006,252円	2,733,686,337円

D I A M世界アセットバランス ファンド25VA（適格機関投資 家限定）	5,231,987,984円	5,033,946,456円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA（適格機関投資 家限定）	26,094,155,748円	24,927,214,741円
D I A Mバランス30VA（適 格機関投資家限定）	293,578,822円	285,014,160円
D I A Mバランス50VA（適 格機関投資家限定）	93,214円	98,499円
D I A Mバランス70VA（適 格機関投資家限定）	142,462円	154,227円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA（適格機関投資 家限定）	22,581,587,143円	21,718,101,653円
D I A M世界バランス25VA （適格機関投資家限定）	195,837,945円	233,049,376円
D I A M国内バランス30VA （適格機関投資家限定）	66,048,728円	79,339,084円
D I A Mバランス20VA（適 格機関投資家限定）	175,014,659円	215,539,586円
D I A Mバランス40VA（適 格機関投資家限定）	88,375円	91,981円
D I A Mバランス60VA（適 格機関投資家限定）	132,677円	140,898円
（合 計）	240,027,615,227円	235,791,967,318円
*2 差入代用有価証券	株式 1,560,000,000円	株式 1,710,000,000円
*3 本半期報告書における開示対 象ファンドの中間計算期間末日 における受益権の総数	240,027,615,227口	235,791,967,318口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11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ぬ。

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

（株式関連）

平成22年7月12日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,565,031,000	-	9,701,050,000	135,436,183
	TOPIX先物				
合 計		9,565,031,000	-	9,701,050,000	135,436,183

平成23年7月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX先物	3,115,696,000	-	3,301,090,000	185,146,095
合 計		3,115,696,000	-	3,301,090,000	185,146,095

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1072円	1.1478円
(1万口当たり純資産額)	(11,072円)	(11,478円)

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		2,290,681,308	7,183,768,928
コール・ローン		905,050,221	54,136,878
株式		272,053,770,193	274,520,031,091
投資信託受益証券		891,442,068	920,023,048
投資証券		3,305,326,538	4,000,376,260
派生商品評価勘定		209,293,577	276,860,317
未収入金		2,902,418	65,159,746
未収配当金		372,479,401	375,768,900
差入委託証拠金		1,490,855,658	1,679,124,331
流動資産合計		281,521,801,382	289,075,249,499
資産合計		281,521,801,382	289,075,249,499
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		744,986	860,540
未払金		-	18,408,174
未払解約金		29,812,000	47,196,000
流動負債合計		30,556,986	66,464,714
負債合計		30,556,986	66,464,714
純資産の部			
元本等			
元本		239,234,223,392	212,919,118,430



剰余金 剰余金又は欠損金（ ）		42,257,021,004	76,089,666,355
元本等合計		281,491,244,396	289,008,784,785
純資産合計		281,491,244,396	289,008,784,785
負債純資産合計		281,521,801,382	289,075,249,499

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	(1)先物取引 同左 (2)為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月15日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月16日から平成24年2月15日までとなっております。

## （追加情報）

自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しておりません。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
*1 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	225,558,619,520円	218,946,599,573円
同期中追加設定元本額	43,531,631,466円	17,573,499,572円
同期中解約元本額	29,856,027,594円	23,600,980,715円
同中間期末における元本の内訳		
D I A M 外国株式パッシブ・ ファンド	690,883,051円	1,232,140,306円
D I A M 外国株式インデックス ファンド< D C 年金 >	26,465,779,897円	30,635,440,616円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型	175,556,840円	176,159,227円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型	990,649,219円	1,006,793,841円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型	1,249,179,821円	1,248,172,984円
D I A M D C バランス 3 0 イ ンデックスファンド	201,539,068円	202,182,992円
D I A M D C バランス 5 0 イ ンデックスファンド	522,865,707円	524,098,483円
D I A M D C バランス 7 0 イ ンデックスファンド	376,585,619円	366,940,007円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	89,857,496円	80,156,374円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	746,660,445円	789,704,125円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	50,104,756円	135,742,986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）	647,872,155円	612,753,445円

D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド（適格機関投資家向 け）	6,092,602,964円	5,963,506,635円
D I A M為替リスクコントロー ル型グローバル株式私募ファン ド（適格機関投資家限定）	16,882,853,661円	17,000,035,639円
D I A Mワールドバランス25 VA（適格機関投資家限定）	117,672,330円	95,726,933円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA（適格機関投 資家限定）	11,156,947,362円	8,959,536,394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）	1,806,343,984円	1,528,574,612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）	215,068,352円	175,546,635円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA（適格機関投資家 限定）	1,167,630,144円	1,013,356,836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）	113,037,058円	90,270,567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）	199,797,835円	162,211,088円
D I A M世界バランスファンド 40VA（適格機関投資家限 定）	20,250,733,085円	16,759,727,857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）	9,903,236,240円	8,358,423,791円
D I A Mバランスファンド25 VA（適格機関投資家限定）	3,560,092,980円	2,897,726,512円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA（適格機関投資家限 定）	3,140,881,876円	2,531,271,241円
D I A Mバランスファンド50 VA（適格機関投資家限定）	8,324,446,323円	6,802,351,300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）	6,065,255,159円	5,123,169,704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）	7,884,339,995円	6,606,880,442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）	5,441,824,915円	4,494,196,853円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA（適格機関投資家 向け）	4,860,710,262円	4,028,111,836円

D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	78,999,091円	58,961,297円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	274,687,898円	円
D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	21,453,858,425円	18,320,398,673円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定）	3,569,670,827円	3,020,682,749円
D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定）	144,568,545円	124,781,994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）	27,643,320,887円	23,020,505,662円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,822,953,027円	2,299,076,649円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	5,068,642,797円	4,233,669,372円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	16,863,571,192円	13,973,938,336円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	181,509円	165,185円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	275,805円	258,916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）	21,922,227,730円	18,265,534,689円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	86,415円	77,087円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	170,645円	157,560円
（合計）	239,234,223,392円	212,919,118,430円
*2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	239,234,223,392口	212,919,118,430口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

（株式関連）

平成22年7月12日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	208,200,271	-	213,774,800	5,574,529
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	339,006,180	-	351,157,032	12,150,852
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	993,160,852	-	1,043,583,554	50,422,702
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	496,815,344	-	520,130,548	23,315,204
	米ドル S&P 500 FUTURE	2,512,237,871	-	2,625,533,625	113,295,754
	合 計	4,549,420,518	-	4,754,179,559	204,759,041

平成23年7月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	406,187,558	-	420,258,720	14,071,162
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	630,083,418	-	640,960,320	10,876,902
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,977,415,180	-	2,001,763,768	24,348,588
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	968,584,665	-	1,000,518,045	31,933,380
	米ドル S&P 500 FUTURE	4,867,287,369	-	5,061,615,114	194,327,745
	合 計	8,849,558,190	-	9,125,115,967	275,557,777

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (通貨関連)

平成22年7月12日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	22,254,550	-	22,252,500	2,050
	買建 オーストラリアドル	31,014,000	-	31,200,000	186,000
	カナダドル	59,351,600	-	60,445,000	1,093,400
	ユーロ	179,567,200	-	179,600,000	32,800
	英ポンド	93,804,200	-	93,744,000	60,200
	米ドル	487,019,500	-	489,555,000	2,535,500
	合 計	873,011,050	-	876,796,500	3,789,550

平成23年7月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 ユーロ	23,338,000	-	22,896,000	442,000
	合 計	23,338,000	-	22,896,000	442,000

（注）時価の算定方法

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

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1766円 (11,766円)	1.3574円 (13,574円)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況  
貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,074,722,211	1,444,839,746
国債証券		315,698,889,600	326,592,204,500
地方債証券		28,159,568,591	28,978,569,399
特殊債券		39,120,623,047	38,940,259,375
社債券		33,219,414,810	31,757,168,560
未収利息		1,250,210,184	1,232,509,453
前払費用		41,987,951	57,722,066
流動資産合計		419,565,416,394	429,003,273,099
資産合計		419,565,416,394	429,003,273,099
負債の部			
流動負債			
未払解約金		71,980,000	103,209,000
流動負債合計		71,980,000	103,209,000
負債合計		71,980,000	103,209,000
純資産の部			
元本等			
元本		375,813,610,249	382,000,137,240
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		43,679,826,145	46,899,926,859
元本等合計		419,493,436,394	428,900,064,099
純資産合計		419,493,436,394	428,900,064,099
負債純資産合計		419,565,416,394	429,003,273,099



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月14日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月15日から平成24年2月14日までとなっております。

## （追加情報）

自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
*1 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	395,927,275,552円	382,815,805,870円
同期中追加設定元本額	30,070,589,355円	26,166,367,528円
同期中解約元本額	50,184,254,658円	26,982,036,158円
同中間期末における元本の内訳 D I A M国内債券パッシブ・ファンド	2,279,311,928円	5,531,500,787円

D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	6,833,341,441円	7,893,056,918円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	2,389,267,356円	2,635,590,131円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	3,828,958,881円	4,173,453,547円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,548,553,289円	1,672,334,514円
D I A M D C バランス3 0 イ ンデックスファンド	1,164,360,330円	1,205,151,774円
D I A M D C バランス5 0 イ ンデックスファンド	1,180,558,502円	1,201,420,070円
D I A M D C バランス7 0 イ ンデックスファンド	152,513,471円	152,558,937円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	239,732,476円	203,363,120円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,989,560,055円	2,002,085,839円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	378,498円	2,980,752円
みずほエマージングボンドオー プン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	10,126,042円	10,126,042円
D I A M国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	12,810,816,415円	20,101,107,695円
D I A M国内債券パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家限 定)	111,456,240円	110,596,194円
D I A Mワールドバランス2 5 V A(適格機関投資家限定)	906,609,855円	871,355,465円
D I A Mグローバル・バランス ファンド2 5 V A(適格機関投 資家限定)	13,411,670,197円	12,752,005,820円
D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A(適格機関投 資家限定)	724,545,458円	724,674,103円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A(適格機関投資家 限定)	503,919,862円	485,950,232円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A(適格機関投資家 限定)	1,171,139,742円	1,201,773,814円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A(適格機関投資家 限定)	567,772,534円	535,697,158円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A(適格機関投資家 限定)	401,077,559円	384,838,262円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	30,440,995,870円	29,818,742,128円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	9,927,568,337円	9,912,532,178円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	14,289,451,077円	13,756,093,499円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	5,400,775,100円	5,147,358,119円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	8,349,427,005円	8,067,135,207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 )	1,816,925,827円	1,823,039,891円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A 2 ( 適格機関投 資家限定 )	6,579,869,204円	6,540,352,694円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A ( 適格 機関投資家限定 )	8,176,210,037円	7,996,389,922円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A ( 適格機関投資家 向け )	14,653,124,336円	14,353,868,135円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド ( 適格機関投資家向け )	812,270,396円	745,905,317円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド ( 適格機関投資家向け )	550,069,731円	円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	14,327,898,550円	14,534,941,964円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A ( 適格機 関投資家限定 )	7,692,813,284円	7,244,881,976円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A ( 適格機関投資家限定 )	1,561,601,034円	1,512,273,557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 )	110,754,216,354円	109,243,683,318円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	2,833,613,843円	2,726,536,091円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A ( 適格機関投 資家限定 )	10,179,560,938円	10,045,588,225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 )	33,833,591,245円	33,152,411,071円

D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	2,285,930,594円	2,280,420,650円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	227,718円	246,499円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	138,728円	153,923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）	36,610,573,972円	36,112,059,781円
D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	626,297,103円	764,046,565円
D I A M国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	149,915,164円	184,659,875円
D I A Mバランス20VA（適格機関投資家限定）	1,704,495,838円	2,154,778,208円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	303,404円	322,175円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	214,590円	234,259円
（合計）	375,813,610,249円	382,000,137,240円
*2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	375,813,610,249口	382,000,137,240口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	--	---

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1162円 (11,162円)	1.1228円 (11,228円)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		4,121,842,793	4,201,387,971
コール・ローン		197,503,525	320,999,171
国債証券		397,830,316,247	375,833,434,826
派生商品評価勘定		5,600	994
未収入金		-	443,648,750
未収利息		5,183,723,108	4,937,152,112
前払費用		268,814,065	244,920,523
流動資産合計		407,602,205,338	385,981,544,347
資産合計		407,602,205,338	385,981,544,347
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,460	308,348
未払解約金		76,747,000	91,033,000
流動負債合計		76,752,460	91,341,348
負債合計		76,752,460	91,341,348
純資産の部			
元本等			
元本		342,563,963,826	330,790,408,621
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		64,961,489,052	55,099,794,378

元本等合計		407,525,452,878	385,890,202,999
純資産合計		407,525,452,878	385,890,202,999
負債純資産合計		407,602,205,338	385,981,544,347

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月22日から平成24年2月21日までとなっております。

## （追加情報）

自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
*1 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	335,169,742,026円	350,943,197,818円
同期中追加設定元本額	26,368,335,015円	16,115,030,821円
同期中解約元本額	18,974,113,215円	36,267,820,018円
同中間期末における元本の内訳		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	3,239,929,928円	2,136,651,398円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C年金>	3,124,141,703円	3,763,460,403円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	278,788,162円	311,126,598円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	983,197,887円	1,115,467,258円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,061,152,898円	1,167,979,550円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	303,836,700円	334,727,857円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	590,203,139円	655,530,912円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	391,882,652円	425,373,509円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	190,461,272円	174,664,812円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,581,158,635円	1,720,730,259円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,787,842円	8,133,387円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	11,347,227,687円	7,158,753,911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）	4,070,136,570円	7,575,104,805円
D I A M外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	7,952,206,865円	7,653,178,768円
D I A M外国債券パッシブファンド2（適格機関投資家向け）	1,972,436,541円	円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	948,875,990円	947,377,584円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	264,855,892円	254,088,055円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	51,635,227,588円	48,915,903,553円



D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A（適格機関投資 家限定）	2,788,726,561円	2,780,524,995円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A（適格機関投資家 限定）	483,899,206円	465,783,995円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A（適格機関投資家 限定）	750,697,465円	767,807,197円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A（適格機関投資家 限定）	218,019,751円	205,324,302円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A（適格機関投資家 限定）	96,368,282円	92,147,295円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限 定）	29,268,757,018円	28,581,284,283円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限 定）	6,365,625,643円	6,333,061,297円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	12,034,361,664円	11,536,663,946円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限 定）	5,628,443,836円	5,345,023,349円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	8,021,503,220円	7,732,364,933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）	2,917,908,274円	2,914,272,664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）	8,874,164,349円	8,777,730,689円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A（適格 機関投資家限定）	10,496,815,583円	10,204,642,037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）	51,735,505,129円	50,335,193,411円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	261,397,379円	270,088,311円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	528,817,558円	円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A（適格機関投資家限 定）	6,900,779,770円	6,962,841,437円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A（適格機 関投資家限定）	16,039,499,664円	15,584,241,743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）	284,501,018円	288,588,800円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	26,669,501,419円	26,167,684,917円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	32,572,939,824円	31,776,594,200円
D I A Mバランス30 V A（適格機関投資家限定）	823,490,024円	819,327,020円
D I A Mバランス50 V A（適格機関投資家限定）	219,455円	236,020円
D I A Mバランス70 V A（適格機関投資家限定）	133,516円	146,642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）	28,188,589,116円	27,687,993,965円
D I A M世界バランス25 V A（適格機関投資家限定）	183,607,629円	222,916,979円
D I A Mバランス20 V A（適格機関投資家限定）	491,852,036円	619,316,473円
D I A Mバランス40 V A（適格機関投資家限定）	208,027円	220,318円
D I A Mバランス60 V A（適格機関投資家限定）	123,459円	134,784円
（合計）	342,563,963,826円	330,790,408,621円
*2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	342,563,963,826口	330,790,408,621口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

（通貨関連）

平成22年7月12日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	118,985,140	-	118,985,000	140
	ユーロ				
合 計		118,985,140	-	118,985,000	140

平成23年7月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	ユーロ	32,513,314	-	32,512,320	994
	買建				
	米ドル	39,922,228	-	39,613,880	308,348
合 計		72,435,542	-	72,126,200	307,354

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1896円	1.1666円
(1万口当たり純資産額)	(11,896円)	(11,666円)

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		218,526,931	5,780,881
投資証券		2,855,263,850	3,402,711,550
未収入金		-	491,480,300
未収配当金		38,556,968	42,462,525
流動資産合計		3,112,347,749	3,942,435,256
資産合計		3,112,347,749	3,942,435,256
負債の部			
流動負債			
未払金		216,781,635	-
未払解約金		54,000	724,000
流動負債合計		216,835,635	724,000

負債合計		216,835,635	724,000
純資産の部			
元本等			
元本		4,296,342,475	4,862,993,462
剰余金			
剰余金又は欠損金( )	*3	1,400,830,361	921,282,206
元本等合計		2,895,512,114	3,941,711,256
純資産合計		2,895,512,114	3,941,711,256
負債純資産合計		3,112,347,749	3,942,435,256

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。	投資証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年6月8日から平成23年6月6日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年6月7日から平成24年6月6日までとなっております。

## （追加情報）

自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
*1 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	5,226,243,410円	4,718,941,254円
同期中追加設定元本額	650,620,627円	2,530,153,832円
同期中解約元本額	1,580,521,562円	2,386,101,624円
同中間期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	78,297,796円	47,535,760円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	649,896,679円	467,372,513円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	968,147円	2,930,331円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家向け）	1,666,475,470円	3,596,462,508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）	456,035,007円	330,392,888円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	925,308,014円	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）	519,361,362円	418,299,462円
（合計）	4,296,342,475円	4,862,993,462円
*2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	4,296,342,475口	4,862,993,462口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,400,830,361円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は921,282,206円であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.6739円	0.8106円
（1万口当たり純資産額）	（6,739円）	（8,106円）



## 「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		25,045,894	34,104,085
コール・ローン		41,374,599	3,758,448
株式		960,497	-
投資信託受益証券		810,651,756	513,034,328
投資証券		3,681,089,514	2,881,700,411
派生商品評価勘定		-	743,550
未収入金		-	99,084,953
未収配当金		22,080,472	15,864,514
流動資産合計		4,581,202,732	3,548,290,289
資産合計		4,581,202,732	3,548,290,289
負債の部			
流動負債			
未払解約金		38,000	302,000
流動負債合計		38,000	302,000
負債合計		38,000	302,000
純資産の部			
元本等			
元本		6,718,377,541	4,235,909,690
剰余金			
剰余金又は欠損金( )	*3	2,137,212,809	687,921,401
元本等合計		4,581,164,732	3,547,988,289
純資産合計		4,581,164,732	3,547,988,289
負債純資産合計		4,581,202,732	3,548,290,289

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資信託受益証券及び投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成21年11月7日から平成22年11月8日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左  (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年11月9日から平成23年11月7日までとなっております。

## （追加情報）

自平成22年1月13日 至平成22年7月12日	自平成23年1月12日 至平成23年7月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
*1 本半期報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	10,398,034,421円	5,089,591,953円
同期中追加設定元本額	47,138,751円	34,455,204円
同期中解約元本額	3,726,795,631円	888,137,467円
同中間期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	62,615,131円	49,830,735円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	520,534,078円	490,146,323円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	16,311,717円	38,795,994円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	5,879,689,567円	3,460,960,935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）	239,227,048円	196,175,703円
（合計）	6,718,377,541円	4,235,909,690円
*2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	6,718,377,541口	4,235,909,690口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,137,212,809円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は687,921,401円であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

（平成22年7月12日現在）

該当事項はありません。

（通貨関連）

平成23年7月11日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	オーストラリアドル	18,109,770	-	18,108,300	1,470
	ユーロ	9,335,280	-	9,158,400	176,880
	米ドル	73,177,200	-	72,612,000	565,200
合計		100,622,250	-	99,878,700	743,550

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成22年7月12日現在	平成23年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.6819円	0.8376円
（1万口当たり純資産額）	（6,819円）	（8,376円）

## 2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

## 【純資産額計算書】

平成23年7月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	7,720,332,655円
負債総額	10,315,689円
純資産総額（ - ）	7,710,016,966円
発行済数量	10,918,180,898口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7062円

## （参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年7月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	258,418,238,682円
負債総額	669,019,397円
純資産総額（ - ）	257,749,219,285円
発行済数量	232,222,392,144口

1口当たり純資産額（ / ）	1.1099円
----------------	---------

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	272,626,599,293円
負債総額	93,683,762円
純資産総額（ - ）	272,532,915,531円
発行済数量	213,142,019,281口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2786円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	434,132,113,861円
負債総額	6,088,944,000円
純資産総額（ - ）	428,043,169,861円
発行済数量	379,620,412,959口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1276円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	384,377,845,399円
負債総額	4,686,674,203円
純資産総額（ - ）	379,691,171,196円
発行済数量	333,791,596,521口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1375円

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	4,027,726,889円
負債総額	303,608,220円
純資産総額（ - ）	3,724,118,669円
発行済数量	4,665,292,946口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7983円

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年7月29日現在

項目	金額又は口数
資産総額	3,236,911,490円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	3,236,911,490円
発行済数量	4,098,069,508口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7899円





## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

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

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

本書提出日現在の資本金の額 20億円

発行する株式総数 80,000株

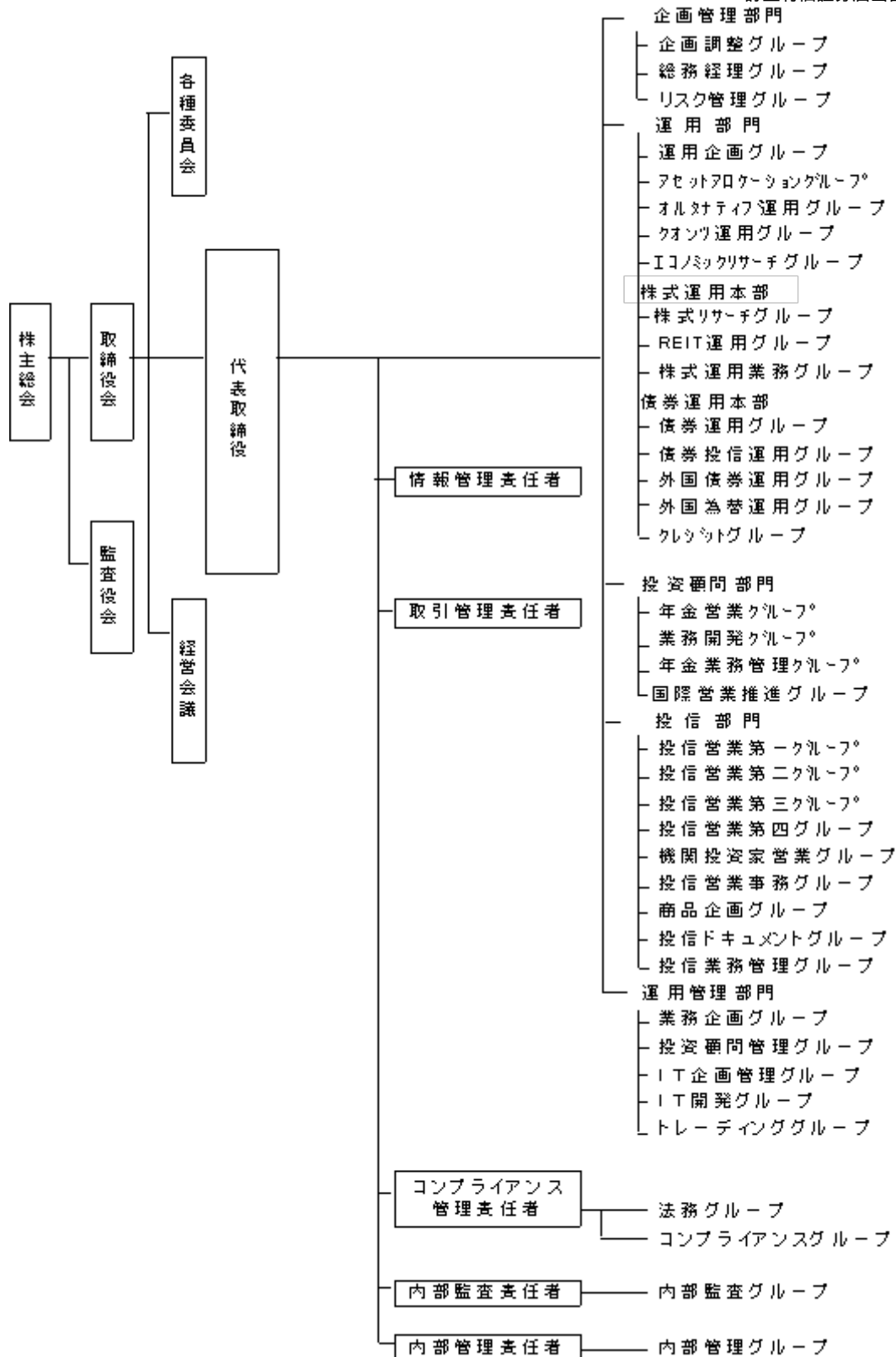
発行済株式総数 24,000株

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成23年7月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 会社の意思決定機構

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

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

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

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

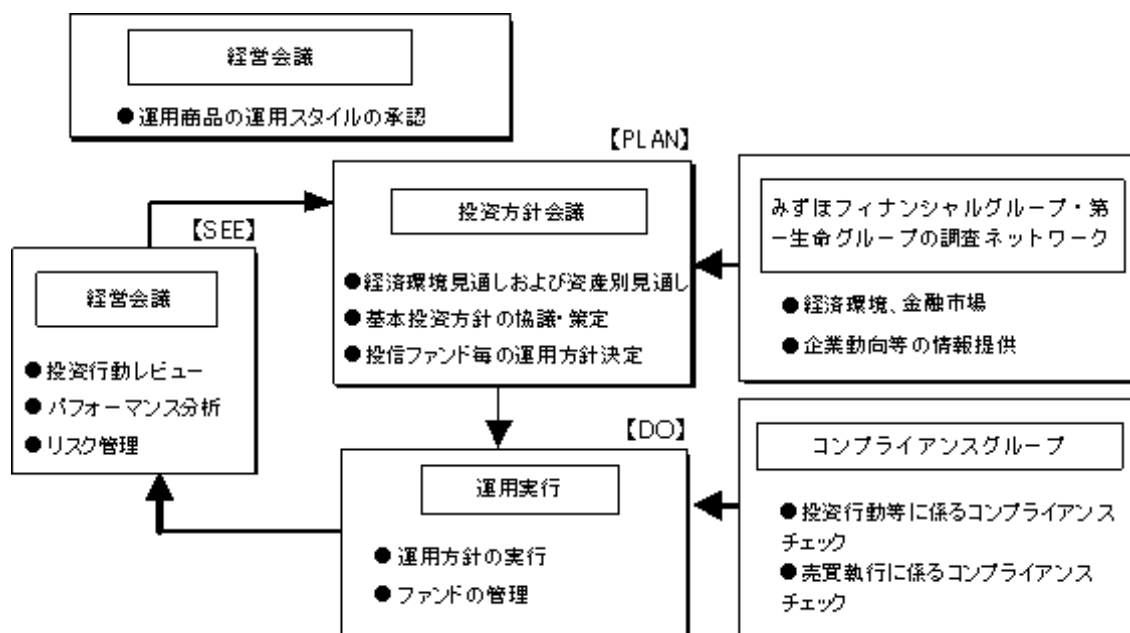
## 投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成23年7月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

平成23年7月29日現在、委託会社の運用する投資信託は279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	17	36,876,260,230
追加型株式投資信託	249	4,228,008,856,031
単位型公社債投資信託	12	85,812,452,297
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	301,282,886
合計	279	4,350,998,851,444

### 3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

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



（単位：千円）

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

次へ



## 重要な会計方針

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

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

## 追加情報

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

## 注記事項

(貸借対照表関係)

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

(損益計算書関係)

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

## （株主資本等変動計算書関係）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(リース取引関係)

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



（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## (4) 長期差入保証金

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

負債

## (1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

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

## (注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

負債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

## （注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

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

（有価証券関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 4. その他有価証券

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

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 4. その他有価証券

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

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

（金銭の信託関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. 運用目的の金銭の信託

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

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。



## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 運用目的の金銭の信託

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

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (2) 株式関連

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

（注2）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 不動産投資信託関連

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

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

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

## 3. 退職給付費用に関する事項

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

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

## 3. 退職給付費用に関する事項

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

## (セグメント情報等)

## 1. セグメント情報

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

## 2. 関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (追加情報)

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

( 関連当事者との取引 )

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

## (1)親会社及び法人主要株主等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

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

## (2)子会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払手 数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払手 数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	401,000	金銭の 信託	399,833
信託報酬の 支払								130			

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。



## 第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1)親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産運 用の助 言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,392	未収投資 助言報酬	190,149

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	646,432	未払 費用	172,736
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	224,694	未払 費用	88,837
	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接100%	-	なし	増資の引 受	300,000	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,538,792	未払手 数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	536,163	未払手 数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収 収益	-
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	198,967	未払 費用	94,085
								業務委託料 の支払	17,740	未払 費用	21,598
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
信託報酬の 支払								3,163			

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## （1株当たり情報）

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

（注）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## （重要な後発事象）

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

<更新・訂正後>

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

平成23年3月末日現在 247,303百万円

##### c. 事業の内容

日本において信託銀行業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

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

(平成23年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	7,425	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

#### (3) 投資顧問会社

##### a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

##### b. 資本金の額

平成23年5月末日現在 5,425万円

##### c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

#### (4) 投資顧問会社

##### a. 名称

DIAM International Ltd

##### b. 資本金の額

平成22年12月末日現在 400万ポンド

##### c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

独立監査人の中間監査報告書

平成23年8月23日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成23年1月12日から平成23年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成23年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年1月12日から平成23年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

中間財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成23年6月10日

D I A Mアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成22年8月24日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成22年1月13日から平成22年7月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成22年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年1月13日から平成22年7月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

中間財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(前期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

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

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

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

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

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

以上

---

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