

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成26年10月14日
<b>【発行者名】</b>	D I A Mアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 西 惠正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	上野 圭子
<b>【電話番号】</b>	03-3287-3110
<b>【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券に係る ファンドの名称】</b>	マネックス資産設計ファンド<育成型>
<b>【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】</b>	3,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

半期報告書の提出に伴い、平成26年4月14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】

<訂正前>

(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)そのものに連動する投資成果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。また、上記マザーファンドには運用管理費用(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%以下にしております\*。

※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、市況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。

\*2013年12月末時点

**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。運用管理費用（信託報酬）は信託財産の純資産総額に対して年率1.026%（税抜0.95%）と、低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。**

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）

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
--------	------	--------	------	-------	----------

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル (日本を含む)  日本			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225      TOPIX
不動産投信  その他資産 (投資信託証 券(資産複合 (株式、債 券、不動産投 信、)資産配 分変更型))	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)  エマージング	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	その他 (MSCIコク サイ・インデッ クス、NOMU RA-BPI総 合、シティグ ループ世界国債 インデックス、 東証REIT指 数、S&P先進 国REITイン デックス)
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(略)

< 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)そのものに連動する投資成果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。また、上記マザーファンドには運用管理費用(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%以下にしております\*。

※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、市況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。

\*2014年7月末時点

**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。運用管理費用（信託報酬）は信託財産の純資産総額に対して年率1.026%（税抜0.95%）と、低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。**

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）

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
--------	------	--------	------	-------	----------



株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル (日本を含む)  日本			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225     TOPIX
不動産投信  その他資産 (投資信託証 券(資産複合 (株式、債 券、不動産投 信、)資産配 分変更型))  資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)  エマージング	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	その他 (MSCIコク サイ・インデッ クス、NOMU RA-BPI総 合、シティ世界 国債インデック ス、東証REI T指数、S&P 先進国REIT インデックス)

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(略)

### (3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

#### 委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

## 資本金の額

20億円（平成26年1月31日現在）

## 委託会社の沿革

- 昭和60年 7月 1日 会社設立
- 平成10年 3月31日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
- 平成10年12月 1日 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
- 平成11年10月 1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
- 平成20年 1月 1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

## 大株主の状況

（平成26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	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

&lt;訂正後&gt;

（略）

## 委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

## 資本金の額

20億円（平成26年7月31日現在）

## 委託会社の沿革

- 昭和60年 7月 1日 会社設立
- 平成10年 3月31日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
- 平成10年12月 1日 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
- 平成11年10月 1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
- 平成20年 1月 1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

## 大株主の状況

（平成26年7月31日現在）

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

## 2【投資方針】

## (2)【投資対象】

&lt;訂正前&gt;

(略)

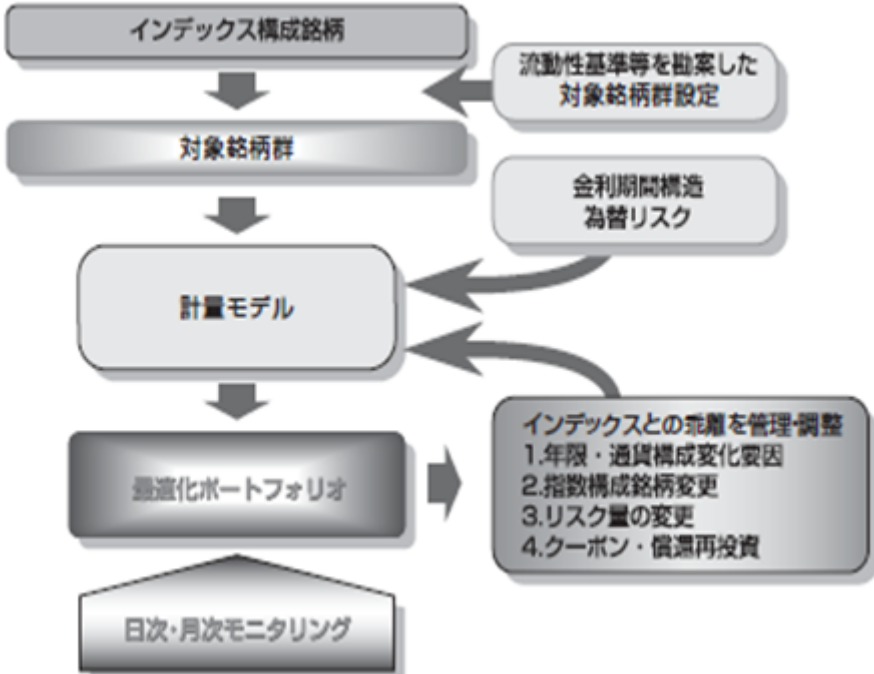
(参考)当ファンドが投資するマザーファンドの概要

(略)

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<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <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>
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	<p>1. 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。</p> <p>2. 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。</p> <p>3. 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。</p>
運用プロセス	<p>1)流動性基準等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。</p> <p>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。</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>・ 年限構成変化要因</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します。</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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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>

<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・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>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>1. 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）<sup>(注)</sup>」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="341 1563 1374 1850" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <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>2. 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>3. 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>

運用プロセス	<p>1)流動性基準等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> 
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せん。</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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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)

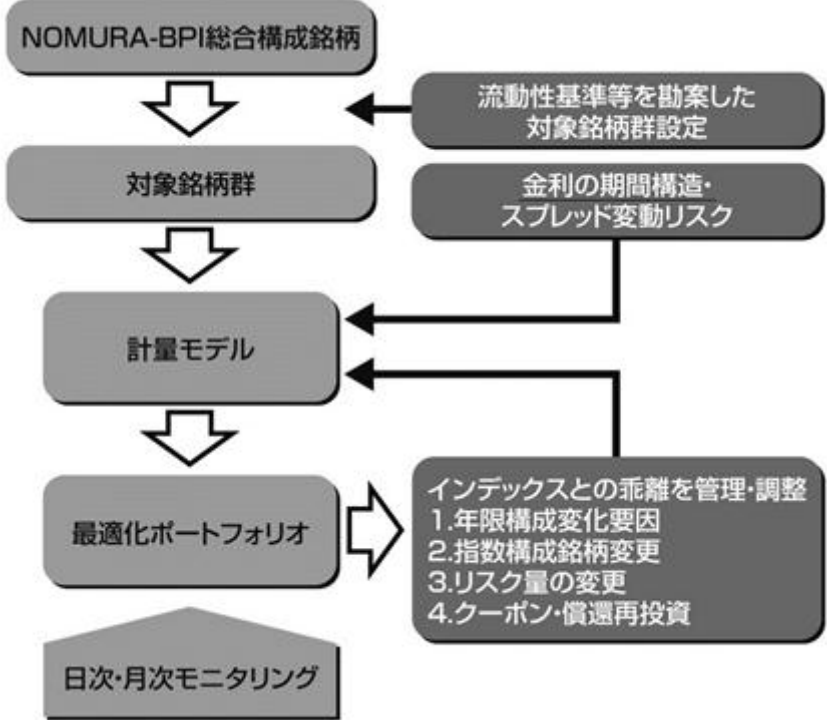
&lt; 訂正後 &gt;

(略)

(参考)当ファンドが投資するマザーファンドの概要

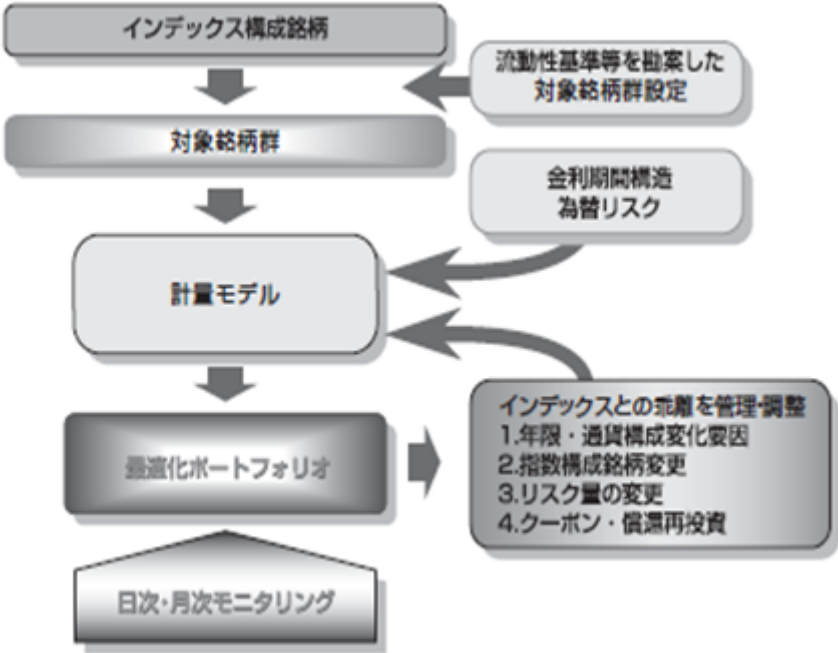
(略)

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<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <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>
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	<p>1. 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。</p> <p>2. 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。</p> <p>3. 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。</p>
運用プロセス	<p>1)流動性基準等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。</p> <p>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。</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。 ・ 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</p>

	
<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します。</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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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>

<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・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>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ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）<sup>（注）</sup>」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;"> <p>（注）シティ世界国債インデックスは、シティグループ・インデックスLLC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>シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。</p> </div> <p>2. 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>3. 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>



運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定 シティ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>・ クーボン・償還再投資</li> </ul> 
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せん。</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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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 >

（ 略 ）

上記運用体制は、平成26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。

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

上記運用体制は、平成26年7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。

（ 略 ）

### 3 【投資リスク】

< 訂正前 >

（ 略 ）

上記体制は平成26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 >

（ 略 ）

上記体制は平成26年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 4 【手数料等及び税金】

#### （ 5 ） 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

（ 略 ）

上記は、平成26年1月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

上記は、平成26年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

（ 略 ）

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	9,343,346,850	98.88
内 日本	9,343,346,850	98.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	105,935,895	1.12
純資産総額	9,449,282,745	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	318,017,234,770	98.32
内 日本	318,017,234,770	98.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,424,990,765	1.68
純資産総額	323,442,225,535	100.00

その他資産の投資状況

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	4,833,950,000	1.49
内 日本	4,833,950,000	1.49

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	352,580,850,300	80.54
内 日本	352,580,850,300	80.54
地方債証券	29,119,325,303	6.65
内 日本	29,119,325,303	6.65
特殊債券	29,183,278,916	6.67
内 日本	29,183,278,916	6.67
社債券	24,912,920,260	5.69
内 日本	24,501,728,260	5.60
内 アメリカ	411,192,000	0.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,952,929,783	0.45
純資産総額	437,749,304,562	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	32,923,290,620	98.99
内 日本	32,923,290,620	98.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	335,408,217	1.01
純資産総額	33,258,698,837	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	297,168,032,745	95.87
内 アメリカ	169,843,449,223	54.79
内 イギリス	27,247,317,778	8.79
内 カナダ	14,442,142,083	4.66
内 スイス	12,869,230,153	4.15
内 フランス	12,037,132,290	3.88
内 ドイツ	11,929,452,430	3.85
内 オーストラリア	10,005,781,051	3.23
内 スペイン	4,920,022,777	1.59
内 オランダ	4,876,573,951	1.57
内 スウェーデン	3,985,775,152	1.29
内 香港	3,423,044,940	1.10
内 アイルランド	3,285,432,228	1.06
内 イタリア	3,217,749,899	1.04
内 ジャージー	2,049,403,140	0.66
内 デンマーク	2,023,948,871	0.65
内 シンガポール	2,014,071,425	0.65
内 ベルギー	1,587,870,085	0.51
内 オランダ領キュラソー	1,414,846,052	0.46
内 フィンランド	1,170,797,025	0.38
内 パミュダ	1,004,253,790	0.32
内 ノルウェー	944,350,407	0.30
内 イスラエル	715,706,014	0.23
内 ルクセンブルグ	532,428,954	0.17
内 ケイマン諸島	364,924,287	0.12
内 オーストリア	286,830,749	0.09
内 ポルトガル	254,481,787	0.08
内 イギリス領バージン諸島	162,544,829	0.05
内 ニュージーランド	155,545,538	0.05
内 パナマ	142,725,759	0.05
内 リベリア	103,770,178	0.03
内 ガーンジー	71,071,657	0.02
内 マン島	64,224,332	0.02
内 モーリシャス	21,133,911	0.01
投資信託受益証券	921,313,576	0.30
内 オーストラリア	786,734,098	0.25
内 シンガポール	134,579,478	0.04
投資証券	5,843,150,282	1.89
内 アメリカ	4,795,744,784	1.55
内 イギリス	413,453,666	0.13
内 フランス	390,366,645	0.13
内 香港	139,465,709	0.04
内 カナダ	61,951,314	0.02
内 オランダ	42,168,164	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,034,358,536	1.95

純資産総額	309,966,855,139	100.00
-------	-----------------	--------

## その他資産の投資状況

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	183,063,000	0.06
-	183,063,000	0.06
株価指数先物取引(買建)	6,009,016,349	1.94
内 アメリカ	3,739,044,897	1.21
内 ドイツ	1,180,174,320	0.38
内 イギリス	562,006,080	0.18
内 カナダ	287,022,260	0.09
内 オーストラリア	240,768,792	0.08

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

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

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

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	362,221,898,155	97.70
内 アメリカ	137,761,868,755	37.16
内 フランス	39,059,012,443	10.54
内 イタリア	38,773,906,930	10.46
内 ドイツ	31,823,108,124	8.58
内 イギリス	29,201,613,858	7.88
内 スペイン	20,976,902,782	5.66
内 オランダ	10,390,280,397	2.80
内 ベルギー	10,330,483,873	2.79
内 カナダ	8,275,067,407	2.23
内 オーストリア	6,543,078,853	1.76
内 オーストラリア	6,159,782,305	1.66
内 メキシコ	3,956,336,799	1.07
内 アイルランド	3,063,374,612	0.83
内 デンマーク	2,886,190,430	0.78
内 フィンランド	2,525,609,561	0.68
内 ポーランド	2,464,651,491	0.66
内 スウェーデン	2,000,586,966	0.54
内 マレーシア	1,983,616,749	0.54
内 南アフリカ	1,784,428,982	0.48
内 シンガポール	1,309,078,081	0.35
内 ノルウェー	952,918,757	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,521,015,704	2.30
純資産総額	370,742,913,859	100.00

## その他資産の投資状況

平成26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	388,492,830	0.10
-	388,492,830	0.10

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 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26年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	385,866,627	12.64
内 オーストラリア	286,012,819	9.37
内 シンガポール	99,853,808	3.27
投資証券	2,581,780,163	84.56
内 アメリカ	2,010,466,835	65.85
内 イギリス	203,059,257	6.65
内 フランス	146,319,389	4.79
内 カナダ	77,445,230	2.54
内 香港	57,594,453	1.89
内 オランダ	41,885,269	1.37
内 ベルギー	25,374,243	0.83
内 ニュージーランド	12,038,147	0.39
内 シンガポール	7,597,340	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	85,467,686	2.80
純資産総額	3,053,114,476	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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



## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成26年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,067,938,655	1.1899 2,460,831,887	1.2028 2,487,316,614	- -	26.32%
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,323,797,253	1.7627 2,333,544,482	1.8156 2,403,486,292	- -	25.44%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	846,420,134	2.2837 1,933,019,907	2.4505 2,074,152,538	- -	21.95%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	534,513,844	1.6357 874,325,517	1.6904 903,542,201	- -	9.56%
5	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	531,735,390	1.3218 702,855,312	1.4755 784,575,567	- -	8.30%
6	グローバルリート・パッシ ブ・ファンド・マザーファ ンド 日本	親投資信託 受益証券	488,447,239	1.2178 594,864,891	1.4132 690,273,638	- -	7.31%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.88%
合計	98.88%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,377,800	5,889.96 14,005,152,500	6,137.00 14,592,558,600	- -	4.51%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	12,886,200	601.09 7,745,790,382	615.60 7,932,744,720	- -	2.45%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	835,300	7,390.46 6,173,256,844	7,572.00 6,324,891,600	- -	1.96%
4	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,551,100	3,674.33 5,699,263,857	3,654.00 5,667,719,400	- -	1.75%
5	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,286,500	4,745.66 6,105,302,807	4,260.00 5,480,490,000	- -	1.69%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	668,400	5,508.47 3,681,864,828	6,860.00 4,585,224,000	- -	1.42%
7	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	22,079,100	213.55 4,715,083,524	201.50 4,448,938,650	- -	1.38%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,070,300	3,190.09 3,414,362,718	3,652.00 3,908,735,600	- -	1.21%
9	ファナック 日本	株式 電気機器	192,300	16,408.23 3,155,304,469	17,990.00 3,459,477,000	- -	1.07%
10	キヤノン 日本	株式 電気機器	999,300	2,991.59 2,989,505,191	3,392.00 3,389,625,600	- -	1.05%
11	日立 日本	株式 電気機器	4,148,000	780.10 3,235,884,600	808.70 3,354,487,600	- -	1.04%
12	武田薬品 日本	株式 医薬品	676,200	4,668.72 3,156,988,954	4,727.00 3,196,397,400	- -	0.99%
13	KDDI 日本	株式 情報・通信業	528,000	5,691.30 3,005,006,720	5,997.00 3,166,416,000	- -	0.98%
14	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	711,600	3,851.07 2,740,425,159	4,330.50 3,081,583,800	- -	0.95%
15	三井不動産 日本	株式 不動産業	893,000	3,258.72 2,910,041,175	3,444.50 3,075,938,500	- -	0.95%
16	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,191,000	2,567.28 3,057,631,020	2,547.50 3,034,072,500	- -	0.94%
17	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	2,056,100	1,235.97 2,541,281,111	1,415.00 2,909,381,500	- -	0.90%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,327,500	1,954.88 2,595,113,524	2,186.00 2,901,915,000	- -	0.90%
19	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	317,100	7,586.98 2,405,832,146	8,322.00 2,638,906,200	- -	0.82%
20	三井物産 日本	株式 卸売業	1,538,400	1,492.64 2,296,278,100	1,666.00 2,562,974,400	- -	0.79%
21	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,401,500	1,608.47 2,254,283,141	1,824.00 2,556,336,000	- -	0.79%
22	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,969,200	1,191.75 2,346,807,667	1,257.50 2,476,269,000	- -	0.77%

23	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,419,500	883.96 2,138,743,946	1,022.00 2,472,729,000	- -	0.76%
24	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	7,629,000	303.00 2,311,650,860	314.10 2,396,268,900	- -	0.74%
25	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,724,000	1,189.87 2,051,351,510	1,376.00 2,372,224,000	- -	0.73%
26	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	3,477,700	691.35 2,404,313,389	660.30 2,296,325,310	- -	0.71%
27	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	154,300	10,965.22 1,691,934,030	14,750.00 2,275,925,000	- -	0.70%
28	東京海上HD 日本	株式 保険業	658,800	2,998.00 1,975,087,680	3,272.00 2,155,593,600	- -	0.67%
29	信越化学 日本	株式 化学	323,700	5,707.58 1,847,544,830	6,580.00 2,129,946,000	- -	0.66%
30	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	565,700	3,597.58 2,035,154,610	3,742.00 2,116,849,400	- -	0.65%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
株式	98.32%
合計	98.32%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成26年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.57%
輸送用機器		11.32%
銀行業		8.90%
情報・通信業		7.06%
化学		5.51%
機械		5.26%
卸売業		4.57%
医薬品		4.44%
小売業		4.09%
食料品		3.98%
陸運業		3.96%
不動産業		3.28%
建設業		2.71%
サービス業		2.57%
保険業		2.14%
電気・ガス業		2.01%
鉄鋼		1.64%
証券、商品先物取引業		1.47%
精密機器		1.38%
その他製品		1.38%
その他金融業		1.32%
非鉄金属		1.06%
ガラス・土石製品		1.01%
ゴム製品		0.88%
繊維製品		0.69%
金属製品		0.65%
石油・石炭製品		0.58%
空運業		0.53%
鉱業		0.51%
海運業		0.33%
パルプ・紙		0.25%
倉庫・運輸関連業	0.22%	
水産・農林業	0.07%	
合計	98.32%	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	1 1 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	6,000,000,000	100.10 6,006,270,000	100.27 6,016,500,000	0.200000 2019/3/20	1.37%
2	3 3 0 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,700,000,000	102.12 5,820,971,000	102.93 5,867,181,000	0.800000 2023/9/20	1.34%
3	3 3 2 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.13 5,507,615,000	100.98 5,554,230,000	0.600000 2023/12/20	1.27%
4	1 1 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.09 5,505,495,000	100.30 5,516,720,000	0.200000 2018/12/20	1.26%
5	3 3 3 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.11 5,005,610,000	100.82 5,041,250,000	0.600000 2024/3/20	1.15%
6	1 0 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.26 5,013,350,000	100.34 5,017,150,000	0.200000 2017/9/20	1.15%
7	3 1 3 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,600,000,000	106.60 4,903,946,000	106.98 4,921,172,000	1.300000 2021/3/20	1.12%
8	3 2 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,700,000,000	102.64 4,824,504,000	103.35 4,857,544,000	0.800000 2022/9/20	1.11%
9	1 1 4 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.58 4,526,410,000	100.73 4,533,255,000	0.300000 2018/9/20	1.04%
10	1 0 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.59 4,526,955,000	100.57 4,525,920,000	0.300000 2017/3/20	1.03%
11	1 0 5 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.28 4,512,690,000	100.33 4,514,850,000	0.200000 2017/6/20	1.03%
12	1 0 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.25 4,310,856,000	100.37 4,315,910,000	0.200000 2017/12/20	0.99%
13	3 0 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.20 4,248,344,000	106.07 4,243,120,000	1.300000 2019/12/20	0.97%
14	2 9 6 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.10 4,244,000,000	105.69 4,227,640,000	1.500000 2018/9/20	0.97%
15	2 9 7 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	105.87 4,234,920,000	105.55 4,222,040,000	1.400000 2018/12/20	0.96%
16	2 8 9 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	105.22 4,103,892,000	104.78 4,086,537,000	1.500000 2017/12/20	0.93%
17	9 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.74 4,029,800,000	100.61 4,024,720,000	0.400000 2016/6/20	0.92%
18	9 2 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.36 4,014,560,000	100.28 4,011,280,000	0.300000 2015/9/20	0.92%

19	3 2 1 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	104.37 3,652,950,000	104.98 3,674,405,000	1.000000 2022/3/20	0.84%
20	3 0 1 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	106.97 3,637,116,000	106.56 3,623,074,000	1.500000 2019/6/20	0.83%
21	1 1 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.60 3,521,070,000	100.73 3,525,655,000	0.300000 2018/6/20	0.81%
22	9 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.78 3,527,580,000	100.61 3,521,420,000	0.500000 2015/12/20	0.80%
23	1 0 2 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.58 3,520,305,000	100.53 3,518,690,000	0.300000 2016/12/20	0.80%
24	2 8 2 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	104.16 3,541,678,000	103.46 3,517,776,000	1.700000 2016/9/20	0.80%
25	2 9 3 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	107.08 3,426,624,000	106.54 3,409,408,000	1.800000 2018/6/20	0.78%
26	3 2 9 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	102.31 3,376,230,000	103.03 3,400,023,000	0.800000 2023/6/20	0.78%
27	3 1 2 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	105.95 3,390,624,000	106.23 3,399,360,000	1.200000 2020/12/20	0.78%
28	2 9 9 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	105.66 3,275,677,000	105.33 3,265,230,000	1.300000 2019/3/20	0.75%
29	2 8 6 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	105.61 3,274,034,000	104.92 3,252,551,000	1.800000 2017/6/20	0.74%
30	3 0 6 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	107.01 3,210,510,000	106.85 3,205,560,000	1.400000 2020/3/20	0.73%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	80.54%
地方債証券	6.65%
特殊債券	6.67%
社債券	5.69%
合計	99.55%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	5,397	587,754.41 3,172,110,593	580,000.00 3,130,260,000	- -	9.41%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	4,783	577,758.81 2,763,420,432	582,000.00 2,783,706,000	- -	8.37%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	8,822	221,611.33 1,955,055,198	227,600.00 2,007,887,200	- -	6.04%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	9,602	162,177.90 1,557,232,268	165,900.00 1,592,971,800	- -	4.79%
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,977	230,083.87 1,375,211,315	240,300.00 1,436,273,100	- -	4.32%
6	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	4,969	247,115.83 1,227,918,577	245,500.00 1,219,889,500	- -	3.67%
7	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	3,153	358,355.47 1,129,894,819	357,500.00 1,127,197,500	- -	3.39%
8	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,896	553,461.31 1,049,362,645	567,000.00 1,075,032,000	- -	3.23%
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	7,515	135,827.98 1,020,747,285	141,800.00 1,065,627,000	- -	3.20%
10	G L P 投資法人 日本	投資証券	8,018	110,556.33 886,440,683	114,800.00 920,466,400	- -	2.77%
11	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	5,045	164,290.78 828,847,028	176,500.00 890,442,500	- -	2.68%
12	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	960	856,801.58 822,529,520	918,000.00 881,280,000	- -	2.65%
13	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,670	499,493.83 834,154,711	519,000.00 866,730,000	- -	2.61%
14	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	5,293	137,539.27 727,995,362	151,100.00 799,772,300	- -	2.40%
15	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	6,365	118,440.93 753,876,579	124,900.00 794,988,500	- -	2.39%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,357	518,658.62 703,819,750	562,000.00 762,634,000	- -	2.29%
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	3,172	233,645.82 741,124,551	236,700.00 750,812,400	- -	2.26%
18	野村不動産オフィスファンド投資法人 日本	投資証券	1,424	466,295.25 664,004,438	488,500.00 695,624,000	- -	2.09%
19	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,764	366,988.40 647,367,540	393,500.00 694,134,000	- -	2.09%
20	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,429	442,010.87 631,633,534	484,000.00 691,636,000	- -	2.08%
21	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	4,635	136,593.89 633,112,694	138,300.00 641,020,500	- -	1.93%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	633	900,044.74 569,728,323	904,000.00 572,232,000	- -	1.72%
23	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	10,019	51,365.82 514,634,167	57,000.00 571,083,000	- -	1.72%

24	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	3,736	139,793.48 522,268,472	140,100.00 523,413,600	- -	1.57%
25	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	1,122	431,691.98 484,358,408	458,000.00 513,876,000	- -	1.55%
26	福岡リート投資法人 日本	投資証券	2,637	169,023.38 445,714,658	187,000.00 493,119,000	- -	1.48%
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,631	131,245.03 476,550,734	135,200.00 490,911,200	- -	1.48%
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,492	150,770.48 375,720,060	177,200.00 441,582,400	- -	1.33%
29	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	5,638	64,814.58 365,424,644	75,700.00 426,796,600	- -	1.28%
30	積水ハウス・S I レジデ投資法人 日本	投資証券	3,498	98,392.25 344,176,107	105,600.00 369,388,800	- -	1.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.99%
合計	98.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。



## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	598,883	7,992.76 4,786,733,407	10,092.67 6,044,328,787	- -	1.95%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	414,839	9,679.21 4,015,315,249	10,619.26 4,405,284,236	- -	1.42%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	757,300	3,869.21 2,930,158,034	4,482.20 3,394,372,331	- -	1.10%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	271,522	9,540.36 2,590,419,257	10,521.55 2,856,833,656	- -	0.92%
5	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	481,097	4,744.47 2,282,550,524	5,358.48 2,577,951,058	- -	0.83%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	962,324	2,647.35 2,547,617,102	2,637.07 2,537,719,599	- -	0.82%
7	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	182,973	11,671.41 2,135,554,365	13,630.71 2,494,051,992	- -	0.80%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	309,542	7,468.83 2,311,918,897	7,734.97 2,394,299,631	- -	0.77%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	364,200	5,980.72 2,178,180,955	6,058.89 2,206,649,012	- -	0.71%
10	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	397,874	4,840.52 1,925,919,011	5,323.51 2,118,088,604	- -	0.68%
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	260,260	8,166.28 2,125,358,635	8,038.75 2,092,166,636	- -	0.67%
12	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	67,415	29,784.74 2,007,938,921	30,203.77 2,036,187,491	- -	0.66%
13	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,807,266	1,110.11 2,006,282,131	1,116.20 2,017,288,381	- -	0.65%
14	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	220,606	8,369.17 1,846,290,220	9,099.63 2,007,434,630	- -	0.65%
15	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	94,874	18,892.51 1,792,408,610	19,952.89 1,893,011,434	- -	0.61%
16	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	500,342	3,409.47 1,705,904,791	3,739.62 1,871,091,952	- -	0.60%
17	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	611,961	3,285.02 2,010,309,631	3,009.39 1,841,629,925	- -	0.59%
18	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	282,267	5,702.00 1,609,487,563	5,973.52 1,686,129,827	- -	0.54%
19	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	475,279	2,546.05 1,210,084,930	3,532.89 1,679,111,990	- -	0.54%
20	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフト ウェア・サービス	27,558	61,721.53 1,700,922,024	60,416.14 1,664,948,179	- -	0.54%
21	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフト ウェア・サービス	26,937	61,954.83 1,668,877,448	61,241.00 1,649,648,924	- -	0.53%

22	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	1,016,192	1,717.59 1,745,406,298	1,602.40 1,628,349,109	- -	0.53%
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	376,859	3,694.01 1,392,124,683	4,145.54 1,562,287,826	- -	0.50%
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	380,237	4,003.95 1,522,450,126	4,074.91 1,549,434,215	- -	0.50%
25	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	291,694	5,093.13 1,485,636,045	5,142.50 1,500,036,395	- -	0.48%
26	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,768,685	846.33 1,496,901,791	838.15 1,482,437,481	- -	0.48%
27	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	345,398	3,910.62 1,350,722,978	4,212.73 1,455,070,588	- -	0.47%
28	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	160,092	8,148.80 1,304,558,570	8,969.54 1,435,952,958	- -	0.46%
29	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	148,770	8,352.44 1,242,593,763	9,646.30 1,435,080,274	- -	0.46%
30	SCHLUMBERGER LTD オランダ領キュラソー	株式 エネルギー設備・サー ビス	124,752	9,302.78 1,160,540,722	11,341.26 1,414,846,052	- -	0.46%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.87%
投資信託受益証券	0.30%
投資証券	1.89%
合計	98.05%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成26年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.64%
石油・ガス・消耗燃料		9.00%
医薬品		6.92%
保険		4.10%
メディア		2.95%
化学		2.84%
各種電気通信サービス		2.80%
コンピュータ・周辺機器		2.73%
ソフトウェア		2.60%
食品		2.48%
金属・鉱業		2.20%
情報技術サービス		2.13%
資本市場		2.08%
飲料		2.08%
食品・生活必需品小売り		2.06%
インターネットソフトウェア・サービス		2.03%
航空宇宙・防衛		1.95%
コングロマリット		1.89%
バイオテクノロジー		1.73%
ホテル・レストラン・レジャー		1.61%
半導体・半導体製造装置		1.61%
電力		1.58%
機械		1.50%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.50%
エネルギー設備・サービス		1.48%
専門小売り		1.46%
ヘルスケア機器・用品		1.45%
家庭用品		1.42%
タバコ		1.34%
各種金融サービス		1.30%
総合公益事業		1.30%
自動車		1.14%
繊維・アパレル・贅沢品		1.13%
通信機器		1.13%
陸運・鉄道		0.98%
電気設備		0.81%
インターネット販売・カタログ販売		0.81%
不動産管理・開発		0.61%
自動車部品		0.60%
航空貨物・物流サービス		0.56%
消費者金融		0.55%
複合小売り		0.53%
専門サービス		0.48%
無線通信サービス		0.46%
建設・土木		0.42%
商業サービス・用品		0.42%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.39%

電子装置・機器・部品	0.35%
建設資材	0.30%
商社・流通業	0.28%
家庭用耐久財	0.28%
パーソナル用品	0.25%
容器・包装	0.20%
建設関連製品	0.19%
運送インフラ	0.18%
ガス	0.16%
旅客航空輸送業	0.15%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11%
紙製品・林産品	0.10%
海運業	0.10%
レジャー用品	0.09%
水道	0.09%
販売	0.08%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.87%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 0.625 07/15/16 アメリカ	国債証券	3,908,300,000	100.32 3,920,962,892	100.13 3,913,615,288	0.625000 2016/7/15	1.06%
2	US T N/B 1.25 08/31/15 アメリカ	国債証券	3,085,500,000	101.55 3,133,448,670	101.18 3,122,001,465	1.250000 2015/8/31	0.84%
3	US T N/B 3.25 06/30/16 アメリカ	国債証券	2,571,250,000	106.51 2,738,869,787	105.22 2,705,520,675	3.250000 2016/6/30	0.73%
4	US T N/B 1.25 09/30/15 アメリカ	国債証券	2,365,550,000	101.62 2,403,990,187	101.24 2,394,930,131	1.250000 2015/9/30	0.65%
5	FRANCE OAT 3.25 04/25/16 フランス	国債証券	2,135,900,000	106.47 2,274,263,602	105.51 2,253,716,244	3.250000 2016/4/25	0.61%
6	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	2,057,000,000	107.29 2,207,078,720	105.98 2,180,173,160	3.250000 2016/12/31	0.59%
7	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	2,057,000,000	106.69 2,194,716,150	105.54 2,170,998,940	3.000000 2017/2/28	0.59%
8	ITALY BTPS 4.0 02/01/17 イタリア	国債証券	1,998,100,000	107.42 2,146,435,760	108.31 2,164,142,110	4.000000 2017/2/1	0.58%
9	US T N/B 3.0 09/30/16 アメリカ	国債証券	2,057,000,000	106.26 2,185,788,770	105.13 2,162,647,520	3.000000 2016/9/30	0.58%
10	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	2,108,425,000	102.96 2,171,003,054	102.27 2,156,433,837	1.750000 2016/5/31	0.58%
11	US T N/B 2.375 03/31/16 アメリカ	国債証券	2,057,000,000	104.18 2,143,044,310	103.27 2,124,325,610	2.375000 2016/3/31	0.57%
12	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16 ドイツ	国債証券	2,011,880,000	106.22 2,137,045,118	104.96 2,111,689,366	3.500000 2016/1/4	0.57%
13	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,832,740,000	109.52 2,007,216,848	112.32 2,058,533,568	4.500000 2018/2/1	0.56%
14	ITALY BTPS 3.75 08/01/16 イタリア	国債証券	1,929,200,000	106.01 2,045,144,920	106.40 2,052,688,092	3.750000 2016/8/1	0.55%
15	US T N/B 1.375 11/30/18 アメリカ	国債証券	2,057,000,000	99.48 2,046,385,880	99.01 2,036,738,550	1.375000 2018/11/30	0.55%
16	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,851,300,000	110.00 2,036,559,591	109.21 2,021,952,834	3.625000 2020/2/15	0.55%
17	FRANCE OAT 3.0 10/25/15 フランス	国債証券	1,929,200,000	104.67 2,019,293,640	103.64 1,999,480,756	3.000000 2015/10/25	0.54%
18	ITALY BTPS 4.5 03/01/19 イタリア	国債証券	1,722,500,000	111.15 1,914,641,430	114.89 1,978,980,250	4.500000 2019/3/1	0.53%
19	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	1,851,300,000	107.23 1,985,223,042	105.95 1,961,581,941	3.125000 2017/4/30	0.53%
20	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	1,777,620,000	110.32 1,961,194,817	109.89 1,953,515,499	3.750000 2017/4/25	0.53%
21	US T N/B 4.5 11/15/15 アメリカ	国債証券	1,851,300,000	107.33 1,987,037,316	105.49 1,953,047,448	4.500000 2015/11/15	0.53%
22	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,954,150,000	98.55 1,925,971,157	98.29 1,920,773,118	0.750000 2017/12/31	0.52%
23	US T N/B 2.0 04/30/16 アメリカ	国債証券	1,851,300,000	103.46 1,915,354,980	102.71 1,901,544,282	2.000000 2016/4/30	0.51%

24	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	1,748,450,000	110.72 1,935,918,809	108.69 1,900,477,727	4.875000 2016/8/15	0.51%
25	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,954,150,000	92.43 1,806,357,635	94.34 1,843,603,734	1.750000 2023/5/15	0.50%
26	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	1,851,300,000	99.26 1,837,736,142	99.02 1,833,212,799	0.625000 2017/5/31	0.49%
27	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	1,799,875,000	99.72 1,794,943,342	99.22 1,785,943,967	1.375000 2018/9/30	0.48%
28	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	1,419,340,000	118.37 1,680,172,111	125.63 1,783,244,582	4.250000 2023/10/25	0.48%
29	US T N/B 1.375 11/30/15 アメリカ	国債証券	1,748,450,000	101.92 1,782,107,662	101.49 1,774,606,812	1.375000 2015/11/30	0.48%
30	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,697,025,000	103.53 1,757,082,714	103.43 1,755,351,749	2.625000 2020/8/15	0.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.70%
合計	97.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

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

平成26年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	10,114	14,994.57 151,655,147	17,500.95 177,004,668	- -	5.80%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	3,010	26,574.72 79,989,937	28,166.31 84,780,623	- -	2.78%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	4,299	16,939.99 72,825,031	18,025.49 77,491,585	- -	2.54%
4	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	16,384	4,096.73 67,120,972	4,261.07 69,813,460	- -	2.29%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	10,110	5,396.10 54,554,669	6,828.21 69,033,218	- -	2.26%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	9,885	6,561.72 64,862,671	6,568.00 64,924,689	- -	2.13%
7	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	5,799	9,293.08 53,890,601	11,018.32 63,895,240	- -	2.09%
8	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	9,561	6,440.38 61,576,551	6,585.48 62,963,826	- -	2.06%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	5,028	10,494.92 52,768,487	12,442.79 62,562,363	- -	2.05%
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	3,948	12,740.80 50,300,709	15,528.29 61,305,700	- -	2.01%
11	HCP INC アメリカ	投資証券	13,752	4,183.79 57,535,571	4,312.50 59,305,506	- -	1.94%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	178,632	292.96 52,332,979	327.08 58,428,240	- -	1.91%
13	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	23,113	1,937.03 44,770,667	2,323.38 53,700,316	- -	1.76%
14	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	27,178	1,691.27 45,965,607	1,825.25 49,606,916	- -	1.62%
15	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託 受益証券	64,658	676.09 43,714,991	727.07 47,011,124	- -	1.54%
16	LINK REIT/THE 香港	投資証券	78,800	515.21 40,598,728	579.89 45,696,041	- -	1.50%
17	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	17,597	2,141.43 37,682,817	2,424.17 42,658,198	- -	1.40%
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	2,130	16,260.02 34,633,850	19,880.90 42,346,327	- -	1.39%
19	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	30,191	1,062.26 32,070,992	1,234.52 37,271,694	- -	1.22%
20	SL GREEN アメリカ	投資証券	2,845	9,641.15 27,429,097	11,248.70 32,002,564	- -	1.05%
21	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	7,030	4,263.13 29,969,821	4,467.80 31,408,662	- -	1.03%
22	STOCKLAND オーストラリア	投資信託 受益証券	79,817	387.80 30,953,709	392.31 31,313,230	- -	1.03%

23	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	4,530	6,052.72 27,418,832	6,799.41 30,801,343	- -	1.01%
24	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	2,424	10,979.43 26,614,142	12,685.51 30,749,698	- -	1.01%
25	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	13,022	2,196.87 28,607,719	2,354.23 30,656,867	- -	1.00%
26	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	27,200	906.54 24,657,888	1,050.09 28,562,448	- -	0.94%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	9,169	2,493.08 22,859,087	3,014.53 27,640,257	- -	0.91%
28	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	4,060	4,927.54 20,005,826	6,662.62 27,050,249	- -	0.89%
29	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	49,752	480.55 23,908,781	512.21 25,483,611	- -	0.83%
30	AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	18,129	1,377.83 24,978,682	1,361.73 24,686,875	- -	0.81%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	12.64%
投資証券	84.56%
合計	97.20%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先 物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2609月	買建	374	4,717,522,176	4,833,950,000	1.49%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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



## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2014年08月	買建	1,100,000	112,834,120	113,124,000	0.04%
		ユーロ買/円売201 4年08月	買建	300,000	41,170,150	41,337,000	0.01%
		オーストラリア・ドル 買/円売2014年0 8月	買建	200,000	19,177,300	19,176,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2014年08月	買建	100,000	9,426,900	9,426,000	0.00%
株価指数先 物取引	シカゴ商品 取引所	S & P 500 F U T U R E S e p 1 4	買建	74	3,709,076,978	3,739,044,897	1.21%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 S e p 1 4	買建	270	1,207,819,756	1,180,174,320	0.38%
	N Y S E L I F F E	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E S e p 1 4	買建	48	561,162,180	562,006,080	0.18%
	モン トリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T S e p 1 4	買建	17	274,888,424	287,022,260	0.09%
	シド ニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S S e p 1 4	買建	18	233,634,742	240,768,792	0.08%

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

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

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ売 / 円買 20 14年08月	売建	1,429,000	196,918,343	196,901,910	0.05%
		アメリカ・ドル売 / 円買 2014年08 月	売建	1,863,000	190,209,505	191,590,920	0.05%

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

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

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（平成26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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年1月11日)	7,975	7,975	0.9125	0.9125
第2計算期間末 (平成21年1月13日)	5,934	5,934	0.6383	0.6383
第3計算期間末 (平成22年1月12日)	7,473	7,473	0.7361	0.7361
第4計算期間末 (平成23年1月11日)	7,727	7,727	0.7224	0.7224
第5計算期間末 (平成24年1月11日)	7,492	7,492	0.6688	0.6688
第6計算期間末 (平成25年1月11日)	8,892	8,892	0.8003	0.8003
第7計算期間末 (平成26年1月14日)	9,193	9,193	0.9817	0.9817
平成25年7月末日	9,294	-	0.9013	-
8月末日	9,171	-	0.8889	-
9月末日	9,537	-	0.9309	-
10月末日	9,520	-	0.9461	-
11月末日	9,529	-	0.9730	-
12月末日	9,330	-	0.9972	-
平成26年1月末日	9,096	-	0.9676	-
2月末日	9,193	-	0.9779	-
3月末日	9,189	-	0.9801	-
4月末日	9,191	-	0.9791	-
5月末日	9,340	-	0.9941	-
6月末日	9,411	-	1.0132	-
7月末日	9,449	-	1.0254	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
平成26年1月15日～ 平成26年7月14日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	8.8
第2計算期間	30.0
第3計算期間	15.3
第4計算期間	1.9
第5計算期間	7.4
第6計算期間	19.7
第7計算期間	22.7
平成26年1月15日～ 平成26年7月14日	3.2

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

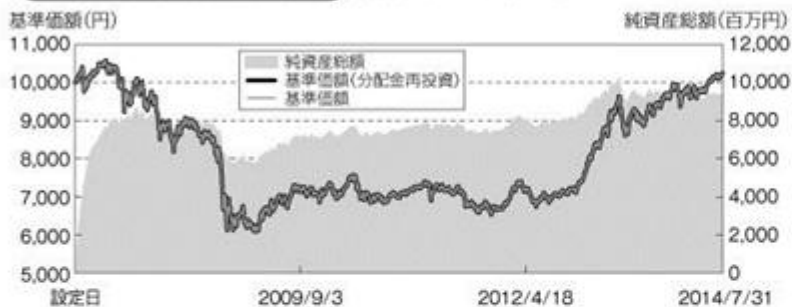
	設定口数	解約口数
第1計算期間	12,252,099,717	3,511,628,988
第2計算期間	2,271,286,181	1,714,151,191
第3計算期間	1,780,961,356	925,938,640
第4計算期間	1,561,559,539	1,016,414,248
第5計算期間	1,553,939,256	1,049,226,063
第6計算期間	1,341,335,454	1,433,126,499
第7計算期間	1,753,311,968	3,498,697,249
平成26年1月15日～ 平成26年7月14日	692,565,213	844,120,098

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2014年7月31日

## 基準価額・純資産の推移 (設定日(2007年1月26日)～2014年7月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日: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3期	(2010.01.12)	0円
第4期	(2011.01.11)	0円
第5期	(2012.01.11)	0円
第6期	(2013.01.11)	0円
第7期	(2014.01.14)	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	26.32%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	25.44%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	21.95%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	9.56%
5	J-REITインデックスファンド・マザー・ファンド	8.30%
6	グローバルリートパッシブ・ファンド・マザー・ファンド	7.31%

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.32
内 日本	98.32
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.68
純資産総額	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.49

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.51%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.45%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.96%
4	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.75%
5	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.69%

## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.57%
2	輸送用機器	11.32%
3	銀行業	8.90%
4	情報・通信業	7.06%
5	化学	5.51%

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.87
内 アメリカ	54.79
内 イギリス	8.79
内 カナダ	4.66
内 スイス	4.15
内 フランス	3.88
内 その他	19.60
投資信託受益証券	0.30
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.89
内 アメリカ	1.55
内 イギリス	0.13
内 フランス	0.13
内 香港	0.04
内 カナダ	0.02
内 オランダ	0.01
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.95
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	1.95%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.42%
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.10%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.92%
5	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.83%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.06
株価指数先物取引(買建)	1.94

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	9.64%
2	石油・ガス・消耗燃料	9.00%
3	医薬品	6.92%
4	保険	4.10%
5	メディア	2.95%

○掲載データ等はい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：2014年7月31日

## 主要な資産の状況

### ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	80.54
内 日本	80.54
地方債証券	6.65
内 日本	6.65
特殊債券	6.67
内 日本	6.67
社債券	5.69
内 日本	5.60
内 アメリカ	0.09
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.45
純資産総額	100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.37%
2	330回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2023/9/20	1.34%
3	332回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/12/20	1.27%
4	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.26%
5	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/3/20	1.15%

### ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.70
内 アメリカ	37.16
内 フランス	10.54
内 イタリア	10.46
内 ドイツ	8.58
内 イギリス	7.88
内 その他	23.08
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.30
純資産総額	100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 0.625 07/15/16	国債証券	アメリカ	0.625000	2016/7/15	1.06%
2	US T N/B 1.25 08/31/15	国債証券	アメリカ	1.250000	2015/8/31	0.84%
3	US T N/B 3.25 06/30/16	国債証券	アメリカ	3.250000	2016/6/30	0.73%
4	US T N/B 1.25 09/30/15	国債証券	アメリカ	1.250000	2015/9/30	0.65%
5	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	国債証券	フランス	3.250000	2016/4/25	0.61%

#### その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△0.10

### ■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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	98.99
内 日本	98.99
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.01
純資産総額	100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	9.41%
2	ジャパリアリアルエステイト投資法人	日本	8.37%
3	日本リートリアルファンド投資法人	日本	6.04%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.79%
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.32%

### ■グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

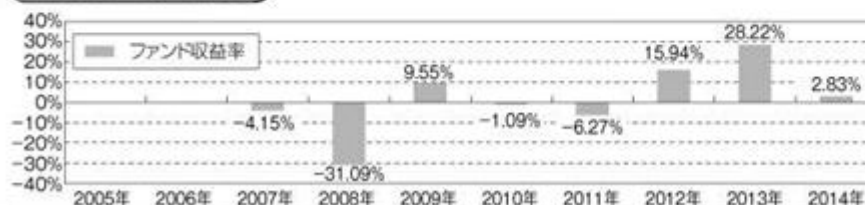
#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	12.64
内 オーストラリア	9.37
内 シンガポール	3.27
投資証券	84.56
内 アメリカ	65.85
内 イギリス	6.65
内 フランス	4.79
内 カナダ	2.54
内 香港	1.89
内 その他	2.84
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.80
純資産総額	100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	5.80%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.78%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.54%
4	PROLOGIS INC	アメリカ	2.29%
5	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.26%

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出してあります。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2007年は設定日から年末までの収益率、および2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 3【資産管理等の概要】

#### (5)【その他】

<訂正前>

(略)

#### ホ.運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（原則として毎年1月11日。休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

(URL <http://www.diam.co.jp/>)

<訂正後>

(略)

#### ホ.運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（原則として毎年1月11日。休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書（交付運用報告書を作成している場合は、交付運用報告書）を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

(URL <http://www.diam.co.jp/>)



### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

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

##### <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）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成26年1月15日から平成26年7月14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8期中間計算期間末 平成26年7月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		126,072,864
親投資信託受益証券		9,216,628,545
未収入金		8,340,000
流動資産合計		9,351,041,409
<b>資産合計</b>		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		18,333,824
未払受託者報酬		57,810
未払委託者報酬		726,741
その他未払費用		3,921
流動負債合計		19,122,296
<b>負債合計</b>		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1 9,213,755,708
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		118,163,405
（分配準備積立金）		1,066,311,709
元本等合計		9,331,919,113
<b>純資産合計</b>		
<b>負債純資産合計</b>		
		9,351,041,409

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第8期中間計算期間 自 平成26年1月15日 至 平成26年7月14日
<b>営業収益</b>	
受取利息	37,696
有価証券売買等損益	337,652,168
営業収益合計	337,689,864
<b>営業費用</b>	
受託者報酬	3,417,818
委託者報酬	1 42,967,448
その他費用	231,841
営業費用合計	46,617,107
営業利益又は営業損失（ ）	291,072,757
経常利益又は経常損失（ ）	291,072,757
中間純利益又は中間純損失（ ）	291,072,757
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	6,097,224
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	171,687,140
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,557,461
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,557,461
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,682,449
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,682,449
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	118,163,405

## ( 3 ) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年1月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成26年1月14日、当中間計算期間末日を平成26年7月14日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第8期中間計算期間末 平成26年7月14日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	9,365,310,593円 692,565,213円 844,120,098円
2. 受益権の総数	9,213,755,708口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期中間計算期間 自 平成26年1月15日 至 平成26年7月14日
1. 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	678,530円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期中間計算期間末 平成26年7月14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)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第8期中間計算期間末 平成26年7月14日現在
1口当たり純資産額	1.0128円
（1万口当たり純資産額）	(10,128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」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「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あります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成26年7月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		9,897,725,187
株式	2	311,673,486,200
派生商品評価勘定		62,366,480
未収入金		3,363,872
未収配当金		249,268,965
前払金		22,896,000
流動資産合計		321,909,106,704
資産合計		321,909,106,704
負債の部		
流動負債		
未払解約金		841,198,000
流動負債合計		841,198,000
負債合計		841,198,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	180,198,015,333
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		140,869,893,371
元本等合計		321,067,908,704
純資産合計		321,067,908,704
負債純資産合計		321,909,106,704

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月14日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	184,628,470,006円
同期中追加設定元本額	17,164,747,857円
同期中一部解約元本額	21,595,202,530円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	4,072,684,695円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,301,356,858円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	37,208,668,766円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	769,441,024円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,906,864,162円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,137,239,124円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	425,486,727円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,381,957,174円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,174,087,366円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	103,163,094円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,323,773,609円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	23,218,922円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	9,022,528円

D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	17,217,804円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	42,309,205円
投資のソムリエ	161,984,072円
クルーズコントロール	315,711,982円
投資のソムリエ<DC年金>	1,661,400円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC 年金>	9,053,863円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機 関投資家限定)	147,964,428円
D I A Mグローバル・バランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,902,621,312円
D I A Mグローバル・バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	810,153,712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)	98,861,045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)	380,247,936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)	99,556,849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)	158,327,505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)	14,026,879,961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)	4,613,511,826円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機 関投資家限定)	3,380,012,849円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適 格機関投資家限定)	2,267,146,883円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機 関投資家限定)	5,495,995,902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)	567,314,766円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A2(適格機関投資家限定)	1,505,150,787円
D I A M アクサ グローバル バランス ファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,433,624,767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)	7,280,809,706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)	87,280,606円
D I A M世界バランスファンド55VA(適 格機関投資家限定)	2,754,458,034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）	7,082,264,454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）	253,965,296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）	26,832,049,357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）	1,266,746,443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）	3,132,062,179円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	16,675,394,495円
D I A Mバランス3 0 V A（適格機関投資家 限定）	40,833円
D I A Mバランス5 0 V A（適格機関投資家 限定）	101,722,584円
D I A Mバランス7 0 V A（適格機関投資家 限定）	56,698,735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）	14,819,449,792円
D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投 資家限定）	143,743,419円
D I A M国内バランス3 0 V A（適格機関投 資家限定）	50,278,069円
D I A Mバランス2 0 V A（適格機関投資家 限定）	73,514,460円
D I A Mバランス4 0 V A（適格機関投資家 限定）	75,171,627円
D I A Mバランス6 0 V A（適格機関投資家 限定）	126,984円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A（1 2 1 2）（適格機関投資家限定）	900,296,115円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A（1 3 0 3）（適格機関投資家限定）	2,273,472,480円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A（1 3 0 6）（適格機関投資家限定）	2,945,619,832円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A（1 3 0 9）（適格機関投資家限定）	120,576,930円
計	180,198,015,333円
2 . 受益権の総数	180,198,015,333口
3 . 2 差入代用有価証券	株式 3,010,500,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月14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)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	平成26年7月14日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	9,182,847,000	-	9,245,450,000	62,603,000
合計	9,182,847,000	-	9,245,450,000	62,603,000

## （注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成26年7月14日現在
1口当たり純資産額	1.7818円
（1万口当たり純資産額）	(17,818円)

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年7月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,218,698,289
国債証券		351,053,658,500
地方債証券		28,824,898,014
特殊債券		28,892,070,173
社債券		24,816,867,140
未収入金		2,597,624,000
未収利息		1,211,259,436
前払費用		26,537,829
流動資産合計		438,641,613,381
資産合計		438,641,613,381
負債の部		
流動負債		
未払解約金		732,186,000
流動負債合計		732,186,000
負債合計		732,186,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	364,320,822,168
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		73,588,605,213
元本等合計		437,909,427,381
純資産合計		437,909,427,381
負債純資産合計		438,641,613,381

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月14日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	384,301,757,056円
同期中追加設定元本額	17,779,458,734円
同期中一部解約元本額	37,760,393,622円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	7,752,128,131円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>	10,171,028,323円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	3,914,092,599円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	6,192,757,632円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	2,517,171,139円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,641,113,671円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,756,052,368円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	244,645,589円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	161,281,285円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,067,907,062円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,783,141円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	76,306,122円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	52,629,594円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	15,623,275円
投資のソムリエ	864,950,322円
クルーズコントロール	583,847,539円
投資のソムリエ< D C年金>	8,751,193円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	76,861,910円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円

D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	12,474,154,955円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	720,115,552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)	6,934,066,375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)	479,395,337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)	341,568,974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)	844,575,756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)	368,590,027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)	312,565,963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)	31,151,512,877円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,247,007,675円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	13,349,675,660円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,035,522,337円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,136,708,904円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	1,260,636,240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)	5,572,079,569円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,375,517,978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)	10,777,731,390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)	508,585,424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)	12,282,364,696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)	8,330,542,690円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	1,267,326,367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)	105,955,919,127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 )	1,875,098,981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 )	9,277,695,375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 )	32,920,033,899円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適格機関投資 家限定 )	487,284円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適格機関投資 家限定 )	376,116,540円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適格機関投資 家限定 )	83,354,529円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A ( 適格機関投資家限定 )	36,574,805,338円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関 投資家限定 )	700,952,715円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機関 投資家限定 )	173,684,857円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適格機関投資 家限定 )	1,092,651,739円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適格機関投資 家限定 )	389,671,541円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適格機関投資 家限定 )	313,763円
計	364,320,822,168円
2 . 受益権の総数	364,320,822,168口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月14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)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
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26年7月14日現在
1口当たり純資産額	1,2020円
（1万口当たり純資産額）	（12,020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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年7月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,160,160,967
投資証券		31,464,556,400
未収入金		40,042,340
未収配当金		221,107,725
流動資産合計		32,885,867,432
資産合計		32,885,867,432
負債の部		
流動負債		
未払金		1,065,311,960
未払解約金		706,000
流動負債合計		1,066,017,960
負債合計		1,066,017,960
純資産の部		
元本等		
元本	1	21,991,117,455
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		9,828,732,017
元本等合計		31,819,849,472
純資産合計		31,819,849,472
負債純資産合計		32,885,867,432

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月14日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	13,323,636,866円
同期中追加設定元本額	35,035,160,794円
同期中一部解約元本額	26,367,680,205円
元本の内訳	
ファンド名	
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	41,484,123円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	531,731,847円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,274,109円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	3,325,877円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	8,414,750円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	23,379,905円
投資のソムリエ	86,261,425円
投資のソムリエ<DC年金>	872,022円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,341,854円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201210（適格機関投資家限定）	2,120,719,175円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212（適格機関投資家限定）	1,145,882,682円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401（適格機関投資家限定）	3,107,027,079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）	10,710,414,146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）	138,473,210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)	210,074,712円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	218,038,011円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドI I (適格機関投資家限定)	82,356,264円
D I A M リスクコントロールJ - R E I Tファンド(適格機関投資家限定)	3,556,046,264円
計	21,991,117,455円
2 . 受益権の総数	21,991,117,455口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月14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)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
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26年7月14日現在
1口当たり純資産額	1,4469円
（1万口当たり純資産額）	（14,469円）

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年7月14日現在
資産の部		
流動資産		
預金		5,839,225,933
コール・ローン		173,714,844
株式		292,486,843,580
投資信託受益証券		889,589,702
投資証券		5,701,891,674
派生商品評価勘定		51,230,439
未収入金		900,936
未収配当金		407,191,300
差入委託証拠金		1,199,446,816
流動資産合計		306,750,035,224
資産合計		306,750,035,224
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		57,575,008
未払解約金		456,368,000
流動負債合計		513,943,008
負債合計		513,943,008
純資産の部		
元本等		
元本	1	127,067,964,616
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		179,168,127,600
元本等合計		306,236,092,216
純資産合計		306,236,092,216
負債純資産合計		306,750,035,224

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3 . 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月14日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	135,913,743,805円
同期中追加設定元本額	6,388,590,603円
同期中一部解約元本額	15,234,369,792円
元本の内訳 ファンド名 D I A M外国株式パッシブ・ファンド	886,988,435円

D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	33,865,181,325円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	149,610,480円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	856,618,886円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,078,718,512円
D I A M D C バランス30インデック スファンド	156,524,275円
D I A M D C バランス50インデック スファンド	434,853,319円
D I A M D C バランス70インデック スファンド	344,717,137円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	65,965,169円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	845,017,664円
マネックス資産設計ファンド エボリュー ション	177,605,873円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	6,587,080円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	12,614,143円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	31,047,635円
投資のソムリエ	119,082,512円
クルーズコントロール	114,758,631円
投資のソムリエ< D C年金>	1,213,773円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	6,695,719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)	422,931,683円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	3,901,253,297円
D I A Mワールドバランス25VA(適格 機関投資家限定)	46,620,553円
D I A Mグローバル・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家限定)	2,871,677,963円
D I A Mグローバル・バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	596,175,198円
D I A M国際分散バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	72,748,351円
D I A M国際分散バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	419,742,948円
D I A M国内重視バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	36,609,441円
D I A M国内重視バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	77,651,441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)	10,321,599,594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)	5,092,818,901円
D I A Mバランスファンド25VA(適格 機関投資家限定)	1,657,461,889円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,459,553,159円
D I A Mバランスファンド50VA(適格 機関投資家限定)	4,043,954,399円
D I A Mグローバル・アセット・バランス VA(適格機関投資家限定)	2,089,958,745円
D I A Mグローバル・アセット・バランス VA2(適格機関投資家限定)	3,309,970,285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)	2,111,611,939円
D I A M世界アセットバランスファンドV A(適格機関投資家向け)	1,775,894,132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)	27,678,338円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	9,151,482,936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)	2,106,792,977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)	61,756,573円
D I A M世界アセットバランスファンド2 VA(適格機関投資家限定)	13,159,561,214円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	932,195,945円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5VA(適格機関投資家限定)	2,304,563,645円
D I A M世界アセットバランスファンド3 VA(適格機関投資家限定)	8,178,265,232円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資 家限定)	151,532円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資 家限定)	298,503,799円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資 家限定)	151,789,349円
D I A M世界アセットバランスファンド4 VA(適格機関投資家限定)	10,904,105,671円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資 家限定)	162,988,126円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資 家限定)	165,814,913円



D I A Mバランス60VA（適格機関投資 家限定）	279,880円
計	127,067,964,616円
2. 受益権の総数	127,067,964,616口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月14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)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成26年7月14日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	400,095,645	-	399,954,200	141,445
アメリカ・ドル	223,004,320	-	222,970,000	34,320
イギリス・ポンド	45,124,780	-	45,117,800	6,980
オーストラリア・ドル	27,570,445	-	27,605,100	34,655
カナダ・ドル	16,181,960	-	16,056,500	125,460
ユーロ	88,214,140	-	88,204,800	9,340
合計	400,095,645	-	399,954,200	141,445

## (注) 時価の算定方法

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

## 株式関連

種類	平成26年7月14日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	6,938,244,123	-	6,931,758,109	6,486,014
合計	6,938,244,123	-	6,931,758,109	6,486,014

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成26年7月14日現在
1口当たり純資産額	2.4100円
(1万口当たり純資産額)	(24,100円)

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年7月14日現在
資産の部		
流動資産		
預金		4,597,016,829
コール・ローン		301,144,686
国債証券		361,534,209,820
派生商品評価勘定		94,915
未収利息		3,994,984,323
前払費用		138,209,556
流動資産合計		370,565,660,129
資産合計		370,565,660,129
負債の部		
流動負債		
未払解約金		713,275,000
流動負債合計		713,275,000
負債合計		713,275,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	221,077,041,605
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		148,775,343,524
元本等合計		369,852,385,129
純資産合計		369,852,385,129
負債純資産合計		370,565,660,129

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年7月14日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	238,565,930,026円 7,099,889,334円 24,588,777,755円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	3,421,892,512円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C年金 >	4,364,812,732円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型	345,163,481円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型	1,233,129,615円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型	1,309,084,118円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	339,503,023円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	713,159,431円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	499,495,318円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	41,621,043円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	533,603,500円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,300,115円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	2,869,887円

D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	4,842,717円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	11,203,801円
クルーズコントロール	416,988,677円
D I A M 8資産バランスファンドN<D C年金>	2,899,476円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	3,134,365,425円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシ ブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,215,131,191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)	5,194,847,568円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資 家限定)	1,255,485,285円
D I A Mワールドバランス25VA(適格 機関投資家限定)	157,277,097円
D I A Mグローバル・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家限定)	19,924,858,738円
D I A Mグローバル・バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	1,378,082,477円
D I A M国際分散バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	245,282,295円
D I A M国際分散バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	404,188,782円
D I A M国内重視バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	105,823,624円
D I A M国内重視バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	56,059,155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)	22,365,816,221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)	4,903,905,768円
D I A Mバランスファンド25VA(適格 機関投資家限定)	8,386,346,582円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	3,916,769,525円
D I A Mバランスファンド50VA(適格 機関投資家限定)	5,841,945,730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)	1,513,386,400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)	5,599,889,580円
D I A M アクサ グローバル バランス ファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,101,586,674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)	28,316,084,207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)	104,311,492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)	4,400,613,343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)	13,558,210,621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)	181,497,646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)	19,010,540,423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)	23,634,976,906円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	131,187円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	270,040,059円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	59,838,834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)	21,006,355,927円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	152,796,643円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	235,047,600円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	199,844,124円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	135,030円
計	221,077,041,605円
2. 受益権の総数	221,077,041,605口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月14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)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。



## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成26年7月14日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	774,364,525	-	774,269,610	94,915
アメリカ・ドル	290,619,762	-	290,570,450	49,312
イギリス・ポンド	193,317,990	-	193,312,420	5,570
ユーロ	290,426,773	-	290,386,740	40,033
合計	774,364,525	-	774,269,610	94,915

## （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26年7月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6730円 (16,730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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成26年7月14日現在
資産の部		
流動資産		
預金		23,978,696
コール・ローン		8,068,335
投資信託受益証券		372,168,294
投資証券		2,574,170,424
派生商品評価勘定		35,890
未収入金		50,953,973
未収配当金		15,526,399
流動資産合計		3,044,902,011
資産合計		3,044,902,011
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		20,120
未払解約金		55,604,000
流動負債合計		55,624,120
負債合計		55,624,120
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,163,667,412
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		825,610,479
元本等合計		2,989,277,891
純資産合計		2,989,277,891
負債純資産合計		3,044,902,011

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成26年7月14日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首 における当該親投資信託の元本額	2,498,251,197円
	同期中追加設定元本額	28,919,576円
	同期中一部解約元本額	363,503,361円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	38,094,048円
	マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	487,645,055円
	マネックス資産設計ファンド エボリュー ション	37,733,127円
	D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,516,421,418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）	83,773,764円
	計	2,163,667,412円
2 .	受益権の総数	2,163,667,412口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年7月14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)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成26年7月14日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	68,950,859	-	68,935,089	15,770
アメリカ・ドル	30,410,160	-	30,405,000	5,160
イギリス・ポンド	3,471,410	-	3,470,600	810
オーストラリア・ドル	12,359,165	-	12,374,700	15,535
カナダ・ドル	3,807,520	-	3,778,000	29,520
シンガポール・ドル	11,425,120	-	11,429,600	4,480
ユーロ	2,899,589	-	2,899,189	400
香港・ドル	4,577,895	-	4,578,000	105
合計	68,950,859	-	68,935,089	15,770

(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26年7月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3816円 (13,816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26年7月31日現在

資産総額	9,479,094,528円
負債総額	29,811,783円
純資産総額（ - ）	9,449,282,745円
発行済数量	9,214,839,956口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0254円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	325,902,663,835円
負債総額	2,460,438,300円
純資産総額（ - ）	323,442,225,535円
発行済数量	178,144,806,614口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8156円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	444,139,062,562円
負債総額	6,389,758,000円
純資産総額（ - ）	437,749,304,562円
発行済数量	363,947,069,364口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2028円

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	33,423,981,537円
負債総額	165,282,700円
純資産総額（ - ）	33,258,698,837円
発行済数量	22,539,887,240口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4755円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	310,229,829,915円
負債総額	262,974,776円
純資産総額（ - ）	309,966,855,139円
発行済数量	126,493,028,580口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4505円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年7月31日現在

資産総額	371,511,767,274円
負債総額	768,853,415円
純資産総額（ - ）	370,742,913,859円
発行済数量	219,326,413,477口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6904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26年7月31日現在

資産総額	3,053,509,476円
負債総額	395,000円
純資産総額（ - ）	3,053,114,476円
発行済数量	2,160,437,549口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4132円



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

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

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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。

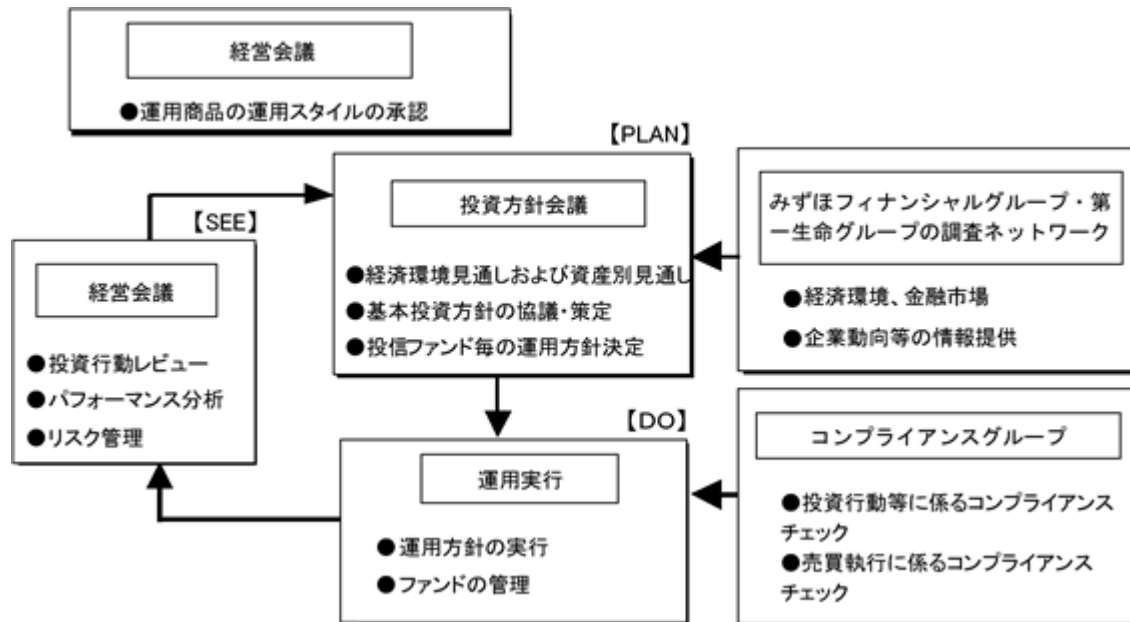
投資運用の意思決定機構

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26年7月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

### <更新・訂正後>

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

平成26年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は331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	7	20,000,365,251
追加型株式投資信託	310	5,099,223,501,944
単位型公社債投資信託	14	142,300,010,495
追加型公社債投資信託	0	0
合計	331	5,261,523,877,690

### 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 委託会社等の状況 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、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。
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29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	10,806,745	11,487,360
金銭の信託	10,214,440	10,952,459
前払費用	69,143	64,554
未収委託者報酬	3,073,481	3,854,410
未収運用受託報酬	1,173,744	1,415,502
未収投資助言報酬	2 245,819	2 255,218
未収収益	244,974	275,082
繰延税金資産	426,229	401,327
その他	25,354	23,246
流動資産計	26,279,933	28,729,163
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 142,820	1 122,181
車両運搬具	1 2,770	1 1,615
器具備品	1 231,732	1 140,023
建設仮勘定	1,207	29,509
無形固定資産		
商標権	1 289	1 195
ソフトウェア	1 1,261,335	1 1,188,444
ソフトウェア仮勘定	68,920	642,834
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 292	1 231
投資その他の資産		
投資有価証券	4,002,042	4,178,284
関係会社株式	400,579	617,159
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	661,777	622,698
差入保証金	731,564	731,197
その他	89,047	88,154
固定資産計	5,718,557	6,310,469
資産合計	31,998,491	35,039,633

（単位：千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	571,153	760,493
未払金	1,547,527	1,972,562
未払収益分配金	48	-
未払償還金	84,932	51,109
未払手数料	1,195,452	1,554,065
その他未払金	267,093	367,387
未払費用	2 1,306,837	2 1,466,924
未払法人税等	1,299,068	1,721,861
未払消費税等	116,872	195,272
賞与引当金	724,974	668,366
その他	100,000	10,000
流動負債計	5,666,434	6,795,481
固定負債		
退職給付引当金	802,603	947,759
役員退職慰労引当金	98,510	136,010
固定負債計	901,113	1,083,769
負債合計	6,567,548	7,879,251
（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	20,898,697	22,488,744
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	16,330,000	17,130,000
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	3,945,403	4,735,451
株主資本計	25,327,175	26,917,222
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	103,768	243,159
評価・換算差額等計	103,768	243,159
純資産合計	25,430,943	27,160,381
負債・純資産合計	31,998,491	35,039,633

## （ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第28期 （ 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日 ）		第29期 （ 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日 ）	
	営業収益			
委託者報酬	23,374,427		25,437,511	
運用受託報酬	5,374,163		6,328,414	
投資助言報酬	885,923		926,837	
その他営業収益	715,164		835,020	
営業収益計		30,349,678		33,527,783
営業費用				
支払手数料	10,846,568		11,284,530	
広告宣伝費	177,553		316,226	
公告費	3,769		319	
調査費	4,546,312		5,226,606	
調査費	3,001,788		3,635,440	
委託調査費	1,544,523		1,591,166	
委託計算費	341,978		356,496	
営業雑経費	456,677		540,260	
通信費	25,513		32,834	
印刷費	374,775		466,075	
協会費	25,492		25,048	
諸会費	42		38	
支払販売手数料	30,854		16,264	
営業費用計		16,372,860		17,724,440
一般管理費				
給料	4,870,759		5,009,676	
役員報酬	242,014		255,603	
給料・手当	4,035,751		4,171,884	
賞与	592,994		582,188	
交際費	36,212		34,917	
寄付金	2,693		2,515	
旅費交通費	187,653		232,436	
租税公課	95,064		103,775	
不動産賃借料	675,811		683,633	
退職給付費用	173,065		221,376	
固定資産減価償却費	524,750		561,503	
福利厚生費	26,642		32,812	
修繕費	6,018		9,184	
賞与引当金繰入額	724,974		668,366	
役員退職慰労引当金繰入額	47,820		47,298	
役員退職慰労金	7,200		6,528	
機器リース料	35		35	
事務委託費	224,066		215,100	
事務用消耗品費	60,044		67,394	
器具備品費	2,065		3,191	
諸経費	159,247		118,672	

一般管理費計		7,824,126		8,018,417
営業利益		6,152,691		7,784,925

（単位：千円）

	第28期		第29期	
	（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）		（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	10,223		15,024	
受取利息	3,554		2,318	
時効成立分配金・償還金	2,080		33,872	
金銭の信託運用益	168,444		-	
雑収入	4,957		4,746	
営業外収益計		189,260		55,962
営業外費用				
為替差損	6,549		7,364	
金銭の信託運用損	-		213,744	
雑損失	-		10,952	
営業外費用計		6,549		232,061
経常利益		6,335,402		7,608,826
特別損失				
固定資産除却損	1	1,752	1	22
固定資産売却損	2	115	2	1,448
特別損失計		1,868		1,470
税引前当期純利益		6,333,533		7,607,355
法人税、住民税及び事業税		2,573,893		2,934,516
法人税等調整額		134,463		13,207
法人税等合計		2,439,430		2,921,308
当期純利益		3,894,102		4,686,047



## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	15,630,000	300,000	200,000	3,463,300	19,716,594	24,145,072
当期変動額									
剰余金の 配当							2,712,000	2,712,000	2,712,000
別途積立金 の積立				700,000			700,000	-	-
当期純利益							3,894,102	3,894,102	3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	700,000	-	-	482,102	1,182,102	1,182,102
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	136,143	24,281,215
当期変動額		
剰余金の 配当		2,712,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	32,375	32,375
当期変動額 合計	32,375	1,149,727
当期末残高	103,768	25,430,943

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の 配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金 の積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の 配当		3,096,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	139,391	139,391
当期変動額 合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

## 重要な会計方針

項目	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法  (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。  (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (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。また、数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

**未適用の会計基準等**

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

**（1）概要**

財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。

**（2）適用予定日**

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用予定であります。

**（3）当該会計基準等の適用による影響**

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正により財務諸表に与える影響額については、現在評価中であります。

**注記事項**

（貸借対照表関係）

## 1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
建物	539,393	562,127
車両運搬具	2,152	3,308
器具備品	565,794	664,016
商標権	649	742
ソフトウェア	1,071,133	1,502,289
電信電話専用施設利用権	1,304	1,365

## 2. 関係会社項目

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

(千円)

		第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	241,190	255,084
流動負債	未払費用	334,888	392,646

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	-	22
ソフトウェア	1,752	0

## 2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	115	1,448

(株主資本等変動計算書関係)

第28期(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2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25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

平成26年6月30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26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

#### (2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

## 第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,806,745	10,806,745	-
(2) 金銭の信託	10,214,440	10,214,440	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	320,332	320,332	-
資産計	21,341,518	21,341,518	-
(1) 未払法人税等	1,299,068	1,299,068	-
負債計	1,299,068	1,299,068	-

## 第29期（平成26年3月31日現在）

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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



負債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
差入保証金	731,564	731,197

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

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

差入保証金は、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等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第28期(平成25年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	10,806,412	-	-	-
合計	10,806,412	-	-	-

## 第29期(平成26年3月31日現在)

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

## (注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

## （有価証券関係）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第28期及び第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 4. その他有価証券

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	307,639	146,101	161,537
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
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）	8,688	10,000	1,312
小計	8,688	10,000	1,312
合計	320,332	159,101	161,231

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

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

## 7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

## 1. 運用目的の金銭の信託

第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,214,440	946,377

## 第29期（平成26年3月31日現在）

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

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引関係）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります）を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2. 退職給付債務に関する事項

（千円）

（1）退職給付債務	936,125
（2）未認識数理計算上の差異	133,522
退職給付引当金	802,603

## 3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

(1) 勤務費用	102,125
(2) 利息費用	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	41,923
(5) その他	314
退職給付費用	173,065

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

## (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

5年（各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理する方法）

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります）を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

退職給付債務の期首残高	936,125
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の発生額	14,996
退職給付の支払額	34,684
過去勤務費用の発生額	24,260
退職給付債務の期末残高	1,079,828

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828
未積立退職給付債務	1,079,828
未認識数理計算上の差異	112,660
未認識過去勤務費用	19,408
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759
退職給付引当金	947,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の費用処理額	35,858
過去勤務費用の費用処理額	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第28期	第29期
	(平成25年3月31日現在)	(平成26年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	107,022	123,518
未払事業所税	5,986	5,841
賞与引当金	275,562	238,205
未払法定福利費	34,566	31,036
未払確定拠出年金掛金	3,091	2,724
減価償却超過額（一括償却資産）	5,192	3,183
減価償却超過額	159,737	152,470
繰延資産償却超過額（税法上）	27,873	10,908
退職給付引当金	286,796	337,781
役員退職慰労引当金	35,109	48,474
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	22,907	-
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	109	-
繰延税金資産合計	1,088,007	1,078,198
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	54,172
繰延税金負債合計	-	54,172
差引繰延税金資産の純額	1,088,007	1,024,025

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

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

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。



## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者との取引)

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務 1名, 出向 2名, 転籍 3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,289	未収投資 助言報酬	203,114

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	520,967	未払 費用	175,664
	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	214,290	未払 費用	89,815

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	627,855	未払 費用	224,758
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	251,110	未払 費用	97,587

## 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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	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  預金の預入 (純額)  受取利息	1,661,638  191,782  106	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	142,323  625,561  -
	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  預金の引出 (純額)  受取利息	460,605  1,912,442  3,210	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	100,875  9,527,582  61
	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 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払  業務委託料 の支払	259,435  11,140	未払 費用  未払 費用	132,250  5,848
	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)  信託報酬の 支払	3,500,000  5,908	金銭の 信託	10,214,440

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
そ の 他 の 関 係 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行 (旧株式 会社みず ほコーポ レート銀 行)	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料  預金の預入 (純額)	1,629,874  775,579	未払 手数料  現金・ 預金	224,525  10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料  預金の引出 (純額)	432,201  203,876	-	-
	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 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払  業務委託料 の支払	287,136  11,810	未払 費用  未払金	155,413  2,646
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額)  信託報酬の 支払	1,000,000  7,933	金銭の 信託	10,952,459

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 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せん。

(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。

(注7) 株式会社みずほ銀行は平成25年7月1日付で株式会社みずほコーポレート銀行(株式会社みずほ銀行に商号変更)に吸収合併されており、合併後の取引については吸収合併後の株式会社みずほ銀行(旧株式会社みずほコーポレート銀行)に引き継いでおります。

(1株当たり情報)

	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	1,059,622円64銭	1,131,682円58銭
1株当たり当期純利益金額	162,254円29銭	195,251円97銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

<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26年3月末日現在 247,369百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

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

名 称	資本金の額* (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	12,200	「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。

\*平成26年3月末日現在

#### (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26年3月末日現在 9,557.5万円

##### 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25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26年8月27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 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成26年1月15日から平成26年7月14日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成26年7月14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26年1月15日から平成26年7月14日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

---

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

X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)



# 独立監査人の監査報告書

平成26年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。