

【表紙】
【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成21年12月28日
【計算期間】 第1期（自 平成21年1月30日 至 平成21年10月13日）
【ファンド名】 D I A M国内債券パッシブ・ファンド
【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 中島 敬雄
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】 大 楽 信 雄
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【電話番号】 0 3 - 3 2 8 7 - 3 1 1 0
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません

第一部【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】

当ファンドは、NOMURA - B P I総合 の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

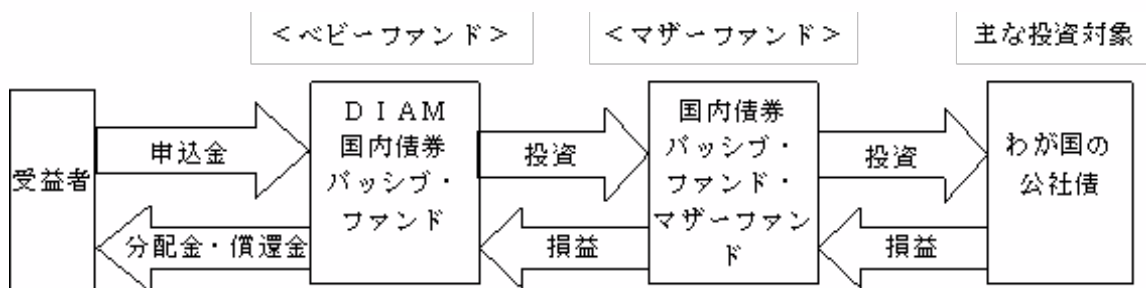
NOMURA - B P I総合

NOMURA - B P I総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）は、野村證券株式会社金融経済研究所が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に算出されます。

（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。

当ファンドは、契約型の追加型株式投資信託に属します。

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



当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

投資対象地域

「国内」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資対象資産

「債券」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

補足分類

「インデックス型」とは目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		
	年4回	北米		日経225
債券 一般 公債 社債	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファ ンド	
その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
不動産投信	日々	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (債券))	その他 ()	中南米	ファンド・オブ ・ファンズ	その他 (NOMURA-BPI総合)
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		アフリカ 中近東 (中東)		
		エマージング		

(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。

属性区分定義

投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（債券）」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として債券へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

(注) 商品分類表の投資対象資産は債券に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（債券））に分類されます。

決算頻度

「年1回」とは目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

投資対象地域

「日本」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態

「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

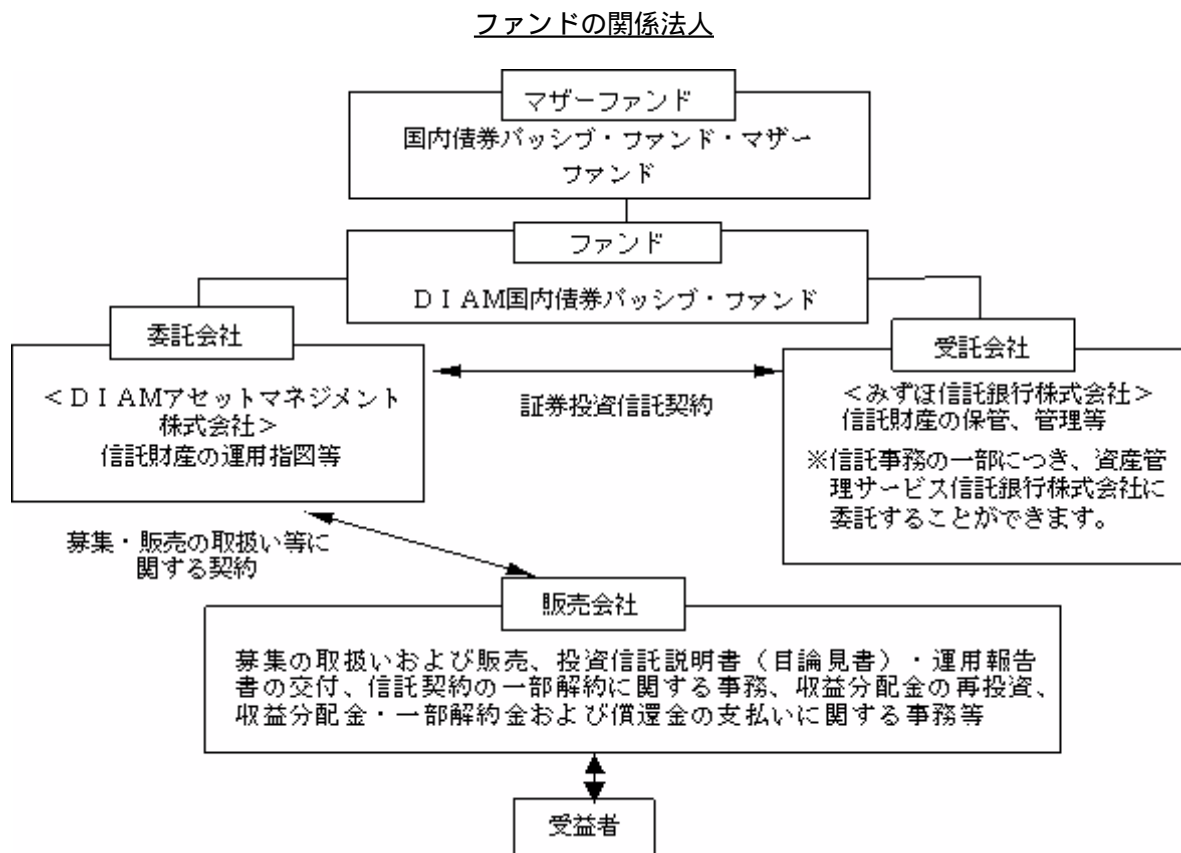
対象インデックス

「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

前記の分類は、社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。前記以外の商品分類および属性区分の定義については、以下の方法でご確認ください。

- ・投資信託協会への照会
ホームページ URL <http://www.toushin.or.jp/>

(2) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

委託会社の概況

資本金の額

20億円（平成21年10月30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21年10月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険相互会社	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】

(1)【投資方針】

<ファンドの特色>

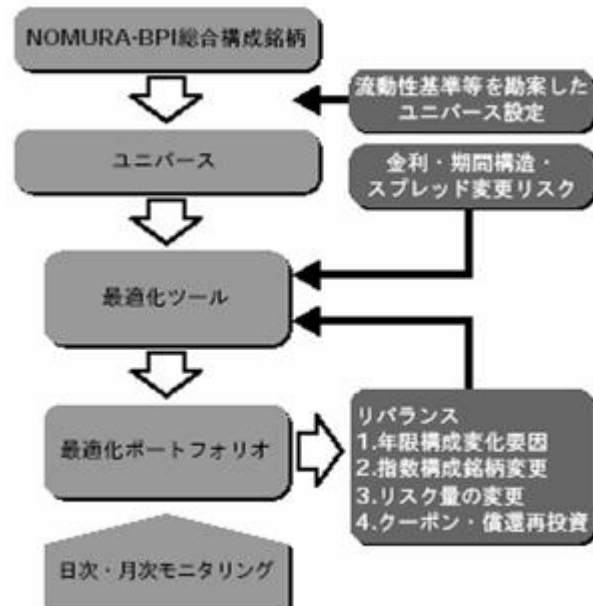
- 主に国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資を行い、「NOMURA - B P I総合」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

NOMURA - B P I総合

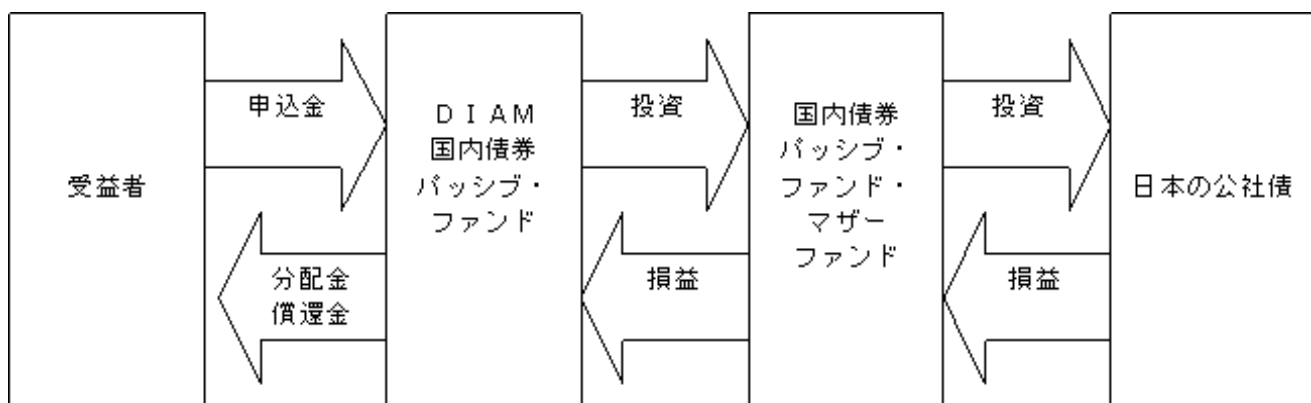
NOMURA - B P I総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）は、野村證券株式会社金融経済研究所が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に算出されます。

（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。

- 流動性等の基準に投資ユニバースを設定し、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。



- 3 当ファンドの運用はファミリーファンド方式で行います。ファミリーファンド方式とは、皆様からご投資いただいた資金をまとめてベビーファンド（D I A M国内債券パッシブ・ファンド）とし、その資金をマザーファンド（国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド）に投資して、その実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。



< 投資態度 >

主として「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券に投資し、NOMURA - BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

ただし、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、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場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。)
 - ハ．金銭債権
 - ニ．約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

運用の指図範囲等（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド（「以下「マザーファンド」ということがあります。」の受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

- 1．株券または新株引受権証書
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債券を含みます。）
- 8．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 9．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 10．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 11．コマーシャル・ペーパー
- 12．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 13．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 14．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
- 15．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 16．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 17．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有

価証券に係るものに限ります。)

18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.ならびに18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第16条第2項)

委託会社は、信託金を、前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（参考）国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資方針

<基本方針>

当ファンドは、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

<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>

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。

2. 運用プロセス

1) 流動性基準によるユニバース設定

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ユニバースを設定します。

2) 最適化法によるポートフォリオの構築

債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

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

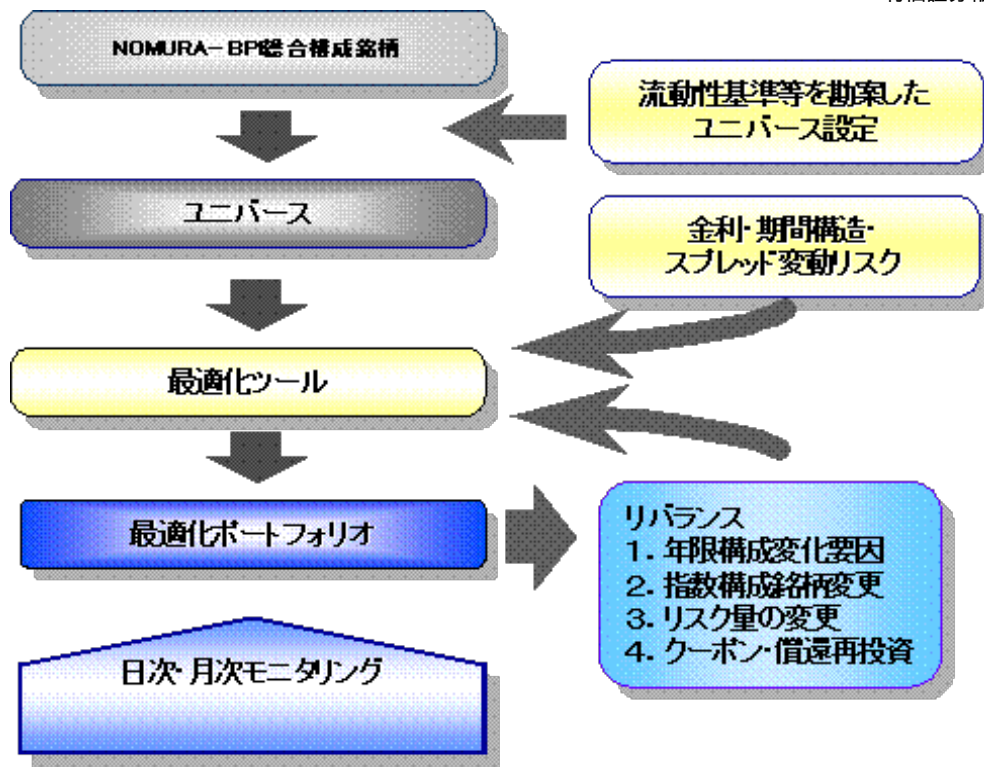
、が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3) リバランス

日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。

リバランス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



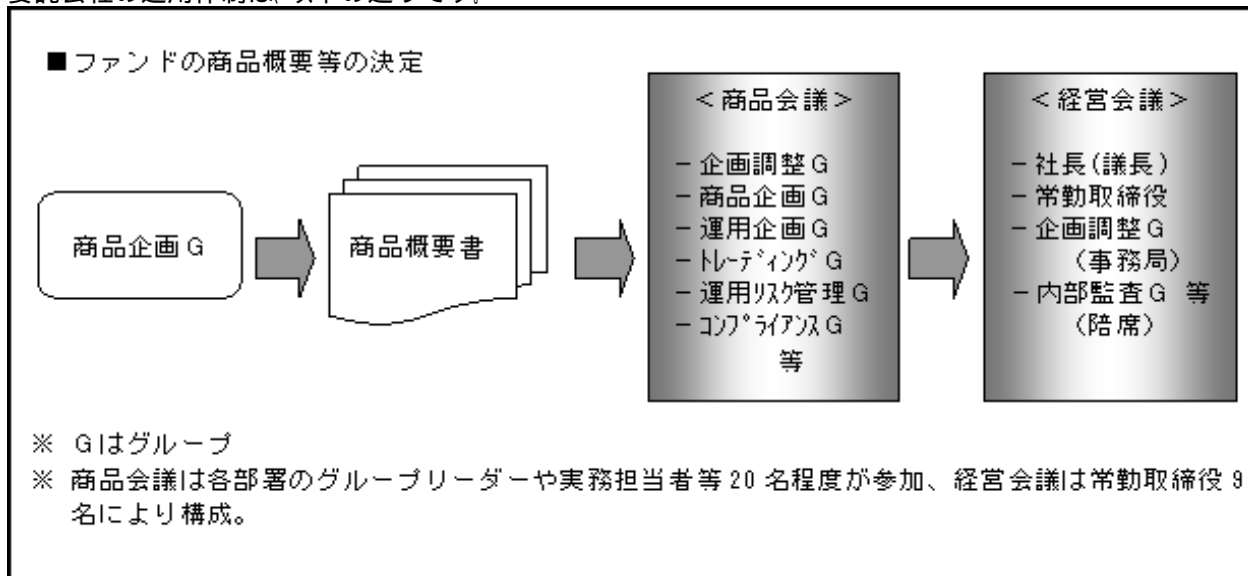
3. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用します。
5. 有価証券等の効率的な運用等のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。

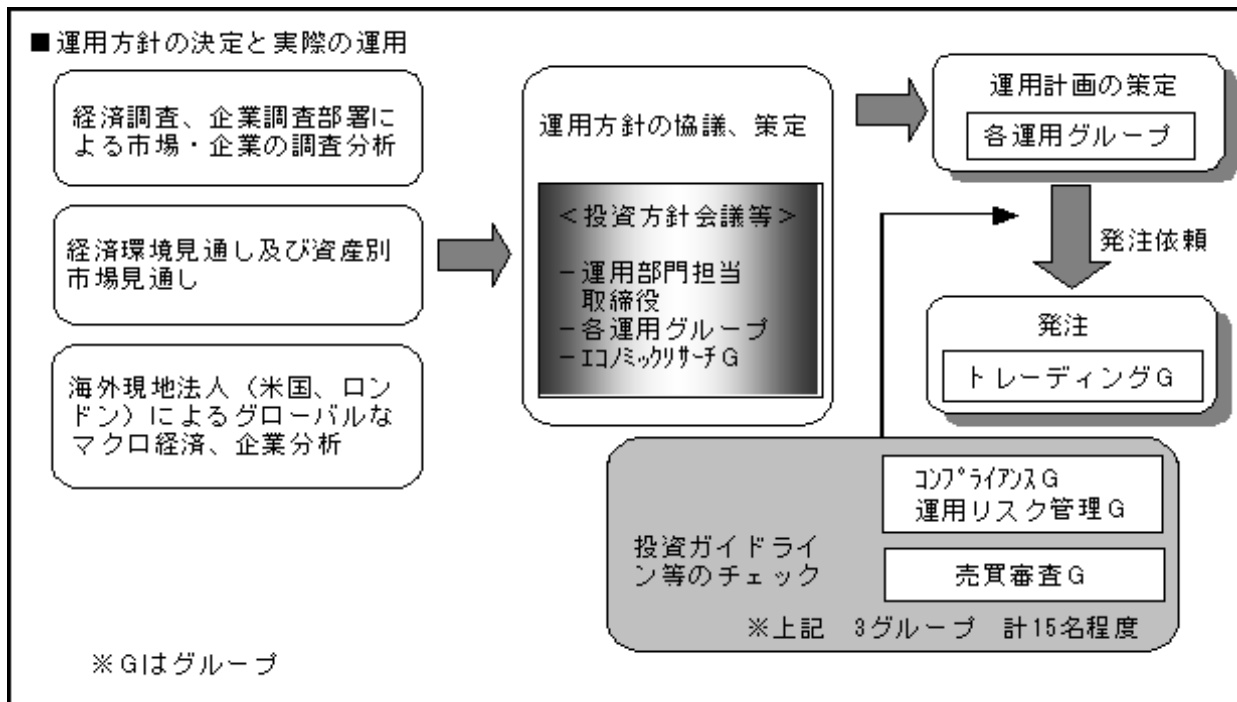
< 主な投資制限 >

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 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。
- 3) 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。
- 4) 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。
- 5) 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。

(3) 【運用体制】

委託会社の運用体制は、以下の通りです。





<ファンドの商品概要等の決定>

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

<運用方針の決定と実際の運用>

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

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ファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等によって得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用担当者の発注依頼に基づき、運用部門から独立したトレーディンググループでその大半が執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループ、運用リスク管理グループにて行われ、有価証券の売買執行等については売買審査グループにてチェックが行われます。

前記体制は平成21年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【配分方針】

1 収益配分方針

毎決算時（原則として毎年10月12日、休業日の場合は翌営業日。）に以下の方針に基づき分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての配分方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

(3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

2 収益の分配方式

(1) 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品賃料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を

受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」と言います。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2) 前記1.および2.におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産に係る配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

3 収益分配金の支払い

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で、取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は、税引後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」（3）投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」（3）投資制限）

外貨建資産への投資は行いません。（約款「運用の基本方針」（3）投資制限）

投資する株式等の範囲（約款第19条）

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券、は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2) 前記1)の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図範囲（約款第20条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 前記1)の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図（約款第21条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）および外国の取引所におけるわが国の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図（約款第22条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引の運用指図(約款第23条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付けの指図および範囲(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.および2.の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1.株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2.公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 前記1)の1.および2.で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

資金の借入れ(約款第30条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律 第9条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託会社指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令 第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

金利リスク

金利リスクとは、金利の変動を受けて債券の価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券の価格は下落します。当ファンドは実質的に債券に投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。これにより投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

有価証券等への実質的投資にあたっては、発行者において利払いや償還金の支払いが遅延したり、支払いが滞るリスクが生じることがあります。

またこうした状況に陥ると予想される場合等には、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。これにより投資元本を割り込むことがあります。

< その他の留意点 >

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

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて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。当該インデックス構成全銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入公社債の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

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

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

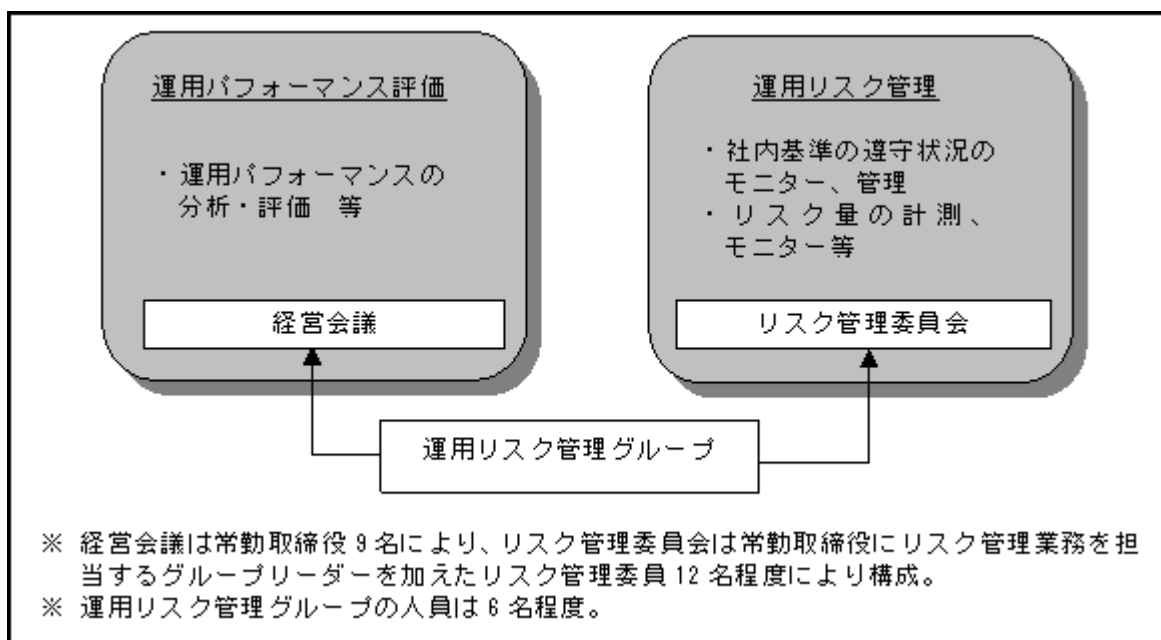
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回った場合、対象インデックスが改廃された場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情があるときは、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

注意事項

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

< 運用評価・運用リスク管理体制 >



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

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

上記体制は平成21年10月30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】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

時期	項目	費用		
		総額	信託財産の純資産総額に対して 年率0.525%（税抜0.50%）	
毎日	信託報酬	配分	委託会社	年率0.4725%（税抜0.45%）
			販売会社	年率0.021%（税抜0.02%）
			受託会社	年率0.0315%（税抜0.03%）

信託報酬の総額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日。）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

信託財産留保額

ありません。

その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息ならびに借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

(5)【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

一部解約時および償還時

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

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

一部解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。
税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(お申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店毎に、「分配金受取コース」および「分配金自動引き落とし投資コース」の両コースを取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。収益分配金に特別分配金が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「特別分配金」については、次の< 収益分配金の課税について >を参照。)

< 収益分配金の課税について >

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「特別分配金」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。なお、収益分配金に特別分配金が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成21年11月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	1,623,140,990	100.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		77,861	0.00
合 計（純資産総額）		1,623,063,129	100.00

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

(参考) マザーファンドの投資状況

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年11月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	300,581,399,900	75.10
地方債証券	日本	25,437,899,499	6.36
特殊債券	日本	37,938,643,183	9.48
社債券	日本	33,372,124,640	8.34
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,915,413,034	0.73
合 計（純資産総額）		400,245,480,256	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成21年11月5日現在

順位	銘柄名	国名	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率（%）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,500,130,305	10,878.95	1,631,983,881	10,820.00	1,623,140,990	100.00

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は1銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成21年11月5日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年11月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	6 3 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	7,000,000,000	102.08	7,145,733,000	102.07	7,144,830,000	1.20	2012/ 3/20	1.79
2	8 3 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	6,500,000,000	101.24	6,580,436,000	101.07	6,569,745,000	0.90	2014/ 6/20	1.64
3	8 1 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	6,500,000,000	100.27	6,517,480,000	100.78	6,550,960,000	0.80	2014/ 3/20	1.64
4	3 0 1 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	6,400,000,000	101.46	6,493,139,000	100.76	6,448,704,000	1.50	2019/ 6/20	1.61
5	6 1 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	6,300,000,000	102.03	6,428,083,000	101.92	6,420,834,000	1.20	2011/ 12/20	1.60
6	6 0 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	6,300,000,000	101.87	6,417,670,000	101.73	6,408,990,000	1.20	2011/ 9/20	1.60
7	2 9 7 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	6,000,000,000	100.84	6,050,642,000	100.41	6,024,300,000	1.40	2018/ 12/20	1.51
8	2 9 9 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	6,000,000,000	98.86	5,931,598,000	99.25	5,955,240,000	1.30	2019/ 3/20	1.49
9	6 4 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	5,700,000,000	103.12	5,877,797,000	102.97	5,869,404,000	1.50	2012/ 6/20	1.47
10	7 2 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	5,600,000,000	103.47	5,794,320,000	103.58	5,800,480,000	1.50	2013/ 6/20	1.45
11	2 9 3 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	5,500,000,000	105.02	5,776,137,000	104.19	5,730,615,000	1.80	2018/ 6/20	1.43
12	2 8 6 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	5,200,000,000	105.48	5,485,148,000	104.84	5,451,680,000	1.80	2017/ 6/20	1.36
13	6 6 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	5,300,000,000	101.81	5,395,688,000	102.04	5,407,961,000	1.10	2012/ 9/20	1.35
14	5 2 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	5,300,000,000	100.76	5,340,015,000	100.66	5,335,192,000	0.80	2010/ 12/20	1.33
15	7 5 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	101.91	5,095,487,000	102.14	5,106,800,000	1.10	2013/ 9/20	1.28
16	5 7 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	102.20	5,110,150,000	101.84	5,092,100,000	1.40	2011/ 6/20	1.27
17	2 9 6 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	101.90	5,094,945,000	101.51	5,075,400,000	1.50	2018/ 9/20	1.27
18	7 8 回 利付国庫 債券(5年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.84	5,041,835,000	101.30	5,065,200,000	0.90	2013/ 12/20	1.27
19	2 8 5 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	4,800,000,000	104.68	5,024,503,000	104.26	5,004,480,000	1.70	2017/ 3/20	1.25
20	2 8 8 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	4,300,000,000	104.46	4,491,606,000	103.93	4,468,861,000	1.70	2017/ 9/20	1.12
21	2 8 9 回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	4,300,000,000	102.39	4,402,623,000	102.22	4,395,331,000	1.50	2017/ 12/20	1.10

22	284回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	4,200,000,000	104.81	4,402,134,000	104.37	4,383,498,000	1.70	2016/ 12/20	1.10
23	70回 利付国 庫債券(5年)	国債 証券	日本	4,300,000,000	100.56	4,324,243,000	101.16	4,349,751,000	0.80	2013/ 3/20	1.09
24	303回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	100.69	4,027,400,000	99.61	3,984,440,000	1.40	2019/ 9/20	1.00
25	54回 利付国 庫債券(5年)	国債 証券	日本	3,900,000,000	101.41	3,955,068,000	101.18	3,946,137,000	1.10	2011/ 3/20	0.99
26	266回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	103.33	3,926,570,000	103.35	3,927,338,000	1.40	2014/ 12/20	0.98
27	290回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	3,700,000,000	101.58	3,758,370,000	101.21	3,744,807,000	1.40	2018/ 3/20	0.94
28	282回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	3,300,000,000	105.44	3,479,488,000	104.56	3,450,513,000	1.70	2016/ 9/20	0.86
29	254回 利付国 庫債券(10年)	国債 証券	日本	3,300,000,000	103.13	3,403,323,000	103.31	3,409,230,000	1.40	2013/ 9/20	0.85
30	85回 利付国 庫債券(5年)	国債 証券	日本	3,400,000,000	100.45	3,415,136,000	100.02	3,400,782,000	0.70	2014/ 9/20	0.85

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

種類別業種別投資比率

平成21年11月5日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	75.10
地方債証券	6.36
特殊債券	9.48
社債券	8.34
合計	99.27

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成21年11月5日）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成21年10月13日現在）	1,434	1,434	1.0096	1.0096
平成21年1月末	1		1.0000	
2月末	1		1.0019	
3月末	29		0.9986	
4月末	88		0.9965	
5月末	213		0.9943	
6月末	351		1.0031	
7月末	540		1.0013	
8月末	902		1.0072	
9月末	1,223		1.0097	
10月末	1,440		1.0049	
11月5日	1,623		1.0035	

【分配の推移】

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1期	0.96

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

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成21年1月30日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後2時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前10時）までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

- ・お申込価額

お申込日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

- ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込み になる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。当初元本は1口当たり1円です。

・お申込手数料
ありません。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、解約の請求をすることができます。受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後2時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前10時）までに解約の請求が行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとします。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

・解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで、ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して4営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

(2)【保管】

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

(3)【信託期間】

信託期間は平成21年1月30日から無期限です。

ただし、下記「(5)その他イ.償還規定」の場合には信託を終了する場合があります。

(4)【計算期間】

- 計算期間は原則として毎年10月13日から翌年10月12日までとします。
- 前記a.の規定にかかわらず、前記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- 委託会社は、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生した場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- 委託会社は、前記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 前記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- 前記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- 前記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、後記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、前記b.に規定する書面に付記します。

ロ．信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、前記a.の事項（前記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限りです。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 前記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 前記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 前記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、前記a.からg.の規定にしたがい信託約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、前記b.に規定する書面に付記します。
- j. 前記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

八．関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに当事者間の別段の意志表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

ホ．運用報告書

委託会社は、毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産にかか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ております。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

2【受益者の権利等】

(1)収益分配金受領権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者は、分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属するものとします。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了後の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属するものとします。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3) 一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第4【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の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、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) 当ファンドの第1期計算期間は、信託約款第33条により、平成21年1月30日から平成21年10月13日までとなっております。
- (3) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成21年1月30日から平成21年10月13日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】
【D I A M国内債券パッシブ・ファンド】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第 1 期 平成21年10月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,226,558
親投資信託受益証券		1,434,142,386
流動資産合計		1,435,368,944
資産合計		1,435,368,944
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		67,383
未払委託者報酬		1,055,919
その他未払費用		5,578
流動負債合計		1,128,880
負債合計		1,128,880
純資産の部		
元本等		
元本		1,420,560,764
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,679,300
（分配準備積立金）		8,956,885
元本等合計		1,434,240,064
純資産合計		1,434,240,064
負債純資産合計		1,435,368,944

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 1 期 自 平成21年 1月30日 至 平成21年10月13日
営業収益	
受取利息	42
有価証券売買等損益	10,595,386
営業収益合計	10,595,428
営業費用	
受託者報酬	94,921
委託者報酬	1,487,882
その他費用	7,812
営業費用合計	1,590,615
営業利益	9,004,813
経常利益	9,004,813
当期純利益	9,004,813
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	47,928
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,726,823
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,726,823
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,408
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,408
分配金	*1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,679,300

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成21年1月30日から平成21年10月13日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 1 期 平成21年10月13日現在
*1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,425,930,490円
期中解約元本額	6,369,726円
*2 計算期間末日における受益権の総数	1,420,560,764口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
*1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,660,922円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(5,295,963円)、信託約款に規定される収益調整金(4,722,415円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は13,679,300円(1万口当たり96.30円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 1 期 自平成21年1月30日 至平成21年10月13日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,434,142,386	10,554,784
合 計	1,434,142,386	10,554,784

（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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第 1 期 平成21年10月13日現在
1口当たり純資産額	1.0096円
（1万口当たり純資産額）	（10,096円）

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,317,903,314	1,434,142,386	
合 計		1,317,903,314	1,434,142,386	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成21年10月13日現在
		金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		9,180,524,551
国債証券		294,587,771,000
地方債証券		25,213,020,006
特殊債証券		37,510,294,217
社債証券		33,275,404,650
未収利息		936,162,568
前払費用		132,521,707
流動資産合計		400,835,698,699
資産合計		400,835,698,699
負債の部		
流動負債		
未払金		9,470,014,487
未払解約金		39,528,000
流動負債合計		9,509,542,487
負債合計		9,509,542,487
純資産の部		
元本等		
元本		359,624,671,487
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		31,701,484,725
元本等合計		391,326,156,212
純資産合計		391,326,156,212
負債純資産合計		400,835,698,699

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成21年1月30日 至平成21年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成21年2月17日から平成22年2月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成21年10月13日現在
*1 本有価証券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	222,554,866,012円
同期中追加設定元本額	162,721,957,163円
同期中解約元本額	25,652,151,688円
同期末における元本の内訳	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	1,317,903,314円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	5,851,704,343円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	2,258,550,854円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,593,346,569円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,502,564,652円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,138,811,499円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,142,409,096円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	143,495,359円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	240,037,784円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,762,389,611円
みずほエマーシ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エマーシング債券ファンド	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	10,126,042円
D I A M国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	10,703,688,890円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	815,690,820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）	15,376,864,953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）	819,014,297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）	549,192,343円
D I A M国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,306,329,701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）	625,037,124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）	440,769,660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）	33,765,288,397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）	11,005,949,978円
D I A Mバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	15,964,550,501円
D I A Mバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	6,087,833,287円
D I A Mバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	9,487,708,907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）	2,047,963,869円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	7,319,561,083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）	9,169,708,335円
D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	15,564,905,383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）	1,116,835,998円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,144,548,232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）	15,593,101,335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）	8,161,958,723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）	1,637,645,775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）	117,679,855,489円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	3,149,178,698円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	10,612,136,254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）	36,001,798,465円
D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	2,015,463,180円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	242,793円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	148,447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）	2,470,500,608円
（合 計）	359,624,671,487円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	359,624,671,487口

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	自平成21年1月30日 至平成21年10月13日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	294,587,771,000	538,344,000
地方債証券	25,213,020,006	242,800,743
特殊債券	37,510,294,217	321,359,305
社債券	33,275,404,650	408,432,820
合計	390,586,489,873	1,510,936,868

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

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21年10月13日現在
1口当たり純資産額	1.0882円
(1万口当たり純資産額)	(10,882円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	2 7 4 回 利付国庫債券（2年）	2,200,000,000	2,209,966,000	
	2 7 5 回 利付国庫債券（2年）	1,600,000,000	1,607,808,000	
	2 7 6 回 利付国庫債券（2年）	3,100,000,000	3,112,152,000	
	2 7 7 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,008,370,000	
	2 7 8 回 利付国庫債券（2年）	2,300,000,000	2,306,624,000	
	2 7 9 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,008,700,000	
	2 8 0 回 利付国庫債券（2年）	2,300,000,000	2,306,670,000	
	2 8 1 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,008,670,000	
	2 8 2 回 利付国庫債券（2年）	3,100,000,000	3,103,751,000	
	2 8 3 回 利付国庫債券（2年）	2,500,000,000	2,502,950,000	
	2 8 4 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,003,420,000	
	5 2 回 利付国庫債券（5年）	5,300,000,000	5,338,584,000	
	5 4 回 利付国庫債券（5年）	3,900,000,000	3,950,115,000	
	5 7 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,098,100,000	
	6 0 回 利付国庫債券（5年）	6,300,000,000	6,416,109,000	
	6 1 回 利付国庫債券（5年）	6,300,000,000	6,427,512,000	
	6 3 回 利付国庫債券（5年）	6,400,000,000	6,540,992,000	
	6 4 回 利付国庫債券（5年）	5,700,000,000	5,879,265,000	
	6 6 回 利付国庫債券（5年）	5,300,000,000	5,416,759,000	
	6 8 回 利付国庫債券（5年）	2,300,000,000	2,352,348,000	
	6 9 回 利付国庫債券（5年）	3,300,000,000	3,354,384,000	
	7 0 回 利付国庫債券（5年）	4,300,000,000	4,357,362,000	
	7 2 回 利付国庫債券（5年）	5,600,000,000	5,814,760,000	
	7 5 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,608,450,000	
	7 8 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,078,700,000	
	8 1 回 利付国庫債券（5年）	5,500,000,000	5,560,555,000	
	8 3 回 利付国庫債券（5年）	6,500,000,000	6,596,200,000	
	8 5 回 利付国庫債券（5年）	1,700,000,000	1,707,718,000	
	2 2 5 回 利付国庫債券（10年）	300,000,000	306,084,000	
	2 2 9 回 利付国庫債券（10年）	1,100,000,000	1,118,865,000	
	2 3 2 回 利付国庫債券（10年）	1,150,000,000	1,168,825,500	
	2 3 4 回 利付国庫債券（10年）	700,000,000	715,589,000	
	2 3 5 回 利付国庫債券（10年）	1,700,000,000	1,741,582,000	
	2 3 7 回 利付国庫債券（10年）	1,540,000,000	1,584,860,200	
	2 4 0 回 利付国庫債券（10年）	800,000,000	821,024,000	
	2 4 3 回 利付国庫債券（10年）	1,400,000,000	1,430,646,000	
	2 4 6 回 利付国庫債券（10年）	1,900,000,000	1,925,042,000	
	2 4 7 回 利付国庫債券（10年）	700,000,000	709,338,000	
	2 5 0 回 利付国庫債券（10年）	2,060,000,000	2,064,078,800	
	2 5 4 回 利付国庫債券（10年）	3,300,000,000	3,418,371,000	
	2 5 6 回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,591,000,000	
	2 5 8 回 利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,548,915,000	
	2 6 0 回 利付国庫債券（10年）	2,800,000,000	2,931,348,000	
	2 6 3 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,829,249,000	

266回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	3,946,718,000
269回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,550,265,000
270回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,099,960,000
272回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,012,114,000
274回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,611,475,000
277回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,311,056,000
280回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,995,188,000
282回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,486,945,000
284回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,433,982,000
285回	利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	5,063,712,000
286回	利付国庫債券(10年)	5,200,000,000	5,518,188,000
288回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,524,417,000
289回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,450,758,000
290回	利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,791,427,000
293回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,802,610,000
296回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,139,600,000
297回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,593,225,000
299回	利付国庫債券(10年)	6,000,000,000	6,032,880,000
301回	利付国庫債券(10年)	6,400,000,000	6,532,480,000
303回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,019,360,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	112,440,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	105,784,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	207,992,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	228,398,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	204,032,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	210,804,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	310,620,000
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	471,170,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	368,004,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	298,098,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	292,143,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	524,215,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	213,348,000
16回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	213,264,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	209,364,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	842,295,800
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	319,875,000
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	512,990,000
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	501,095,200
23回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	426,260,000
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	639,630,000
25回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	205,146,000
26回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,254,996,000
27回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,279,992,000
28回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,386,385,000
29回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,777,384,000
30回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,741,242,000
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	694,344,000
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	447,812,000
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	787,039,200
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	896,728,000
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	988,819,400
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	991,341,000
46回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	432,344,000

	47回 利付国庫債券（20年）	950,000,000	1,025,943,000
	50回 利付国庫債券（20年）	980,000,000	1,023,237,600
	51回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	842,680,000
	52回 利付国庫債券（20年）	750,000,000	796,747,500
	54回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	857,656,000
	55回 利付国庫債券（20年）	810,000,000	849,746,700
	57回 利付国庫債券（20年）	630,000,000	652,320,900
	58回 利付国庫債券（20年）	900,000,000	930,915,000
	60回 利付国庫債券（20年）	990,000,000	962,161,200
	61回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	735,168,000
	62回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	712,584,000
	64回 利付国庫債券（20年）	1,000,000,000	1,025,410,000
	65回 利付国庫債券（20年）	1,300,000,000	1,329,692,000
	67回 利付国庫債券（20年）	1,400,000,000	1,429,120,000
	70回 利付国庫債券（20年）	1,250,000,000	1,353,562,500
	72回 利付国庫債券（20年）	1,250,000,000	1,302,550,000
	73回 利付国庫債券（20年）	1,390,000,000	1,428,238,900
	75回 利付国庫債券（20年）	1,540,000,000	1,598,658,600
	78回 利付国庫債券（20年）	1,350,000,000	1,361,502,000
	81回 利付国庫債券（20年）	1,500,000,000	1,528,620,000
	83回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	1,856,016,000
	85回 利付国庫債券（20年）	1,650,000,000	1,698,741,000
	88回 利付国庫債券（20年）	1,700,000,000	1,796,339,000
	90回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	1,872,756,000
	92回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	1,844,226,000
	93回 利付国庫債券（20年）	1,000,000,000	1,007,810,000
	94回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	817,728,000
	95回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	1,891,512,000
	97回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	1,862,244,000
	99回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	1,833,768,000
	100回 利付国庫債券（20年）	2,000,000,000	2,064,960,000
	102回 利付国庫債券（20年）	1,900,000,000	2,018,427,000
	105回 利付国庫債券（20年）	2,100,000,000	2,128,833,000
	107回 利付国庫債券（20年）	2,100,000,000	2,126,145,000
	109回 利付国庫債券（20年）	2,100,000,000	2,056,236,000
	111回 利付国庫債券（20年）	2,500,000,000	2,565,150,000
	113回 利付国庫債券（20年）	800,000,000	806,800,000
国債証券計			294,587,771,000
地方債証券	582回 東京都公募公債	100,000,000	102,638,000
	583回 東京都公募公債	200,000,000	205,416,000
	585回 東京都公募公債	228,000,000	233,896,080
	588回 東京都公募公債	200,000,000	204,948,000
	589回 東京都公募公債	100,000,000	102,504,000
	595回 東京都公募公債	300,000,000	303,099,000
	600回 東京都公募公債	400,000,000	405,212,000
	602回 東京都公募公債	148,000,000	152,799,640
	611回 東京都公募公債	200,000,000	210,680,000
	612回 東京都公募公債	161,500,000	169,205,165
	614回 東京都公募公債	200,000,000	207,538,000
	616回 東京都公募公債	100,000,000	103,447,000
	617回 東京都公募公債	200,000,000	206,744,000
	619回 東京都公募公債	200,000,000	208,142,000
	620回 東京都公募公債	200,000,000	206,264,000

6 2 2 回	東京都公募公債	106,800,000	109,645,152
6 2 3 回	東京都公募公債	200,000,000	205,654,000
6 2 7 回	東京都公募公債	100,000,000	103,959,000
6 2 8 回	東京都公募公債	100,000,000	104,376,000
6 2 9 回	東京都公募公債	494,000,000	511,403,620
6 3 2 回	東京都公募公債	115,300,000	123,267,230
6 3 3 回	東京都公募公債	100,000,000	106,728,000
6 3 4 回	東京都公募公債	200,000,000	212,172,000
6 3 8 回	東京都公募公債	200,000,000	212,642,000
6 4 0 回	東京都公募公債	150,000,000	158,209,500
6 4 1 回	東京都公募公債	100,000,000	105,674,000
6 5 9 回	東京都公募公債	203,500,000	210,132,065
6 6 7 回	東京都公募公債	300,000,000	306,402,000
1 2 年度 3 回	北海道公募公債	100,000,000	101,611,000
1 3 年度 1 回	北海道公募公債	100,000,000	101,741,000
1 3 年度 2 回	北海道公募公債	100,000,000	101,865,000
1 5 年度 2 回	北海道公募公債	203,000,000	206,036,880
1 6 年度 1 1 回	北海道公募公債	100,000,000	102,075,000
1 8 年度 4 回	北海道公募公債	190,500,000	201,783,315
1 8 年度 6 回	北海道公募公債	100,000,000	106,534,000
1 9 年度 4 回	北海道公募公債	200,000,000	210,932,000
2 7 回 1 号	宮城県公募公債	125,820,000	128,667,306
1 1 8 回	神奈川県公募公債	145,090,000	147,845,259
1 2 5 回	神奈川県公募公債	100,000,000	103,230,000
1 2 6 回	神奈川県公募公債	178,870,000	185,457,782
1 2 7 回	神奈川県公募公債	100,000,000	105,151,000
1 2 8 回	神奈川県公募公債	100,000,000	103,788,000
1 3 0 回	神奈川県公募公債	156,200,000	161,326,484
1 3 5 回	神奈川県公募公債	200,000,000	208,618,000
1 3 6 回	神奈川県公募公債	100,000,000	103,710,000
2 3 回	神奈川県公募公債 5 年	100,000,000	101,791,000
2 4 6 回	大阪府公募公債	100,000,000	101,845,000
2 5 1 回	大阪府公募公債	110,100,000	111,879,216
2 5 2 回	大阪府公募公債	100,000,000	100,663,000
2 7 8 回	大阪府公募公債	200,000,000	204,008,000
2 8 5 回	大阪府公募公債	100,000,000	102,949,000
2 8 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	205,862,000
2 8 9 回	大阪府公募公債	200,000,000	209,496,000
2 9 3 回	大阪府公募公債	200,000,000	213,336,000
3 0 1 回	大阪府公募公債	100,000,000	104,604,000
3 1 0 回	大阪府公募公債	240,000,000	245,796,000
2 5 回	大阪府公募公債 5 年	200,000,000	203,978,000
2 6 回	大阪府公募公債 5 年	120,000,000	122,181,600
1 5 年度 3 回	京都府公募公債	219,300,000	227,192,607
1 6 年度 2 回	京都府公募公債	100,000,000	103,776,000
1 8 年度 1 回	京都府公募公債	100,000,000	104,695,000
1 4 年度 5 回	兵庫県公募公債	100,000,000	100,728,000
1 6 年度 8 回	兵庫県公募公債	111,500,000	117,325,875
1 7 年度 9 回	兵庫県公募公債	306,000,000	317,340,360
1 7 年度 1 0 回	兵庫県公募公債 5 年	100,000,000	100,556,000
1 7 年度 1 3 回	兵庫県公募公債	105,000,000	109,480,350
1 8 年度 1 回	兵庫県公募公債	120,000,000	125,851,200
1 8 年度 2 回	兵庫県公募公債 5 年	200,000,000	203,222,000
1 4 年度 3 回	静岡県公募公債	147,610,000	151,269,251

	15年度1回 静岡県公募公債	100,000,000	99,782,000	
	15年度3回 静岡県公募公債	116,130,000	119,808,998	
	18年度5回 静岡県公募公債	129,800,000	137,349,168	
	15年度1回 愛知県公募公債	303,600,000	313,218,048	
	17年度5回 愛知県公募公債 5年	155,000,000	156,052,450	
	18年度2回 愛知県公募公債	160,300,000	171,285,359	
	20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	102,656,000	
	13年度1回 広島県公募公債	100,000,000	102,289,000	
	16年度2回 広島県公募公債	200,000,000	207,522,000	
	14年度2回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,362,000	
	15年度3回 埼玉県公募公債	100,000,000	103,940,000	
	17年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	205,322,000	
	18年度1回 埼玉県公募公債	200,000,000	211,046,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	240,000,000	241,627,200	
	16年度3回 福岡県公募公債	131,040,000	134,654,083	
	17年度1回 福岡県公募公債	100,000,000	103,160,000	
	17年度5回 福岡県公募公債	100,000,000	103,695,000	
	18年度1回 福岡県公募公債	104,000,000	111,794,800	

[次へ](#)

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
	15年度4回 千葉県公募公債	100,000,000	103,189,000	
	16年度3回 千葉県公募公債	100,000,000	105,671,000	
	16年度8回 千葉県公募公債	200,000,000	205,518,000	
	17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	205,282,000	
	19年度5回 千葉県公募公債	100,000,000	105,355,000	
	13年度1回 新潟県公募公債	110,000,000	112,104,300	
	13年度1回 長野県公募公債	121,500,000	123,831,585	
	2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,194,000	
	3回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,782,000	
	8回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	415,928,000	
	9回 共同発行市場公募地方債	210,000,000	217,520,100	
	11回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,349,000	
	12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	134,183,400	
	18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,256,000	
	19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	135,552,300	
	20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,798,000	
	21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,834,000	
	23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,759,000	
	25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	313,822,240	
	28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,238,000	
	29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,318,000	
	31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,452,000	
	32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,600,000	
	33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,882,000	
	35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,558,000	
	36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,265,000	
	37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	158,328,000	
	38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	181,616,100	
	39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	155,072,440	
	40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	161,245,500	
	47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	170,192,272	
	55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,710,000	
	61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,950,000	
	65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,913,000	
	75回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,272,000	
	14年度3回 大阪市公募公債	146,500,000	149,509,110	
	14年度6回 大阪市公募公債	116,800,000	119,305,360	
	17年度3回 大阪市公募公債	100,000,000	101,808,000	
	17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	206,950,000	
	17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	103,404,000	
	18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	105,905,000	
	18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	159,825,000	
	19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	142,420,950	
	12回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,159,000	
	12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	370,817,060	
	17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	103,044,000	
	18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	107,699,283	
	13年度7回 神戸市公募公債	129,300,000	132,441,990	
	17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	106,761,560	
	13年度3回 横浜市公募公債	100,000,000	101,945,000	
	14年度1回 横浜市公募公債	100,000,000	102,590,000	

	14年度3回 横浜市公募公債	153,500,000	155,956,000
	14年度5回 横浜市公募公債	281,100,000	283,806,993
	16年度1回 横浜市公募公債	200,000,000	208,186,000
	17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	308,289,000
	14年度5回 札幌市公募公債	106,000,000	107,014,420
	14年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	100,588,000
	16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	103,815,000
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	101,232,000
	19回 川崎市公募公債 5年	100,000,000	103,105,000
	14年度2回 北九州市公募公債	100,000,000	101,504,000
	14年度1回 福岡市公募公債	200,000,000	204,836,000
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	105,315,000
	16年度1回 広島市公募公債	100,000,000	103,122,000
	14年度1回 仙台市公募公債	100,000,000	102,389,000
	16年度2回 千葉市公募公債	100,000,000	103,176,000
地方債証券計			25,213,020,006
特殊債券	4回 政保日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,868,000
	8回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	107,588,580
	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	129,816,060
	16回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,713,000
	7回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,650,000
	9回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,769,000
	13回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,960,000
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	212,852,000
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,944,000
	12回 日本道路・機構承継債	100,000,000	102,538,000
	34回 日本道路・機構承継債	200,000,000	208,386,000
	313回 政保道路債	220,000,000	225,812,400
	314回 政保道路債	200,000,000	203,582,000
	315回 政保道路債	300,000,000	302,394,000
	319回 政保道路債	132,000,000	133,921,920
	322回 政保道路債	106,000,000	110,044,960
	323回 政保道路債	200,000,000	207,688,000
	324回 政保道路債	200,000,000	206,894,000
	328回 政保道路債	200,000,000	207,954,000
	329回 政保道路債	100,000,000	104,455,000
	333回 政保道路債	300,000,000	313,758,000
	335回 政保道路債	237,000,000	245,503,560
	338回 政保道路債	264,000,000	274,945,440
	339回 政保道路債	301,000,000	311,902,220
	342回 政保道路債	100,000,000	101,146,000
	15回 高速道路機構債	400,000,000	427,660,000
	25回 高速道路機構債	300,000,000	314,613,000
	35回 高速道路機構債	100,000,000	103,167,000
	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	312,399,000
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	218,871,070
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,120,280
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,847,000
	10回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,138,000
	16回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	323,009,120
	17回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	130,951,140
	19回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,996,000
	21回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	175,000,000	185,381,000

	2 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,594,000
	2 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,810,000
	3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,333,000
	3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	312,105,420
	3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	366,222,400
	4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	352,121,110
	4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,168,000
	5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,924,000
	6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	165,802,140
	6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	413,426,990
	7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	607,416,000
	1 6 回 日本道路・機構承継債	230,000,000	233,369,500
	2 6 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	208,394,000
	5 回 公営企業債券	100,000,000	100,861,000
	7 9 6 回 政保公営企業債券	210,000,000	213,933,300
	7 9 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	203,802,000
	8 0 5 回 政保公営企業債券	200,000,000	204,148,000
	8 0 7 回 政保公営企業債券	100,000,000	102,214,000
	8 1 2 回 政保公営企業債券	230,000,000	236,338,800
	8 1 5 回 政保公営企業債券	204,000,000	209,508,000
	8 1 6 回 政保公営企業債券	365,000,000	375,052,100
	8 1 8 回 政保公営企業債券	107,000,000	109,769,160
	8 2 0 回 政保公営企業債券	200,000,000	205,356,000
	8 2 1 回 政保公営企業債券	405,000,000	413,513,100
	8 2 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	202,370,000
	8 2 4 回 政保公営企業債券	300,000,000	303,540,000
	8 2 8 回 政保公営企業債券	210,000,000	210,000,000
	8 2 9 回 政保公営企業債券	400,000,000	408,820,000
	8 3 2 回 政保公営企業債券	298,000,000	308,143,920
	8 3 4 回 政保公営企業債券	207,000,000	214,977,780
	8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	447,150,240
	8 3 8 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,947,000
	8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	104,085,000
	8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,194,000
	8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,152,000
	8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	271,854,990
	8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	309,117,000
	8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	209,024,520
	8 5 4 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,582,000
	8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,278,000
	8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	215,540,820
	8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	253,332,830
	8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	214,614,000
	8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	211,964,000
	8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,026,670
	8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	108,034,320
	8 7 5 回 政保公営企業債券	300,000,000	315,063,000
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	300,000,000	305,079,000
	4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	101,774,000
	6 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	200,844,000
	1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	311,610,000
	1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,498,000
	1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	308,472,000
	1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,135,000

20回	公営企業金融公庫債券	200,000,000	214,366,000
24回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	319,119,000
191回	政保首都高速道路債	113,000,000	119,094,090
142回	政保阪神高速道路債	100,000,000	103,549,000
148回	政保阪神高速道路債	107,000,000	110,108,350
5回	阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	104,753,000
162回	政保中小企業債券	126,000,000	128,624,580
171回	政保中小企業債券	161,000,000	163,877,070
173回	政保中小企業債券	100,000,000	101,170,000
176回	政保中小企業債券	100,000,000	104,137,000
180回	政保中小企業債券	142,000,000	149,697,820
185回	政保中小企業債券	200,000,000	201,908,000
186回	政保中小企業債券	104,000,000	107,061,760
10回	中小企業債券	100,000,000	101,044,000
15回	国際協力銀行債券	200,000,000	209,340,000
12回	国際協力銀行債券	200,000,000	208,006,000
2回	都市再生債券	100,000,000	106,432,000
19回	都市再生機構債券	200,000,000	212,050,000
2回	本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	104,828,000
36回	政保関西国際空港債	100,000,000	101,702,000
4回	政保中部国際空港債券	300,000,000	308,349,000
6回	政保中部国際空港債券	100,000,000	103,444,000
108回	政保預金保険機構債券	100,000,000	102,133,000
121回	政保預金保険機構債券	200,000,000	202,988,000
125回	政保預金保険機構債券	200,000,000	202,624,000
140回	政保預金保険機構債券	300,000,000	303,504,000
143回	政保預金保険機構債券	280,000,000	284,046,000
8回	政保住宅金融公庫債券	100,000,000	102,069,000
11回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	206,932,000
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	205,167,000	210,692,147
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	139,962,000	142,758,440
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	211,362,000	216,134,553
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	230,391,000	236,680,674
4回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	136,611,000	137,061,816
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,498,000	82,593,362
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	321,880,000	330,670,542
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	254,253,000	258,971,935
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	429,685,000	439,576,348
8回	政保国民生活債券	300,000,000	303,495,000
14回	政保国民生活債券	132,000,000	137,357,880
27回	国民生活金融公庫債券	200,000,000	205,272,000
8回	日本学生支援機構債	200,000,000	204,348,000
673号	利附商工債	100,000,000	101,971,000
674号	利附商工債	200,000,000	204,828,000
676号	利附商工債	100,000,000	101,930,000
678号	利附商工債	200,000,000	204,104,000
680号	利附商工債	110,000,000	112,525,600
683号	利附商工債	100,000,000	102,103,000
685号	利附商工債	100,000,000	102,719,000
691号	利附商工債	200,000,000	205,096,000
692号	利附商工債	200,000,000	203,864,000
704号	利附商工債	200,000,000	205,114,000
706号	利付商工債	300,000,000	307,686,000
667号	利附農林債	100,000,000	100,629,000

	671号 利附農林債	300,000,000	305,013,000
	672号 利附農林債	300,000,000	305,472,000
	673号 利附農林債	100,000,000	101,733,000
	675号 利附農林債	100,000,000	102,072,000
	677号 利附農林債	200,000,000	203,630,000
	681号 利附農林債	300,000,000	306,081,000
	684号 利附農林債	250,000,000	255,087,500
	688号 利附農林債	200,000,000	204,356,000
	694号 利附農林債	400,000,000	406,820,000
	698号 利附農林債	300,000,000	308,958,000
	701号 利附農林債	200,000,000	205,666,000
	577回 あおぞら債券（5年）	100,000,000	99,460,000
	194回 利附しんきん中金債	100,000,000	100,654,000
	195回 利附しんきん中金債	200,000,000	201,784,000
	196回 利附しんきん中金債	100,000,000	101,078,000
	200回 利附しんきん中金債	100,000,000	102,326,000
	203回 利附しんきん中金債	100,000,000	101,998,000
	204回 利附信金中金債	100,000,000	101,947,000
	208回 利附信金中金債	150,000,000	152,887,500
	210回 利附信金中金債	100,000,000	102,140,000
	215回 利附信金中金債	200,000,000	205,550,000
	222回 利附信金中金債	200,000,000	205,376,000
	226回 利附信金中金債	300,000,000	307,677,000
	229回 利附信金中金債	200,000,000	205,508,000
	233回 利附信金中金債	300,000,000	307,821,000
	236回 利附信金中金債	300,000,000	301,518,000
	677号 みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,593,000
	679号 みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,864,000
	97号 利附商工債（3年）	100,000,000	100,824,000
	108号 利附商工債（3年）	200,000,000	202,780,000
	1回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,711,650
	2回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,106,660
	4回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	177,950,900
	8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	182,325,000
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	312,702,000
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	208,726,000
	1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	210,376,650
	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	273,959,840
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	123,735,690
	2回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	316,242,000
特殊債券計			37,510,294,217
社債券	345回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,054,000
	12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	92,834,000
	4回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	99,795,000
	15回 シティグループ円貨社債	100,000,000	94,301,000
	22回 シティグループ円貨社債	200,000,000	185,830,000
	7回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	97,769,000
	1回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,415,000
	20回 王子製紙社債	100,000,000	101,739,000
	25回 住友化学工業社債	100,000,000	103,103,000
	25回 三菱化学社債	100,000,000	102,739,000
	34回 三井化学社債	100,000,000	101,905,000
	2回 花王社債	100,000,000	104,465,000

19回	新日本石油社債	100,000,000	102,721,000
8回	旭硝子社債	100,000,000	99,893,000
48回	新日本製鐵社債	100,000,000	101,705,000
52回	新日本製鐵社債	100,000,000	103,731,000
4回	神戸製鋼所社債	100,000,000	105,333,000
11回	豊田自動織機社債	100,000,000	101,530,000
12回	日立製作所社債	100,000,000	99,126,000
23回	富士通社債	100,000,000	100,327,000
7回	パナソニック社債	100,000,000	102,592,000
19回	ソニー社債	100,000,000	102,695,000
4回	デンソー社債	100,000,000	101,486,000
15回	三菱重工業社債	100,000,000	101,162,000
6回	トヨタ自動車社債	200,000,000	204,360,000
7回	トヨタ自動車社債	300,000,000	307,308,000
45回	三井物産社債	100,000,000	100,260,000
29回	住友商事社債	100,000,000	102,317,000
16回	三菱商事社債	100,000,000	109,201,000
14回	クレディセゾン社債	100,000,000	91,453,000
12回	三菱UFJフィナンシャルG社債	100,000,000	101,144,000
1回	みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	207,856,000
3回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,782,000
6回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,468,000
9回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,722,000
11回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,810,000
13回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	102,404,000
15回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,320,000
2回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,294,000
29回	東京三菱銀行社債	200,000,000	203,774,000
82回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	101,660,000
84回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	203,816,000
92回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	205,476,000
100回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	205,204,000
3回	2号 三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	200,000,000	202,176,000
3回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	208,180,000
6回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	102,590,000
8回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	101,798,000
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	100,000,000	105,158,000
5回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,626,000
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	101,111,000
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	103,823,000
37回	三井住友銀行社債	200,000,000	203,830,000
45回	三井住友銀行社債	200,000,000	203,942,000
6回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,510,000
7回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,712,000
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,286,000
1回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,072,000
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	104,627,000
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	101,800,000
14回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	101,225,000
18回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	203,492,000
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	105,547,000
23回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	105,065,000
26回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	102,048,000
39回	アコム社債	100,000,000	85,825,000

106回	オリックス社債	100,000,000	97,931,000
115回	オリックス社債	100,000,000	93,612,000
118回	オリックス社債	100,000,000	83,444,000
6回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	100,007,000
9回	野村ホールディングス社債	100,000,000	100,716,000
3回	野村ホールディングス社債	100,000,000	100,380,000
24回	三井不動産社債	100,000,000	102,716,000
53回	三菱地所社債	100,000,000	102,517,000
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	107,342,000
18回	京王電鉄社債	100,000,000	106,344,000
2回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	242,970,000
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,181,000
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,295,000
25回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	302,373,000
31回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,915,000
35回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	202,428,000
41回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,950,000
3回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,584,000
10回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,495,000
1回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	117,029,000
2回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	237,850,000
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,644,000
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	193,796,200
19回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,544,000
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,174,000
43回	日本電信電話社債	200,000,000	203,628,000
44回	日本電信電話社債	100,000,000	102,356,000
47回	日本電信電話社債	400,000,000	404,248,000
48回	日本電信電話社債	400,000,000	416,664,000
50回	日本電信電話社債	100,000,000	104,004,000
2回	KDDI社債	100,000,000	101,478,000
8回	NTTドコモ社債	100,000,000	101,484,000
16回	NTTドコモ社債	200,000,000	204,440,000
441回	東京電力社債	200,000,000	228,858,000
455回	東京電力社債	200,000,000	212,704,000
457回	東京電力社債	100,000,000	106,102,000
473回	東京電力社債	300,000,000	312,669,000
487回	東京電力社債	500,000,000	510,545,000
489回	東京電力社債	300,000,000	306,117,000
491回	東京電力社債	217,000,000	222,260,080
493回	東京電力社債	500,000,000	513,025,000
495回	東京電力社債	200,000,000	205,164,000
496回	東京電力社債	300,000,000	308,103,000
498回	東京電力社債	300,000,000	305,421,000
501回	東京電力社債	200,000,000	202,526,000
502回	東京電力社債	200,000,000	202,784,000
505回	東京電力社債	100,000,000	100,744,000
507回	東京電力社債	300,000,000	309,966,000
510回	東京電力社債	200,000,000	206,208,000
511回	東京電力社債	100,000,000	104,143,000
514回	東京電力社債	300,000,000	312,033,000
515回	東京電力社債	200,000,000	206,596,000
516回	東京電力社債	100,000,000	103,232,000
517回	東京電力社債	100,000,000	102,843,000

518回	東京電力社債	300,000,000	308,496,000
519回	東京電力社債	372,000,000	387,318,960
522回	東京電力社債	300,000,000	321,096,000
527回	東京電力社債	500,000,000	518,045,000
535回	東京電力社債	500,000,000	522,300,000
536回	東京電力社債	200,000,000	207,084,000
541回	東京電力社債	500,000,000	509,245,000
542回	東京電力社債	500,000,000	513,670,000
407回	中部電力社債	100,000,000	114,296,000
409回	中部電力社債	300,000,000	356,838,000
457回	中部電力社債	100,000,000	102,076,000
460回	中部電力社債	200,000,000	203,794,000
462回	中部電力社債	100,000,000	101,166,000
463回	中部電力社債	200,000,000	201,730,000
467回	中部電力社債	100,000,000	103,849,000
468回	中部電力社債	100,000,000	103,296,000
471回	中部電力社債	300,000,000	307,668,000
476回	中部電力社債	100,000,000	106,908,000
478回	中部電力社債	100,000,000	105,881,000
480回	中部電力社債	200,000,000	210,128,000
484回	中部電力社債	200,000,000	206,498,000
410回	関西電力社債	300,000,000	316,983,000
427回	関西電力社債	100,000,000	103,293,000
429回	関西電力社債	200,000,000	205,596,000
431回	関西電力社債	100,000,000	102,608,000
432回	関西電力社債	300,000,000	307,572,000
433回	関西電力社債	100,000,000	102,685,000
441回	関西電力社債	200,000,000	206,878,000
298回	中国電力社債	200,000,000	235,774,000
310回	中国電力社債	200,000,000	230,962,000
334回	中国電力社債	112,000,000	114,289,280
337回	中国電力社債	219,000,000	224,534,130
341回	中国電力社債	100,000,000	103,866,000
350回	中国電力社債	200,000,000	208,050,000
245回	北陸電力社債	200,000,000	232,764,000
260回	北陸電力社債	100,000,000	107,956,000
264回	北陸電力社債	100,000,000	101,692,000
281回	北陸電力社債	100,000,000	105,818,000
368回	東北電力社債	300,000,000	354,723,000
375回	東北電力社債	100,000,000	115,837,000
380回	東北電力社債	300,000,000	351,570,000
401回	東北電力社債	100,000,000	101,711,000
405回	東北電力社債	100,000,000	102,065,000
408回	東北電力社債	100,000,000	102,582,000
411回	東北電力社債	200,000,000	204,300,000
420回	東北電力社債	100,000,000	102,907,000
427回	東北電力社債	200,000,000	206,336,000
432回	東北電力社債	500,000,000	535,970,000
249回	四国電力社債	200,000,000	205,008,000
257回	四国電力社債	200,000,000	206,128,000
358回	九州電力社債	100,000,000	101,746,000
369回	九州電力社債	300,000,000	305,781,000
374回	九州電力社債	300,000,000	310,296,000
382回	九州電力社債	100,000,000	103,348,000

	383回 九州電力社債	100,000,000	103,439,000	
	387回 九州電力社債	200,000,000	209,308,000	
	257回 北海道電力社債	200,000,000	236,616,000	
	282回 北海道電力社債	200,000,000	206,416,000	
	284回 北海道電力社債	500,000,000	516,845,000	
	286回 北海道電力社債	100,000,000	103,831,000	
	7回 沖縄電力社債	100,000,000	102,785,000	
	2回 電源開発社債	100,000,000	103,610,000	
	4回 電源開発社債	200,000,000	205,220,000	
	6回 電源開発社債	100,000,000	103,668,000	
	14回 電源開発社債	100,000,000	103,726,000	
	17回 電源開発社債	100,000,000	106,915,000	
	24回 東京瓦斯社債	200,000,000	206,172,000	
	9回 大阪ガス社債	100,000,000	113,282,000	
	20回 NTTデータ社債	100,000,000	101,656,000	
社債券計			33,275,404,650	
合計			390,586,489,873	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年11月5日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	1,623,544,953円
負債総額	481,824円
純資産総額（ - ）	1,623,063,129円
発行済数量	1,617,330,301口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0035円

(参考) マザーファンドの現況

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年11月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	400,992,755,256円
負債総額	747,275,000円
純資産総額(-)	400,245,480,256円
発行済数量	369,906,332,457口
1口当たり純資産額(/)	1.0820円

第5【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	1,426,930,490	6,369,726

(注1)本邦外における設定及び解約はございません。

(注2)設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

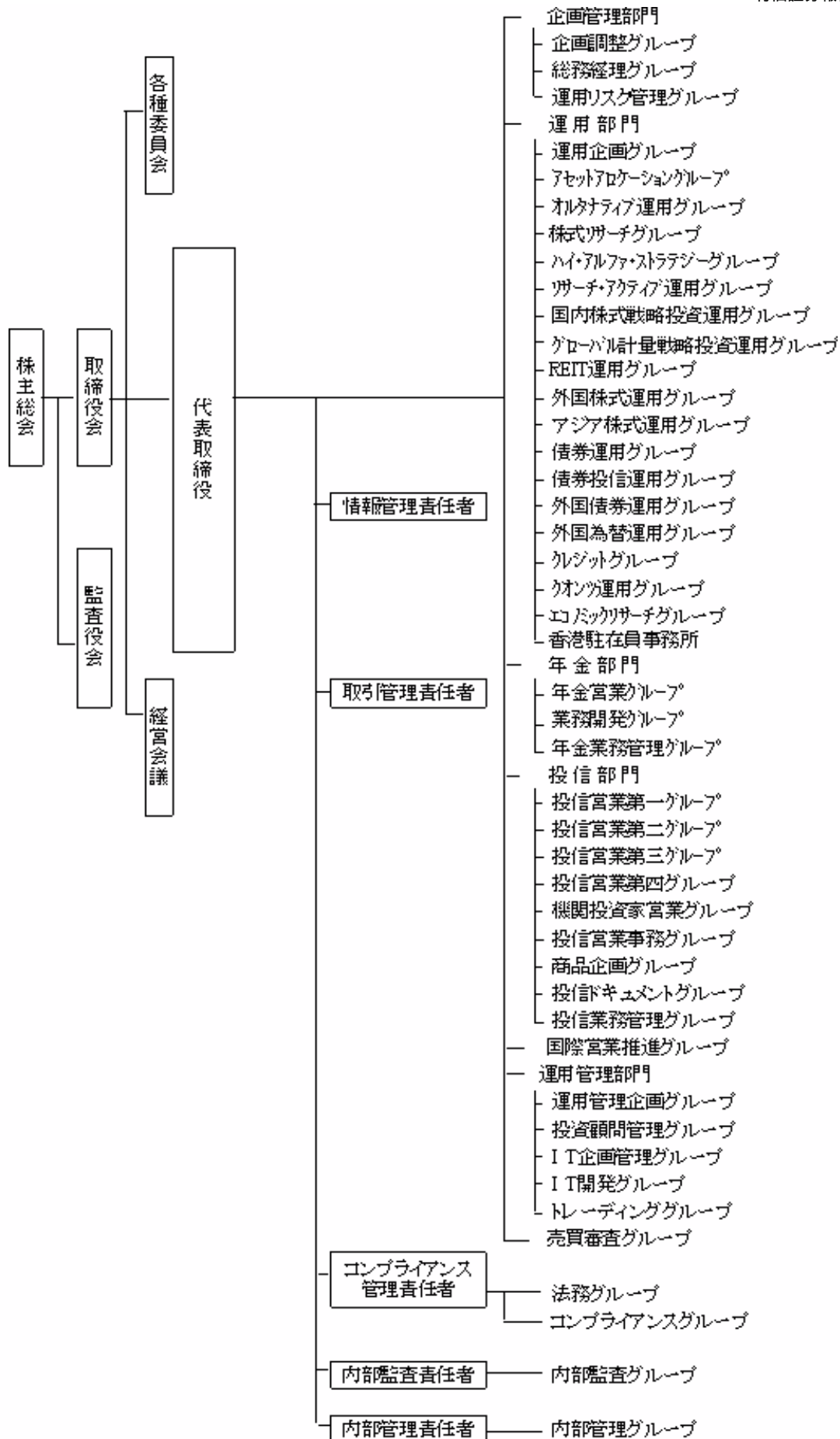
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成21年10月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

会社の意思決定機構

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

取締役会は、代表取締役を選任し、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、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決します。

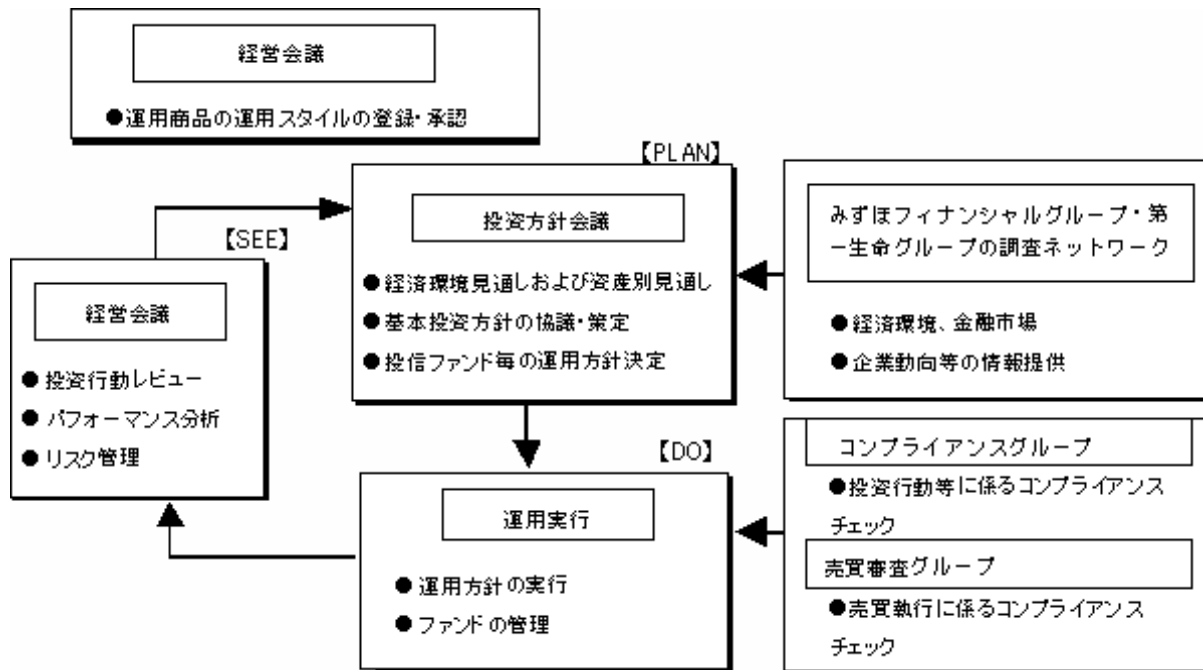
投資運用の意思決定機構

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登録および承認は、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、委員長は社長とします。

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回の経営会議において、検討・評価されます。



上記体制は平成21年10月30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】

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

平成21年10月30日現在、委託会社の運用する投資信託は262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	19	107,445,051,535
追加型株式投資信託	228	3,829,006,127,029
単位型公社債投資信託	14	120,567,013,031
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	1,746,219,601
合計	262	4,058,764,411,196

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）または「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）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20年8月7日内閣府令第50号）附則第2条により改正前の財務諸表等規則に基づき作成しております。

2．財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第23期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）の財務諸表について、新日本監査法人の監査を受け、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21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。

なお、新日本有限責任監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成20年7月1日をもって新日本監査法人から名称変更しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第23期 (平成20年3月31日現在)		第24期 (平成21年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金・預金		13,267,152		12,558,999
前払費用		64,301		54,242
未収委託者報酬		3,423,783		2,254,741
未収運用受託報酬		-		1,046,291
未収投資助言報酬		-	2	252,337
未収収益	2	1,933,135		197,045
未収消費税等		-		98,402
繰延税金資産		553,910		369,826
その他		43,115		23,865
流動資産計		19,285,400		16,855,752
固定資産				
有形固定資産		488,486		501,481
建物	1	335,163	1	283,511
器具備品	1	153,323	1	201,169
建設仮勘定		-		16,799
無形固定資産		616,621		721,812
商標権	1	2,104	1	1,335
ソフトウェア	1	606,677	1	555,121
ソフトウェア仮勘定		-		157,595
電話加入権		7,148		7,148
電話施設利用権	1	691	1	611
投資その他の資産		5,842,772		4,051,090
投資有価証券		3,097,362		498,041
関係会社株式		1,261,144		1,661,144
繰延税金資産		233,849		442,390
長期差入保証金		1,194,310		1,169,961
その他		83,032		306,478
貸倒引当金		26,925		26,925
固定資産計		6,947,880		5,274,384
資産合計		26,233,280		22,130,137

（単位：千円）

	第23期 （平成20年3月31日現在）	第24期 （平成21年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	162,809	37,445
未払金	2,186,170	1,293,636
未払収益分配金	8,470	8,201
未払償還金	50,930	48,993
未払手数料	1,527,000	931,529
その他未払金	599,769	304,912
未払費用	2 1,653,424	2 1,040,620
未払法人税等	2,575,999	179,557
未払消費税等	316,821	-
賞与引当金	687,832	618,303
その他	-	20,741
流動負債計	7,583,058	3,190,304
固定負債		
役員退職慰労引当金	179,237	145,732
退職給付引当金	334,280	404,437
固定負債計	513,518	550,169
負債合計	8,096,577	3,740,474
（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	13,718,238	13,962,732
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	7,040,000	10,040,000
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	6,054,944	3,299,438
株主資本合計	18,146,716	18,391,210
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	10,012	1,547
評価・換算差額等合計	10,012	1,547
純資産合計	18,136,703	18,389,662
負債・純資産合計	26,233,280	22,130,137

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	32,833,957		24,552,133	
顧問料	6,804,888		-	
運用受託報酬	-		4,509,994	
投資助言報酬	-		1,228,096	
その他営業収益	863,734		697,007	
営業収益計		40,502,581		30,987,232
営業費用				
支払手数料	14,748,737		10,967,681	
広告宣伝費	830,858		488,151	
公告費	3,293		-	
受益証券発行費	2,167		-	
調査費	6,268,709		5,076,631	
調査費	2,415,829		2,506,175	
委託調査費	3,852,880		2,570,455	
委託計算費	345,695		325,174	
営業雑経費	1,143,457		812,013	
通信費	33,290		35,872	
印刷費	1,041,499		732,985	
協会費	22,173		25,313	
諸会費	41		41	
支払販売手数料	46,452		17,800	
営業費用計		23,342,919		17,669,652
一般管理費				
給料	4,082,147		4,587,983	
役員報酬	1 223,147		1 234,353	
給料・手当	3,258,097		3,647,502	
賞与	600,902		706,127	
交際費	44,264		44,085	
寄付金	4,010		4,462	
旅費交通費	309,129		308,237	
租税公課	103,549		82,762	
不動産賃借料	754,728		801,086	
退職給付費用	88,449		106,223	
固定資産減価償却費	337,808		330,412	
福利厚生費	23,757		22,556	
修繕費	16,394		6,755	
賞与引当金繰入	687,832		618,303	
役員退職慰労引当金繰入	60,123		42,570	
役員退職金	528		13,175	
機器リース料	1,207		973	
事務委託費	279,797		247,087	
消耗品費	76,448		84,099	
器具備品費	10,563		6,094	
諸経費	204,099		177,386	
一般管理費計		7,084,837		7,484,253
営業利益		10,074,823		5,833,325

（単位：千円）

	第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）		第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		92,575		4,558
受取利息		59,127		59,458
時効成立分配金		298		164
為替差益		14,223		-
雑収入		7,064		5,482
先物利益		-		180,422
営業外収益計		173,289		250,086
営業外費用				
為替差損		-		24,553
時効成立後支払分配金		557		517
投資信託解約損		109,677		38,254
営業外費用計		110,234		63,325
経常利益		10,137,878		6,020,086
特別利益				
関係会社株式売却益		39,215		-
貸倒引当金戻入益		123		-
特別利益計		39,338		-
特別損失				
固定資産除却損	2	10,466	2	14,476
ゴルフ会員権売却損		5,200		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,000
投資有価証券評価損		-		484,009
退職給付費用		106,395		-
特別損失計		122,062		504,485
税引前当期純利益		10,055,154		5,515,600
法人税、住民税及び事業税		4,252,414		2,301,373
法人税等調整額		172,622		30,266
法人税等合計		4,079,792		2,271,106
当期純利益		5,975,362		3,244,494

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

		第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
株主資本			
	資本金		
	前期末残高	2,000,000	2,000,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,000,000	2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	前期末残高	2,428,478	2,428,478
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,428,478	2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	前期末残高	123,293	123,293
	当期変動額	-	-
	当期末残高	123,293	123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	前期末残高	4,640,000	7,040,000
	当期変動額	2,400,000	3,000,000
	当期末残高	7,040,000	10,040,000
	研究開発積立金		
	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
	運用責任準備積立金		
	前期末残高	200,000	200,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	200,000	200,000
	繰越利益剰余金		
	前期末残高	4,843,582	6,054,944
	当期変動額		
	剰余金の配当	2,364,000	3,000,000
	別途積立金の積立	2,400,000	3,000,000
	当期純利益	5,975,362	3,244,494
	当期末残高	6,054,944	3,299,438
	株主資本合計		
	前期末残高	14,535,353	18,146,716
	当期変動額	3,611,362	244,494
	当期末残高	18,146,716	18,391,210
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	前期末残高	992	10,012
	当期変動額(純額)	11,004	8,464
	当期末残高	10,012	1,547
純資産合計			
	前期末残高	14,536,346	18,136,703
	当期変動額	3,600,357	252,958
	当期末残高	18,136,703	18,389,662

[次へ](#)

重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：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</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 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。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正法人税法に規定する方法により減価償却費を計上しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(追加情報) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年3月31日以前に取得した有形固定資産については、償却可能限度額まで償却が終了した翌事業年度から、残存簿価を5年間で均等償却しております。 なお、これにより営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p>

<p style="text-align: center;">第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更)</p> <p>従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用していましたが、当事業年度末から原則法に変更いたしました。</p> <p>この変更は、従業員数の増加に伴い、退職給付債務の数理計算に用いられる基礎率の推定について一定の有効性が確保されることによって、原則法による計算の結果に一定の高い水準の信頼性が得られたことから、退職給付費用の期間損益計算をより適正化するために行ったものであります。</p> <p>この変更に伴い、当事業年度末における簡便法と原則法により計算した退職給付債務の差額106,395千円を特別損失に計上しております。この結果、従来と同一の方法によった場合と比較して、税引前当期純利益は106,395千円減少しております。</p> <p>なお、上記に記載の通り退職給付債務の算定方法の変更が当事業年度末に行われたため、当中間会計期間は従来の方によっております。したがって、当中間会計期間は、当事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>6. リース取引の処理方法</p> <p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法</p> <p>税抜方式によっております。</p>	<p>5. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>(3) 同左</p> <p>(4) 同左</p> <p>6. リース取引の処理方法</p> <p>所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法</p> <p>同左</p>

会計方針の変更

第23期（平成20年3月31日現在）	第24期（平成21年3月31日現在）
	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当事業年度における貸借対照表および損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>

表示方法の変更

第23期（平成20年3月31日現在）	第24期（平成21年3月31日現在）
<p>金融商品取引業等に関する内閣府令が制定されたことに伴い、以下のとおり表示方法を変更しております。</p> <p>（貸借対照表） 前事業年度において区分掲記していた「現金」および「預金」は、当事業年度から「現金・預金」として表示しております。なお、当事業年度末における「現金」および「預金」の金額はそれぞれ1,205千円、13,265,946千円であります。</p> <p>（損益計算書） 前事業年度において区分掲記していた「法人税等」は当事業年度から「法人税、住民税及び事業税」として表示しております。</p>	<p>（貸借対照表）</p> <ol style="list-style-type: none"> 前事業年度において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当事業年度から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前事業年度末における「未収運用受託報酬」の金額は1,299,666千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は369,475千円であります。 前事業年度において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は31,213千円であります。 <p>（損益計算書） 前事業年度において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」の金額は4,929,946千円であり、「投資助言報酬」の金額は1,874,941千円であります。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

第23期（平成20年3月31日現在）			第24期（平成21年3月31日現在）		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物	373,021千円		建物	426,679千円	
器具備品	229,532千円		器具備品	290,397千円	
商標権	5,582千円		商標権	6,351千円	
ソフトウェア	653,371千円		ソフトウェア	648,713千円	
電話施設利用権	905千円		電話施設利用権	985千円	
2. 関係会社項目			2. 関係会社項目		
関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。			関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。		
流動資産	未収収益	379,257千円	流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円
流動負債	未払費用	641,087千円	流動負債	未払費用	345,744千円

（損益計算書関係）

第23期 （自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	第24期 （自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
1. 役員報酬の限度額	1. 役員報酬の限度額
取締役 年額250,000千円	同左
監査役 年額 50,000千円	
2. 固定資産除却損の内訳	2. 固定資産除却損の内訳
建物 3,634千円	建物 2,251千円
器具備品 5,271千円	器具備品 9,818千円
ソフトウェア 1,560千円	ソフトウェア 2,406千円

（株主資本等変動計算書関係）

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29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20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

(リース取引関係)

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)				第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)			
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額相当額	29,608千円	-	29,608千円	減価償却累計額相当額	52,335千円	-	52,335千円
期末残高相当額	60,993千円	-	60,993千円	期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料 期末残高相当額	22,595千円	39,602千円	62,197千円	未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額			
支払リース料		25,173千円		支払リース料		24,096千円	
減価償却費相当額		20,191千円		減価償却費相当額		22,727千円	
支払利息相当額		1,754千円		支払利息相当額		1,501千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2.オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。				2.オペレーティング・リース取引 同左			

（有価証券関係）

第23期（平成20年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
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）	3,031,000	3,014,115	16,884
小計	3,031,000	3,014,115	16,884
合計	3,031,000	3,014,115	16,884

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
574,322	3,196	112,873

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 83,246千円

8. その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的の債券の今後の償還予定額

該当事項はありません。

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	146,101	146,101	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	271,802	269,192	2,610
小計	417,904	415,294	2,610
合計	417,904	415,294	2,610

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
3,021,000	20,615	58,869

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 82,746千円

8. その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的の債券の今後の償還予定額

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第23期（平成20年3月31日現在）

1．取引の状況に関する事項

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を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。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替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。
(5)取引に係るリスク管理体制	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。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2．取引の時価等に関する事項

区分	種類	第23期(平成20年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	523,028	-	508,267	14,760
	合計	523,028	-	508,267	14,760

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 取引の状況に関する事項

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引及び株価指数先物取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を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。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスク及び株価変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	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。
(5)取引に係るリスク管理体制	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。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2. 取引の時価等に関する事項

(1) 通貨関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	24,432	-	24,960	528
	香港ドル	34,020	-	34,412	392
	豪ドル	77,510	-	78,736	1,226
	シンガポールドル	12,564	-	12,672	107
	合計	148,527	-	150,782	2,255

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	212,667	-	230,215	17,547
	合計	212,667	-	230,215	17,547

(注2) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

（退職給付関係）

第23期（平成20年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

当社は、当事業年度末から原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成20年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		334,280
	退職給付引当金		334,280
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		165,213
	確定拠出年金	拠出額	29,631
	退職給付費用		194,844

3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

		第23期 (平成20年3月31日)
(1)	割引率(%)	1.5
(2)	退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準

第24期（平成21年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

当社は、原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成21年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		431,448
	未認識数理計算上の差異		27,011
	退職給付引当金		404,437
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		71,958
	確定拠出年金	拠出額	34,264
	退職給付費用		106,223

3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

		第24期 (平成21年3月31日)
(1)	割引率(%)	1.5
(2)	退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3)	数理計算上の差異の処理年数(年)	5

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第23期	第24期
	(平成20年3月31日現在)	(平成21年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	197,866	19,218
未払事業所税	5,714	6,269
賞与引当金	279,947	251,649
未払法定福利費	27,884	27,146
未払確定拠出年金掛金	2,610	2,667
減価償却超過額	-	7,579
減価償却超過額（一括償却資産）	10,139	8,559
繰延資産償却超過額（税法上）	27,940	46,274
その他（未払金等）	1,807	461
退職給付引当金	136,052	164,605
役員退職慰労引当金	72,949	59,313
ゴルフ会員権評価損	3,135	5,577
投資有価証券評価損	-	196,991
貸倒引当金繰入額	14,840	14,840
その他有価証券評価差額金	6,871	1,062
繰延税金資産合計	<u>787,759</u>	<u>812,216</u>
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	<u>-</u>	<u>-</u>
差引繰延税金資産の純額	<u>787,759</u>	<u>812,216</u>

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

第23期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第24期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（関連当事者との取引）

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名， 出向3名， 転籍2名	資産の運用および 助言、当社 設定投信の 販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	833,702	未収 収益	219,740
								販売手数料 の支払	46,452	-	-
								保険料の支 払	5,707	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注2）支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	（所有）直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	1,096,514	未払費用	456,913
	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	466,450	未払費用	184,052

取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を助案した個別契約により決定しております。
- （注2）上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
兄弟会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田区	6,500 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の販 売代行手数料	2,104,660	未払 手数料	145,839
	株式会社 みずほコーポ レート銀行	東京都 千代田区	10,709 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の販 売代行手数料	739,368	未払 手数料	137,112
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の 運用	当社預り資産 の運用の顧問 料の支払 業務委託料の 支払	340,983 16,800	未払 費用 -	 -

取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

（追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に対し、重要な追加はありません。

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
法人主要株主	第一生命 保険相互 会社	東京都 千代田 区	4,200億円 （基金およ び基金償却 積立金）	生命保 険業	（被所有） 直接50%	兼務 1名、 出向 3名、 転籍 2名	資産の運 用および 助言、当 社設定投 信の販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	718,870	未収投資 助言報酬	172,117
								販売手数料の 支払	17,800	-	-
								保険料の支払	5,828	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注2) 支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- (注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	933,784	未払費用	236,518
	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	324,748	未払費用	109,093

取引条件およ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) 上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
兄弟会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	6,500億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	1,531,236	未払手数料	96,917
								預金の引出(純額)	300,370	現金・預金	322,365
								受取利息	894	未収収益	-
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	10,709億円	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	701,162	未払手数料	91,628
								預金の引出(純額)	1,034,219	現金・預金	11,438,676
								受取利息	55,734	未収収益	4,158
みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	-	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	299,054	未払費用	117,438	
							業務委託料の支払	17,550	未払費用	2,677	

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（1株当たり情報）

第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）
1株当たり純資産額 755,695円99銭 1株当たり当期純利益金額 248,973円42銭	1株当たり純資産額 766,235円93銭 1株当たり当期純利益金額 135,187円25銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）
当期純利益	5,975,362千円	3,244,494千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,975,362千円	3,244,494千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）
平成20年3月28日開催の取締役会の決議により、平成20年4月1日付にて100%出資の子会社DIAM SINGAPORE PTE.LTD.を設立し、その後、平成20年4月14日付にて株主割当増資を実施いたしました。 （出資の総額400,000千円、資本金400,000千円）	平成21年2月13日開催の臨時取締役会の決議により平成21年3月19日に設立した100%出資の子会社DIAM Asset Management (HK)Limitedに対して、平成21年4月9日に資本金の払込みを実施いたしました。 当該子会社の設立は、運用・営業両面においてビジネス機会の広がる中国圏での業容拡大や、当社におけるアジア株関連商品の営業強化などを主な目的とするものです。 <子会社の概要> 商 号：DIAM Asset Management(HK)Limited 主な事業内容：資産運用業務 設 立 年 月 日：平成21年3月19日 資 本 金：500,000千円 発行済株式総数：500,000株 出 資 の 総 額：500,000千円 出 資 比 率：当社100%

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更
当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

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】

(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21年3月末日現在 247,231百万円
- c. 事業の内容
日本において信託銀行業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

(平成21年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
水戸証券株式会社	12,272	「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。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間の間に、書類を提出していません。

独立監査人の監査報告書

平成21年11月11日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内債券パッシブ・ファンドの平成21年1月30日から平成21年10月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M国内債券パッシブ・ファンドの平成21年10月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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。

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

以 上

上記は、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。

財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月29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	山本禎良	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内正彦	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20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成20年6月13日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 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19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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