

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成25年10月11日

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 中島 敬雄

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 大楽 信雄

【電話番号】 03-3287-3110

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）  
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）  
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

愛称として「宝船」という名称を用いる場合があります。

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）  
200億円を上限とします。  
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）  
200億円を上限とします。  
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）  
200億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

半期報告書の提出に伴い、平成25年3月27日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

**2【訂正の内容】**

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

**第二部【ファンド情報】****第1【ファンドの状況】****1【ファンドの性格】****(3)【ファンドの仕組み】**

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成25年1月31日現在）

( 略 )

大株主の状況

(平成25年1月31日現在)

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

&lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成25年7月31日現在）

( 略 )

大株主の状況

(平成25年7月31日現在)

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

**2【投資方針】****(3)【運用体制】**

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

上記体制は平成25年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

&lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

上記体制は平成25年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

上記体制は平成25年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

上記体制は平成25年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 4【手数料等及び税金】

#### (3)【信託報酬等】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (3) 信託報酬等」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興国10)	ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.33075% <sup>*</sup> (税抜0.315%) *消費税率が8%になった場合は、年率0.3402%となります。 <table border="1" data-bbox="700 1088 1383 1294"> <thead> <tr> <th colspan="2">信託報酬の配分(税抜)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率0.155%</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率0.125%</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率0.035%</td> </tr> </tbody> </table>	信託報酬の配分(税抜)		委託会社	年率0.155%	販売会社	年率0.125%	受託会社	年率0.035%
信託報酬の配分(税抜)									
委託会社	年率0.155%								
販売会社	年率0.125%								
受託会社	年率0.035%								
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興国20)	ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.36225% <sup>*</sup> (税抜0.345%) *消費税率が8%になった場合は、年率0.3726%となります。 <table border="1" data-bbox="700 1440 1383 1644"> <thead> <tr> <th colspan="2">信託報酬の配分(税抜)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率0.17%</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率0.14%</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率0.035%</td> </tr> </tbody> </table>	信託報酬の配分(税抜)		委託会社	年率0.17%	販売会社	年率0.14%	受託会社	年率0.035%
信託報酬の配分(税抜)									
委託会社	年率0.17%								
販売会社	年率0.14%								
受託会社	年率0.035%								
DIAM DC 8資産 バランスファンド(新興国30)	ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.39375% <sup>*</sup> (税抜0.375%) *消費税率が8%になった場合は、年率0.405%となります。 <table border="1" data-bbox="700 1778 1383 1975"> <thead> <tr> <th colspan="2">信託報酬の配分(税抜)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率0.185%</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率0.155%</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率0.035%</td> </tr> </tbody> </table>	信託報酬の配分(税抜)		委託会社	年率0.185%	販売会社	年率0.155%	受託会社	年率0.035%
信託報酬の配分(税抜)									
委託会社	年率0.185%								
販売会社	年率0.155%								
受託会社	年率0.035%								

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日(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。

### (5)【課税上の取扱い】

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

#### <更新・訂正後>

ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

確定拠出年金の加入者におかれましては、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

なお、上記以外の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

#### 個人の受益者に対する課税

時 期	項 目	税 金
分配時	所得税、復興特別所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して10.147%
換金（解約）時および償還時	所得税、復興特別所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して10.147%

税金は表に記載の時期に適用されます。

上記の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

上記税率は平成25年12月31日まで適用されるものであり、平成26年1月1日以降は20.315%の税率となる予定です。

#### 法人の受益者に対する課税

平成25年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

上記税率は平成25年12月31日まで適用されるものであり、平成26年1月1日以降は15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率となる予定です。

#### 益金不算入制度、配当控除の適用

益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

上記は、平成25年7月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、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>

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

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

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

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

#### <収益分配金の課税について>

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	93,287,306	95.99
内 日本	93,287,306	95.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,898,352	4.01
純資産総額	97,185,658	100.00

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	87,062,885	96.98
内 日本	87,062,885	96.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,708,471	3.02
純資産総額	89,771,356	100.00

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	103,595,209	97.97
内 日本	103,595,209	97.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,147,905	2.03
純資産総額	105,743,114	100.00

（参考）マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	300,873,396,304	94.88
内 日本	300,873,396,304	94.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	16,250,071,151	5.12
純資産総額	317,123,467,455	100.00

## その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	15,070,445,000	4.75
内 日本	15,070,445,000	4.75

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	354,066,140,800	78.96
内 日本	354,066,140,800	78.96
地方債証券	30,126,460,004	6.72
内 日本	30,126,460,004	6.72
特殊債券	31,767,663,692	7.08
内 日本	31,767,663,692	7.08
社債券	30,308,601,400	6.76
内 日本	30,308,601,400	6.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,122,157,574	0.47
純資産総額	448,391,023,470	100.00

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	10,658,997,500	98.59
内 日本	10,658,997,500	98.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	152,811,400	1.41
純資産総額	10,811,808,900	100.00

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	298,741,681,825	95.92
内 アメリカ	178,854,858,016	57.42
内 ユーロ	39,530,973,730	12.69
内 イギリス	29,705,301,145	9.54
内 カナダ	14,111,868,809	4.53
内 スイス	12,453,627,262	4.00
内 オーストラリア	9,993,943,730	3.21
内 スウェーデン	4,476,858,455	1.44
内 香港	4,009,859,989	1.29
内 シンガポール	2,081,682,482	0.67
内 デンマーク	1,588,310,247	0.51
内 ノルウェー	1,149,601,375	0.37
内 イスラエル	653,590,346	0.21
内 ニュージーランド	131,206,239	0.04



投資信託受益証券		998,838,027	0.32
	内 オーストラリア	876,896,665	0.28
	内 シンガポール	121,941,362	0.04
投資証券		5,634,153,694	1.81
	内 アメリカ	4,635,950,649	1.49
	内 ユーロ	387,578,225	0.12
	内 イギリス	357,860,686	0.11
	内 香港	136,038,100	0.04
	内 カナダ	116,726,034	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,083,911,092	1.95
純資産総額		311,458,584,638	100.00

## その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	365,555,000	0.12
	内 日本	365,555,000
為替予約取引（売建）	78,927,000	0.03
	内 日本	78,927,000
株価指数先物取引（買建）	5,902,699,839	1.90
	内 アメリカ	3,635,178,272
	内 ユーロ	1,152,608,440
	内 イギリス	565,495,829
	内 オーストラリア	288,190,402
	内 カナダ	261,226,896

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	384,973,032,547	97.69
	内 ユーロ	165,833,740,726
	内 アメリカ	156,020,098,512
	内 イギリス	28,610,604,236
	内 カナダ	9,843,584,417
	内 オーストラリア	5,434,546,824
	内 メキシコ	3,939,851,226
	内 デンマーク	3,360,574,919
	内 ポーランド	2,917,276,843
	内 南アフリカ	2,145,271,500
	内 スウェーデン	2,144,670,609
	内 マレーシア	1,888,068,838
	内 シンガポール	1,630,175,394
	内 ノルウェー	1,204,568,503
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,092,559,167	2.31
純資産総額	394,065,591,714	100.00

## その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	356,289,960	0.09
内 日本	356,289,960	0.09

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	3,778,967,884	13.82
内 オーストラリア	2,779,985,837	10.16
内 シンガポール	998,982,047	3.65
投資証券	23,431,568,930	85.67
内 アメリカ	18,501,968,665	67.65
内 ユーロ	1,913,356,537	7.00
内 イギリス	1,627,793,627	5.95
内 カナダ	735,808,053	2.69
内 香港	556,025,740	2.03
内 ニュージーランド	91,106,648	0.33
内 イスラエル	5,509,660	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	138,963,397	0.51
純資産総額	27,349,500,211	100.00

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	35,736,886,302	95.11
内 香港	6,740,909,471	17.94
内 韓国	5,438,769,374	14.47
内 台湾	4,240,470,153	11.29
内 ブラジル	3,973,429,780	10.57
内 アメリカ	3,730,613,036	9.93
内 南アフリカ	2,642,495,185	7.03
内 インド	2,023,849,370	5.39
内 メキシコ	1,626,874,326	4.33
内 マレーシア	1,417,349,786	3.77
内 インドネシア	1,062,946,478	2.83
内 タイ	977,813,833	2.60
内 トルコ	667,078,598	1.78
内 ポーランド	593,900,359	1.58
内 フィリピン	393,289,206	1.05
内 チェコ	95,769,602	0.25
内 ハンガリー	78,723,934	0.21
内 モロッコ	32,603,811	0.09
投資信託受益証券	327,193,231	0.87
内 メキシコ	327,193,231	0.87

投資証券		55,473,722	0.15
	内 メキシコ	45,261,740	0.12
	内 トルコ	10,211,982	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,454,538,565	3.87
純資産総額		37,574,091,820	100.00

## その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	409,659,344	1.09
	内 日本	409,659,344
為替予約取引(売建)	499,490,000	1.33
	内 日本	499,490,000
株価指数先物取引(買建)	1,437,690,968	3.83
	内 アメリカ	1,437,690,968

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	33,066,591,981	95.44
	内 アメリカ	33,066,591,981
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,578,649,474	4.56
純資産総額	34,645,241,455	100.00

## その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	332,653,440	0.96
	内 日本	332,653,440

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

(注2) 投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

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

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

## (2)【投資資産】

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	47,469,000	1.1692 55,504,087	1.1700 55,538,730	- -	57.15%
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	6,235,191	1.5567 9,706,604	1.5622 9,740,615	- -	10.02%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,940,099	1.9632 9,698,565	1.9650 9,707,294	- -	9.99%
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,610,558	1.3496 4,872,911	1.3410 4,841,758	- -	4.98%
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,805,381	0.8378 4,863,986	0.8293 4,814,402	- -	4.95%
6	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,930,574	1.5118 2,918,740	1.5087 2,912,656	- -	3.00%
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,693,374	0.7896 2,916,588	0.7812 2,885,263	- -	2.97%
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,459,468	1.1871 2,919,714	1.1574 2,846,588	- -	2.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	95.99%
合計	95.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	23,909,526	1.1691 27,953,264	1.1700 27,974,145	- -	31.16%
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	8,654,139	1.5587 13,489,773	1.5622 13,519,495	- -	15.06%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	6,860,457	1.9650 13,481,449	1.9650 13,480,798	- -	15.02%
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	6,685,127	1.3552 9,059,842	1.3410 8,964,755	- -	9.99%
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	10,748,340	0.8416 9,046,867	0.8293 8,913,598	- -	9.93%
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	6,840,095	0.7919 5,417,133	0.7812 5,343,482	- -	5.95%
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,553,596	1.1881 5,410,488	1.1574 5,270,332	- -	5.87%
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,383,695	1.5145 3,610,263	1.5087 3,596,280	- -	4.01%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.98%
合計	96.98%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化 法）・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	13,615,182	1.5615 21,261,338	1.5622 21,269,637	- -	20.11%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド 日本	親投資信託受 益証券	10,800,520	1.9627 21,198,990	1.9650 21,223,021	- -	20.07%
3	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	11,840,526	1.3561 16,057,600	1.3410 15,878,145	- -	15.02%
4	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	19,037,158	0.8411 16,012,340	0.8293 15,787,515	- -	14.93%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券	12,116,069	0.7930 9,609,117	0.7812 9,465,073	- -	8.95%
6	J-REITインデックスファンド・マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	8,064,430	1.1910 9,605,026	1.1574 9,333,771	- -	8.83%
7	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	4,555,649	1.1690 5,325,961	1.1700 5,330,109	- -	5.04%
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド 日本	親投資信託受 益証券	3,518,220	1.5149 5,329,902	1.5087 5,307,938	- -	5.02%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.97%
合計	97.97%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考)マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,461,500	4,815.00 11,852,122,500	5,970.00 14,695,155,000	- -	4.63%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	14,319,800	538.00 7,704,052,400	601.00 8,606,199,800	- -	2.71%
3	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,430,200	3,790.00 5,420,458,000	4,485.00 6,414,447,000	- -	2.02%
4	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,616,300	3,580.00 5,786,354,000	3,630.00 5,867,169,000	- -	1.85%
5	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	915,900	3,478.23 3,185,714,640	6,240.00 5,715,216,000	- -	1.80%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	24,460,900	209.00 5,112,363,073	203.00 4,965,562,700	- -	1.57%
7	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,192,900	3,026.02 3,609,743,362	3,425.00 4,085,682,500	- -	1.29%
8	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	796,100	4,050.00 3,224,205,000	4,935.00 3,928,753,500	- -	1.24%
9	キヤノン 日本	株式 電気機器	1,110,800	3,310.00 3,676,748,000	3,025.00 3,360,170,000	- -	1.06%
10	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,323,000	2,143.00 2,835,189,000	2,491.00 3,295,593,000	- -	1.04%
11	武田薬品 日本	株式 医薬品	751,600	4,700.00 3,532,520,000	4,375.00 3,288,250,000	- -	1.04%
12	日立 日本	株式 電気機器	4,600,000	536.48 2,467,814,409	658.00 3,026,800,000	- -	0.95%
13	ファナック 日本	株式 電気機器	199,500	14,790.00 2,950,605,000	14,860.00 2,964,570,000	- -	0.93%
14	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	791,000	2,817.00 2,228,247,000	3,700.00 2,926,700,000	- -	0.92%
15	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	3,866,200	531.00 2,052,952,200	747.00 2,888,051,400	- -	0.91%
16	KDDI 日本	株式 情報・通信業	533,700	3,420.00 1,825,254,000	5,410.00 2,887,317,000	- -	0.91%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	353,400	6,440.00 2,275,896,000	7,890.00 2,788,326,000	- -	0.88%
18	三井不動産 日本	株式 不動産業	891,000	2,095.00 1,866,645,000	2,963.00 2,640,033,000	- -	0.83%
19	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,475,400	1,953.00 2,881,456,200	1,789.00 2,639,490,600	- -	0.83%

20	ソニー 日本	株式 電気機器	1,204,100	1,519.00 1,829,027,900	2,068.00 2,490,078,800	- -	0.79%
21	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,420,100	993.00 2,403,159,300	1,027.00 2,485,442,700	- -	0.78%
22	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	8,480,000	273.00 2,315,040,000	285.00 2,416,800,000	- -	0.76%
23	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	15,583	136,900.00 2,133,312,700	149,500.00 2,329,658,500	- -	0.73%
24	東京海上HD 日本	株式 保険業	732,400	2,713.00 1,987,001,200	3,135.00 2,296,074,000	- -	0.72%
25	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	435,000	4,750.00 2,066,250,000	5,250.00 2,283,750,000	- -	0.72%
26	信越化学 日本	株式 化学	359,900	5,590.00 2,011,841,000	6,120.00 2,202,588,000	- -	0.69%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	628,800	2,473.00 1,555,022,400	3,480.00 2,188,224,000	- -	0.69%
28	三井物産 日本	株式 卸売業	1,632,000	1,406.00 2,294,592,000	1,315.00 2,146,080,000	- -	0.68%
29	デンソー 日本	株式 輸送用機器	473,300	3,700.00 1,751,210,000	4,460.00 2,110,918,000	- -	0.67%
30	小松製作所 日本	株式 機械	935,700	2,458.00 2,299,950,600	2,188.00 2,047,311,600	- -	0.65%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
株式	94.88%
合計	94.88%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

平成25年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
輸送用機器	国内	11.38%
電気機器	国内	10.80%
銀行業	国内	9.72%
情報・通信業	国内	6.57%
化学	国内	5.14%
機械	国内	4.76%
卸売業	国内	4.30%
小売業	国内	4.19%
医薬品	国内	4.19%
陸運業	国内	3.82%
食料品	国内	3.79%
不動産業	国内	3.33%
電気・ガス業	国内	2.46%
建設業	国内	2.35%



保険業	2.28%
サービス業	2.02%
証券、商品先物取引業	1.76%
鉄鋼	1.66%
その他製品	1.30%
精密機器	1.27%
その他金融業	1.22%
非鉄金属	0.95%
ゴム製品	0.92%
ガラス・土石製品	0.87%
繊維製品	0.70%
金属製品	0.63%
石油・石炭製品	0.62%
空運業	0.60%
鉱業	0.43%
海運業	0.32%
パルプ・紙	0.25%
倉庫・運輸関連業	0.22%
水産・農林業	0.07%
合計	94.88%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成25年7月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX 先物 2509月	買建	1,339	15,142,521,731	15,070,445,000	4.75%

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

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

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	328回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	6,500,000,000	98.83 6,424,005,000	98.34 6,392,295,000	0.600000 2023/3/20	1.43%
2	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	6,000,000,000	100.85 6,051,140,000	100.47 6,028,200,000	0.800000 2022/9/20	1.34%
3	326回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	6,000,000,000	100.28 6,017,040,000	99.43 5,965,800,000	0.700000 2022/12/20	1.33%
4	326回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.06 5,503,660,000	99.98 5,499,065,000	0.100000 2015/3/15	1.23%
5	105回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.32 5,517,765,000	99.96 5,497,855,000	0.200000 2017/6/20	1.23%
6	97回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.99 5,049,930,000	100.76 5,038,000,000	0.400000 2016/6/20	1.12%
7	106回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.29 5,014,680,000	99.87 4,993,850,000	0.200000 2017/9/20	1.11%
8	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.33 5,016,905,000	99.80 4,990,200,000	0.200000 2017/12/20	1.11%
9	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	106.11 4,775,108,000	105.10 4,729,815,000	1.300000 2021/3/20	1.05%
10	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	102.69 4,621,170,000	102.48 4,611,735,000	1.000000 2022/3/20	1.03%
11	306回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,300,000,000	106.74 4,589,820,000	106.18 4,565,912,000	1.400000 2020/3/20	1.02%
12	103回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.61 4,527,875,000	100.39 4,517,820,000	0.300000 2017/3/20	1.01%
13	293回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	108.42 4,553,894,000	107.34 4,508,532,000	1.800000 2018/6/20	1.01%
14	89回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.82 4,335,561,000	100.53 4,323,005,000	0.400000 2015/6/20	0.96%
15	296回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	107.01 4,280,695,000	106.17 4,247,000,000	1.500000 2018/9/20	0.95%
16	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.53 4,261,405,000	105.85 4,234,200,000	1.400000 2018/12/20	0.94%
17	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	106.53 4,154,748,000	105.46 4,113,135,000	1.500000 2017/12/20	0.92%

18	9 2 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.65 4,026,320,000	100.39 4,015,720,000	0.300000 2015/9/20	0.90%
19	3 1 0 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	103.76 3,943,184,000	103.23 3,922,740,000	1.000000 2020/9/20	0.87%
20	3 1 2 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,700,000,000	105.15 3,890,883,000	104.46 3,865,131,000	1.200000 2020/12/20	0.86%
21	3 0 1 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	107.42 3,867,300,000	106.68 3,840,804,000	1.500000 2019/6/20	0.86%
22	8 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,800,000,000	100.83 3,831,692,000	100.53 3,820,444,000	0.500000 2014/12/20	0.85%
23	2 8 8 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	107.15 3,857,652,000	106.04 3,817,476,000	1.700000 2017/9/20	0.85%
24	3 0 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	105.74 3,806,664,000	105.56 3,800,484,000	1.300000 2019/12/20	0.85%
25	3 1 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	104.92 3,672,480,000	104.31 3,651,165,000	1.200000 2021/6/20	0.81%
26	2 8 2 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	105.79 3,596,962,000	104.83 3,564,390,000	1.700000 2016/9/20	0.79%
27	9 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.28 3,545,080,000	100.90 3,531,605,000	0.500000 2015/12/20	0.79%
28	8 8 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.94 3,533,110,000	100.62 3,521,910,000	0.500000 2015/3/20	0.79%
29	1 0 2 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.76 3,526,740,000	100.43 3,515,295,000	0.300000 2016/12/20	0.78%
30	2 8 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	106.48 3,513,939,000	105.46 3,480,246,000	1.700000 2017/3/20	0.78%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	78.96%
地方債証券	6.72%
特殊債券	7.08%
社債券	6.76%
合計	99.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
該当事項はありません。

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	1,203	1,008,666.48 1,213,425,785	1,067,000.00 1,283,601,000	- -	11.87%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	1,033	979,349.08 1,011,667,602	1,036,000.00 1,070,188,000	- -	9.90%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	3,616	181,431.58 656,056,622	193,000.00 697,888,000	- -	6.45%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	4,123	123,083.25 507,472,259	121,800.00 502,181,400	- -	4.64%
5	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,157	201,802.39 435,287,766	198,100.00 427,301,700	- -	3.95%
6	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	485	822,037.62 398,688,246	850,000.00 412,250,000	- -	3.81%
7	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,435	285,042.02 409,035,299	268,300.00 385,010,500	- -	3.56%
8	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	431	877,997.21 378,416,800	833,000.00 359,023,000	- -	3.32%
9	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	421	761,122.31 320,432,495	841,000.00 354,061,000	- -	3.27%
10	G L P投資法人 日本	投資証券	3,196	89,721.77 286,750,780	96,000.00 306,816,000	- -	2.84%
11	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	2,767	103,035.26 285,098,573	109,500.00 302,986,500	- -	2.80%
12	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	2,896	98,981.90 286,651,604	97,100.00 281,201,600	- -	2.60%
13	野村不動産オフィスファンド投資法人 日本	投資証券	640	482,565.84 308,842,139	428,500.00 274,240,000	- -	2.54%
14	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	401	609,320.87 244,337,670	644,000.00 258,244,000	- -	2.39%
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	357	699,714.83 249,798,196	701,000.00 250,257,000	- -	2.31%
16	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	688	345,084.63 237,418,231	359,000.00 246,992,000	- -	2.28%
17	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	443	558,970.54 247,623,953	548,000.00 242,764,000	- -	2.25%
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	272	863,357.13 234,833,141	877,000.00 238,544,000	- -	2.21%
19	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	612	366,025.39 224,007,543	379,000.00 231,948,000	- -	2.15%
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	257	871,968.68 224,095,953	870,000.00 223,590,000	- -	2.07%

21	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	391	546,548.02 213,700,276	521,000.00 203,711,000	- -	1.88%
22	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券	498	365,469.19 182,003,659	390,000.00 194,220,000	- -	1.80%
23	福岡リート投資法人 日本	投資証券	240	728,943.31 174,946,395	745,000.00 178,800,000	- -	1.65%
24	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	4,559	34,821.75 158,752,377	37,750.00 172,102,250	- -	1.59%
25	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	2,314	65,960.41 152,632,389	66,800.00 154,575,200	- -	1.43%
26	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	295	522,466.81 154,127,710	510,000.00 150,450,000	- -	1.39%
27	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	213	684,870.16 145,877,345	672,000.00 143,136,000	- -	1.32%
28	プレミア投資法人 日本	投資証券	342	356,107.04 121,788,610	378,500.00 129,447,000	- -	1.20%
29	野村不動産レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	262	485,848.85 127,292,401	489,500.00 128,249,000	- -	1.19%
30	積水ハウス・S I 投資法人 日本	投資証券	278	444,678.93 123,620,743	449,500.00 124,961,000	- -	1.16%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.59%
合計	98.59%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	110,566	45,615.44 5,043,517,638	44,461.62 4,915,944,096	- -	1.58%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	528,488	8,684.84 4,589,836,745	9,200.88 4,862,557,206	- -	1.56%
3	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	329,987	7,456.49 2,460,547,543	9,138.11 3,015,458,692	- -	0.97%
4	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	1,222,206	2,295.74 2,805,876,476	2,400.99 2,934,514,650	- -	0.94%
5	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	937,132	2,786.98 2,611,771,092	3,123.84 2,927,457,923	- -	0.94%
6	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	228,955	11,354.27 2,599,617,701	12,336.50 2,824,503,906	- -	0.91%
7	GOOGLE INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェ ア・サービス	31,479	77,448.57 2,438,003,787	87,381.43 2,750,680,148	- -	0.88%
8	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	320,866	7,532.06 2,416,783,400	7,889.55 2,531,490,018	- -	0.81%
9	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	590,524	3,466.38 2,046,981,912	4,242.94 2,505,558,372	- -	0.80%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	380,693	6,642.96 2,528,930,779	6,542.85 2,490,821,001	- -	0.80%
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	450,646	4,834.71 2,178,745,142	5,426.76 2,445,550,571	- -	0.79%
12	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	2,177,728	1,081.25 2,354,671,160	1,100.39 2,396,367,839	- -	0.77%
13	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	124,490	19,570.49 2,436,330,631	19,224.66 2,393,278,022	- -	0.77%
14	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	784,580	2,654.04 2,082,310,469	2,910.03 2,283,154,161	- -	0.73%
15	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	644,019	3,461.32 2,229,159,339	3,473.99 2,237,317,884	- -	0.72%
16	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	82,923	21,711.41 1,800,375,594	24,430.19 2,025,825,059	- -	0.65%
17	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	271,696	6,674.86 1,813,535,458	6,991.36 1,899,525,225	- -	0.61%
18	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	472,093	3,622.86 1,710,329,217	3,954.58 1,866,932,179	- -	0.60%
19	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融サービス	356,566	4,362.80 1,555,629,606	5,078.58 1,810,849,812	- -	0.58%

20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融サービス	1,270,991	1,191.20 1,514,015,593	1,424.12 1,810,045,736	- -	0.58%
21	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	193,987	8,822.00 1,711,355,240	8,745.79 1,696,570,263	- -	0.54%
22	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	355,814	4,051.79 1,441,684,684	4,712.74 1,676,860,293	- -	0.54%
23	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サービス	5,742,174	250.82 1,440,269,983	291.61 1,674,509,640	- -	0.54%
24	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	334,764	4,361.63 1,460,118,510	4,945.19 1,655,472,790	- -	0.53%
25	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	626,082	2,066.54 1,293,827,286	2,517.71 1,576,295,166	- -	0.51%
26	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,256,831	672.76 1,518,322,313	674.70 1,522,700,981	- -	0.49%
27	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	182,162	7,110.25 1,295,217,752	8,347.58 1,520,613,470	- -	0.49%
28	WAL-MART STORES INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	198,081	6,956.53 1,377,958,033	7,639.45 1,513,230,133	- -	0.49%
29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	452,767	3,172.26 1,436,297,174	3,306.27 1,496,972,846	- -	0.48%
30	SANOFI ユーロ	株式 医薬品	140,101	9,387.30 1,315,171,268	10,414.40 1,459,068,414	- -	0.47%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.92%
投資信託受益証券	0.32%
投資証券	1.81%
合計	98.05%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

平成25年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
石油・ガス・消耗燃料	外国	8.90%
商業銀行		7.62%
医薬品		6.77%
保険		4.63%
メディア		2.87%
各種金融サービス		2.76%
化学		2.75%
各種電気通信サービス		2.70%
食品		2.68%
ソフトウェア		2.35%
飲料		2.33%



食品・生活必需品小売り
コンピュータ・周辺機器
情報技術サービス
資本市場
金属・鉱業
航空宇宙・防衛
コングロマリット
専門小売り
ホテル・レストラン・レジャー
機械
インターネットソフトウェア・サービス
電力
家庭用品
バイオテクノロジー
ヘルスケア機器・用品
エネルギー設備・サービス
タバコ
半導体・半導体製造装置
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
総合公益事業
通信機器
繊維・アパレル・贅沢品
自動車
陸運・鉄道
電気設備
無線通信サービス
インターネット販売・カタログ販売
不動産管理・開発
複合小売り
消費者金融
航空貨物・物流サービス
自動車部品
商業サービス・用品
専門サービス
建設・土木
電子装置・機器・部品
ライフサイエンス・ツール/サービス
パーソナル用品
建設資材
商社・流通業
家庭用耐久財
建設関連製品
容器・包装
ガス
運送インフラ
独立系発電事業者・エネルギー販売業者

2.29%
2.28%
2.22%
2.19%
2.08%
2.01%
1.98%
1.69%
1.66%
1.66%
1.63%
1.62%
1.60%
1.59%
1.48%
1.46%
1.46%
1.46%
1.42%
1.35%
1.28%
1.22%
1.05%
0.90%
0.87%
0.79%
0.72%
0.62%
0.62%
0.57%
0.53%
0.53%
0.47%
0.46%
0.35%
0.34%
0.33%
0.31%
0.29%
0.28%
0.26%
0.20%
0.19%
0.19%
0.16%
0.12%

紙製品・林産品	0.12%
旅客航空輸送業	0.11%
レジャー用品	0.10%
販売	0.09%
水道	0.08%
海運業	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.06%
事務用電子機器	0.04%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.92%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年7月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	日本	アメリカ・ドル買/円売2013年08月	買建	2,100,000	205,945,950	205,947,000	0.07%
		ユーロ買/円売2013年08月	買建	600,000	77,999,880	78,024,000	0.03%
		イギリス・ポンド買/円売2013年08月	買建	300,000	45,124,950	44,838,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売2013年08月	買建	200,000	19,115,000	19,038,000	0.01%
		オーストラリア・ドル買/円売2013年08月	買建	200,000	18,047,500	17,708,000	0.01%
		アメリカ・ドル売/円買2013年08月	売建	500,000	49,039,250	49,035,000	0.02%
		イギリス・ポンド売/円買2013年08月	売建	200,000	29,893,200	29,892,000	0.01%
株価指数先物取引	アメリカ	S & P 500 FUTURE Sep 13	買建	88	3,558,825,444	3,635,178,272	1.17%
	ユーロ	DJ EURO STOXX 50 Sep 13	買建	321	1,124,085,874	1,152,608,440	0.37%
	イギリス	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep 13	買建	58	552,493,434	565,495,829	0.18%
	オーストラリア	SPI 200 FUTURE S Sep 13	買建	26	279,658,610	288,190,402	0.09%
	カナダ	S & P / TSE 60 INDEX FUTURE Sep 13	買建	19	257,317,984	261,226,896	0.08%

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

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

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 0.25 09/15/14 アメリカ	国債証券	3,923,200,000	100.07 3,926,103,168	100.03 3,924,573,120	0.250000 2014/9/15	1.00%
2	US T N/B 4.25 11/15/14 アメリカ	国債証券	3,579,920,000	106.91 3,827,543,066	105.24 3,767,579,406	4.250000 2014/11/15	0.96%
3	US T N/B 2.375 09/30/14 アメリカ	国債証券	3,432,800,000	103.41 3,549,858,480	102.57 3,521,160,272	2.375000 2014/9/30	0.89%
4	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15 ユーロ	国債証券	3,186,225,000	106.66 3,398,650,620	105.24 3,353,310,639	3.750000 2015/1/4	0.85%
5	US T N/B 2.5 03/31/15 アメリカ	国債証券	2,942,400,000	104.64 3,079,045,056	103.74 3,052,504,608	2.500000 2015/3/31	0.77%
6	US T N/B 2.125 11/30/14 アメリカ	国債証券	2,942,400,000	103.32 3,040,323,072	102.58 3,018,461,040	2.125000 2014/11/30	0.77%
7	US T N/B 1.25 08/31/15 アメリカ	国債証券	2,942,400,000	102.27 3,009,280,752	101.89 2,998,129,056	1.250000 2015/8/31	0.76%
8	US T N/B 4.25 08/15/14 アメリカ	国債証券	2,746,240,000	105.95 2,909,723,667	104.26 2,863,257,286	4.250000 2014/8/15	0.73%
9	US T N/B 2.25 11/30/17 アメリカ	国債証券	2,648,160,000	106.76 2,827,251,137	104.60 2,770,001,841	2.250000 2017/11/30	0.70%
10	US T N/B 3.25 06/30/16 アメリカ	国債証券	2,452,000,000	109.20 2,677,657,560	107.69 2,640,779,480	3.250000 2016/6/30	0.67%
11	US T N/B 2.625 12/31/14 アメリカ	国債証券	2,452,000,000	104.38 2,559,446,640	103.43 2,536,177,160	2.625000 2014/12/31	0.64%
12	US T N/B 2.25 01/31/15 アメリカ	国債証券	2,452,000,000	103.83 2,546,132,280	103.05 2,526,786,000	2.250000 2015/1/31	0.64%
13	FRANCE OAT 3.0 10/25/15 ユーロ	国債証券	2,340,900,000	106.71 2,498,138,253	106.01 2,481,588,090	3.000000 2015/10/25	0.63%
14	US T N/B 4.625 02/15/17 アメリカ	国債証券	2,157,760,000	115.67 2,495,902,569	113.16 2,441,807,526	4.625000 2017/2/15	0.62%
15	US T N/B 2.375 02/28/15 アメリカ	国債証券	2,255,840,000	104.20 2,350,743,188	103.40 2,332,583,676	2.375000 2015/2/28	0.59%
16	US T N/B 1.25 09/30/15 アメリカ	国債証券	2,255,840,000	102.31 2,308,085,254	101.93 2,299,535,620	1.250000 2015/9/30	0.58%
17	FRANCE OAT 3.5 04/25/15 ユーロ	国債証券	2,145,825,000	106.75 2,290,705,902	105.56 2,265,132,870	3.500000 2015/4/25	0.57%
18	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	2,255,840,000	100.68 2,271,185,596	96.82 2,184,284,755	1.250000 2019/10/31	0.55%
19	FRANCE OAT 3.25 04/25/16 ユーロ	国債証券	2,015,775,000	108.33 2,183,735,875	107.63 2,169,659,263	3.250000 2016/4/25	0.55%
20	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	1,961,600,000	110.00 2,157,760,000	108.25 2,123,569,312	3.250000 2016/12/31	0.54%

21	FRANCE OAT 4.0 10/25/14 ユーロ	国債証券	2,015,775,000	106.16 2,140,148,317	104.68 2,110,113,270	4.000000 2014/10/25	0.54%
22	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	1,961,600,000	109.31 2,144,264,192	107.50 2,108,857,312	3.000000 2017/2/28	0.54%
23	US T N/B 3.0 09/30/16 アメリカ	国債証券	1,961,600,000	108.71 2,132,612,288	107.23 2,103,502,144	3.000000 2016/9/30	0.53%
24	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	2,010,640,000	104.03 2,091,779,622	103.33 2,077,634,524	1.750000 2016/5/31	0.53%
25	US T N/B 4.0 02/15/15 アメリカ	国債証券	1,961,600,000	107.34 2,105,718,752	105.78 2,075,157,024	4.000000 2015/2/15	0.53%
26	US T N/B 2.375 03/31/16 アメリカ	国債証券	1,961,600,000	105.94 2,078,138,656	104.98 2,059,287,680	2.375000 2016/3/31	0.52%
27	US T N/B 2.5 04/30/15 アメリカ	国債証券	1,961,600,000	104.79 2,055,599,872	103.88 2,037,827,776	2.500000 2015/4/30	0.52%
28	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17 ユーロ	国債証券	1,820,700,000	112.51 2,048,568,408	111.64 2,032,775,136	3.750000 2017/1/4	0.52%
29	ITALY BTPS 3.75 08/01/15 ユーロ	国債証券	1,950,750,000	103.57 2,020,391,775	103.39 2,016,880,425	3.750000 2015/8/1	0.51%
30	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16 ユーロ	国債証券	1,820,700,000	109.20 1,988,259,021	108.02 1,966,720,140	3.500000 2016/1/4	0.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.69%
合計	97.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成25年7月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	日本	アメリカ・ドル買/円売 2013年08月	買建	2,080,000	203,984,560	203,985,600	0.05%
		カナダ・ドル買/円売 2013年08月	買建	962,000	91,577,590	91,572,780	0.02%
		オーストラリア・ドル買/円売 2013年08月	買建	686,000	60,736,382	60,731,580	0.02%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	113,543	15,366.29 1,744,735,098	15,861.49 1,800,962,021	- -	6.58%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE ユーロ	投資証券	34,893	21,929.31 765,179,639	23,883.68 833,373,333	- -	3.05%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	52,785	14,694.81 775,665,710	15,647.68 825,962,957	- -	3.02%
4	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	737,963	987.68 728,873,827	1,006.81 742,991,110	- -	2.72%
5	HCP INC アメリカ	投資証券	166,166	4,246.21 705,577,385	4,381.23 728,012,062	- -	2.66%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	107,185	6,437.08 689,959,172	6,652.76 713,076,766	- -	2.61%
7	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	182,153	3,570.31 650,343,454	3,815.31 694,970,526	- -	2.54%
8	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	103,986	6,224.59 647,270,499	6,432.08 668,846,936	- -	2.45%
9	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	117,184	5,380.60 630,520,394	5,655.29 662,709,831	- -	2.42%
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	44,458	12,933.90 575,015,686	13,461.47 598,470,477	- -	2.19%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	55,470	10,008.28 555,159,612	10,663.25 591,490,899	- -	2.16%
12	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	62,179	7,694.11 478,412,675	8,450.57 525,448,166	- -	1.92%
13	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	272,185	1,588.58 432,387,859	1,767.40 481,060,204	- -	1.76%
14	LINK REIT/THE 香港	投資証券	837,523	475.56 398,298,786	480.69 402,597,306	- -	1.47%
15	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	285,077	1,304.81 371,972,651	1,410.24 402,029,681	- -	1.47%
16	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	164,645	1,913.62 315,068,149	2,102.83 346,221,301	- -	1.27%
17	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	149,324	2,045.04 305,374,980	2,196.99 328,063,633	- -	1.20%
18	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	364,178	853.82 310,942,843	889.34 323,880,429	- -	1.18%
19	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	50,227	5,742.84 288,445,627	6,229.06 312,867,036	- -	1.14%
20	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	71,681	4,009.92 287,435,477	4,335.13 310,746,883	- -	1.14%

21	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資信託受益証券	1,115,648	258.24 288,114,325	270.96 302,299,329	- -	1.11%
22	SL GREEN アメリカ	投資証券	33,459	8,363.50 279,834,571	8,945.87 299,320,091	- -	1.09%
23	STOCKLAND オーストラリア	投資信託受益証券	842,079	315.43 265,618,019	324.97 273,657,570	- -	1.00%
24	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	46,902	5,727.35 268,624,580	5,564.07 260,966,405	- -	0.95%
25	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	23,822	9,549.88 227,497,359	10,413.15 248,062,145	- -	0.91%
26	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	552,216	417.87 230,756,651	418.84 231,290,977	- -	0.85%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	91,539	2,352.07 215,306,314	2,501.03 228,942,700	- -	0.84%
28	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	13,871	14,986.90 207,883,396	16,090.02 223,184,722	- -	0.82%
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	30,970	6,419.54 198,813,184	7,025.47 217,578,818	- -	0.80%
30	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	260,165	727.43 189,253,328	782.47 203,572,724	- -	0.74%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	13.82%
投資証券	85.67%
合計	99.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	11,421	131,624.52 1,503,283,736	113,520.00 1,296,511,920	- -	3.45%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,533,083	328.10 831,109,893	333.53 844,884,503	- -	2.25%
3	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	621,000	1,019.75 633,265,694	1,053.11 653,982,862	- -	1.74%
4	CHINA CONSTRUCTION BANK 香港	株式 商業銀行	7,349,530	75.90 557,831,946	72.73 534,586,438	- -	1.42%
5	TENCENT HOLDINGS LTD 香港	株式 インターネットソフト ウェア・サービス	105,300	3,195.29 336,464,811	4,599.54 484,331,562	- -	1.29%
6	IND & COMM BK OF CHINA - H 香港	株式 商業銀行	7,509,235	64.16 481,867,461	64.38 483,508,377	- -	1.29%
7	AO GAZPROM ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	606,315	739.68 448,481,891	769.92 466,818,895	- -	1.24%
8	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	3,922,678	94.95 372,477,198	101.66 398,786,506	- -	1.06%
9	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	40,539	5,845.75 236,981,047	8,300.00 336,473,700	- -	0.90%
10	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	15,859	17,045.97 270,332,150	20,900.00 331,453,100	- -	0.88%
11	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,815,000	169.39 307,455,005	178.61 324,191,670	- -	0.86%
12	SBERBANK ADR アメリカ	株式 商業銀行	287,203	1,167.66 335,357,557	1,118.11 321,125,120	- -	0.85%
13	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	254,880	1,315.31 335,247,765	1,255.58 320,023,096	- -	0.85%
14	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信サービス	172,868	1,629.41 281,674,026	1,828.89 316,158,285	- -	0.84%
15	BANK OF CHINA LTD 香港	株式 商業銀行	7,569,200	43.26 327,469,811	41.23 312,146,238	- -	0.83%
16	LUKOIL SPON ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	52,787	5,869.54 309,835,813	5,865.18 309,605,467	- -	0.82%
17	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	422,212	733.60 309,738,744	707.28 298,624,721	- -	0.79%
18	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,020,609	253.08 258,304,040	257.34 262,652,705	- -	0.70%
19	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	211,349	1,388.66 293,492,674	1,209.60 255,648,912	- -	0.68%
20	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	55,411	3,736.13 207,022,984	4,532.09 251,128,193	- -	0.67%

21	PETRO CHINA CO LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,144,000	116.75 250,325,056	116.63 250,061,152	- -	0.67%
22	CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS PREF ブラジル	株式 飲料	69,590	3,405.56 236,993,507	3,527.83 245,502,176	- -	0.65%
23	ECOPETROL SA SP ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	52,448	4,533.88 237,793,392	4,470.48 234,468,070	- -	0.62%
24	VALE SA-PREF A ブラジル	株式 金属・鉱業	189,196	1,310.26 247,896,393	1,218.62 230,559,770	- -	0.61%
25	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	318,010	662.96 210,829,716	665.60 211,669,141	- -	0.56%
26	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	149,627	1,293.87 193,598,574	1,316.79 197,028,160	- -	0.52%
27	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	6,650	28,059.70 186,597,027	28,644.00 190,482,600	- -	0.51%
28	BANCOLOMBIA SA SPONS ADR アメリカ	株式 商業銀行	33,113	6,239.90 206,622,068	5,736.69 189,959,320	- -	0.51%
29	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV メキシコ	投資信託受益証券 -	195,700	1,142.49 223,586,977	968.17 189,471,064	- -	0.50%
30	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,581,200	79.77 205,906,233	72.73 187,750,035	- -	0.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.11%
投資信託受益証券	0.87%
投資証券	0.15%
合計	96.13%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

平成25年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	17.93%
石油・ガス・消耗燃料		10.97%
半導体・半導体製造装置		7.65%
無線通信サービス		5.78%
金属・鉱業		4.74%
保険		3.00%
自動車		2.75%
化学		2.51%
食品・生活必需品小売り		2.44%
食品		2.38%
不動産管理・開発		1.99%



電子装置・機器・部品
コングロマリット
各種電気通信サービス
各種金融サービス
飲料
インターネットソフトウェア・サービス
メディア
情報技術サービス
電力
コンピュータ・周辺機器
建設資材
医薬品
運送インフラ
建設・土木
独立系発電事業者・エネルギー販売業者
機械
自動車部品
タバコ
複合小売り
専門小売り
資本市場
ガス
家庭用品
パーソナル用品
貯蓄・抵当・不動産金融
家庭用耐久財
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ホテル・レストラン・レジャー
旅客航空輸送業
商社・流通業
紙製品・林産品
エネルギー設備・サービス
電気設備
繊維・アパレル・贅沢品
海運業
航空宇宙・防衛
水道
容器・包装
販売
消費者金融
通信機器
各種消費者サービス
ソフトウェア
総合公益事業
陸運・鉄道
レジャー用品

1.94%
1.88%
1.82%
1.74%
1.64%
1.60%
1.56%
1.46%
1.38%
1.13%
1.12%
0.96%
0.90%
0.89%
0.88%
0.86%
0.80%
0.79%
0.76%
0.70%
0.69%
0.62%
0.59%
0.56%
0.55%
0.52%
0.50%
0.47%
0.35%
0.31%
0.29%
0.29%
0.24%
0.23%
0.22%
0.19%
0.18%
0.16%
0.14%
0.14%
0.14%
0.13%
0.12%
0.12%
0.10%
0.10%

商業サービス・用品	0.10%
航空貨物・物流サービス	0.06%
建設関連製品	0.06%
ヘルスケア機器・用品	0.04%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.01%
合計	95.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成25年7月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	日本	アメリカ・ドル買/円売2013年08月	買建	4,177,213	412,020,000	409,659,344	1.09%
		韓国・ウォン売/円買2013年08月	売建	2,000,000,000	176,600,000	176,000,000	0.47%
		台湾・ドル売/円買2013年08月	売建	49,000,000	160,720,000	160,230,000	0.43%
		南アフリカ・ランド売/円買2013年08月	売建	9,000,000	91,803,600	89,910,000	0.24%
		インド・ルピー売/円買2013年08月	売建	45,000,000	74,700,000	73,350,000	0.20%
株価指数先物取引	アメリカ	MINI MSCI EMG MKT Sep13	買建	310	1,425,531,009	1,437,690,968	3.83%

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

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 アメリカ	国債証券	1,929,037,440	124.55 2,402,748,533	117.89 2,274,335,141	7.500000 2030/3/31	6.56%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 アメリカ	国債証券	500,208,000	144.07 720,674,676	138.06 690,612,175	11.000000 2018/7/24	1.99%
3	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 アメリカ	国債証券	529,632,000	131.14 694,568,232	110.00 582,595,200	6.050000 2040/1/11	1.68%
4	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 アメリカ	国債証券	529,632,000	115.55 612,019,200	109.09 577,802,030	5.000000 2020/4/29	1.67%
5	PERU 8.75 11/21/33 アメリカ	国債証券	392,320,000	166.44 652,998,004	146.68 575,454,976	8.750000 2033/11/21	1.66%
6	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 アメリカ	国債証券	617,904,000	109.39 675,937,936	90.55 559,512,072	4.750000 2044/3/8	1.61%
7	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 アメリカ	国債証券	304,048,000	197.62 600,890,062	175.60 533,908,288	12.750000 2028/6/24	1.54%
8	PERU 7.35 07/21/25 アメリカ	国債証券	372,704,000	143.02 533,063,819	128.60 479,334,614	7.350000 2025/7/21	1.38%
9	BRAZIL 7.125 01/20/37 アメリカ	国債証券	392,320,000	143.51 563,052,760	117.85 462,349,120	7.125000 2037/1/20	1.33%
10	BRAZIL 10.125 05/15/27 アメリカ	国債証券	294,240,000	175.75 517,126,800	153.70 452,246,880	10.125000 2027/5/15	1.31%
11	TURKEY 7.375 02/05/25 アメリカ	国債証券	382,512,000	133.65 511,227,288	116.75 446,582,760	7.375000 2025/2/5	1.29%
12	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16 アメリカ	国債証券	343,280,000	134.00 459,995,200	129.50 444,547,600	11.375000 2016/9/15	1.28%
13	PANAMA 6.7 01/26/36 アメリカ	国債証券	362,896,000	139.40 505,877,024	120.20 436,200,992	6.700000 2036/1/26	1.26%
14	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 アメリカ	国債証券	362,896,000	140.26 509,034,219	119.60 434,059,905	6.750000 2034/9/27	1.25%
15	COLOMBIA 7.375 03/18/19 アメリカ	国債証券	353,088,000	129.27 456,439,800	121.85 430,237,728	7.375000 2019/3/18	1.24%
16	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 アメリカ	国債証券	353,088,000	133.69 472,059,040	121.75 429,884,640	6.375000 2034/10/23	1.24%
17	TURKEY 7.25 03/15/15 アメリカ	国債証券	392,320,000	110.36 432,980,044	107.65 422,332,480	7.250000 2015/3/15	1.22%
18	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20 アメリカ	国債証券	372,704,000	119.85 446,685,744	112.50 419,292,000	5.125000 2020/1/15	1.21%

19	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 アメリカ	国債証券	392,320,000	117.35 460,391,443	105.29 413,073,728	5.625000 2042/4/4	1.19%
20	BRAZIL 4.875 01/22/21 アメリカ	国債証券	382,512,000	119.10 455,571,792	106.95 409,096,584	4.875000 2021/1/22	1.18%
21	COLOMBIA 6.125 01/18/41 アメリカ	国債証券	362,896,000	135.25 490,816,840	112.00 406,443,520	6.125000 2041/1/18	1.17%
22	RUSSIA FOREIGN BOND 3.625 04/29/15 アメリカ	国債証券	362,896,000	104.90 380,700,952	104.26 378,391,659	3.625000 2015/4/29	1.09%
23	BRAZIL 8.25 01/20/34 アメリカ	国債証券	284,432,000	158.75 451,564,243	130.75 371,894,840	8.250000 2034/1/20	1.07%
24	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19 アメリカ	国債証券	313,856,000	123.25 386,827,520	116.75 366,426,880	5.950000 2019/3/19	1.06%
25	COLOMBIA 7.375 09/18/37 アメリカ	国債証券	284,432,000	150.10 426,942,240	128.75 366,206,200	7.375000 2037/9/18	1.06%
26	HUNGARY 6.375 03/29/21 アメリカ	国債証券	333,472,000	109.15 364,001,361	105.75 352,646,640	6.375000 2021/3/29	1.02%
27	COLOMBIA 4.375 07/12/21 アメリカ	国債証券	333,472,000	114.10 380,491,552	104.50 348,478,240	4.375000 2021/7/12	1.01%
28	BRAZIL 5.875 01/15/19 アメリカ	国債証券	304,048,000	121.43 369,227,064	113.50 345,094,480	5.875000 2019/1/15	1.00%
29	TURKEY 6.875 03/17/36 アメリカ	国債証券	313,856,000	129.77 407,291,912	109.75 344,456,960	6.875000 2036/3/17	0.99%
30	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 アメリカ	国債証券	225,584,000	169.12 381,518,940	151.37 341,477,780	9.500000 2030/2/2	0.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	95.44%
合計	95.44%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成25年7月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	日本	アメリカ・ドル買 / 円売 2013年08月	買建	3,392,000	332,651,744	332,653,440	0.96%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

**(3) 【運用実績】**

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

**【純資産の推移】**

直近日（平成25年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）(円)	1口当たりの 純資産額 （分配付）(円)
第1計算期間末 （平成25年1月11日）	0	0	1.0794	1.0794
平成24年9月末日	0	-	1.0038	-
10月末日	0	-	1.0111	-
11月末日	0	-	1.0291	-
12月末日	0	-	1.0593	-
平成25年1月末日	0	-	1.0976	-
2月末日	0	-	1.1108	-
3月末日	0	-	1.1407	-
4月末日	1	-	1.1704	-
5月末日	3	-	1.1634	-
6月末日	6	-	1.1422	-
7月末日	97	-	1.1503	-

**【分配の推移】**

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	-

**【収益率の推移】**

	収益率(%)
第1計算期間	7.9
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	7.0

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

## 純資産の推移

直近日（平成25年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）(円)	1口当たりの 純資産額 （分配付）(円)
第1計算期間末 （平成25年1月11日）	0	0	1.1353	1.1353
平成24年9月末日	0	-	1.0052	-
10月末日	0	-	1.0187	-
11月末日	0	-	1.0472	-
12月末日	0	-	1.1008	-
平成25年1月末日	0	-	1.1641	-
2月末日	0	-	1.1819	-
3月末日	1	-	1.2274	-
4月末日	1	-	1.2830	-
5月末日	6	-	1.2771	-
6月末日	8	-	1.2347	-
7月末日	89	-	1.2466	-

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	-

## 収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	13.5
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	10.7

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）

## 純資産の推移

直近日（平成25年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）(円)	1口当たりの 純資産額 （分配付）(円)
第1計算期間末 （平成25年1月11日）	0	0	1.1928	1.1928
平成24年9月末日	0	-	1.0067	-
10月末日	0	-	1.0263	-
11月末日	0	-	1.0654	-
12月末日	0	-	1.1435	-
平成25年1月末日	0	-	1.2326	-
2月末日	0	-	1.2550	-
3月末日	0	-	1.3182	-
4月末日	3	-	1.4039	-
5月末日	10	-	1.3982	-
6月末日	11	-	1.3304	-
7月末日	105	-	1.3459	-

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	-

## 収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	19.3
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	14.1

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

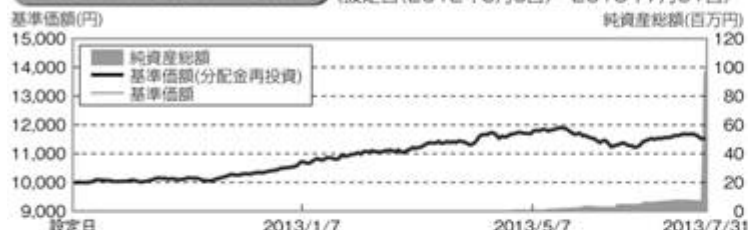
なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## 参考情報

データの基準日:2013年7月31日

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)

## 基準価額・純資産の推移 (設定日(2012年9月6日)~2013年7月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2012年9月6日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	57.15%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	10.02%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	9.99%
4	エマージング債券パッシブ・マザー・ファンド	4.98%
5	エマージング株式パッシブ・マザー・ファンド	4.95%
6	外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	3.00%
7	外国リートパッシブ・ファンド・マザー・ファンド	2.97%
8	J-REITインデックスファンド・マザー・ファンド	2.93%

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

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。  
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2012年は設定日から年末までの収益率、および2013年については年初から基準日までの収益率を表示しています。  
 ※2011年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは、合成ベンチマークであり、当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチマークを基本アロケーションで委託会社が合成したものです。

※ファンドのベンチマークは、当社が独自に指数化した合成ベンチマークです。国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMU RA-BPI総合、先進国株式(除く日本)についてはMSCIロクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、先進国債券(除く日本)についてはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、新興国株式についてはMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、新興国債券についてはJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース、為替ヘッジなし)、国内リートについては東証REIT指数(配当込み)、先進国リート(除く日本)についてはS&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローン(オーバーナイト物)を、各ファンドの基本アロケーションに基づいて合成したものです。(以下、(新興国20)、(新興国30)についても同様。)

## &lt;基本アロケーション&gt;

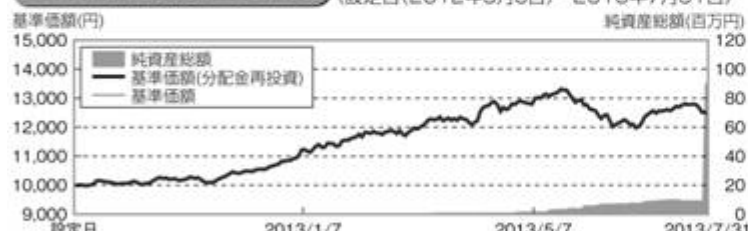
・DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)  
 国内株式:10% 国内債券:57% 先進国株式(除く日本):10% 先進国債券(除く日本):3% 新興国株式:5% 新興国債券:5% 国内リート:3% 先進国リート(除く日本):3% 短期金融資産:4%

・DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)  
 国内株式:15% 国内債券:31% 先進国株式(除く日本):15% 先進国債券(除く日本):4% 新興国株式:10% 新興国債券:10% 国内リート:6% 先進国リート(除く日本):6% 短期金融資産:3%

・DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)  
 国内株式:20% 国内債券:5% 先進国株式(除く日本):20% 先進国債券(除く日本):5% 新興国株式:15% 新興国債券:15% 国内リート:9% 先進国リート(除く日本):9% 短期金融資産:2%

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)

## 基準価額・純資産の推移 (設定日(2012年9月6日)~2013年7月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2012年9月6日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第1期 (2013.01.11)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万口当たりです。

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



データの基準日:2013年7月31日

## 主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	31.16%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	15.06%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.02%
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	9.99%
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	9.93%
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.95%
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	5.87%
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.01%

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

## 年間収益率の推移

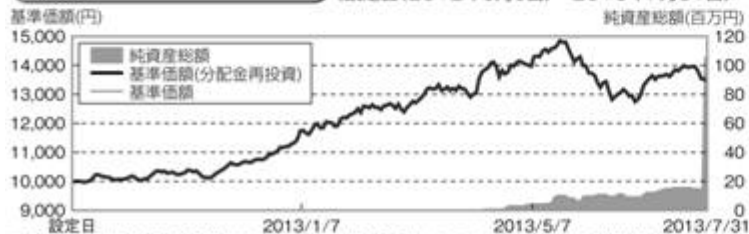


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと  
して算出しております。  
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、  
2012年は設定日から年末までの収益率、および2013年  
については年初から基準日までの収益率を表示しています。  
※2011年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表  
示しています。当ファンドのベンチマークは、合成ベンチマ  
ークであり、当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチ  
マークを基本アロケーションで委託会社が合成したものです。

## DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)

## 基準価額・純資産の推移

(設定日(2012年9月6日)~2013年7月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資  
したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2012年9月6日)  
※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第1期(2013.01.11)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

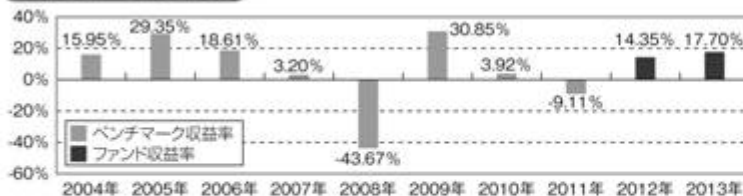
(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.11%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.07%
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	15.02%
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	14.93%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.95%
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	8.83%
7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.04%
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.02%

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

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと  
して算出しております。  
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、  
2012年は設定日から年末までの収益率、および2013年  
については年初から基準日までの収益率を表示しています。  
※2011年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表  
示しています。当ファンドのベンチマークは、合成ベンチマ  
ークであり、当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチ  
マークを基本アロケーションで委託会社が合成したものです。

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

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2013年7月31日

## 各マザーファンドの主要な資産の状況

## ■国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	94.88
内 日本	94.88
コールローン、その他の資産(負債控除後)	5.12
純資産総額	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	4.75

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.63%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.71%
3	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.02%
4	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.85%
5	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.80%

## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	輸送用機器	11.38%
2	電気機器	10.80%
3	銀行業	9.72%
4	情報・通信業	6.57%
5	化学	5.14%

## ■国内債券バッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	78.96
内 日本	78.96
地方債証券	6.72
内 日本	6.72
特殊債券	7.08
内 日本	7.08
社債券	6.76
内 日本	6.76
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.47
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	328回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/3/20	1.43%
2	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2022/9/20	1.34%
3	326回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.700000	2022/12/20	1.33%
4	326回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2015/3/15	1.23%
5	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.23%

## ■外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.92
内 アメリカ	57.42
内 ユーロ	12.69
内 イギリス	9.54
内 カナダ	4.53
内 スイス	4.00
内 その他	7.74
投資信託受益証券	0.32
内 オーストラリア	0.28
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.81
内 アメリカ	1.49
内 ユーロ	0.12
内 イギリス	0.11
内 香港	0.04
内 カナダ	0.04
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.95
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	1.58%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.56%
3	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.97%
4	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.94%
5	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	0.94%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	石油・ガス・消耗燃料	8.90%
2	商業銀行	7.62%
3	医薬品	6.77%
4	保険	4.63%
5	メディア	2.87%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.12
為替予約取引(売建)	△0.03
株価指数先物取引(買建)	1.90

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

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2013年7月31日

## ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.69
内 ユーロ	42.08
内 アメリカ	39.59
内 イギリス	7.26
内 カナダ	2.50
内 オーストラリア	1.38
内 その他	4.88
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.31
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 0.25 09/15/14	国債証券	アメリカ	0.250000	2014/9/15	1.00%
2	US T N/B 4.25 11/15/14	国債証券	アメリカ	4.250000	2014/11/15	0.96%
3	US T N/B 2.375 09/30/14	国債証券	アメリカ	2.375000	2014/9/30	0.89%
4	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債証券	ユーロ	3.750000	2015/1/4	0.85%
5	US T N/B 2.5 03/31/15	国債証券	アメリカ	2.500000	2015/3/31	0.77%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.09

## ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.11
内 香港	17.94
内 韓国	14.47
内 台湾	11.29
内 ブラジル	10.57
内 アメリカ	9.93
内 その他	30.91
投資信託受益証券	0.87
内 メキシコ	0.87
投資証券	0.15
内 メキシコ	0.12
内 トルコ	0.03
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.87
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	半導体・半導体製造装置	3.45%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	2.25%
3	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.74%
4	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	香港	商業銀行	1.42%
5	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	香港	インターネットソフトウェアサービス	1.29%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	17.93%
2	石油・ガス・消耗燃料	10.97%
3	半導体・半導体製造装置	7.65%
4	無線通信サービス	5.78%
5	金属・鉱業	4.74%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1.09
為替予約取引(売建)	△1.33
株価指数先物取引(買建)	3.83

## ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	95.44
内 アメリカ	95.44
コールローン、その他の資産(負債控除後)	4.56
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	アメリカ	7.500000	2030/3/31	6.56%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	国債証券	アメリカ	11.000000	2018/7/24	1.99%
3	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	アメリカ	6.050000	2040/1/11	1.68%
4	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	アメリカ	5.000000	2020/4/29	1.67%
5	PERU 8.75 11/21/33	国債証券	アメリカ	8.750000	2033/11/21	1.66%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.96

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

データの基準日:2013年7月31日

## ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	98.59
内 日本	98.59
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.41
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	11.87%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	9.90%
3	日本リテールファンド投資法人	日本	6.45%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.64%
5	アドバンスレジデンス投資法人	日本	3.95%

## ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けしております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	13.82
内 オーストラリア	10.16
内 シンガポール	3.65
投資証券	85.67
内 アメリカ	67.65
内 ユーロ	7.00
内 イギリス	5.95
内 カナダ	2.69
内 香港	2.03
内 その他	0.35
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.51
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	6.58%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	ユーロ	3.05%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.02%
4	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	2.72%
5	HCP INC	アメリカ	2.66%

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

**(4)【設定及び解約の実績】**

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	500,000	0
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	6,791,789	922,548

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	500,000	0
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	7,875,011	305,523

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	500,000	0
平成25年1月12日～ 平成25年7月11日	16,391,515	5,407,364

（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2【管理及び運営】

### 3【資産管理等の概要】

#### (5)【その他】

<訂正前>

(略)

#### 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。

平成25年4月1日より、公告の方法は以下の通り変更される予定です。

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

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

ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告による公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行います。

(略)

<訂正後>

(略)

#### 二．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

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

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

(略)

### 第3【ファンドの経理状況】

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

< 追 加 >

#### D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成25年1月12日から平成25年7月11日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

## 【D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		301,325
親投資信託受益証券		7,060,171
流動資産合計		7,361,496
資産合計		7,361,496
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		279
未払委託者報酬		2,568
その他未払費用		2
流動負債合計		2,849
負債合計		2,849
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,369,241
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		989,406
（分配準備積立金）		28,501
元本等合計		7,358,647
純資産合計		7,358,647
負債純資産合計		7,361,496



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第2期中間計算期間 自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
営業収益		
受取利息		1
有価証券売買等損益		63,943
営業収益合計		63,944
営業費用		
受託者報酬		279
委託者報酬		2,568
その他費用		2
営業費用合計		2,849
営業利益又は営業損失（ ）		61,095
経常利益又は経常損失（ ）		61,095
中間純利益又は中間純損失（ ）		61,095
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う 中間純損失金額の分配額（ ）		2,081
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		39,724
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,032,097
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,032,097
剰余金減少額又は欠損金増加額		145,591
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		145,591
分配金		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		989,406

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1 . 1 期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	6,791,789円
期中一部解約元本額	922,548円
2 . 受益権の総数	6,369,241口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1 . 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1553円
(1万口当たり純資産額)	(11,553円)

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成25年1月12日から平成25年7月11日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

## 【D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		307,908
親投資信託受益証券		9,835,744
流動資産合計		10,143,652
資産合計		10,143,652
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		458
未払委託者報酬		4,547
その他未払費用		28
流動負債合計		5,033
負債合計		5,033
純資産の部		
元本等		
元本	1	8,069,488
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,069,131
（分配準備積立金）		61,915
元本等合計		10,138,619
純資産合計		10,138,619
負債純資産合計		10,143,652

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第2期中間計算期間 自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
営業収益		
有価証券売買等損益		47,503
営業収益合計		47,503
営業費用		
受託者報酬		458
委託者報酬		4,547
その他費用		28
営業費用合計		5,033
営業利益又は営業損失（ ）		52,536
経常利益又は経常損失（ ）		52,536
中間純利益又は中間純損失（ ）		52,536
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う 中間純損失金額の分配額（ ）		1,279
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		67,642
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,138,933
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,138,933
剰余金減少額又は欠損金増加額		83,629
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		83,629
分配金		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,069,131

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1 . 1 期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	7,875,011円
期中一部解約元本額	305,523円
2 . 受益権の総数	8,069,488口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1 . 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2564円
(1万口当たり純資産額)	(12,564円)

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成25年1月12日から平成25年7月11日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

## 【D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		347,815
親投資信託受益証券		15,325,088
流動資産合計		15,672,903
資産合計		15,672,903
負債の部		
流動負債		
未払解約金		29,310
未払受託者報酬		753
未払委託者報酬		7,822
その他未払費用		56
流動負債合計		37,941
負債合計		37,941
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,484,151
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		4,150,811
（分配準備積立金）		44,352
元本等合計		15,634,962
純資産合計		15,634,962
負債純資産合計		15,672,903



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

科 目	注記 番号	第2期中間計算期間 自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
営業収益		
受取利息		24
有価証券売買等損益		217,965
営業収益合計		217,941
営業費用		
受託者報酬		753
委託者報酬		7,822
その他費用		56
営業費用合計		8,631
営業利益又は営業損失（ ）		226,572
経常利益又は経常損失（ ）		226,572
中間純利益又は中間純損失（ ）		226,572
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う 中間純損失金額の分配額（ ）		90,189
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		96,399
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,382,600
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,382,600
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,191,805
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,191,805
分配金		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		4,150,811

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1. 1 期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	16,391,515円
期中一部解約元本額	5,407,364円
2. 受益権の総数	11,484,151口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期中間計算期間末 平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3614円
(1万口当たり純資産額)	(13,614円)

（参考）

「DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）」、「DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）」、「DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

#### 貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		10,305,997,660
株式	2	323,911,813,000
派生商品評価勘定		830,393,722
未収入金		10,750,287
未収配当金		256,560,240
流動資産合計		335,315,514,909
資産合計		335,315,514,909
負債の部		
流動負債		
前受金		837,615,000
未払解約金		302,718,000
流動負債合計		1,140,333,000
負債合計		1,140,333,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	202,562,042,559
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		131,613,139,350
元本等合計		334,175,181,909
純資産合計		334,175,181,909
負債純資産合計		335,315,514,909

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	237,448,868,793円
同期中追加設定元本額	18,162,113,075円
同期中一部解約元本額	53,048,939,309円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	3,855,023,340円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,293,638,430円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	37,845,908,406円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	765,154,246円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,859,458,936円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,121,839,084円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	394,168,833円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,336,839,351円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,110,011,421円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	121,688,174円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,505,002,365円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	19,921,906円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	447,178円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	938,056円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	1,909,405円
投資のソムリエ	1,963,761円
クルーズコントロール	731,997円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	171,780,489円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	6,634,581,043円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,307,919,165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）	160,569,000円

D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	612,152,345円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定）	147,490,509円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	231,173,116円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）	16,058,829,754円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	5,340,516,978円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	3,846,338,105円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限定）	2,590,147,425円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	6,156,965,800円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A（適格機関投資家限定）	856,350,813円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2（適格機関投資家限定）	1,897,386,268円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定）	1,812,507,661円
D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	9,967,969,824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）	113,023,493円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A（適格機関投資家限定）	3,436,454,466円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド3 5 V A（適格機関投資家限定）	7,511,813,682円
D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）	340,256,026円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	30,814,423,202円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）	1,715,757,687円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	3,648,045,066円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	18,784,738,540円
D I A Mバランス3 0 V A（適格機関投資家限定）	89,536,768円
D I A Mバランス5 0 V A（適格機関投資家限定）	111,722,556円
D I A Mバランス7 0 V A（適格機関投資家限定）	149,141円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A（適格機関投資家限定）	16,600,911,191円
D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投資家限定）	211,148,382円
D I A M国内バランス3 0 V A（適格機関投資家限定）	68,311,460円
D I A Mバランス2 0 V A（適格機関投資家限定）	143,194,770円
D I A Mバランス4 0 V A（適格機関投資家限定）	79,134円
D I A Mバランス6 0 V A（適格機関投資家限定）	125,386円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A（1 2 1 2）（適格機関投資家限定）	1,034,935,394円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A（1 3 0 3）（適格機関投資家限定）	2,563,890,274円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A（1 3 0 6）（適格機関投資家限定）	3,341,912,869円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A（1 3 0 9）（適格機関投資家限定）	4,289,888円

計 202,562,042,559円

2 . 受益権の総数 202,562,042,559口

3 .	2	差入代用有価証券	株式	3,190,000,000円
-----	---	----------	----	----------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年7月11日現在
1 . 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成25年7月11日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
先物取引				
買 建	9,287,980,000	-	10,118,875,000	830,895,000
合計	9,287,980,000	-	10,118,875,000	830,895,000

## (注) 1 . 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 . 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3 . 契約額等には手数料相当額を含んでおりませぬ。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありませぬ。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.6497円
(1万口当たり純資産額)	(16,497円)



## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,008,631,797
国債証券		351,286,599,200
地方債証券		29,811,806,539
特殊債券		30,677,970,955
社債券		29,889,205,480
未収入金		2,346,344,000
未収利息		1,215,876,334
前払費用		53,775,022
流動資産合計		446,290,209,327
資産合計		446,290,209,327
負債の部		
流動負債		
未払解約金		449,588,000
流動負債合計		449,588,000
負債合計		449,588,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	381,744,908,581
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		64,095,712,746
元本等合計		445,840,621,327
純資産合計		445,840,621,327
負債純資産合計		446,290,209,327



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	368,547,050,465円
同期中追加設定元本額	52,235,681,787円
同期中一部解約元本額	39,037,823,671円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	6,041,625,889円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C 年金 >	9,584,300,613円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	3,459,872,744円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	5,536,825,211円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	2,217,350,199円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,320,114,855円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,478,113,206円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	204,711,146円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	170,792,784円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	2,117,734,243円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,912,440円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	3,593,317円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	2,698,048円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	670,204円
投資のソムリエ	16,276,477円
クルーズコントロール	1,253,047円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
D I A M国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	13,991,244,497円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	756,941,623円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	10,682,521,021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）	701,513,587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）	502,326,175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）	1,232,190,346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）	494,415,878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）	413,470,795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）	32,291,705,733円

D I A M世界バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	10,739,659,742円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	13,767,285,744円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限定）	5,213,581,358円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	8,260,686,736円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A（適格機関投資家限定）	1,723,854,087円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2（適格機関投資家限定）	6,368,010,036円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定）	7,299,350,500円
D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	13,379,912,347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）	461,343,393円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A（適格機関投資家限定）	13,843,432,679円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド3 5 V A（適格機関投資家限定）	8,368,660,728円
D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）	1,549,003,873円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	110,271,679,860円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）	2,302,038,182円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	9,792,868,160円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	33,606,955,408円
D I A Mバランス3 0 V A（適格機関投資家限定）	962,691,235円
D I A Mバランス5 0 V A（適格機関投資家限定）	375,042,348円
D I A Mバランス7 0 V A（適格機関投資家限定）	200,402円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A（適格機関投資家限定）	37,131,289,980円
D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投資家限定）	932,253,475円
D I A M国内バランス3 0 V A（適格機関投資家限定）	213,806,786円
D I A Mバランス2 0 V A（適格機関投資家限定）	1,924,614,132円
D I A Mバランス4 0 V A（適格機関投資家限定）	372,357円
D I A Mバランス6 0 V A（適格機関投資家限定）	280,116円
計	381,744,908,581円
2 . 受益権の総数	381,744,908,581口

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1679円
(1万口当たり純資産額)	(11,679円)

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		36,916,662
投資証券		11,578,688,330
未収配当金		97,430,182
流動資産合計		11,713,035,174
資産合計		11,713,035,174
負債の部		
流動負債		
未払金		15,248,065
未払解約金		1,147,000
流動負債合計		16,395,065
負債合計		16,395,065
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,575,572,422
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		2,121,067,687
元本等合計		11,696,640,109
純資産合計		11,696,640,109
負債純資産合計		11,713,035,174

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目		平成25年7月11日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,227,610,808円
	同期中追加設定元本額	4,876,166,095円
	同期中一部解約元本額	9,528,204,481円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	45,593,563円
	マネックス資産設計ファンド<育成型>	563,959,185円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,906,824円
	D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	178,975円
	D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	499,022円
	D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	1,162,700円
	投資のソムリエ	726,559円
	D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201210(適格機関投資家限定)	2,529,503,354円
	D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	1,513,433,495円
	D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201301(適格機関投資家限定)	503,763,684円
	D I A M J - R E I Tインデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,956,284,754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)	158,679,384円
	D I A Mグローバル分散ファンドV A(適格機関投資家限定)	299,880,923円
	計	9,575,572,422円
2 .	受益権の総数	9,575,572,422口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1,2215円
（1万口当たり純資産額）	（12,215円）

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金		3,607,514,372
コール・ローン		118,088,415
株式		305,289,685,731
投資信託受益証券		1,060,494,924
投資証券		5,837,908,298
派生商品評価勘定		71,967,377
未収入金		31,756,410
未収配当金		490,964,289
差入委託証拠金		951,211,272
流動資産合計		317,459,591,088
資産合計		317,459,591,088
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		9,713,777
未払解約金		215,771,000
流動負債合計		225,484,777
負債合計		225,484,777
純資産の部		
元本等		
元本	1	162,914,515,077
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		154,319,591,234
元本等合計		317,234,106,311
純資産合計		317,234,106,311
負債純資産合計		317,459,591,088

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成25年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	192,607,329,918円  7,382,673,103円 37,075,487,944円
元本の内訳 ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,090,611,135円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 >	33,484,443,583円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	169,039,370円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	959,945,405円



D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,192,609,487円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	161,057,872円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	462,569,742円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	357,715,615円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	84,946,212円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,052,118,798円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	171,585,133円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	382,707円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	786,588円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,608,717円
投資のソムリエ	1,899,357円
クルーズコントロール	304,242円
D I A M外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	485,807,416円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,344,869,700円
D I A M為替リスクコントロール型グローバル株式私募ファンド(適格機関投資家限定)	6,279,907,342円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	61,294,403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)	5,535,761,423円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,091,106,449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)	133,793,785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)	766,286,772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)	61,414,183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)	128,453,130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)	13,388,967,448円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,679,116,242円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,138,870,999円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,890,982,843円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,137,309,190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)	3,543,461,737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)	4,707,369,523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)	3,025,703,036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)	2,765,696,311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)	28,820,733円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	12,818,966,404円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	2,511,237,330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)	96,477,347円

	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	17,138,219,774円
	D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	1,432,702,227円
	D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	3,043,917,210円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	10,447,574,735円
	D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	186,590,586円
	D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	249,410円
	D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	13,851,758,852円
	D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	65,769円
	D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	138,805円
	計	162,914,515,077円
2 .	受益権の総数	162,914,515,077口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成25年7月11日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	205,624,370	-	204,823,000	801,370
アメリカ・ドル	110,638,600	-	109,560,000	1,078,600
イギリス・ポンド	30,036,860	-	30,078,000	41,140
ユーロ	64,948,910	-	65,185,000	236,090
合計	205,624,370	-	204,823,000	801,370

## （注）時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

- 3．換算において円未満の端数は切捨てております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	平成25年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	4,802,474,476	-	4,863,926,706	61,452,230
合計	4,802,474,476	-	4,863,926,706	61,452,230

(注) 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.9472円
(1万口当たり純資産額)	(19,472円)

[次へ](#)

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金		6,781,183,327
コール・ローン		350,641,339
国債証券		387,878,068,043
派生商品評価勘定		1,380,751
未収利息		4,406,515,301
前払費用		125,348,311
流動資産合計		399,543,137,072
資産合計		399,543,137,072
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,822,670
未払解約金		639,326,000
流動負債合計		642,148,670
負債合計		642,148,670
純資産の部		
元本等		
元本	1	262,886,291,305
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		136,014,697,097
元本等合計		398,900,988,402
純資産合計		398,900,988,402
負債純資産合計		399,543,137,072

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	286,407,723,256円
同期中追加設定元本額	11,407,077,407円
同期中一部解約元本額	34,928,509,358円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	2,395,059,104円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C 年金 >	4,208,057,600円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	335,597,463円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	1,210,032,041円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,241,243,071円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	297,541,073円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	651,972,941円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	449,738,308円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	49,418,246円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	604,685,197円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	8,396,763円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	144,543円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	265,593円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	512,324円
クルーズコントロール	928,226円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	4,132,700,382円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	6,550,931,595円
D I A M外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	5,048,214,652円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	944,573,320円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	179,360,414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）	33,307,186,644円

D I A Mグローバル・バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	2,187,453,961円
D I A M国際分散バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定）	391,326,403円
D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	639,777,808円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定）	153,987,014円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	80,419,856円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）	25,156,029,478円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	5,576,072,721円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	9,384,159,699円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限定）	4,400,142,986円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	6,435,017,272円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A（適格機関投資家限定）	2,244,103,224円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2（適格機関投資家限定）	6,956,364,032円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定）	7,562,280,859円
D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	37,957,258,466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）	114,075,674円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A（適格機関投資家限定）	5,397,297,565円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド3 5 V A（適格機関投資家限定）	14,359,088,148円
D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）	241,188,145円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	21,468,337,391円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	26,182,149,346円
D I A Mバランス3 0 V A（適格機関投資家限定）	281,138,068円
D I A Mバランス5 0 V A（適格機関投資家限定）	292,182,937円
D I A Mバランス7 0 V A（適格機関投資家限定）	155,879円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A（適格機関投資家限定）	23,138,746,397円
D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投資家限定）	221,015,623円
D I A Mバランス2 0 V A（適格機関投資家限定）	449,624,974円
D I A Mバランス4 0 V A（適格機関投資家限定）	207,250円
D I A Mバランス6 0 V A（適格機関投資家限定）	130,629円
計	262,886,291,305円
2 . 受益権の総数	262,886,291,305口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成25年7月11日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	668,641,521	-	670,083,440	1,441,919
メキシコ・ペソ	157,794,616	-	156,425,640	1,368,976
ユーロ	510,846,905	-	513,657,800	2,810,895
合計	668,641,521	-	670,083,440	1,441,919

## （注）時価の算定方法

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



上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.5174円
（1万口当たり純資産額）	（15,174円）

## 「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金		3,324,618
コール・ローン		31,643,738
投資信託受益証券		3,945,506,632
投資証券		23,987,440,316
派生商品評価勘定		338,580
未収入金		79,722,216
未収配当金		118,116,832
流動資産合計		28,166,092,932
資産合計		28,166,092,932
負債の部		
流動負債		
未払解約金		41,018,000
流動負債合計		41,018,000
負債合計		41,018,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	35,700,508,547
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2	7,575,433,615
元本等合計		28,125,074,932
純資産合計		28,125,074,932
負債純資産合計		28,166,092,932

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	41,124,927,128円
同期中追加設定元本額	2,983,053,798円
同期中一部解約元本額	8,407,472,379円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	280,570円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	770,321円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	1,788,834円
投資のソムリエ	53,459円
為替フルヘッジ型外国リート・パッシブ・ファンド（適格機関投資家限定）	513,836,995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）	13,549,802,224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）	20,950,223,722円
D I A M海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	683,752,422円
計	35,700,508,547円
2 . 受益権の総数	35,700,508,547口

3 .	2	元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,575,433,615円でありま す。
-----	---	-------	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年7月11日現在
1 . 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載して おります。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載して おります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭 債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似 していることから、当該帳簿価額を時価として おります。
3 . 金融商品の時価等に関する事項について の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場 価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれて おります。当該価額の算定においては一定の前提条件等 を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、 当該価額が異なることもありま す。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくま でもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、 当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示 すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成25年7月11日 現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売 建	22,250,580	-	21,912,000		338,580
アメリカ・ドル	22,250,580	-	21,912,000		338,580
合計	22,250,580	-	21,912,000		338,580

## (注)時価の算定方法

1. 計算期間末日に對顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価して  
おります。計算期間末日に對為替予約の受渡日の對顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、  
当該為替予約は当該仲値で評価して  
おります。計算期間末日に對為替予約の受渡日の對顧客先物売買相場の仲値が発表されてい  
ない場合は、以下の方法  
によつて  
おります。

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

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.7878円
（1万口当たり純資産額）	（7,878円）

## 「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金		992,664,393
コール・ローン		46,958,165
株式		36,199,479,112
投資信託受益証券		338,155,005
投資証券		57,640,197
派生商品評価勘定		1,383,096
未収入金		316,708
未収配当金		210,596,664
差入委託証拠金		330,446,115
流動資産合計		38,177,639,455
資産合計		38,177,639,455
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		53,988,210
未払解約金		28,032,000
流動負債合計		82,020,210
負債合計		82,020,210
純資産の部		
元本等		
元本	1	46,837,683,733
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2	8,742,064,488
元本等合計		38,095,619,245
純資産合計		38,095,619,245
負債純資産合計		38,177,639,455

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	46,090,797,565円 5,659,718,503円 4,912,832,335円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	205,402,668円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	251,571,533円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	447,018円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	1,229,400円

	D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	2,885,753円
	投資のソムリエ	742,983円
	クルーズコントロール	631,162円
	エマージング株式パッシブファンドV A(適格機関投資家専用)	8,849,633,854円
	新興国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家限定)	3,098,812,860円
	エマージング株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,208,777,825円
	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A(適格機関投資家限定)	20,017,056,544円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A(適格機関投資家限定)	12,200,492,133円
	計	46,837,683,733円
2 .	受益権の総数	46,837,683,733口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,742,064,488円であり ます。



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成25年7月11日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	12,517,026	-	12,515,022	2,004
アメリカ・ドル	10,006,026	-	10,005,022	1,004
南アフリカ・ランド	2,511,000	-	2,510,000	1,000
買 建	10,006,026	-	9,990,000	16,026
台湾・ドル	10,006,026	-	9,990,000	16,026
合計	22,523,052	-	22,505,022	14,022

## （注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
  - 2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
  - 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	平成25年7月11日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
先物取引				
買 建	1,531,982,874	-	1,479,391,782	52,591,092
合計	1,531,982,874	-	1,479,391,782	52,591,092

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

- 2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.8134円
(1万口当たり純資産額)	(8,134円)

## 「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金		993,288,048
コール・ローン		26,655,503
国債証券		33,069,651,653
派生商品評価勘定		200,070
未収利息		625,185,201
前払費用		31,963,416
流動資産合計		34,746,943,891
資産合計		34,746,943,891
負債の部		
流動負債		
未払解約金		23,650,000
流動負債合計		23,650,000
負債合計		23,650,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	25,952,878,514
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		8,770,415,377
元本等合計		34,723,293,891
純資産合計		34,723,293,891
負債純資産合計		34,746,943,891

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成25年7月11日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	28,309,027,227円
	同期中追加設定元本額	2,361,571,124円
	同期中一部解約元本額	4,717,719,837円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,962,135円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	267,612円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	737,069円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	1,723,423円
	投資のソムリエ	1,510,150円
	クルーズコントロール	382,873円
	グローバル債券ファンド（適格機関投資家限定）	321,885,428円
	為替フルヘッジ型エマージング債券ファンド（適格機関投資家限定）	885,794,406円
	エマージング債券パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）	5,256,993,244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）	12,084,180,790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）	7,365,441,384円
	計	25,952,878,514円
2 .	受益権の総数	25,952,878,514口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成25年7月11日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	13,148,070	-	12,948,000	200,070
アメリカ・ドル	13,148,070	-	12,948,000	200,070
合計	13,148,070	-	12,948,000	200,070

## （注）時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3379円
(1万口当たり純資産額)	(13,379円)

## 2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

### 【純資産額計算書】

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）

平成25年7月31日現在

資産総額	97,187,923円
負債総額	2,265円
純資産総額（ - ）	97,185,658円
発行済数量	84,490,118口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1503円

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

平成25年7月31日現在

資産総額	89,774,130円
負債総額	2,774円
純資産総額（ - ）	89,771,356円
発行済数量	72,013,752口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2466円

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）

平成25年7月31日現在

資産総額	105,747,562円
負債総額	4,448円
純資産総額（ - ）	105,743,114円
発行済数量	78,565,712口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3459円

（参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	318,202,564,377円
負債総額	1,079,096,922円
純資産総額（ - ）	317,123,467,455円
発行済数量	202,991,927,320口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5622円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	454,763,444,470円
負債総額	6,372,421,000円
純資産総額（ - ）	448,391,023,470円
発行済数量	383,240,080,368口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1700円

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	11,132,118,003円
負債総額	320,309,103円
純資産総額（ - ）	10,811,808,900円
発行済数量	9,341,443,352口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1574円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	311,661,782,043円
負債総額	203,197,405円
純資産総額（ - ）	311,458,584,638円
発行済数量	158,500,755,232口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9650円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	394,668,445,326円
負債総額	602,853,612円
純資産総額（ - ）	394,065,591,714円
発行済数量	261,187,223,171口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5087円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	27,384,304,987円
負債総額	34,804,776円
純資産総額（ - ）	27,349,500,211円
発行済数量	35,009,993,973口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7812円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	37,736,374,466円
負債総額	162,282,646円
純資産総額（ - ）	37,574,091,820円
発行済数量	45,306,180,476口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8293円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	34,654,269,455円
負債総額	9,028,000円
純資産総額（ - ）	34,645,241,455円
発行済数量	25,835,480,684口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3410円



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

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

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

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

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

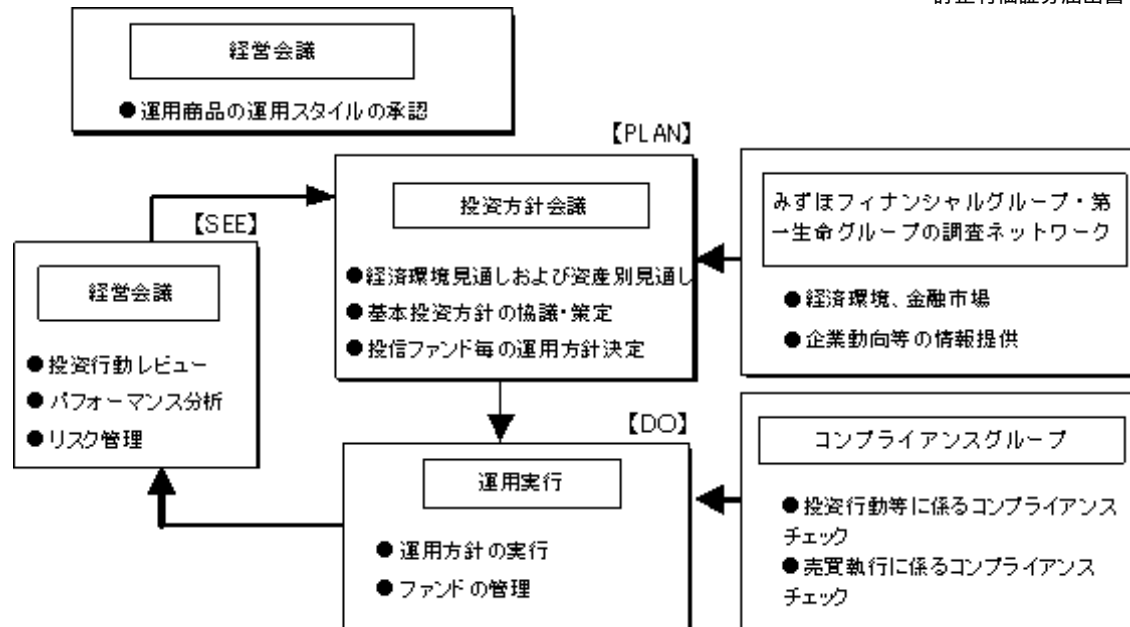
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成25年7月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

平成25年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は294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	10	22,363,692,013
追加型株式投資信託	275	4,666,286,574,951
単位型公社債投資信託	8	83,684,378,117
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	134,803,414
合計	294	4,772,469,448,495

### 3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
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28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,520,748	10,806,745
金銭の信託	6,548,577	10,214,440
前払費用	25,744	69,143
未収委託者報酬	2,780,527	3,073,481
未収運用受託報酬	1,167,998	1,173,744
未収投資助言報酬	2 241,851	2 245,819
未収収益	212,226	244,974
繰延税金資産	344,793	426,229
その他	22,264	25,354
流動資産計	23,864,733	26,279,933
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 167,433	1 142,820
車両運搬具	1 4,752	1 2,770
器具備品	1 188,367	1 231,732
建設仮勘定	109,529	1,207
無形固定資産		
商標権	1 383	1 289
ソフトウェア	1 1,101,685	1 1,261,335
ソフトウェア仮勘定	152,513	68,920
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 371	1 292
投資その他の資産		
投資有価証券	3,982,258	4,002,042
関係会社株式	450,882	400,579
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	590,822	661,777
長期差入保証金	731,197	731,564
その他	90,282	89,047
固定資産計	5,714,444	5,718,557
資産合計	29,579,177	31,998,491

(単位：千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	132,805	571,153
未払金	1,460,128	1,547,527
未払収益分配金	670	48
未払償還金	86,391	84,932
未払手数料	1,088,348	1,195,452
その他未払金	284,718	267,093
未払費用	2 1,105,512	2 1,306,837
未払法人税等	1,195,056	1,299,068
未払消費税等	92,354	116,872
賞与引当金	574,646	724,974
その他	-	100,000
流動負債計	4,560,503	5,666,434
固定負債		
退職給付引当金	680,768	802,603
役員退職慰労引当金	56,690	98,510
固定負債計	737,458	901,113
負債合計	5,297,962	6,567,548
(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	19,716,594	20,898,697
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,463,300	3,945,403
株主資本計	24,145,072	25,327,175
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	136,143	103,768
評価・換算差額等計	136,143	103,768
純資産合計	24,281,215	25,430,943
負債・純資産合計	29,579,177	31,998,491

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)		第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	23,208,602		23,374,427	
運用受託報酬	4,966,992		5,374,163	
投資助言報酬	943,057		885,923	
その他営業収益	697,063		715,164	
営業収益計		29,815,715		30,349,678
営業費用				
支払手数料	10,154,958		10,846,568	
広告宣伝費	164,286		177,553	
公告費	-		3,769	
調査費	4,590,302		4,546,312	
調査費	2,888,013		3,001,788	
委託調査費	1,702,289		1,544,523	
委託計算費	335,754		341,978	
営業雑経費	496,565		456,677	
通信費	26,941		25,513	
印刷費	399,066		374,775	
協会費	25,014		25,492	
諸会費	41		42	
支払販売手数料	45,500		30,854	
営業費用計		15,741,867		16,372,860
一般管理費				
給料	4,630,102		4,870,759	
役員報酬	245,224		242,014	
給料・手当	3,824,122		4,035,751	
賞与	560,755		592,994	
交際費	35,987		36,212	
寄付金	3,156		2,693	
旅費交通費	213,642		187,653	
租税公課	84,346		95,064	
不動産賃借料	656,463		675,811	
退職給付費用	164,627		173,065	
固定資産減価償却費	475,556		524,750	
福利厚生費	24,887		26,642	
修繕費	6,721		6,018	
賞与引当金繰入	574,646		724,974	
役員退職慰労引当金繰入	30,048		47,820	
役員退職金	27,503		7,200	
機器リース料	1,510		35	
事務委託費	323,740		224,066	
消耗品費	58,739		60,044	
器具備品費	2,889		2,065	
諸経費	114,695		159,247	
一般管理費計		7,429,267		7,824,126
営業利益		6,644,580		6,152,691

（単位：千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）		第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	
	営業外収益			
受取配当金	61,720		10,223	
受取利息	3,921		3,554	
時効成立分配金	11,383		2,080	
為替差益	1,660		-	
金銭の信託運用益	-		168,444	
雑収入	5,992		4,957	
営業外収益計		84,678		189,260
営業外費用				
為替差損	-		6,549	
時効成立後支払分配金	36		-	
金銭の信託運用損	417,812		-	
雑損失	1,152		-	
営業外費用計		419,001		6,549
経常利益		6,310,257		6,335,402
特別利益				
ゴルフ会員権売却益	1,959		-	
特別利益計		1,959		-
特別損失				
固定資産除却損	1	36,415	1	1,752
固定資産売却損		381		115
関係会社株式評価損		338,244		-
特別損失計		375,042		1,868
税引前当期純利益		5,937,173		6,333,533
法人税、住民税及び事業税		2,582,251		2,573,893
法人税等調整額		56,997		134,463
法人税等合計		2,525,253		2,439,430
当期純利益		3,411,920		3,894,102

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	13,430,000	15,630,000
当期変動額	2,200,000	700,000
当期末残高	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	4,459,380	3,463,300
当期変動額		
剰余金の配当	2,208,000	2,712,000
別途積立金の積立	2,200,000	700,000
当期純利益	3,411,920	3,894,102
当期末残高	3,463,300	3,945,403
利益剰余金合計		
当期首残高	18,512,674	19,716,594
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	19,716,594	20,898,697
株主資本合計		
当期首残高	22,941,152	24,145,072
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	24,145,072	25,327,175
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	216,534	136,143



	当期変動額（純額）	80,390	32,375
	当期末残高	136,143	103,768
純資産合計			
	当期首残高	23,157,686	24,281,215
	当期変動額	1,123,529	1,149,727
	当期末残高	24,281,215	25,430,943

[次へ](#)

## 重要な会計方針

項目	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)</p> <p>法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。</p> <p>なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当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>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

## 未適用の会計基準等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）	
「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針 平成24年5月17日）	
（1）概要 財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。	
（2）適用予定日 平成25年4月1日以後に開始する事業年度の期末から適用予定であります。ただし、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。	
（3）当該会計基準等の適用による影響 財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。	

## 注記事項

（貸借対照表関係）

## 1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
建物	513,080	539,393
車両運搬具	171	2,152
器具備品	462,449	565,794
商標権	2,555	649
ソフトウェア	961,584	1,071,133
電話施設利用権	1,225	1,304

## 2. 関係会社項目

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

（千円）

		第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	238,121	241,190
流動負債	未払費用	292,536	334,888

## （損益計算書関係）

## 1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	第28期 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）
建物	1,892	-
器具備品	18,917	-
ソフトウェア	15,606	1,752

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## （1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

平成25年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

## (リース取引関係)

## 1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

該当事項はありません。

未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

(千円)

	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
支払リース料	588	-
減価償却費相当額	543	-
支払利息相当額	1	-

減価償却費相当額の算定方法  
該当事項はありません。

利息相当額の算定方法  
該当事項はありません。

2. オペレーティング・リース取引  
該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

#### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

## 第27期（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,520,748	12,520,748	-
(2) 金銭の信託	6,548,577	6,548,577	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	370,636	370,636	-
資産計	19,439,962	19,439,962	-
(1) 未払法人税等	1,195,056	1,195,056	-
負債計	1,195,056	1,195,056	-

## 第28期（平成25年3月31日現在）

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払法人税等

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



（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
長期差入保証金	731,197	731,564

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期（平成24年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
(1) 預金	12,520,524	-	-	-
合計	12,520,524	-	-	-

第28期（平成25年3月31日現在）

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

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第27期及び第28期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 4. その他有価証券

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	359,540	146,101	213,438
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,482	3,000	482
小計	363,022	149,101	213,920
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,614	10,000	2,386
小計	7,614	10,000	2,386
合計	370,636	159,101	211,534

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

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

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

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

## 7. 減損処理を行った有価証券

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

該当事項はありません。

## （金銭の信託関係）

## 1. 運用目的の金銭の信託

第27期（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	6,548,577	495,939

第28期（平成25年3月31日現在）

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

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引関係）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

（千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
（1）退職給付債務	740,560	936,125
（2）未認識数理計算上の差異	59,792	133,522
退職給付引当金	680,768	802,603

## 3. 退職給付費用に関する事項

（千円）

	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	第28期 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）
（1）勤務費用	102,728	102,125
（2）利息費用	9,549	11,108
（3）数理計算上の差異の費用処理額	13,388	17,593
（4）確定拠出年金 拠出額	38,960	41,923
（5）その他	-	314
退職給付費用	164,627	173,065

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

## （1）割引率

第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	第28期 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）
1.5%	1.5%

## （2）退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

## （3）数理計算上の差異の処理年数

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第27期	第28期
	(平成24年3月31日現在)	(平成25年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	87,682	107,022
未払事業所税	5,792	5,986
賞与引当金	218,423	275,562
未払法定福利費	24,791	34,566
未払確定拠出年金掛金	2,607	3,091
減価償却超過額（一括償却資産）	5,496	5,192
減価償却超過額	150,369	159,737
繰延資産償却超過額（税法上）	47,261	27,873
退職給付引当金	243,845	286,796
役員退職慰労引当金	20,204	35,109
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	4,410	22,907
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	678	109
繰延税金資産合計	935,615	1,088,007
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	-	-
差引繰延税金資産の純額	935,615	1,088,007

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

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

## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	23,208,602	5,910,049	697,063	29,815,715

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者との取引 )

## (1) 親会社及び法人主要株主等

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102 億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	687,972	未収投資助言報酬	177,282

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102 億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	710,289	未収投資助言報酬	203,114

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	523,845	未払 費用	158,645
	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	203,092	未払 費用	75,484

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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



## (3)兄弟会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	1,548,354	未払 手数料	122,786
								預金の引出 (純額)	91,135	現金・ 預金	433,779
								受取利息	104	未収 収益	-
	株式会社 みずほ コーポ レート銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	450,766	未払 手数料	83,446
								預金の預入 (純額)	392,267	現金・ 預金	11,440,025
								受取利息	3,654	未収 収益	-
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	237,031	未払 費用	127,757
								業務委託料 の支払	15,140	未払 費用	6,373
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額)	1,000,000	金銭の 信託	6,548,577
								信託報酬の 支払	5,087		

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料  預金の預入 (純額)  受取利息	1,661,638  191,782  106	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	142,323  625,561  -
	株式会社 みずほ コーポ レート銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料  預金の引出 (純額)  受取利息	460,605  1,912,442  3,210	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	100,875  9,527,582  61
	みずほ第 一フィ ナンシャ ルテクノ ロジー株 式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払  業務委託料 の支払	259,435  11,140	未払 費用  未払 費用	132,250  5,848
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の 追加 (純額)  信託報酬の 支払	3,500,000  5,908	金銭の 信託	10,214,440

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,011,717円32銭	1,059,622円64銭
1株当たり当期純利益金額	142,163円33銭	162,254円29銭

(注1) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

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

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 5【その他】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 5 その他」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

・公告の方法の変更（電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。）に変更）

(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】

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

<更新・訂正後>

#### (1)受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

平成25年3月末日現在 247,369百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

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

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

\*平成25年3月末日現在

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年8月28日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）の平成25年1月12日から平成25年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）の平成25年7月11日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年1月12日から平成25年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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

中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書2へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年8月28日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）の平成25年1月12日から平成25年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）の平成25年7月11日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年1月12日から平成25年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

---

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

中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[ファンド監査報告書3へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年8月28日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）の平成25年1月12日から平成25年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）の平成25年7月11日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年1月12日から平成25年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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

中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

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



## 独立監査人の監査報告書

平成25年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

---

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

[ファンド監査報告書3へ](#)