

【表紙】

【提出書類】 半期報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2022年10月11日提出

【計算期間】 第10期中(自 2022年1月12日 至 2022年7月11日)

【ファンド名】 D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>

【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【事務連絡者氏名】 酒井 隆

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【電話番号】 03-6774-5100

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

3【ファンドの経理状況】

- (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、第10期中間計算期間(2022年1月12日から2022年7月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

【DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第9期 2022年1月11日現在	第10期中間計算期間末 2022年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	440,129,761	496,397,525
親投資信託受益証券	9,952,659,250	11,124,481,545
未収入金	2,276,000	3,563,000
流動資産合計	10,395,065,011	11,624,442,070
資産合計	10,395,065,011	11,624,442,070
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,210,363	24,318,503
未払受託者報酬	1,359,836	1,453,035
未払委託者報酬	11,966,834	12,787,061
その他未払費用	193,560	206,825
流動負債合計	23,730,593	38,765,424
負債合計	23,730,593	38,765,424
純資産の部		
元本等		
元本	7,382,611,558	8,455,537,262
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,988,722,860	3,130,139,384
(分配準備積立金)	1,220,655,087	1,181,900,067
元本等合計	10,371,334,418	11,585,676,646
純資産合計	10,371,334,418	11,585,676,646
負債純資産合計	10,395,065,011	11,624,442,070

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12日	第10期中間計算期間 自 2022年1月12日 至 2022年7月11日
営業収益		
受取利息	58	1,616
有価証券売買等損益	428,685,668	246,650,705
営業収益合計	428,685,726	246,649,089
営業費用		
支払利息	30,064	44,534
受託者報酬	1,197,437	1,453,035
委託者報酬	10,537,831	12,787,061
その他費用	170,424	206,825
営業費用合計	11,935,756	14,491,455
営業利益又は営業損失()	416,749,970	261,140,544
経常利益又は経常損失()	416,749,970	261,140,544
中間純利益又は中間純損失()	416,749,970	261,140,544
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()	5,751,679	6,713,364
期首剰余金又は期首欠損金()	2,045,137,984	2,988,722,860
剰余金増加額又は欠損金減少額	230,475,797	496,554,406
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	230,475,797	496,554,406
剰余金減少額又は欠損金増加額	59,059,060	100,710,702
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	59,059,060	100,710,702
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	2,627,553,012	3,130,139,384

(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9期 2022年1月11日現在	第10期中間計算期間末 2022年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4048円 (14,048円)	1.3702円 (13,702円)

(参考)

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「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、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・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」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,930,858,741
株式	435,590,889,830
派生商品評価勘定	74,970,950
未収入金	106,045,000
未収配当金	536,474,159
前払金	263,780,000
差入委託証拠金	571,605,000
流動資産合計	450,074,623,680
資産合計	
450,074,623,680	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	258,483,450
未払解約金	587,698,000
流動負債合計	846,181,450
負債合計	
846,181,450	
純資産の部	
元本等	
元本	139,705,613,956
剰余金	
剰余金又は欠損金()	309,522,828,274
元本等合計	449,228,442,230
純資産合計	449,228,442,230
負債純資産合計	450,074,623,680

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額	3.2155円
(1万口当たり純資産額)	(32,155円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,372,535,579
国債証券	454,144,467,200
地方債証券	33,087,965,922
特殊債証券	30,973,035,370
社債証券	26,778,809,650
未収利息	655,856,826
前払費用	97,860,070
流動資産合計	548,110,530,617
資産合計	
548,110,530,617	
負債の部	
流動負債	
未払金	1,023,970,000
未払解約金	393,594,000
流動負債合計	1,417,564,000
負債合計	
1,417,564,000	
純資産の部	
元本等	
元本	431,250,768,086
剰余金	
剰余金又は欠損金()	115,442,198,531
元本等合計	546,692,966,617
純資産合計	546,692,966,617
負債純資産合計	548,110,530,617

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

(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)

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2677円
(1万口当たり純資産額)	(12,677円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	667,048,779
コール・ローン	343,951,194
国債証券	171,245,332,814
派生商品評価勘定	65,759
未収利息	892,838,259
前払費用	153,293,083
流動資産合計	173,302,529,888
資産合計	173,302,529,888
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	227,101
未払金	1,413,365,603
未払解約金	62,693,000
流動負債合計	1,476,285,704
負債合計	1,476,285,704
純資産の部	
元本等	
元本	81,983,703,364
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,842,540,820
元本等合計	171,826,244,184
純資産合計	171,826,244,184
負債純資産合計	173,302,529,888

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2022年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,991,925,573
コール・ローン	243,447,124
株式	58,942,010,212
投資信託受益証券	322,229,480
投資証券	58,941,958
派生商品評価勘定	8,150,152
未収入金	18,459,585
未収配当金	411,927,200
差入委託証拠金	1,855,138,109
流動資産合計	64,852,229,393
資産合計	64,852,229,393
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,863,442
未払金	2,885
未払解約金	62,044,000
流動負債合計	84,910,327
負債合計	84,910,327
純資産の部	
元本等	
元本	45,722,371,191
剰余金	
剰余金又は欠損金()	19,044,947,875
元本等合計	64,767,319,066
純資産合計	64,767,319,066
負債純資産合計	64,852,229,393

先物取引 買建	4,642,567,350	-	4,550,139,000	92,428,350
合計	4,642,567,350	-	4,550,139,000	92,428,350

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額	2,394.8円
(1万口当たり純資産額)	(23,948円)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年7月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	157,337,103
コール・ローン	178,417,988
投資信託受益証券	7,127,398,066
投資証券	62,985,944,128
派生商品評価勘定	24,350
未収配当金	239,132,524
流動資産合計	70,688,254,159
資産合計	70,688,254,159
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	241
未払金	92,742,540
未払解約金	76,371,000
流動負債合計	169,113,781
負債合計	169,113,781
純資産の部	
元本等	
元本	41,139,882,079
剰余金	
剰余金又は欠損金()	29,379,258,299
元本等合計	70,519,140,378
純資産合計	70,519,140,378
負債純資産合計	70,688,254,159

5【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の財務諸表及び中間財務諸表の金額については百万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37期事業年度（自2021年4月1日至2022年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

