

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成28年12月8日
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 西 恵正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	上野 圭子
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【届出の対象とした募集内 国投資信託受益証券に係 るファンドの名称】</b>	D L / ピムコ・米国債券オープン
<b>【届出の対象とした募集内 国投資信託受益証券の金 額】</b>	2,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

有価証券報告書の提出に伴い、平成28年6月8日付をもって提出した有価証券届出書（平成28年9月30日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書で訂正済。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。

## 第一部【証券情報】

### （ 7 ）【申込期間】

#### < 訂正前 >

継続申込期間：平成28年6月9日から平成29年6月8日まで

#### （略）

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

#### < 訂正後 >

継続申込期間：平成28年6月9日から平成29年6月8日まで<sup>（注）</sup>

#### （略）

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（注）信託を終了（繰上償還）することとなった場合、取得のお申込みは、平成29年3月6日までとし、平成29年3月8日をもって償還する予定です。

### （ 1 2 ）【その他】

#### < 訂正前 >

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

#### （略）

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

#### （略）

#### < 訂正後 >

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

#### （略）

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

#### < 信託終了（繰上償還）のお知らせ >

平成28年9月30日現在、当ファンドの受益権の口数が10億口を下回った状態となっており、昨今の純資産総額の推移を鑑みるに、今後、純資産総額の大幅な増加を期待することは難しいと思われます。また、継続して一部解約の発生も見込まれることから、投資信託約款上の運用の基本方針に則った運用の継続が困難になることが懸念されます。このような状況に鑑み、このまま運用を継続するよりも、当ファンドの信託を終了（繰上償還）することが、受益者の皆さまの利益に資するとの判断に至りました。これより、投資信託約款第47条第9項および第49条第1項の規定に基づき信託終了日を繰り上げ、平成29年3月8日をもって信託を終了（繰上償還）させていただくための手続きをとらせていただきたいと存じます。

公告日（電子公告）

平成28年12月9日

異議申立期間

平成28年12月9日から平成29年1月17日まで

信託終了（繰上償還）予定日

平成29年3月8日

公告は電子公告の方法により行い、アセットマネジメントOne株式会社のホームページ上  
(<http://www.am-one.co.jp/>)に掲載します。

当ファンドの信託終了(繰上償還)につきましては、改正前の「投資信託及び投資法人に関する法律」および投資信託約款の規定にしたがい、異議申立ての手続きをもって実施する予定です。

公告日(平成28年12月9日)現在の当ファンドの受益者(平成28年12月7日までに取得のお申し込みをなされた方)で、信託終了(繰上償還)にご異議のある受益者の方は、異議申立期間中に、自己の保有される口数についてアセットマネジメントOne株式会社に対して書面をもって異議を申し立てることができます。

(注)平成28年12月8日以降のお申込みにより取得された受益権については、当該信託終了(繰上償還)に関する異議を申立てる権利はございません。

異議申立期間中に異議申立てをされた当ファンドの受益者の受益権口数の合計が、公告日(平成28年12月9日)現在の受益権総口数の2分の1を超えない場合は、平成29年3月8日をもって信託を終了(繰上償還)いたします。

異議申立てをされた受益者の受益権口数の合計が、公告日(平成28年12月9日)現在の受益権総口数の2分の1を超えた場合は、信託を終了いたしません。この場合、信託の終了(繰上償還)を行わない旨およびその理由を、異議申立期間終了後、速やかに電子公告の方法により公告し、これらの事項を記載した書面を受益者の皆さまに送付いたします。

(略)

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

2

#### **パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー(PIMCO)に運用指図に関する権限を委託します。**

PIMCOとは Pacific Investment Management Company LLC の略称です。

PIMCOは世界各国の機関投資家や年金基金、個人のお客様等に運用を委託されており、その運用資産総額は、2016年3月末現在で約1.5兆米ドル(約169兆円)(1米ドル=112.68円で換算)

(略)

4

#### **ベンチマークを中長期的に上回る投資成果をめざします。**

当ファンドのベンチマークであるバークレイズ・米国総合インデックス(円換算ベース・為替ヘッジなし)\*を中長期的に上回る投資成果をめざします。

※バークレイズ・米国総合インデックスとは、バークレイズ・バンク・ビーエルシーおよび関連会社(バークレイズ)の算出する債券ベンチマークで、米ドル建ての固定利付投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわすものです。  
また、「円換算ベース」とは、同インデックスの現地通貨建てリターンをのデータを基に、委託会社対顧客電信売買相場仲値(TTM)で円建てに換算したものです。

(略)

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

2

#### **パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー(PIMCO)に運用指図に関する権限を委託します。**

PIMCOとは Pacific Investment Management Company LLC の略称です。

PIMCOは世界各国の機関投資家や年金基金、個人のお客様等に運用を委託されており、その運用資産総額は、2016年9月末現在で約1.55兆米ドル(約157兆円)(1米ドル=101.12円で換算)

(略)

4

#### **ベンチマークを中長期的に上回る投資成果をめざします。**

当ファンドのベンチマークであるブルームバーグ・バークレイズ米国総合インデックス(円換算ベース・為替ヘッジなし)\*を中長期的に上回る投資成果をめざします。

※ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エルピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ビーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エルピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

(略)

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

<訂正前>

(略)

投資態度

- 1)米国通貨建の債券を主要投資対象として分散投資を行い、バークレイズ・米国総合インデックス（円換算ベース・為替ヘッジなし）をベンチマークとし、当該ベンチマークに対して中長期的に超過収益を積み上げることを目標に運用を行います。

(略)

<訂正後>

(略)

投資態度

- 1)米国通貨建の債券を主要投資対象として分散投資を行い、ブルームバーグ・バークレイズ米国総合インデックス（円換算ベース・為替ヘッジなし）をベンチマークとし、当該ベンチマークに対して中長期的に超過収益を積み上げることを目標に運用を行います。

(略)

### (3)【運用体制】

<訂正前>

(略)

当ファンドは信託財産の運用指図に関する権限をパシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに委託します。
------------------------------------------------------------------

(略)

上記体制は平成28年3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)

当ファンドは信託財産の運用指図に関する権限をパシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに委託します。
------------------------------------------------------------------

(略)

上記体制は平成28年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<その他の留意点>

(略)

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

（略）

<訂正後>

（略）

<その他の留意点>

（略）

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

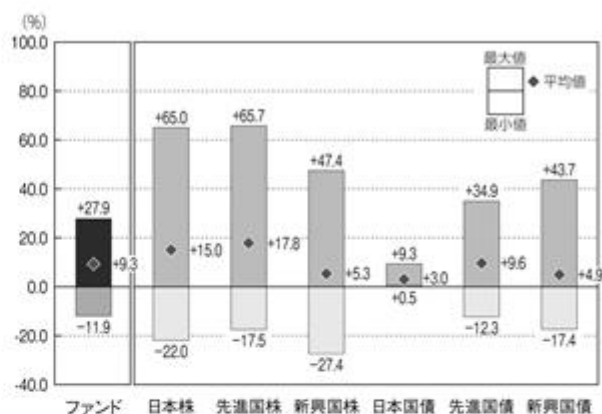
当ファンドが、平成29年3月8日に信託を終了（繰上償還）することとなった場合、当該信託終了日までの運用にあたり、委託会社の判断で組入資産を現金化する予定です。この結果、主要投資対象への投資比率は低下していきます。

また、信託を終了しないこととなった場合、信託財産が少額のままであることも考えられることから、運用方針に沿った運用を継続することが困難となることも考えられます。

（略）

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

**(参考情報)****ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移****ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較**

2011年10月～2016年9月

\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

**\*各資産クラスの指数**

- 日本株…… 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
- 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス (円ベース、配当込み)
- 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス (円ベース、配当込み)
- 日本国債… NOMURA-BPI国債
- 先進国債… シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
- 新興国債… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース)

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数 (TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。



## 4【手数料等及び税金】

## (5)【課税上の取扱い】

&lt;訂正前&gt;

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

(略)

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(略)

上記は、平成28年4月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

(略)

&lt;訂正後&gt;

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

(略)

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、平成29年3月8日に信託を終了（繰上償還）する予定です。詳細は「第一部 証券情報（12）その他<信託終了（繰上償還）のお知らせ>」をご参照ください。

(略)

上記は、平成28年9月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

(略)

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成28年9月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	122,774,462	22.68
内 アメリカ	122,774,462	22.68
地方債証券	23,313,001	4.31
内 アメリカ	23,313,001	4.31
特殊債券	426,869,705	78.85
内 アメリカ	421,653,531	77.88
内 国際機関	5,216,174	0.96
社債券	133,094,443	24.58
内 アメリカ	133,094,443	24.58
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	164,651,045	30.41
純資産総額	541,400,566	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	FNMA I TBA 4.0 30YR NOV アメリカ	特殊債券	60,672,000	107.12 64,994,880	107.31 65,113,190	4.000000 2046/11/14	12.03%
2	TSY INFL 0.125 04/15/20 アメリカ	国債証券	50,560,000	104.26 52,714,361	104.75 52,963,622	0.125000 2020/4/15	9.78%
3	FNMA I TBA 3.5 30YR NOV アメリカ	特殊債券	40,448,000	105.07 42,502,000	105.49 42,671,022	3.500000 2046/11/14	7.88%
4	FNMA I TBA 3.0 30YR OCT (注2) アメリカ	特殊債券	40,448,000	103.80 41,988,259	104.06 42,094,233	3.000000 2046/10/13	7.78%
5	FNMA I TBA 3.0 30YR NOV (注2) アメリカ	特殊債券	40,448,000	103.58 41,899,678	103.83 42,000,798	3.000000 2046/11/14	7.76%
6	FNMA I TBA 3.0 30YR DEC アメリカ	特殊債券	40,448,000	102.98 41,653,540	103.62 41,914,240	3.000000 2046/12/13	7.74%
7	TSY INFL 0.25 01/15/25 アメリカ	国債証券	36,403,200	103.36 37,626,711	103.56 37,700,246	0.250000 2025/1/15	6.96%
8	FHLB 10/12/16 アメリカ	特殊債券	30,336,000	99.97 30,328,416	99.99 30,333,876	- 2016/10/12	5.60%
9	FHLMC 1.0 03/08/17 アメリカ	特殊債券	20,224,000	100.23 20,271,121	100.23 20,271,930	1.000000 2017/3/8	3.74%
10	FHLB 10/11/16 アメリカ	特殊債券	20,224,000	99.97 20,219,146	99.99 20,222,786	- 2016/10/11	3.74%
11	FHLB 10/28/16 アメリカ	特殊債券	20,224,000	99.96 20,216,720	99.98 20,220,966	- 2016/10/28	3.73%
12	TENN VALLEY AUTHORITY 5.25 09/15/39 アメリカ	特殊債券	10,112,000	141.17 14,276,121	139.81 14,138,092	5.250000 2039/9/15	2.61%
13	TSY INFL 1.375 02/15/44 アメリカ	国債証券	10,112,000	124.84 12,624,124	123.27 12,465,466	1.375000 2044/2/15	2.30%
14	BANK OF AMERICA CORP 4.0 04/01/24 アメリカ	社債券	11,123,200	108.23 12,039,205	108.16 12,031,520	4.000000 2024/4/1	2.22%
15	VERIZON COMMUNICATIONS 5.15 09/15/23 アメリカ	社債券	10,112,000	117.28 11,860,364	116.94 11,825,478	5.150000 2023/9/15	2.18%
16	BEAR STEARNS CO INC 6.4 10/02/17 アメリカ	社債券	10,112,000	105.23 10,641,160	104.75 10,592,623	6.400000 2017/10/2	1.96%
17	US T N/B 1.125 08/31/21 アメリカ	国債証券	10,112,000	99.75 10,087,509	100.08 10,120,595	1.125000 2021/8/31	1.87%
18	GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.75 10/01/16 アメリカ	社債券	10,112,000	100.24 10,137,077	100.00 10,112,000	5.750000 2016/10/1	1.87%
19	FHLB 10/25/16 アメリカ	特殊債券	10,112,000	99.98 10,110,331	99.98 10,110,584	- 2016/10/25	1.87%

20	FHLB 11/23/16 アメリカ	特殊債券	10,112,000	99.96 10,108,203	99.95 10,107,651	- 2016/11/23	1.87%
21	US T N/B 2.5 02/15/46 アメリカ	国債証券	9,100,800	105.61 9,611,991	104.65 9,524,533	2.500000 2046/2/15	1.76%
22	MSRR 2009-GG10 A4A アメリカ	特殊債券	8,271,407	101.18 8,369,340	101.09 8,361,731	5.988240 2045/8/12	1.54%
23	CITIGROUP INC 2.4 02/18/20 アメリカ	社債券	8,089,600	101.82 8,237,639	101.50 8,211,267	2.400000 2020/2/18	1.52%
24	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 3.5 05/15/24 アメリカ	社債券	7,078,400	105.40 7,460,916	105.10 7,439,893	3.500000 2024/5/15	1.37%
25	FNMA PASS #AE0307 アメリカ	特殊債券	6,963,600	106.44 7,412,195	106.27 7,400,635	4.000000 2025/5/1	1.37%
26	CMLT 2008-LS1 A4B アメリカ	特殊債券	6,645,623	103.11 6,852,567	102.90 6,838,744	6.296340 2049/12/10	1.26%
27	BAY AREA TOLL-S1 6.793 04/01/30 アメリカ	地方債証券	5,056,000	131.72 6,660,167	130.90 6,618,405	6.793000 2030/4/1	1.22%
28	FNMA PASS #256711 アメリカ	特殊債券	5,835,417	113.30 6,611,877	112.78 6,581,300	5.500000 2037/5/1	1.22%
29	GENERAL ELECTRIC CO 2.7 10/09/22 アメリカ	社債券	6,067,200	105.10 6,377,233	104.55 6,343,378	2.700000 2022/10/9	1.17%
30	FSPC T-62 1A1 アメリカ	特殊債券	5,575,185	102.03 5,688,694	102.06 5,690,256	1.689170 2044/10/25	1.05%

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

(注2) 当該銘柄は、直近日現在において売付取引の対象となっております。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年9月30日現在

種類	投資比率
国債証券	22.68%
地方債証券	4.31%
特殊債券	78.85%
社債券	24.58%
合計	130.41%

(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。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(平成28年9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16計算期間末 (平成19年3月8日)	2,411	2,458	1.0152	1.0352
第17計算期間末 (平成19年9月10日)	2,135	2,167	0.9904	1.0054
第18計算期間末 (平成20年3月10日)	1,825	1,845	0.9107	0.9207
第19計算期間末 (平成20年9月8日)	1,783	1,801	0.9680	0.9780
第20計算期間末 (平成21年3月9日)	1,494	1,511	0.8606	0.8706
第21計算期間末 (平成21年9月8日)	1,409	1,426	0.8493	0.8593
第22計算期間末 (平成22年3月8日)	1,295	1,307	0.8499	0.8579
第23計算期間末 (平成22年9月8日)	1,166	1,177	0.8337	0.8417
第24計算期間末 (平成23年3月8日)	1,052	1,063	0.8010	0.8090
第25計算期間末 (平成23年9月8日)	933	943	0.7875	0.7955
第26計算期間末 (平成24年3月8日)	911	920	0.8333	0.8413
第27計算期間末 (平成24年9月10日)	842	851	0.8140	0.8220
第28計算期間末 (平成25年3月8日)	879	886	0.9739	0.9819
第29計算期間末 (平成25年9月9日)	770	776	0.9698	0.9778
第30計算期間末 (平成26年3月10日)	713	719	1.0187	1.0267
第31計算期間末 (平成26年9月8日)	699	705	1.0480	1.0560
第32計算期間末 (平成27年3月9日)	757	762	1.2047	1.2127
第33計算期間末 (平成27年9月8日)	671	675	1.1834	1.1914
第34計算期間末 (平成28年3月8日)	603	607	1.1237	1.1317
第35計算期間末 (平成28年9月8日)	544	548	1.0433	1.0513
平成27年9月末日	672	-	1.1901	-

10月末日	670	-	1.1964	-
11月末日	675	-	1.2138	-
12月末日	643	-	1.1850	-
平成28年1月末日	650	-	1.2018	-
2月末日	610	-	1.1398	-
3月末日	608	-	1.1331	-
4月末日	593	-	1.1055	-
5月末日	596	-	1.1195	-
6月末日	563	-	1.0557	-
7月末日	565	-	1.0755	-
8月末日	556	-	1.0642	-
9月末日	541	-	1.0376	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第16計算期間	0.0200
第17計算期間	0.0150
第18計算期間	0.0100
第19計算期間	0.0100
第20計算期間	0.0100
第21計算期間	0.0100
第22計算期間	0.0080
第23計算期間	0.0080
第24計算期間	0.0080
第25計算期間	0.0080
第26計算期間	0.0080
第27計算期間	0.0080
第28計算期間	0.0080
第29計算期間	0.0080
第30計算期間	0.0080
第31計算期間	0.0080
第32計算期間	0.0080
第33計算期間	0.0080
第34計算期間	0.0080
第35計算期間	0.0080

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第16計算期間	2.8
第17計算期間	1.0
第18計算期間	7.0
第19計算期間	7.4
第20計算期間	10.1
第21計算期間	0.2
第22計算期間	1.0
第23計算期間	1.0
第24計算期間	3.0
第25計算期間	0.7
第26計算期間	6.8
第27計算期間	1.4
第28計算期間	20.6
第29計算期間	0.4
第30計算期間	5.9
第31計算期間	3.7
第32計算期間	15.7
第33計算期間	1.1
第34計算期間	4.4
第35計算期間	6.4

(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。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。



## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第16計算期間	94,515,539	505,205,553
第17計算期間	82,997,805	302,464,544
第18計算期間	75,810,919	226,987,829
第19計算期間	73,380,609	235,834,873
第20計算期間	63,194,990	168,930,296
第21計算期間	58,111,329	134,716,166
第22計算期間	54,239,339	189,547,903
第23計算期間	46,128,942	171,970,750
第24計算期間	44,465,373	128,876,272
第25計算期間	42,232,067	170,790,494
第26計算期間	33,158,384	124,667,155
第27計算期間	28,762,783	87,499,309
第28計算期間	29,090,116	161,345,616
第29計算期間	34,048,351	143,159,471
第30計算期間	27,463,901	121,106,891
第31計算期間	20,787,427	53,635,074
第32計算期間	72,236,215	111,055,576
第33計算期間	57,101,295	118,906,267
第34計算期間	13,554,215	43,917,063
第35計算期間	14,665,341	29,198,433

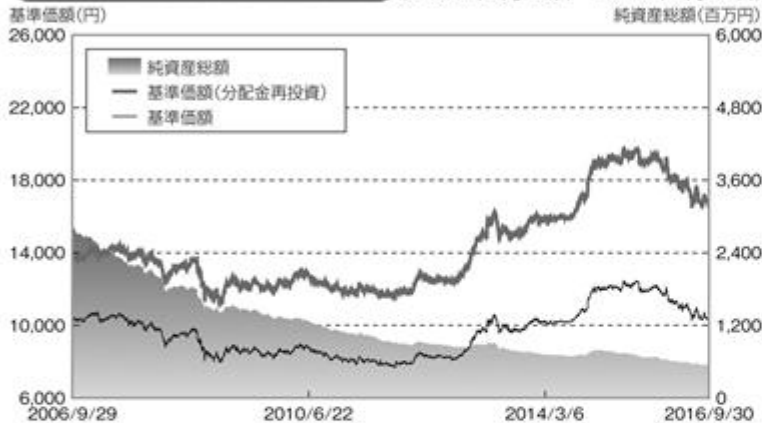
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2016年9月30日

## 基準価額・純資産の推移

(2006年9月29日～2016年9月30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:1999年4月28日)  
※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第31期 (2014.09.08)	80円
第32期 (2015.03.09)	80円
第33期 (2015.09.08)	80円
第34期 (2016.03.08)	80円
第35期 (2016.09.08)	80円
設定来累計	4,770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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

## ポートフォリオの状況

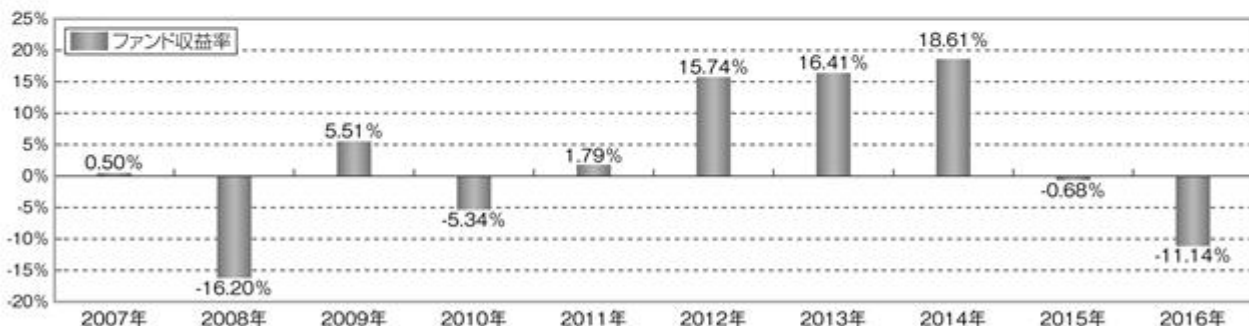
資産の種類	投資比率(%)
国債証券	22.68
内 アメリカ	22.68
地方債証券	4.31
内 アメリカ	4.31
特殊債券	78.85
内 アメリカ	77.88
内 国際機関	0.96
社債券	24.58
内 アメリカ	24.58
コールローン、その他の資産(負債控除後)	△30.41
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	FNMA I TBA 4.0 30YR NOV	特殊債券	アメリカ	4.000000	2046/11/14	12.03%
2	TSY INFL 0.125 04/15/20	国債証券	アメリカ	0.125000	2020/4/15	9.78%
3	FNMA I TBA 3.5 30YR NOV	特殊債券	アメリカ	3.500000	2046/11/14	7.88%
4	FNMA I TBA 3.0 30YR OCT(※)	特殊債券	アメリカ	3.000000	2046/10/13	7.78%
5	FNMA I TBA 3.0 30YR NOV(※)	特殊債券	アメリカ	3.000000	2046/11/14	7.76%
6	FNMA I TBA 3.0 30YR DEC	特殊債券	アメリカ	3.000000	2046/12/13	7.74%
7	TSY INFL 0.25 01/15/25	国債証券	アメリカ	0.250000	2025/1/15	6.96%
8	FHLB 10/12/16	特殊債券	アメリカ	-	2016/10/12	5.60%
9	FHLMC 1.0 03/08/17	特殊債券	アメリカ	1.000000	2017/3/8	3.74%
10	FHLB 10/11/16	特殊債券	アメリカ	-	2016/10/11	3.74%

(※)基準日現在において売付取引の対象となっております。

## 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、2016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。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### <訂正前>

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

（略）

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

（略）

#### <訂正後>

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

（略）

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。（注）

（注）信託を終了（繰上償還）することとなった場合、取得のお申込みは、平成29年3月6日までとし、平成29年3月8日をもって償還する予定です。

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

（略）

### 3【資産管理等の概要】

#### （3）【信託期間】

##### <訂正前>

信託期間は平成11年4月28日から無期限です。ただし、下記（5）1.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了信託を終了させることがあります。

##### <訂正後>

信託期間は平成11年4月28日から無期限です。ただし、下記（5）1.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了信託を終了させることがあります。

##### <信託の終了>

ファンドは、平成29年3月8日に信託を終了（繰上償還）する予定です。

### 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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期計算期間(平成28年3月9日から平成28年9月8日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## DL / ピムコ・米国債券オープン

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第34期 平成28年3月8日現在	第35期 平成28年9月8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	89,437,299	56,483,424
金銭信託	24,114,113	-
コール・ローン	-	21,339,215
国債証券	125,817,174	113,156,107
地方債証券	24,697,439	23,704,989
特殊債証券	396,373,060	387,767,223
社債証券	123,756,758	139,315,553
未収入金	333,507,229	300,453,193
未収利息	3,208,282	2,833,028
前払費用	51,016	136,678
その他未収収益	380,372	-
流動資産合計	1,121,342,742	1,045,189,410
資産合計	1,121,342,742	1,045,189,410
<b>負債の部</b>		
流動負債		
売付債券	-	42,204,180
未払金	509,222,173	449,726,826
未払収益分配金	4,293,377	4,177,112
未払解約金	170,138	237,371
未払受託者報酬	175,682	157,120
未払委託者報酬	4,393,128	3,928,978
その他未払費用	16,606	12,780
流動負債合計	518,271,104	500,444,367
負債合計	518,271,104	500,444,367
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,536,672,164	1,522,139,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	66,399,474	22,605,971
（分配準備積立金）	92,429,076	85,834,104
元本等合計	603,071,638	544,745,043
純資産合計	603,071,638	544,745,043
負債純資産合計	1,121,342,742	1,045,189,410

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第34期		第35期	
	自	平成27年9月9日 平成28年3月8日	自	平成28年3月9日 平成28年9月8日
<b>営業収益</b>				
受取利息		7,622,908		6,705,412
有価証券売買等損益		1,311,448		17,449,198
為替差損益		32,127,729		58,669,600
その他収益		424,454		338,429
営業収益合計		22,768,919		34,176,561
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		3,898
受託者報酬		175,682		157,120
委託者報酬		2 4,393,128		2 3,928,978
その他費用		354,608		334,655
営業費用合計		4,923,418		4,424,651
営業利益又は営業損失( )		27,692,337		38,601,212
経常利益又は経常損失( )		27,692,337		38,601,212
当期純利益又は当期純損失( )		27,692,337		38,601,212
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		52,192		1,335,185
期首剰余金又は期首欠損金( )		104,018,855		66,399,474
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,479,568		1,250,468
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,479,568		1,250,468
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,061,043		3,600,832
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,061,043		3,600,832
分配金		1 4,293,377		1 4,177,112
期末剰余金又は期末欠損金( )		66,399,474		22,605,971

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券及び売付債券 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。</p>
2. 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	第34期 平成28年3月8日現在	第35期 平成28年9月8日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	567,035,012円 13,554,215円 43,917,063円	536,672,164円 14,665,341円 29,198,433円
2. 受益権の総数	536,672,164口	522,139,072口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第34期 自 平成27年9月9日 至 平成28年3月8日	第35期 自 平成28年3月9日 至 平成28年9月8日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,898,049円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(77,223,720円)及び分配準備積立金(93,824,404円)より分配対象収益は173,946,173円(1万口当たり3,241.20円)であり、うち4,293,377円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,528,002円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(77,611,525円)及び分配準備積立金(87,483,214円)より分配対象収益は167,622,741円(1万口当たり3,210.31円)であり、うち4,177,112円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>
2. 2 信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用	1,300,853円	1,163,427円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第34期	第35期
	自 平成27年9月9日 至 平成28年3月8日	自 平成28年3月9日 至 平成28年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第34期 平成28年3月8日現在	第35期 平成28年9月8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。	同左
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。	同左
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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第34期 平成28年3月8日現在	第35期 平成28年9月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	590,941	5,495,329
地方債証券	637,082	1,496,303
特殊債証券	245,640	2,513,410
社債証券	130,799	5,405,917
売付債証券	-	134,749
合計	851,584	14,776,210

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第34期 平成28年3月8日現在	第35期 平成28年9月8日現在
1口当たり純資産額	1.1237円	1.0433円
(1万口当たり純資産額)	(11,237円)	(10,433円)

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## （１）株式

該当事項はありません。

## （２）株式以外の有価証券

平成28年9月8日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	TSY INFL 0.125 04/15/20	500,000.000	521,305.000	
		TSY INFL 0.25 01/15/25	360,000.000	372,099.600	
		TSY INFL 1.375 02/15/44	100,000.000	124,843.000	
		US T N/B 2.5 02/15/46	90,000.000	95,055.300	
		アメリカ・ドル 小計		1,050,000.000 (106,722,000)	1,113,302.900 (113,156,107)
国債証券 合計			106,722,000 (106,722,000)	113,156,107 (113,156,107)	
地方債証券	アメリカ・ドル	BAY AREA TOLL-S1 6.793 04/01/30	50,000.000	65,864.000	
		CA UNIV 6.484 11/01/41	30,000.000	41,599.800	
		MET TRN AUTH-A2-BABS 6.089 11/15/40	30,000.000	42,100.500	
		NYS URBAN DEV CORP BAB 5.77 03/15/39	30,000.000	39,150.600	
		UNIV CA BABS 6.583 05/15/49	30,000.000	44,510.100	
		アメリカ・ドル 小計		170,000.000 (17,278,800)	233,225.000 (23,704,989)
地方債証券 合計			17,278,800 (17,278,800)	23,704,989 (23,704,989)	
特殊債券	アメリカ・ドル	CITHE 2003-1 A4	9,142.820	9,166.040	
		CMLT 2008-LS1 A4B	65,827.130	67,877.640	
		CSFB 2003-AR15 2A1	12,518.850	12,226.910	
		FHLB 09/09/16	100,000.000	99,999.000	
		FHLB 09/14/16	100,000.000	99,996.000	
		FHLB 10/05/16	100,000.000	99,980.000	
		FHLB 10/11/16	300,000.000	299,928.000	
		FHLB 10/12/16	300,000.000	299,925.000	
		FHLMC 1.0 03/08/17	200,000.000	200,466.000	
		FHR 3201 SG	30,215.070	6,157.520	
		FHR 3221 SI	55,965.200	12,133.810	
		FHR 3284 BI	48,943.060	10,366.140	
		FHR 3532 SN	83,872.000	16,634.330	
		FHR 3984 DF	36,773.070	36,898.830	
		FN ARM 775852	14,233.700	14,514.240	
		FNMA I TBA 3.0 30YR NOV	400,000.000	414,356.000	
		FNMA I TBA 3.0 30YR OCT	400,000.000	415,232.000	
		FNMA I TBA 3.5 30YR OCT	400,000.000	421,872.000	
		FNMA I TBA 4.0 30YR OCT	600,000.000	643,518.000	
		FNMA PASS #256711	57,707.850	65,386.450	

		FNMA PASS #AA6860	18,463.050	19,462.630	
		FNMA PASS #AE0307	68,864.720	73,300.980	
		FNR 2001-51 PZ PAC WM31 WC6.9	45,168.090	52,071.580	
		FNR 2006-117 SA	14,077.020	2,903.800	
		FNR 2007-3 SH	8,996.810	1,626.170	
		FNR 2007-39 PI	14,533.620	2,941.890	
		FNR 2007-73 A1	10,995.450	10,784.110	
		FNR 2009-106 SN	110,837.960	21,390.610	
		FSPC T-62 1A1	56,142.060	57,285.670	
		FSPC T-63 1A1	6,779.000	6,956.200	
		GN II ARM 8123M	18,124.970	18,619.960	
		GN2 ARM 80045M	5,437.460	5,628.200	
		GNR 2003-42 SA	19,606.920	3,349.840	
		GSR 2005-AR6 2A1 WM35	10,414.950	10,466.390	
		HEAT 2002-1 A4	2,565.960	2,200.230	
		IFC 2.125 04/07/26	50,000.000	51,681.000	
		MSRR 2009-GG10 A4A	81,850.590	82,820.510	
		SASC 2003-35 3A1	3,818.640	3,800.840	
		TENN VALLEY AUTHORITY 5.25 09/15/39	100,000.000	141,180.000	
	アメリカ・ドル	小計	3,961,876.020 (402,685,079)	3,815,104.520 (387,767,223)	
特殊債券		合計	402,685,079 (402,685,079)	387,767,223 (387,767,223)	
社債券	アメリカ・ドル	ABBVIE INC 3.6 05/14/25	40,000.000	42,382.400	
		AFLAC INC 6.9 12/17/39	20,000.000	28,688.200	
		AMER AIRLN 14-1 B PTT 4.375 10/01/22	25,937.380	26,358.860	
		AMERICAN INTL GROUP 4.375 01/15/55	50,000.000	48,762.500	
		AT&T INC 2.8 02/17/21	50,000.000	51,696.000	
		BANK OF AMERICA CORP 4.0 04/01/24	90,000.000	97,450.200	
		BEAR STEARNS CO INC 6.4 10/02/17	100,000.000	105,233.000	
		BECTON DICKINSON 3.734 12/15/24	30,000.000	32,660.400	
		BOSTON SCIENTIFIC CORP 3.85 05/15/25	30,000.000	32,319.300	
		BURLINGTON NORTH SANTA FE 3.0 03/15/23	50,000.000	52,914.500	
		CITIGROUP INC 2.4 02/18/20	80,000.000	81,464.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP 5.25 01/15/23	30,000.000	34,360.500	
		CVS PASS-THROUGH TRUST 7.507 01/10/32	33,848.810	43,679.180	

	DUKE ENERGY CAROLINAS 2.5 03/15/23	40,000.000	41,479.200	
	ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.75 02/15/25	30,000.000	31,408.200	
	GENERAL ELECTRIC CO 2.7 10/09/22	60,000.000	63,066.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.75 10/01/16	100,000.000	100,248.000	
	KINDER MORGAN INC DELAWA 4.3 06/01/25	40,000.000	41,600.000	
	KLA-TENCOR CORP 4.65 11/01/24	30,000.000	33,063.300	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 3.5 05/15/24	70,000.000	73,782.800	
	QUALCOMM INC 3.45 05/20/25	40,000.000	43,374.400	
	SOUTHERN CO 3.25 07/01/26	30,000.000	31,303.500	
	VERIZON COMMUNICATIONS 5.15 09/15/23	100,000.000	117,290.000	
	VIACOM INC 5.85 09/01/43	30,000.000	33,564.000	
	WELLS FARGO & COMPANY 3.0 02/19/25	80,000.000	82,528.000	
	アメリカ・ドル 小計	1,279,786.190 (130,077,468)	1,370,676.440 (139,315,553)	
社債券 合計		130,077,468 (130,077,468)	139,315,553 (139,315,553)	
合計		656,763,347 (656,763,347)	663,943,872 (663,943,872)	

平成28年9月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
売付債券	アメリカ・ドル	FNMA I TBA 3.0 30YR OCT	400,000.000	415,232.000	
	アメリカ・ドル 小計		400,000.000 ( 40,656,000)	415,232.000 ( 42,204,180)	
売付債券 合計			40,656,000 ( 40,656,000)	42,204,180 ( 42,204,180)	
合計			40,656,000 ( 40,656,000)	42,204,180 ( 42,204,180)	

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。  
2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。  
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	4銘柄	20.77%
	地方債証券	5銘柄	4.35%
	特殊債券	39銘柄	71.18%
	社債券	25銘柄	25.57%
			100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成28年9月30日現在

資産総額	976,381,772円
負債総額	434,981,206円
純資産総額( - )	541,400,566円
発行済数量	521,800,914口
1口当たり純資産額( / )	1.0376円

## 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】

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・訂正いたします。

<更新・訂正後>

「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る委託会社は、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）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。

平成28年9月30日現在、D I A Mアセットマネジメント株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	393	5,864,442,125,905
単位型公社債投資信託	49	337,748,656,746
単位型株式投資信託	9	88,382,773,408
合計	451	6,290,573,556,059

（ご参考）

平成28年9月30日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

・みずほ投信投資顧問株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	13	275,632,843,628
追加型株式投資信託	229	2,280,959,186,831
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,454,591,074
合計	245	2,558,046,621,533



## ・新光投信株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	25	651,056,923,166
追加型株式投資信託	240	3,084,756,237,399
単位型公社債投資信託	7	42,284,286,781
単位型株式投資信託	79	290,858,982,767
合計	351	4,068,956,430,113

**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】**

&lt;訂正前&gt;

## (1) 投資顧問会社

## a. 名称

パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー

## b. 資本金の額

平成28年1月末日現在 175,840,532.12米ドル

## c. 事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

(略)

&lt;訂正後&gt;

## (1) 投資顧問会社

## a. 名称

パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー

## b. 資本金の額

平成28年8月末日現在 338,413,044米ドル

## c. 事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

(略)

独立監査人の監査報告書

平成28年10月26日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 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DL/ピムコ・米国債券オープンの平成28年3月9日から平成28年9月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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、DL/ピムコ・米国債券オープンの平成28年9月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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

XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。