

【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28年11月8日
【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 西 恵正
【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】	上野 圭子
【電話番号】	03-6774-5100
【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国内株式インデックスファンド< D C 年金 >
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【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28年5月6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。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

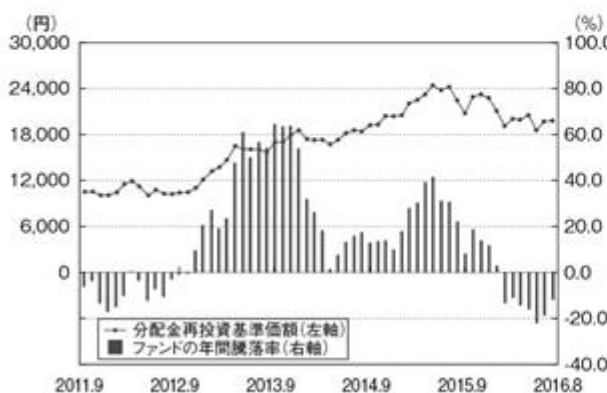
3【投資リスク】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク（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。

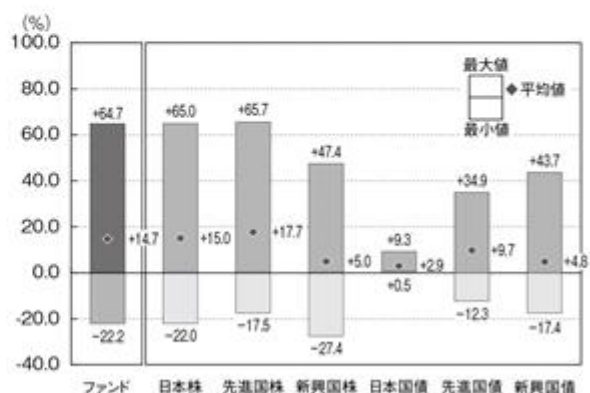
<更新・訂正後>

（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9月～2016年8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(東東京証券取引所)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、株式会社東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株式会社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、株式会社東京証券取引所は、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】

<訂正前>

(略)

法人の受益者に対する課税

（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）

<訂正後>

（略）

法人の受益者に対する課税

（略）

上記は、平成28年8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8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	76,173,548,674	100.00
内 日本	76,173,548,674	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,347,543	0.00
純資産総額	76,172,201,131	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	278,721,714,360	98.69
内 日本	278,721,714,360	98.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,704,639,094	1.31
純資産総額	282,426,353,454	100.00

その他資産の投資状況

平成28年8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）	3,499,215,000	1.24
内 日本	3,499,215,000	1.24

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・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	39,111,495,520	1.9921 77,915,975,169	1.9476 76,173,548,674	- -	100.00%

(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28年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成28年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,805,300	6,489.85 11,716,136,836	6,238.00 11,261,461,400	- -	3.99%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	11,214,900	534.86 5,998,455,918	564.10 6,326,325,090	- -	2.24%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	792,000	5,150.50 4,079,197,434	6,756.00 5,350,752,000	- -	1.89%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,080,500	5,282.81 5,708,076,661	4,546.00 4,911,953,000	- -	1.74%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,382,800	3,195.64 4,418,936,889	3,036.00 4,198,180,800	- -	1.49%
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,119,200	3,397.39 3,802,363,731	3,621.00 4,052,623,200	- -	1.43%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,274,500	3,106.46 3,959,193,600	3,170.00 4,040,165,000	- -	1.43%
8	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	20,091,300	180.08 3,618,209,584	179.70 3,610,406,610	- -	1.28%
9	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	879,400	4,635.41 4,076,388,197	4,008.00 3,524,635,200	- -	1.25%

10	ソニー 日本	株式 電気機器	999,400	2,584.05 2,582,507,576	3,325.00 3,323,005,000	- -	1.18%
11	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,044,500	2,834.82 2,960,978,696	2,603.00 2,718,833,500	- -	0.96%
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	590,800	5,780.65 3,415,209,710	4,560.00 2,694,048,000	- -	0.95%
13	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	584,700	5,108.70 2,987,060,804	4,361.00 2,549,876,700	- -	0.90%
14	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,609,900	1,658.53 2,670,073,678	1,580.50 2,544,446,950	- -	0.90%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	143,600	16,400.39 2,355,096,206	17,630.00 2,531,668,000	- -	0.90%
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	32,100	58,581.30 1,880,459,996	72,530.00 2,328,213,000	- -	0.82%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	566,300	3,927.24 2,224,001,260	4,064.00 2,301,443,200	- -	0.81%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	256,800	10,802.28 2,774,025,608	8,860.00 2,275,248,000	- -	0.81%
19	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,048,800	1,871.61 1,962,954,713	2,155.50 2,260,688,400	- -	0.80%
20	キヤノン 日本	株式 電気機器	762,400	3,349.96 2,554,014,116	2,964.00 2,259,753,600	- -	0.80%
21	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	126,800	22,228.54 2,818,579,524	16,990.00 2,154,332,000	- -	0.76%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	149,400	13,863.72 2,071,239,782	13,905.00 2,077,407,000	- -	0.74%
23	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,511,000	1,146.04 1,731,681,480	1,350.50 2,040,605,500	- -	0.72%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,039,000	2,236.36 2,323,583,200	1,957.00 2,033,323,000	- -	0.72%
25	花王 日本	株式 化学	376,700	6,189.12 2,331,444,652	5,377.00 2,025,515,900	- -	0.72%
26	信越化学工業 日本	株式 化学	266,000	5,982.11 1,591,241,686	7,594.00 2,020,004,000	- -	0.72%
27	任天堂 日本	株式 その他製品	87,200	17,229.54 1,502,416,552	22,675.00 1,977,260,000	- -	0.70%
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	206,200	7,741.00 1,596,195,040	9,589.00 1,977,251,800	- -	0.70%
29	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,930,500	1,075.90 2,077,026,483	1,015.00 1,959,457,500	- -	0.69%
30	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	447,500	4,148.02 1,856,242,867	4,098.00 1,833,855,000	- -	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28年8月31日現在

種類	投資比率
株式	98.69%
合計	98.69%

（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

平成28年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.20%
輸送用機器		9.86%
情報・通信業		8.29%
銀行業		7.95%
化学		6.39%
医薬品		5.12%
機械		4.94%
食料品		4.65%
小売業		4.54%
卸売業		4.17%
陸運業		4.10%
サービス業		3.77%
建設業		2.99%
不動産業		2.50%
保険業		2.41%
電気・ガス業		1.81%
その他製品		1.80%
精密機器		1.50%
その他金融業		1.28%
鉄鋼		1.25%
証券、商品先物取引業		1.01%
ガラス・土石製品		0.91%
非鉄金属		0.91%
ゴム製品		0.86%
繊維製品		0.74%
金属製品		0.65%
空運業		0.57%
石油・石炭製品		0.45%
鋳業		0.31%
パルプ・紙		0.25%
海運業		0.22%
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.09%	
合計	98.69%	

（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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成28年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2809月	買建	263	3,430,173,812	3,499,215,000	1.24%

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成28年8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4計算期間末 (平成19年2月7日)	32,044	32,044	2.1853	2.1853
第5計算期間末 (平成20年2月7日)	30,110	30,110	1.6674	1.6674
第6計算期間末 (平成21年2月9日)	22,737	22,737	1.0115	1.0115
第7計算期間末 (平成22年2月8日)	31,206	31,206	1.1660	1.1660
第8計算期間末 (平成23年2月7日)	38,104	38,104	1.2631	1.2631
第9計算期間末 (平成24年2月7日)	35,526	35,526	1.0602	1.0602
第10計算期間末 (平成25年2月7日)	49,488	49,488	1.3587	1.3587
第11計算期間末 (平成26年2月7日)	61,898	61,898	1.6948	1.6948
第12計算期間末 (平成27年2月9日)	73,449	73,449	2.0668	2.0668
第13計算期間末 (平成28年2月8日)	76,274	76,274	2.0357	2.0357
平成27年8月末日	79,562	-	2.2488	-
9月末日	75,502	-	2.0800	-
10月末日	83,612	-	2.2966	-
11月末日	83,793	-	2.3289	-
12月末日	83,535	-	2.2826	-
平成28年1月末日	78,570	-	2.1125	-
2月末日	71,836	-	1.9139	-
3月末日	75,801	-	2.0056	-
4月末日	75,239	-	1.9951	-
5月末日	78,116	-	2.0540	-
6月末日	70,688	-	1.8568	-
7月末日	75,422	-	1.9715	-
8月末日	76,172	-	1.9816	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
平成28年2月9日～ 平成28年8月8日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	1.9
第5計算期間	23.7
第6計算期間	39.3
第7計算期間	15.3
第8計算期間	8.3
第9計算期間	16.1
第10計算期間	28.2
第11計算期間	24.7
第12計算期間	21.9
第13計算期間	1.5
平成28年2月9日～ 平成28年8月8日	4.4

(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4計算期間	7,400,148,798	4,214,916,172
第5計算期間	8,779,618,539	5,384,513,066
第6計算期間	8,569,368,552	4,148,881,796
第7計算期間	8,901,159,838	4,615,887,504
第8計算期間	7,387,878,523	3,984,381,861
第9計算期間	8,287,509,892	4,947,169,536
第10計算期間	9,700,581,703	6,785,126,872
第11計算期間	16,783,744,888	16,684,231,460
第12計算期間	12,348,095,889	13,334,064,929
第13計算期間	15,836,928,730	13,906,095,221
平成28年2月9日～ 平成28年8月8日	5,537,554,830	4,739,983,905

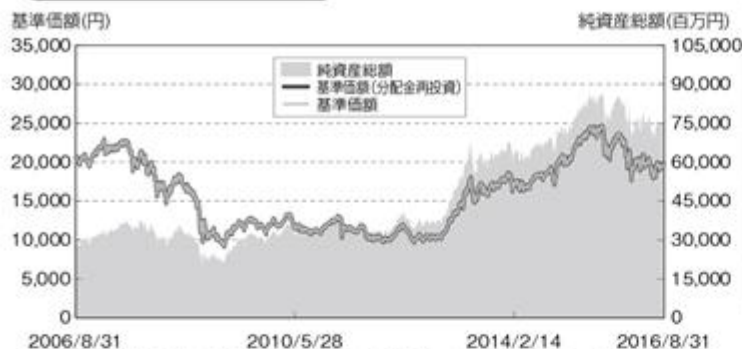
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年8月31日

基準価額・純資産の推移

(2006年8月31日～2016年8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:2002年11月15日)
※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第9期	(2012.02.07)	0円
第10期	(2013.02.07)	0円
第11期	(2014.02.07)	0円
第12期	(2015.02.09)	0円
第13期	(2016.02.08)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 (注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	投資比率
1	国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.00%

■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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.69
内 日本	98.69
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.31
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.24

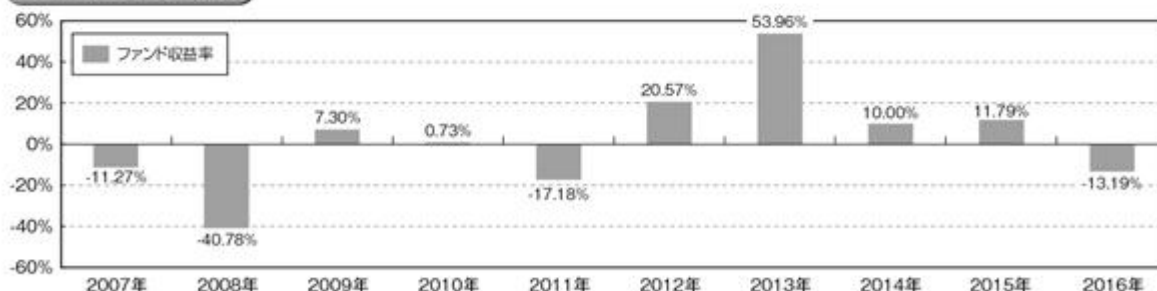
組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.20%
2	輸送用機器	9.86%
3	情報・通信業	8.29%
4	銀行業	7.95%
5	化学	6.39%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.99%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.24%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.89%
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.74%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.49%
6	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.43%
7	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.43%
8	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.28%
9	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.25%
10	ソニー	株式	日本	電気機器	1.18%

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3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」につきましては、以下の内容を追加いたします。

<追 加>

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月9日から平成28年8月8日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた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】

D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 平成28年2月8日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	298,233,769	208,178,279
親投資信託受益証券	76,272,395,045	74,435,578,703
流動資産合計	76,570,628,814	74,643,756,982
資産合計	76,570,628,814	74,643,756,982
負債の部		
流動負債		
未払解約金	196,968,807	109,364,069
未払受託者報酬	13,211,830	11,902,840
未払委託者報酬	83,675,190	75,384,930
その他未払費用	2,091,784	1,057,792
流動負債合計	295,947,611	197,709,631
負債合計	295,947,611	197,709,631
純資産の部		
元本等		
元本	1 37,468,044,034	1 38,265,614,959
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	38,806,637,169	36,180,432,392
(分配準備積立金)	11,931,069,673	10,523,986,833
元本等合計	76,274,681,203	74,446,047,351
純資産合計	76,274,681,203	74,446,047,351
負債純資産合計	76,570,628,814	74,643,756,982

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自 平成27年2月10日 至 平成27年8月9日	第14期中間計算期間 自 平成28年2月9日 至 平成28年8月8日
営業収益		
受取利息	108,482	3,306
有価証券売買等損益	13,755,441,182	3,300,903,342
営業収益合計	13,755,549,664	3,300,900,036
営業費用		
支払利息	-	54,993
受託者報酬	12,960,388	11,902,840
委託者報酬	82,082,765	75,384,930
その他費用	2,051,975	1,058,089
営業費用合計	97,095,128	88,400,852
営業利益又は営業損失（ ）	13,658,454,536	3,389,300,888
経常利益又は経常損失（ ）	13,658,454,536	3,389,300,888
中間純利益又は中間純損失（ ）	13,658,454,536	3,389,300,888
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（ ）	1,925,623,249	400,668,021
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	37,912,403,493	38,806,637,169
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,313,411,109	5,245,986,523
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,313,411,109	5,245,986,523
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,883,287,133	4,883,558,433
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,883,287,133	4,883,558,433
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	51,075,358,756	36,180,432,392

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月7日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成28年2月8日、当中間計算期間末日を平成28年8月8日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成28年2月8日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8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	35,537,210,525円 15,836,928,730円 13,906,095,221円	37,468,044,034円 5,537,554,830円 4,739,983,905円
2. 受益権の総数	37,468,044,034口	38,265,614,959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13期 平成28年2月8日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月8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。	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）

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13期 平成28年2月8日現在	第14期中間計算期間末 平成28年8月8日現在
1口当たり純資産額	2,0357円	1,9455円
（1万口当たり純資産額）	（20,357円）	（19,455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28年2月8日現在	平成28年8月8日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,429,529,564	4,049,908,606
株式	2	281,831,760,820	273,578,642,560
派生商品評価勘定		-	11,866,900
未収入金		33,300,100	978,704
未収配当金		387,169,296	376,390,737
前払金		146,427,000	84,318,600
流動資産合計		287,828,186,780	278,102,106,107
資産合計		287,828,186,780	278,102,106,107
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		84,351,696	27,098,952
未払金		1,567,776	-
未払解約金		844,877,000	906,435,000
流動負債合計		930,796,472	933,533,952
負債合計		930,796,472	933,533,952
純資産の部			
元本等			
元本	1	143,582,065,487	144,980,823,231
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		143,315,324,821	132,187,748,924
元本等合計		286,897,390,308	277,168,572,155
純資産合計		286,897,390,308	277,168,572,155
負債純資産合計		287,828,186,780	278,102,106,107

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28年2月8日現在	平成28年8月8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	160,436,237,384円	143,582,065,487円
同期中追加設定元本額	38,536,719,607円	23,384,021,976円
同期中一部解約元本額	55,390,891,504円	21,985,264,232円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	5,617,682,100円	6,427,224,567円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,820,166,879円	1,533,828,155円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	6,660,487円	9,213,796円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	13,299,631円	18,041,513円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	31,387,977円	37,782,776円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	15,547,145円	19,183,379円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,093,364円	16,162,980円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,755,011円	16,502,632円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	38,172,461,361円	38,934,814,679円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	786,499,443円	913,291,182円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,836,468,246円	3,125,660,733円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,892,104,565円	3,164,660,003円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	368,856,638円	408,716,759円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,224,436,857円	1,312,232,391円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,092,740,778円	1,145,875,934円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	60,704,664円	64,124,991円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,226,882,342円	1,351,017,134円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	27,113,958円	30,643,797円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	24,706,633円	34,834,545円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	49,577,626円	70,571,847円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	106,323,778円	134,517,105円
投資のソムリエ	1,057,072,049円	1,071,677,253円
クルーズコントロール	708,256,115円	979,491,190円
投資のソムリエ<DC年金>	18,989,955円	25,554,828円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	76,867,727円	107,114,949円
DIAM DC バランス・F(成長型)	55,564,467円	81,189,697円
クルーズコントロール<DC年金>	182,825円	380,482円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	12,186,127円	16,719,561円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	30,724,957円	39,117,817円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	660,417円	3,612,287円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	526,072円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	266,833,209円	174,944,494円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	113,636,589円	117,637,406円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	536,918,730円	277,127,750円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	478,804,153円	459,550,993円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	41,760,119円	36,158,910円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	166,681,120円	144,330,977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)	41,989,158円	37,322,761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)	58,181,496円	48,997,248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)	5,375,516,838円	3,611,538,857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)	2,050,277,399円	1,244,586,920円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	2,019,290,758円	1,881,158,925円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,613,319,467円	1,559,267,924円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,174,989,311円	4,112,315,720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)	322,112,731円	342,933,197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)	853,964,228円	849,504,241円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,010,419,845円	981,869,308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)	4,107,539,986円	4,026,092,615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)	46,003,219円	51,147,517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)	1,335,804,233円	1,422,864,518円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	5,542,900,861円	5,531,171,471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)	21,045,587,384円	21,851,055,483円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	799,834,907円	803,944,611円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	2,401,484,718円	2,499,493,425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)	13,407,676,777円	13,785,298,880円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	4,455,809円	7,974,250円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	7,115,578円	761,002円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	5,949,384円	5,724,599円
	D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	12,049,845,453円	12,395,172,113円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	113,139,882円	112,201,693円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	42,673,735円	44,215,821円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	39,006,138円	26,364,338円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	12,245,363円	40,046,439円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	120,493円	131,089円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	670,998,289円	729,123,003円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,887,540,594円	1,971,158,603円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,485,634,300円	2,597,804,800円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	94,839,111円	105,546,296円
	計	143,582,065,487円	144,980,823,231円
2 .	受益権の総数	143,582,065,487口	144,980,823,231口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,277,500,000円	株式 3,027,500,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年2月8日現在	平成28年8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	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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。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。	同左

（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28年2月8日 現在				平成28年8月8日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	4,960,587,000	-	4,876,350,000	84,237,000	3,570,968,600	-	3,555,825,000	15,143,600
合計	4,960,587,000	-	4,876,350,000	84,237,000	3,570,968,600	-	3,555,825,000	15,143,600

(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28年2月8日現在	平成28年8月8日現在
1口当たり純資産額	1.9981円	1.9118円
(1万口当たり純資産額)	(19,981円)	(19,118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・訂正いたします。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

平成28年8月31日現在

資産総額	76,274,071,825円
負債総額	101,870,694円
純資産総額（ - ）	76,172,201,131円
発行済数量	38,438,961,335口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9816円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年8月31日現在

資産総額	282,706,870,254円
負債総額	280,516,800円
純資産総額（ - ）	282,426,353,454円
発行済数量	145,011,552,087口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9476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8月31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	392	5,889,391,856,643
単位型公社債投資信託	49	344,511,981,244
単位型株式投資信託	7	79,197,511,703
合計	448	6,313,101,349,590

（ご参考）

平成28年8月31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	263,953,485,574
追加型株式投資信託	232	2,245,140,638,646
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,483,762,979
合計	248	2,510,577,887,199

・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	645,515,628,611
追加型株式投資信託	243	3,151,408,584,879
単位型公社債投資信託	6	40,509,834,945
単位型株式投資信託	78	282,536,779,714
合計	352	4,119,970,828,149

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】

<訂正前>

(略)

(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
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社中国銀行	15,149	日本において銀行業務を営んでおります。
(略)		

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

(略)

<訂正後>

(略)

(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
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉銀行	145,069	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社中国銀行	15,149	日本において銀行業務を営んでおります。
(略)		

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9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

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式インデックスファンド< D C年金 >の平成28年2月9日から平成28年8月8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国内株式インデックスファンド< D C年金 >の平成28年8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中間計算期間（平成28年2月9日から平成28年8月8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。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。