

【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29年2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 惠正

【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 世界6資産アクティブ・バランス・ファンド
投資信託受益証券に係るファ
ンドの名称】**

**【届出の対象とした募集内国 500億円を上限とします。
投資信託受益証券の金額】**

【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】

有価証券報告書の提出に伴い、平成28年8月9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】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

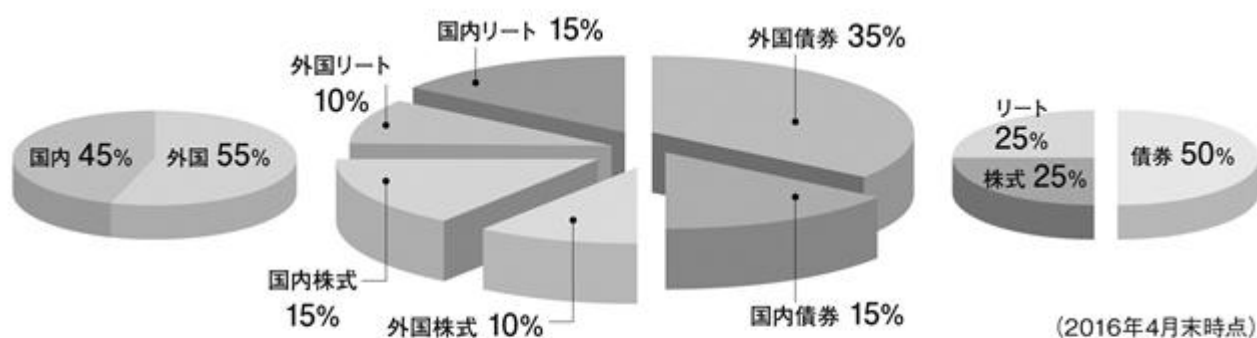
<訂正前>

(略)

6つの資産にバランスよく分散投資

- 国内外の債券、株式、リーートの6資産に分散投資を行います。

[基本資産配分]



※上記基本資産配分は、各マザーファンドの構成比です。

※今後の市場規模・投資環境等が大幅に変化する局面においては変更となる場合があります。

※時価変動等により各マザーファンドの純資産総額が基本資産配分比率から一定以上乖離した場合には、各マザーファンドへの投資割合を基本資産配分比率に近づけることとします。

※外国リーートの基本資産配分比率は、DIAM US・リート・オープン・マザーファンドとDIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの合計です。

(略)

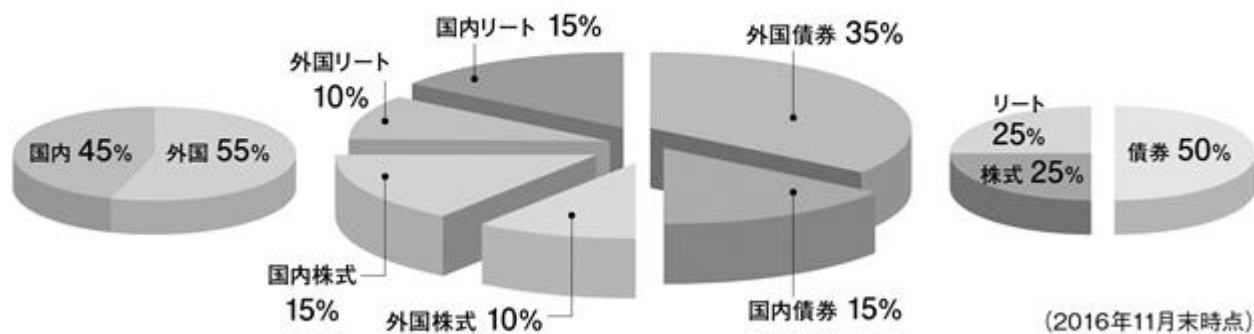
<訂正後>

(略)

6つの資産にバランスよく分散投資

- 国内外の債券、株式、リーートの6資産に分散投資を行います。

[基本資産配分]



※上記基本資産配分は、各マザーファンドの構成比です。

※今後の市場規模・投資環境等が大幅に変化する局面においては変更となる場合があります。

※時価変動等により各マザーファンドの純資産総額が基本資産配分比率から一定以上乖離した場合には、各マザーファンドへの投資割合を基本資産配分比率に近づけることとします。

※外国リーートの基本資産配分比率は、DIAM US・リート・オープン・マザーファンドとDIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの合計です。

(略)

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円(平成28年10月1日現在)

(略)

大株主の状況

(平成28年10月1日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1: A種種類株式(15,510株)を含みます。

2: 普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円(平成28年11月30日現在)

(略)

大株主の状況

(平成28年11月30日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1: A種種類株式(15,510株)を含みます。

2: 普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

<訂正前>

(略)

(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

(略)

ファンド名	ジャパン・セレクション・マザーファンド
(略)	
運用プロセス	<p>マクロ経済・金融政策、相場局面分析をベースとしたトップダウンアプローチを行います。</p> <p>相場を動かしている基本的な要因を調べ、その流れを掴むことを重視します。</p>
(略)	

(略)

ファンド名	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>(略)</p> <p>デビス・セレクトド・アドバイザーズとは・・・ Davis Selected Advisers, LP</p> <ul style="list-style-type: none"> ・1969年設立。創業者一族であるDavis家が出資する独立系運用会社。 ・運用受託資産は、約3兆21億円(約26,643百万米ドル、1米ドル=112.68円で換算)。そのうち、不動産関連証券投資は約732億円(2016年3月末現在)。 ・不動産関連証券投資では1994年からの実績。 ・運用スタイルは、個別銘柄選択による割安銘柄投資を特徴としています。 <p>(略)</p>
(略)	

ファンド名	DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>(略)</p> <p>コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントとは・・・ Colonial First State Asset Management (Australia) Limited</p> <ul style="list-style-type: none"> ・オーストラリア・コモンウェルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。 ・運用受託資産は、約16兆6,319億円(約192,834百万豪ドル、1豪ドル=86.25円換算)と豪州を代表する資産運用会社の一つです。そのうち、不動産関連証券投資は約2,708億円(2016年3月末現在)。 ・不動産関連証券投資では1991年からの実績。 ・運用スタイルは、マクロ分析によるトップダウンと個別銘柄調査によるボトムアップ運用の融合を特徴としています。 <p>(略)</p>

(略)

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

<訂正後>

(略)

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

(略)

ファンド名	ジャパン・セレクション・マザーファンド
(略)	
運用プロセス	<p>マクロ経済・金融政策、相場局面分析をベースとしたトップダウンアプローチを行います。</p> <p>相場を動かしている基本的な要因を調べ、その流れを掴むことを重視します。</p>
(略)	

(略)

ファンド名	D I A M U S ・リート・オープン・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>(略)</p> <p>デービス・セレクトド・アドバイザーズとは・・・ Davis Selected Advisers, LP</p> <ul style="list-style-type: none"> ・1969年設立。創業者一族であるDavis家が約80%を出資する独立系運用会社。 ・運用受託資産は、約2兆6,912億円(約26,614百万米ドル、1米ドル=101.12円で換算)。そのうち、不動産関連証券投資は約674億円(2016年9月末現在)。 ・不動産関連証券投資では1994年からの実績。 ・運用スタイルは、個別銘柄選択による割安銘柄投資を特徴としています。 <p>(略)</p>
(略)	

ファンド名	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド
(略)	

投資態度	<p>(略)</p> <p>コロニアル・ファースト・ステート・アセット・マネジメントとは・・・ Colonial First State Asset Management (Australia) Limited</p> <ul style="list-style-type: none"> ・オーストラリア・コモンウェルス銀行による100%出資の資産運用会社。英国・香港等グローバルに拠点を持っています。 ・運用受託資産は、約15兆6,776億円(約203,499百万豪ドル、1豪ドル=77.04円換算)と豪州を代表する資産運用会社の一つです。そのうち、不動産関連証券投資は約2,317億円(2016年9月末現在)。 ・不動産関連証券投資では1991年からの実績。 ・運用スタイルは、マクロ分析によるトップダウンと個別銘柄調査によるボトムアップ運用の融合を特徴としています。 <p>(略)</p>
(略)	

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

<訂正前>

(略)

運用体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(略)

上記体制は、平成28年5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。ただし、Asset Management One International Ltd.の運用体制は、平成28年10月1日現在のものです。

<訂正後>

(略)

運用体制は平成28年11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。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(略)

上記体制は、平成28年11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)

<リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成28年10月1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)

<リスク管理体制>

(略)

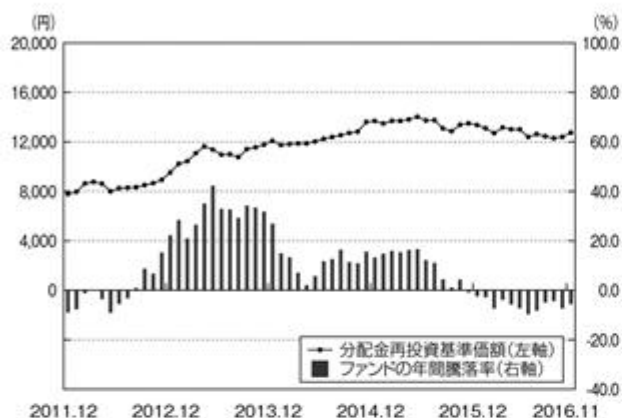
上記体制は平成28年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「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。

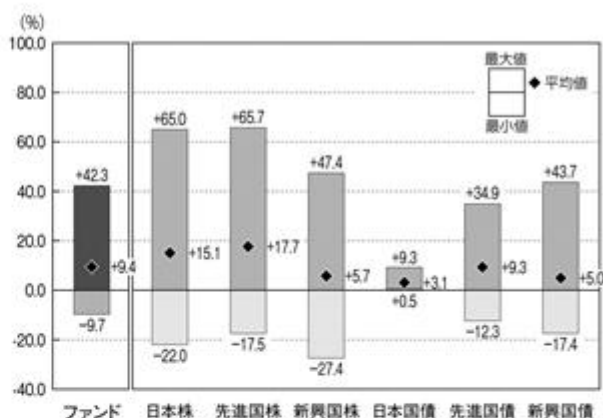
<更新・訂正後>

（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12月～2016年11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、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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5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。

課税上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。

（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11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。

課税上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。

（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11月30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	875,621,048	98.43
内 日本	875,621,048	98.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	14,008,580	1.57
純資産総額	889,629,628	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）

ジャパン・セレクション・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	8,395,377,470	98.10
内 日本	8,395,377,470	98.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	162,995,595	1.90
純資産総額	8,558,373,065	100.00

その他資産の投資状況

平成28年11月30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）	73,700,000	0.86
内 日本	73,700,000	0.86

（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。

国内債券アクティブ・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	492,130,640	69.31
内 日本	492,130,640	69.31
社債券	208,413,820	29.35
内 日本	208,413,820	29.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,538,834	1.34
純資産総額	710,083,294	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。

J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	818,851,630	96.27
内 日本	818,851,630	96.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	31,727,135	3.73
純資産総額	850,578,765	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。

DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	36,805,833,511	95.34
内 アメリカ	36,805,833,511	95.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,800,593,896	4.66
純資産総額	38,606,427,407	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。

DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

平成28年11月30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	26,368,398,587	47.03
内 オーストラリア	16,274,015,294	29.03
内 シンガポール	10,094,383,293	18.00
投資証券	27,976,278,346	49.90
内 イギリス	7,498,541,843	13.37
内 ベルギー	4,733,724,749	8.44
内 フランス	4,710,376,360	8.40
内 カナダ	3,698,154,582	6.60
内 オランダ	3,541,099,310	6.32
内 ニュージーランド	2,637,848,529	4.70
内 ドイツ	1,156,532,973	2.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,720,240,077	3.07
純資産総額	56,064,917,010	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。

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	33,000,565,020	97.93
内 アメリカ	17,737,019,877	52.63
内 カナダ	3,294,222,332	9.78
内 イギリス	3,066,691,314	9.10
内 フランス	2,029,596,960	6.02
内 スイス	1,414,036,980	4.20
内 ドイツ	1,084,303,435	3.22
内 香港	795,459,125	2.36
内 オーストラリア	688,864,123	2.04
内 フィンランド	602,477,568	1.79
内 スウェーデン	579,925,822	1.72
内 オランダ	435,853,048	1.29
内 シンガポール	283,843,450	0.84
内 ノルウェー	184,910,812	0.55
内 アイルランド	176,867,631	0.52
内 ニュージーランド	169,043,768	0.50
内 ルクセンブルグ	163,411,650	0.48
内 ベルギー	153,246,254	0.45
内 イタリア	140,790,871	0.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	698,839,297	2.07
純資産総額	33,699,404,317	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。

高金利ソブリン・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	6,394,528,088	97.87
内 アメリカ	839,518,890	12.85
内 マレーシア	728,796,071	11.15
内 タイ	668,338,988	10.23
内 シンガポール	631,611,536	9.67
内 イギリス	627,297,590	9.60
内 カナダ	625,850,853	9.58
内 ニュージーランド	608,113,394	9.31
内 ポーランド	602,882,053	9.23
内 メキシコ	555,481,004	8.50
内 オーストラリア	506,637,709	7.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	139,113,551	2.13
純資産総額	6,533,641,639	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11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	高金利ソブリン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	249,597,954	1.2005 299,667,303	1.2324 307,604,518	- -	34.58%
2	国内債券アクティブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	97,951,283	1.3933 136,485,317	1.3839 135,554,780	- -	15.24%
3	ジャパン・セレクション・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	61,816,821	2.0540 126,977,932	2.1772 134,587,582	- -	15.13%
4	J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	65,334,323	1.9116 124,899,625	1.9473 127,225,527	- -	14.30%
5	DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	39,658,651	2.0873 82,783,468	2.2714 90,080,659	- -	10.13%
6	DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	23,601,096	2.0058 47,341,438	2.0815 49,125,681	- -	5.52%
7	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	10,858,648	2.6672 28,963,271	2.8956 31,442,301	- -	3.53%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年11月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.43%
合計	98.43%

(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)

ジャパン・セレクション・マザーファンド

平成28年11月30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	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	92,600	3,920.25 363,015,966	4,645.00 430,127,000	- -	5.03%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	617,400	536.87 331,465,795	669.80 413,534,520	- -	4.83%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	32,200	6,477.00 208,559,400	6,712.00 216,126,400	- -	2.53%
4	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	42,800	3,931.24 168,257,436	4,899.00 209,677,200	- -	2.45%
5	三菱商事 日本	株式 卸売業	70,000	2,149.19 150,443,394	2,471.50 173,005,000	- -	2.02%
6	スズキ 日本	株式 輸送用機器	46,400	3,528.40 163,718,045	3,680.00 170,752,000	- -	2.00%
7	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	25,600	6,031.10 154,396,400	6,649.00 170,214,400	- -	1.99%
8	信越化学工業 日本	株式 化学	17,600	7,646.00 134,569,773	8,460.00 148,896,000	- -	1.74%
9	T D K 日本	株式 電気機器	19,000	7,253.44 137,815,481	7,690.00 146,110,000	- -	1.71%
10	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	31,000	4,614.00 143,034,000	4,625.00 143,375,000	- -	1.68%
11	ダイキン工業 日本	株式 機械	13,200	9,486.36 125,219,963	10,715.00 141,438,000	- -	1.65%
12	オリックス 日本	株式 その他金融業	74,800	1,470.50 109,993,400	1,781.50 133,256,200	- -	1.56%
13	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	31,200	3,437.00 107,234,400	4,206.00 131,227,200	- -	1.53%
14	日立ハイテクノロジーズ 日本	株式 卸売業	27,200	3,999.89 108,797,218	4,510.00 122,672,000	- -	1.43%
15	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	27,700	3,886.18 107,647,289	4,365.00 120,910,500	- -	1.41%
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	36,200	2,975.86 107,726,250	3,332.00 120,618,400	- -	1.41%
17	三井住友トラスト・ホール ディングス 日本	株式 銀行業	28,400	4,087.85 116,095,001	4,150.00 117,860,000	- -	1.38%
18	ソニー 日本	株式 電気機器	35,700	3,320.00 118,524,000	3,288.00 117,381,600	- -	1.37%
19	小糸製作所 日本	株式 電気機器	18,900	4,765.00 90,058,500	5,960.00 112,644,000	- -	1.32%
20	ヤマハ発動機 日本	株式 輸送用機器	42,200	2,084.07 87,948,035	2,631.00 111,028,200	- -	1.30%

21	三菱ケミカルホールディングス 日本	株式 化学	152,700	606.60 92,627,820	719.50 109,867,650	- -	1.28%
22	ニトリホールディングス 日本	株式 小売業	9,000	11,160.00 100,440,000	11,940.00 107,460,000	- -	1.26%
23	富士通 日本	株式 電気機器	159,000	564.02 89,680,132	674.80 107,293,200	- -	1.25%
24	イリソ電子工業 日本	株式 電気機器	15,400	5,554.06 85,532,645	6,730.00 103,642,000	- -	1.21%
25	SOMPOホールディングス 日本	株式 保険業	27,600	3,630.13 100,191,611	3,728.00 102,892,800	- -	1.20%
26	日油 日本	株式 化学	97,000	989.18 95,950,826	1,059.00 102,723,000	- -	1.20%
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	167,000	546.18 91,212,348	609.30 101,753,100	- -	1.19%
28	キーエンス 日本	株式 電気機器	1,300	73,460.00 95,498,000	78,230.00 101,699,000	- -	1.19%
29	S M C 日本	株式 機械	3,000	29,035.96 87,107,908	32,520.00 97,560,000	- -	1.14%
30	東ソー 日本	株式 化学	127,000	632.77 80,362,467	768.00 97,536,000	- -	1.14%

(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11月30日現在

種類	投資比率
株式	98.10%
合計	98.10%

(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11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	16.00%
輸送用機器		11.72%
化学		7.98%
情報・通信業		7.95%
銀行業		7.74%
機械		6.02%
卸売業		5.28%
保険業		4.52%
小売業		4.04%
サービス業		3.75%
医薬品		3.11%
食料品		3.02%
建設業		2.92%
非鉄金属		2.50%
不動産業		2.26%
その他金融業		2.14%
その他製品		1.61%
精密機器		1.08%
証券、商品先物取引業		1.02%
陸運業		1.00%
電気・ガス業		0.74%
ゴム製品		0.68%
鉄鋼		0.55%
ガラス・土石製品	0.46%	
合計	98.10%	

(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。

国内債券アクティブ・マザーファンド

平成28年11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	120回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	100,000,000	101.33 101,337,000	100.99 100,998,000	0.200000 2019/9/20	14.22%
2	51回 三井不動産社債 日本	社債券	100,000,000	100.00 100,002,000	100.00 100,002,000	0.001000 2019/12/6	14.08%
3	327回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	106.87 96,188,600	105.38 94,842,900	0.800000 2022/12/20	13.36%
4	33回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証券	33,000,000	140.50 46,365,160	133.17 43,948,740	2.000000 2040/9/20	6.19%
5	151回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	38,000,000	122.25 46,457,030	114.62 43,557,120	1.200000 2034/12/20	6.13%
6	301回 北陸電力社債 日本	社債券	30,000,000	107.28 32,184,000	105.67 31,702,500	1.158000 2023/3/24	4.46%
7	145回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	19,000,000	126.70 24,073,190	122.94 23,359,170	1.700000 2033/6/20	3.29%
8	153回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	18,000,000	121.69 21,904,230	116.34 20,941,740	1.300000 2035/6/20	2.95%
9	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	17,000,000	105.02 17,853,440	103.61 17,613,870	0.400000 2025/9/20	2.48%
10	473回 東北電力社債 日本	社債券	17,000,000	101.83 17,312,630	101.50 17,256,360	0.597000 2021/4/23	2.43%
11	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	17,000,000	101.43 17,244,250	100.90 17,154,020	0.100000 2026/6/20	2.42%
12	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	16,000,000	106.41 17,027,040	104.84 16,775,200	0.600000 2024/6/20	2.36%
13	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	12,000,000	104.08 12,489,960	102.76 12,331,320	0.300000 2025/12/20	1.74%
14	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	11,000,000	101.33 11,146,960	100.83 11,091,410	0.100000 2026/9/20	1.56%
15	147回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	9,000,000	125.30 11,277,720	121.38 10,924,200	1.600000 2033/12/20	1.54%
16	471回 東北電力社債 日本	社債券	10,000,000	106.47 10,647,600	106.04 10,604,400	1.168000 2023/12/25	1.49%
17	277回 四国電力社債 日本	社債券	10,000,000	106.63 10,663,800	105.44 10,544,200	1.179000 2022/9/22	1.48%

18	374回 中国電力社債 日本	社債券	10,000,000	102.58 10,258,700	102.05 10,205,700	0.814000 2020/2/25	1.44%
19	178回 オリックス社債 日本	社債券	10,000,000	101.50 10,150,280	100.42 10,042,600	0.552000 2021/6/16	1.41%
20	98回 近鉄グループホール ディングス社債 日本	社債券	10,000,000	100.39 10,039,000	99.82 9,982,300	0.300000 2021/4/20	1.41%
21	148回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	8,000,000	123.69 9,895,440	119.73 9,578,480	1.500000 2034/3/20	1.35%
22	342回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	8,000,000	102.09 8,167,360	100.92 8,074,320	0.100000 2026/3/20	1.14%
23	76回 伊藤忠商事社債 日本	社債券	8,000,000	101.71 8,136,880	100.92 8,073,760	0.560000 2021/1/29	1.14%
24	149回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	6,000,000	121.31 7,278,780	119.70 7,182,300	1.500000 2034/6/20	1.01%
25	155回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	5,000,000	115.74 5,787,420	110.81 5,540,800	1.000000 2035/12/20	0.78%
26	329回 利付国庫債券(1 0年) 日本	国債証券	5,000,000	107.32 5,366,400	105.75 5,287,850	0.800000 2023/6/20	0.74%
27	41回 利付国庫債券(30 年) 日本	国債証券	4,000,000	137.62 5,505,120	129.05 5,162,120	1.700000 2043/12/20	0.73%
28	146回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	4,000,000	126.87 5,074,840	122.98 4,919,240	1.700000 2033/9/20	0.69%
29	150回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証券	4,000,000	120.31 4,812,640	118.08 4,723,520	1.400000 2034/9/20	0.67%
30	6回 利付国庫債券(40 年) 日本	国債証券	3,000,000	154.64 4,639,200	141.91 4,257,570	1.900000 2053/3/20	0.60%

(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11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	69.31%
社債券	29.35%
合計	98.66%

(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。

J - R E I Tオープン・アクティブ・マザーファンド

平成28年11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	野村不動産マスターファンド 投資法人 日本	投資証券	303	167,217.38 50,676,900	170,500.00 51,671,730	- -	6.07%
2	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	78	673,218.53 52,511,046	637,000.00 49,686,000	- -	5.84%
3	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	64	671,756.25 42,992,400	619,000.00 39,616,000	- -	4.66%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	166	255,596.75 42,429,062	232,200.00 38,545,200	- -	4.53%
5	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	100	288,512.21 28,851,221	288,200.00 28,820,000	- -	3.39%
6	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	44	676,420.18 29,762,488	579,000.00 25,476,000	- -	3.00%
7	G L P 投資法人 日本	投資証券	186	129,627.44 24,110,704	128,300.00 23,863,800	- -	2.81%
8	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	124	185,101.04 22,952,530	174,400.00 21,625,600	- -	2.54%
9	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	75	272,680.60 20,451,045	284,700.00 21,352,500	- -	2.51%
10	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	122	181,418.64 22,133,075	173,100.00 21,118,200	- -	2.48%
11	イオンリート投資法人 日本	投資証券	170	132,425.37 22,512,314	122,800.00 20,876,000	- -	2.45%
12	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	117	190,551.60 22,294,538	172,200.00 20,147,400	- -	2.37%
13	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	353	64,220.45 22,669,821	57,000.00 20,121,000	- -	2.37%
14	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	107	186,570.45 19,963,039	185,900.00 19,891,300	- -	2.34%
15	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	42	476,403.88 20,008,963	465,000.00 19,530,000	- -	2.30%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	32	630,664.65 20,181,269	610,000.00 19,520,000	- -	2.29%
17	阪急リート投資法人 日本	投資証券	129	139,805.76 18,034,944	149,200.00 19,246,800	- -	2.26%
18	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	125	163,414.59 20,426,824	151,200.00 18,900,000	- -	2.22%

19	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	76	252,463.36 19,187,216	236,900.00 18,004,400	- -	2.12%
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	219	87,591.39 19,182,516	79,600.00 17,432,400	- -	2.05%
21	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	36	461,771.61 16,623,778	472,000.00 16,992,000	- -	2.00%
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	32	556,850.43 17,819,214	509,000.00 16,288,000	- -	1.91%
23	ケネディクス商業リート投資法人 日本	投資証券	62	268,607.09 16,653,640	257,500.00 15,965,000	- -	1.88%
24	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	30	552,520.46 16,575,614	529,000.00 15,870,000	- -	1.87%
25	日本リート投資法人 日本	投資証券	55	271,940.87 14,956,748	273,300.00 15,031,500	- -	1.77%
26	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	98	150,268.31 14,726,295	142,600.00 13,974,800	- -	1.64%
27	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	166	83,858.31 13,920,481	82,000.00 13,612,000	- -	1.60%
28	いちごオフィスリート投資法人 日本	投資証券	174	76,513.12 13,313,284	77,200.00 13,432,800	- -	1.58%
29	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	104	115,899.74 12,053,573	121,800.00 12,667,200	- -	1.49%
30	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	25	560,242.80 14,006,070	503,000.00 12,575,000	- -	1.48%

(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11月30日現在

種類	投資比率
投資証券	96.27%
合計	96.27%

(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。

DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

平成28年11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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	107,830	21,664.39 2,336,071,478	20,494.16 2,209,885,919	- -	5.72%
2	CATCHMARK TIMBER TRUST INC アメリカ	投資証券	1,544,230	1,235.01 1,907,139,836	1,235.49 1,907,889,679	- -	4.94%
3	POST PROPERTIES, INC アメリカ	投資証券	194,100	6,577.59 1,276,710,883	7,479.30 1,451,732,634	- -	3.76%
4	TERRENO REALTY CORP アメリカ	投資証券	475,623	2,493.00 1,185,732,311	3,051.07 1,451,163,252	- -	3.76%
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	59,060	28,744.60 1,697,656,528	23,564.35 1,391,710,877	- -	3.60%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	195,575	8,273.70 1,618,129,747	6,800.28 1,329,965,895	- -	3.44%
7	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	50,781	25,849.28 1,312,652,420	24,268.10 1,232,358,660	- -	3.19%
8	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	210,950	5,762.47 1,215,593,466	5,782.88 1,219,899,548	- -	3.16%
9	KITE REALTY GROUP TRUST アメリカ	投資証券	439,462	2,936.21 1,290,355,390	2,752.04 1,209,417,705	- -	3.13%
10	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES アメリカ	投資証券	596,110	1,866.89 1,112,871,997	1,941.49 1,157,343,630	- -	3.00%
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	62,080	20,177.24 1,252,603,657	18,522.31 1,149,865,575	- -	2.98%
12	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES アメリカ	投資証券	198,244	4,357.55 863,858,233	5,335.45 1,057,721,584	- -	2.74%
13	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	145,780	7,444.26 1,085,225,356	7,216.23 1,051,983,438	- -	2.72%
14	FIRST INDUSTRIAL RT アメリカ	投資証券	315,450	2,513.61 792,921,171	3,017.35 951,823,940	- -	2.47%
15	CYRUSONE INC アメリカ	投資証券	190,878	4,214.04 804,368,253	4,955.47 945,890,889	- -	2.45%
16	HIGHWOODS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	168,060	4,779.35 803,218,993	5,470.35 919,348,231	- -	2.38%
17	ACADIA REALTY TRUST アメリカ	投資証券	236,870	3,696.10 875,497,086	3,760.44 890,737,554	- -	2.31%
18	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP アメリカ	投資証券	373,650	2,045.60 764,340,271	2,355.19 880,020,106	- -	2.28%
19	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	362,930	1,814.45 658,521,532	2,373.18 861,300,467	- -	2.23%
20	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC アメリカ	投資証券	176,380	3,657.27 645,070,473	4,746.37 837,165,163	- -	2.17%

21	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	81,170	9,644.17 782,818,054	9,581.55 777,734,949	- -	2.01%
22	DCT INDUSTRIAL TRUST INC アメリカ	投資証券	147,977	4,244.16 628,039,523	5,211.79 771,225,226	- -	2.00%
23	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	85,800	8,335.33 715,171,800	8,910.40 764,513,109	- -	1.98%
24	LIFE STORAGE INC アメリカ	投資証券	75,250	9,331.18 702,171,656	9,238.67 695,210,338	- -	1.80%
25	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	61,426	11,113.55 682,661,094	11,140.82 684,336,132	- -	1.77%
26	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	52,384	10,166.14 532,543,109	12,559.56 657,920,116	- -	1.70%
27	COUSINS PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	691,860	769.64 532,483,807	906.10 626,897,943	- -	1.62%
28	APARTMENT INVT & MGMT CO-A アメリカ	投資証券	130,870	4,341.75 568,205,258	4,727.26 618,656,647	- -	1.60%
29	SL GREEN アメリカ	投資証券	51,000	11,844.68 604,079,126	11,919.89 607,914,522	- -	1.57%
30	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	208,060	3,076.05 640,003,123	2,884.69 600,190,099	- -	1.55%

(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11月30日現在

種類	投資比率
投資証券	95.34%
合計	95.34%

(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。

D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

平成28年11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	NATIONAL STORAGE REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	26,930,611	133.77 3,602,741,092	127.47 3,432,901,538	- -	6.12%
2	WAREHOUSES DE PAUW ベルギー	投資証券	349,944	9,050.72 3,167,246,077	9,616.69 3,365,305,764	- -	6.00%
3	VICINITY CENTRES オーストラリア	投資信託受益 証券	12,100,968	234.75 2,840,709,498	239.79 2,901,800,025	- -	5.18%
4	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	2,067,921	1,564.74 3,235,771,192	1,369.48 2,831,986,790	- -	5.05%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	108,558	27,488.40 2,984,086,630	25,244.72 2,740,517,399	- -	4.89%
6	GOODMAN PROPERTY TRUST ニュージーランド	投資証券	26,401,917	100.31 2,648,442,299	99.91 2,637,848,529	- -	4.70%
7	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	2,920,106	834.17 2,435,875,266	772.52 2,255,869,488	- -	4.02%
8	CAPITALAND MALL TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	14,673,800	162.20 2,380,141,391	150.83 2,213,288,873	- -	3.95%
9	CHARTER HALL GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,708,113	380.31 2,170,868,437	379.47 2,166,065,631	- -	3.86%
10	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV オランダ	投資証券	506,927	4,713.18 2,389,241,999	4,129.64 2,093,431,085	- -	3.73%
11	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資信託受益 証券	5,268,993	350.86 1,848,698,906	353.38 1,861,998,898	- -	3.32%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	5,147,091	348.33 1,792,935,620	354.22 1,823,250,956	- -	3.25%
13	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	9,478,152	161.54 1,531,184,081	171.64 1,626,883,086	- -	2.90%
14	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	12,519,840	120.00 1,502,416,006	126.35 1,581,906,823	- -	2.82%
15	MAPLETREE LOGISTICS TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	19,701,320	78.31 1,542,822,200	78.57 1,548,034,174	- -	2.76%
16	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	1,778,892	1,129.29 2,008,899,889	842.75 1,499,179,021	- -	2.67%
17	VASTNED RETAIL オランダ	投資証券	348,484	4,841.69 1,687,254,589	4,154.18 1,447,668,225	- -	2.58%
18	FRASERS CENTREPOINT TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	8,667,000	147.67 1,279,889,691	152.80 1,324,377,835	- -	2.36%
19	ASCOTT RESIDENCE TRUST シンガポール	投資信託受益 証券	14,377,600	88.17 1,267,673,063	89.23 1,283,000,951	- -	2.29%
20	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA オーストラリア	投資信託受益 証券	6,514,520	177.53 1,156,557,914	177.53 1,156,557,914	- -	2.06%
21	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券	827,220	1,380.14 1,141,680,238	1,398.09 1,156,532,973	- -	2.06%
22	ASCENDAS REAL ESTATE INV シンガポール	投資信託受益 証券	6,204,791	187.95 1,166,221,037	182.42 1,131,882,317	- -	2.02%

23	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	847,500	1,100.39 932,582,220	1,295.36 1,097,823,024	- -	1.96%
24	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	1,047,168	1,065.24 1,115,491,942	983.23 1,029,617,464	- -	1.84%
25	ALE PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,579,620	323.09 833,469,030	360.11 928,970,690	- -	1.66%
26	SEGRO PLC イギリス	投資証券	1,550,272	612.40 949,395,254	587.96 911,506,544	- -	1.63%
27	COFINIMMO SA ベルギー	投資証券	66,685	11,582.17 772,357,139	12,538.57 836,134,873	- -	1.49%
28	ALLIED PROPERTIES REIT カナダ	投資証券	280,522	2,646.79 742,485,180	2,864.36 803,517,791	- -	1.43%
29	ICADE フランス	投資証券	96,588	7,678.75 741,675,587	7,754.16 748,959,385	- -	1.34%
30	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST カナダ	投資証券	268,754	2,615.00 702,791,710	2,635.08 708,189,150	- -	1.26%

(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11月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	47.03%
投資証券	49.90%
合計	96.93%

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成28年11月30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	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消 耗燃料	75,132	11,444.77 859,868,680	12,292.00 923,522,754	- -	2.74%
2	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	213,064	3,827.13 815,425,102	3,588.44 764,568,743	- -	2.27%
3	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	108,090	6,402.54 692,051,414	6,991.39 755,700,404	- -	2.24%
4	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	203,141	3,187.12 647,436,511	3,353.48 681,231,027	- -	2.02%
5	ALTRIA GROUP INC アメリカ	株式 タバコ	90,528	7,204.84 652,240,584	7,327.53 663,347,142	- -	1.97%
6	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	64,221	11,170.29 717,367,325	10,185.25 654,107,068	- -	1.94%
7	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	163,821	3,755.42 615,217,314	3,969.55 650,295,683	- -	1.93%
8	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	69,596	9,607.82 668,666,259	9,318.49 648,529,894	- -	1.92%
9	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	93,958	5,927.94 556,977,545	6,867.73 645,278,908	- -	1.91%
10	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	141,220	4,375.65 617,929,536	4,438.34 626,782,600	- -	1.86%
11	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD 香港	株式 商業銀行	1,475,500	392.61 579,296,502	420.50 620,447,750	- -	1.84%
12	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP アメリカ	株式 運送インフラ	66,187	8,880.53 587,776,161	9,198.20 608,801,554	- -	1.81%
13	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	68,750	8,569.60 589,160,151	7,783.25 535,098,815	- -	1.59%
14	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	21,088	27,525.44 580,456,613	25,155.30 530,475,050	- -	1.57%
15	TOTAL SA フランス	株式 石油・ガス・消 耗燃料	100,507	5,275.17 530,192,415	5,257.22 528,387,812	- -	1.57%
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消 耗燃料	53,934	10,148.09 547,327,383	9,656.87 520,834,058	- -	1.55%
17	QUALCOMM INC アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	65,752	6,744.05 443,435,134	7,506.28 493,553,146	- -	1.46%

18	NORTHLAND POWER INC カナダ	株式 独立系発電事業者・エネルギー販売業者	265,970	2,039.27 542,384,728	1,820.03 484,076,038	- -	1.44%
19	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 タバコ	76,932	5,978.71 459,954,747	6,256.79 481,347,422	- -	1.43%
20	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	66,502	6,942.55 461,693,741	6,923.94 460,456,376	- -	1.37%
21	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	213,476	2,088.13 445,767,012	2,118.13 452,171,371	- -	1.34%
22	SANOFI フランス	株式 医薬品	49,455	8,941.03 442,178,727	9,135.50 451,796,350	- -	1.34%
23	ROYAL BANK OF CANADA カナダ	株式 商業銀行	56,789	6,719.78 381,609,840	7,541.24 428,259,569	- -	1.27%
24	REYNOLDS AMERICAN INC アメリカ	株式 タバコ	66,078	5,822.10 384,712,763	6,178.60 408,269,742	- -	1.21%
25	UNITED BANKSHARES INC アメリカ	株式 商業銀行	73,469	4,595.15 337,601,714	5,182.56 380,757,647	- -	1.13%
26	IMPERIAL BRANDS PLC イギリス	株式 タバコ	76,072	5,449.12 414,526,111	4,941.38 375,900,872	- -	1.12%
27	PACWEST BANCORP アメリカ	株式 商業銀行	64,967	4,987.95 324,052,528	5,767.14 374,674,174	- -	1.11%
28	FNB CORP アメリカ	株式 商業銀行	218,625	1,527.65 333,983,914	1,693.04 370,142,006	- -	1.10%
29	LAS VEGAS SANDS CORP アメリカ	株式 ホテル・レストラン・レジャー	52,488	5,754.95 302,066,257	6,986.90 366,728,564	- -	1.09%
30	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	45,918	8,221.60 377,519,623	7,588.81 348,463,115	- -	1.03%

(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11月30日現在

種類	投資比率
株式	97.93%
合計	97.93%

(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。

投資株式の業種別投資比率

平成28年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	12.19%
医薬品		11.67%
石油・ガス・消耗燃料		10.72%
タバコ		7.66%
半導体・半導体製造装置		5.88%
保険		4.30%
ホテル・レストラン・レジャー		3.61%
化学		3.18%
各種電気通信サービス		2.82%
運送インフラ		2.31%
通信機器		2.02%
食品		2.02%
総合公益事業		2.02%
家庭用品		1.92%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		1.92%
ソフトウェア		1.91%
電力		1.69%
金属・鉱業		1.38%
バイオテクノロジー		1.37%
電気設備		1.27%
容器・包装		1.19%
ガス		1.09%
機械		1.08%
商業サービス・用品		1.03%
コングロマリット		0.98%
食品・生活必需品小売り		0.97%
無線通信サービス		0.92%
航空貨物・物流サービス		0.92%
複合小売り		0.90%
コンピュータ・周辺機器		0.89%
紙製品・林産品		0.79%
航空宇宙・防衛		0.73%
飲料		0.57%
建設・土木		0.55%
情報技術サービス		0.55%
消費者金融		0.54%
建設資材		0.50%
専門サービス		0.49%
各種消費者サービス		0.49%
メディア		0.48%
商社・流通業		0.39%
合計		97.93%

(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。

高金利ソブリン・マザーファンド

平成28年11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	US T N/B 1.125 02/28/21 アメリカ	国債証券	860,013,000	99.66 857,164,811	97.61 839,518,890	1.125000 2021/2/28	12.85%
2	MALAYSIA 4.16 07/15/21 マレーシア	国債証券	730,220,000	103.52 755,929,787	99.80 728,796,071	4.160000 2021/7/15	11.15%
3	THAILAND 3.65 12/17/21 タイ	国債証券	619,360,000	110.89 686,833,078	107.90 668,338,988	3.650000 2021/12/17	10.23%
4	SINGAPORE 2.25 06/01/21 シンガポール	国債証券	615,966,000	103.17 635,516,760	102.53 631,611,536	2.250000 2021/6/1	9.67%
5	UK TREASURY 1.5 01/22/21 イギリス	国債証券	603,978,000	103.93 627,752,400	103.86 627,297,590	1.500000 2021/1/22	9.60%
6	CANADA 0.75 03/01/21 カナダ	国債証券	630,110,400	100.28 631,916,381	99.32 625,850,853	0.750000 2021/3/1	9.58%
7	POLAND 2.0 04/25/21 ポーランド	国債証券	623,469,000	99.07 617,711,979	96.69 602,882,053	2.000000 2021/4/25	9.23%
8	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21 メキシコ	国債証券	566,800,000	105.09 595,655,788	98.00 555,481,004	6.500000 2021/6/10	8.50%
9	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20 オーストラリア	国債証券	512,412,600	100.22 513,571,956	98.87 506,637,709	1.750000 2020/11/21	7.75%
10	NEW ZEALAND 6.0 05/15/21 ニュージーランド	国債証券	280,875,000	118.54 332,966,077	114.85 322,587,746	6.000000 2021/5/15	4.94%
11	NEW ZEALAND 3.0 04/15/20 ニュージーランド	国債証券	279,270,000	103.58 289,293,000	102.24 285,525,648	3.000000 2020/4/15	4.37%

(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11月30日現在

種類	投資比率
国債証券	97.87%
合計	97.87%

(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)

ジャパン・セレクション・マザーファンド

平成28年11月30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 2812月	買建	5	67,371,620	73,700,000	0.86%

(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。

国内債券アクティブ・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド

該当事項はありません。

DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

該当事項はありません。

DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

該当事項はありません。

DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド

該当事項はありません。

高金利ソブリン・マザーファンド

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11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2特定期間末 (平成19年5月8日)	6,978	7,433	1.1054	1.1774
第3特定期間末 (平成19年11月8日)	10,701	10,829	1.0050	1.0170
第4特定期間末 (平成20年5月8日)	9,350	9,422	0.9010	0.9080
第5特定期間末 (平成20年11月10日)	5,935	6,002	0.6217	0.6287
第6特定期間末 (平成21年5月8日)	5,763	5,829	0.6119	0.6189
第7特定期間末 (平成21年11月9日)	5,647	5,710	0.6287	0.6357
第8特定期間末 (平成22年5月10日)	4,599	4,635	0.6322	0.6372
第9特定期間末 (平成22年11月8日)	3,804	3,835	0.6233	0.6283
第10特定期間末 (平成23年5月9日)	3,282	3,295	0.6444	0.6469
第11特定期間末 (平成23年11月8日)	2,525	2,536	0.5797	0.5822
第12特定期間末 (平成24年5月8日)	2,272	2,281	0.6048	0.6073
第13特定期間末 (平成24年11月8日)	1,899	1,906	0.6114	0.6139
第14特定期間末 (平成25年5月8日)	2,187	2,194	0.8241	0.8266
第15特定期間末 (平成25年11月8日)	1,912	1,918	0.7901	0.7926
第16特定期間末 (平成26年5月8日)	1,647	1,652	0.8171	0.8196
第17特定期間末 (平成26年11月10日)	1,491	1,495	0.8958	0.8983
第18特定期間末 (平成27年5月8日)	1,226	1,230	0.9257	0.9282
第19特定期間末 (平成27年11月9日)	1,065	1,068	0.9003	0.9028
第20特定期間末 (平成28年5月9日)	955	958	0.8513	0.8538
第21特定期間末 (平成28年11月8日)	862	864	0.8138	0.8163
平成27年11月末日	1,059	-	0.9058	-

12月末日	1,029	-	0.8966	-
平成28年1月末日	995	-	0.8766	-
2月末日	960	-	0.8499	-
3月末日	987	-	0.8781	-
4月末日	975	-	0.8687	-
5月末日	962	-	0.8654	-
6月末日	911	-	0.8251	-
7月末日	922	-	0.8377	-
8月末日	908	-	0.8258	-
9月末日	868	-	0.8130	-
10月末日	868	-	0.8200	-
11月末日	889	-	0.8400	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第2特定期間	0.0840
第3特定期間	0.0260
第4特定期間	0.0210
第5特定期間	0.0210
第6特定期間	0.0210
第7特定期間	0.0210
第8特定期間	0.0170
第9特定期間	0.0150
第10特定期間	0.0075
第11特定期間	0.0075
第12特定期間	0.0075
第13特定期間	0.0075
第14特定期間	0.0075
第15特定期間	0.0075
第16特定期間	0.0075
第17特定期間	0.0075
第18特定期間	0.0075
第19特定期間	0.0075
第20特定期間	0.0075
第21特定期間	0.0075

【収益率の推移】

	収益率(%)
第2特定期間	15.0
第3特定期間	6.7
第4特定期間	8.3
第5特定期間	28.7
第6特定期間	1.8
第7特定期間	6.2
第8特定期間	3.3
第9特定期間	1.0
第10特定期間	4.6
第11特定期間	8.9
第12特定期間	5.6
第13特定期間	2.3
第14特定期間	36.0
第15特定期間	3.2
第16特定期間	4.4
第17特定期間	10.5
第18特定期間	4.2
第19特定期間	1.9
第20特定期間	4.6
第21特定期間	3.5

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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】

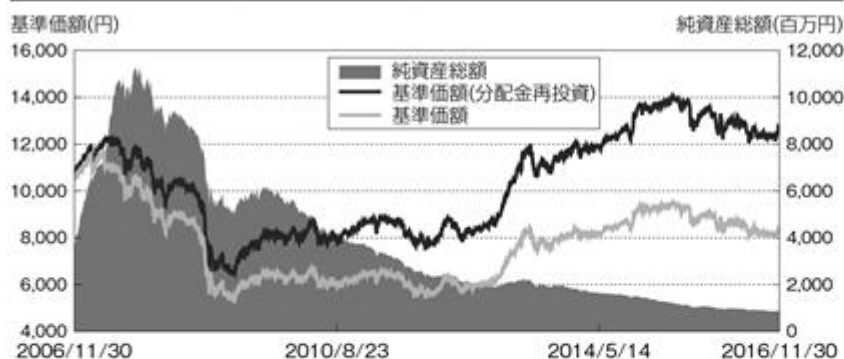
	設定口数	解約口数
第2特定期間	3,945,715,927	562,935,400
第3特定期間	5,065,799,987	730,982,231
第4特定期間	289,060,834	559,653,233
第5特定期間	43,617,037	874,268,467
第6特定期間	57,610,908	185,438,942
第7特定期間	54,405,415	490,942,217
第8特定期間	38,274,159	1,745,390,064
第9特定期間	26,785,109	1,198,695,817
第10特定期間	15,254,576	1,025,078,928
第11特定期間	13,841,925	751,920,633
第12特定期間	10,842,593	609,617,246
第13特定期間	6,837,426	657,902,253
第14特定期間	11,438,694	462,970,501
第15特定期間	4,241,088	238,551,301
第16特定期間	4,571,190	408,819,196
第17特定期間	2,381,432	353,467,789
第18特定期間	1,374,876	340,968,128
第19特定期間	1,805,271	143,312,878
第20特定期間	1,848,230	62,867,315
第21特定期間	1,176,681	64,367,301

(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11月30日

基準価額・純資産の推移 (2006年11月30日)～2016年11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:2006年7月20日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移 (税引前)

第57期(2016.03.08)	25円
第58期(2016.05.09)	25円
第59期(2016.07.08)	25円
第60期(2016.09.08)	25円
第61期(2016.11.08)	25円
直近1年間累計	150円
設定来累計	3,410円

(注)分配金は1万円当たりです。

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	高金利ソブリン・マザーファンド	34.58%
2	国内債券アクティブ・マザーファンド	15.24%
3	ジャパン・セレクション・マザーファンド	15.13%
4	J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド	14.30%
5	DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	10.13%
6	DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	5.52%
7	DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	3.53%

■国内債券アクティブ・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。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	69.31
内 日本	69.31
社債券	29.35
内 日本	29.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.34
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	120回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/9/20	14.22%
2	51回 三井不動産社債	社債券	日本	0.001000	2019/12/6	14.08%
3	327回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2022/12/20	13.36%
4	33回 利付国庫債券(30年)	国債証券	日本	2.000000	2040/9/20	6.19%
5	151回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.200000	2034/12/20	6.13%
6	301回 北陸電力社債	社債券	日本	1.158000	2023/3/24	4.46%
7	145回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.700000	2033/6/20	3.29%
8	153回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.300000	2035/6/20	2.95%
9	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	2.48%
10	473回 東北電力社債	社債券	日本	0.597000	2021/4/23	2.43%

■高金利ソブリン・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(%)
国債証券	97.87
内 アメリカ	12.85
内 マレーシア	11.15
内 タイ	10.23
内 シンガポール	9.67
内 イギリス	9.60
内 その他	44.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.13
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	UST N/B 1.125 02/28/21	国債証券	アメリカ	1.125000	2021/2/28	12.85%
2	MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	マレーシア	4.160000	2021/7/15	11.15%
3	THAILAND 3.65 12/17/21	国債証券	タイ	3.650000	2021/12/17	10.23%
4	SINGAPORE 2.25 06/01/21	国債証券	シンガポール	2.250000	2021/6/1	9.67%
5	UK TREASURY 1.5 01/22/21	国債証券	イギリス	1.500000	2021/1/22	9.60%
6	CANADA 0.75 03/01/21	国債証券	カナダ	0.750000	2021/3/1	9.58%
7	POLAND 2.0 04/25/21	国債証券	ポーランド	2.000000	2021/4/25	9.23%
8	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	メキシコ	6.500000	2021/6/10	8.50%
9	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国債証券	オーストラリア	1.750000	2020/11/21	7.75%
10	NEW ZEALAND 6.0 05/15/21	国債証券	ニュージーランド	6.000000	2021/5/15	4.94%

○ 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。

データの基準日: 2016年11月30日

主要な資産の状況

■ジャパン・セレクション・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	98.10
内 日本	98.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.90
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)	0.86

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	富士重工業	株式	日本	輸送用機器	5.03%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	4.83%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.53%
4	東京海上ホールディングス	株式	日本	保険業	2.45%
5	三菱商事	株式	日本	卸売業	2.02%
6	スズキ	株式	日本	輸送用機器	2.00%
7	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	1.99%
8	信越化学工業	株式	日本	化学	1.74%
9	TDK	株式	日本	電気機器	1.71%
10	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.68%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	16.00%
2	輸送用機器	11.72%
3	化学	7.98%
4	情報・通信業	7.95%
5	銀行業	7.74%

■DIAM世界好配当株オープン・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	97.93
内 アメリカ	52.63
内 カナダ	9.78
内 イギリス	9.10
内 フランス	6.02
内 スイス	4.20
内 その他	16.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.07
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	業種	投資比率
1	CHEVRON CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	2.74%
2	PFIZER INC	株式	アメリカ	医薬品	2.27%
3	MERCK & CO. INC.	株式	アメリカ	医薬品	2.24%
4	CISCO SYSTEMS INC	株式	アメリカ	通信機器	2.02%
5	ALTRIA GROUP INC	株式	アメリカ	タバコ	1.97%
6	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	アメリカ	タバコ	1.94%
7	INTEL CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.93%
8	PROCTER & GAMBLE CO	株式	アメリカ	家庭用品	1.92%
9	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.91%
10	AT&T INC	株式	アメリカ	各種電気通信サービス	1.86%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	12.19%
2	医薬品	11.67%
3	石油・ガス・消耗燃料	10.72%
4	タバコ	7.66%
5	半導体・半導体製造装置	5.88%

■J-REITオープン・アクティブ・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。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(%)
投資証券	96.27
内 日本	96.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.73
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	6.07%
2	日本ビルファンド投資法人	日本	5.84%
3	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	4.66%
4	日本リートファンド投資法人	日本	4.53%
5	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	3.39%
6	大和証券オフィス投資法人	日本	3.00%
7	GLP投資法人	日本	2.81%
8	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	2.54%
9	大和ハウスリート投資法人	日本	2.51%
10	オリックス不動産投資法人	日本	2.48%

- 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。

データの基準日: 2016年11月30日

主要な資産の状況

■DIAM US・リート・オープン・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(%)
投資証券	95.34
内 アメリカ	95.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.66
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	5.72%
2	CATCHMARK TIMBER TRUST INC	アメリカ	4.94%
3	POST PROPERTIES. INC	アメリカ	3.76%
4	TERRENO REALTY CORP	アメリカ	3.76%
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.60%
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	3.44%
7	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	3.19%
8	PROLOGIS INC	アメリカ	3.16%
9	KITE REALTY GROUP TRUST	アメリカ	3.13%
10	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	アメリカ	3.00%

■DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・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。

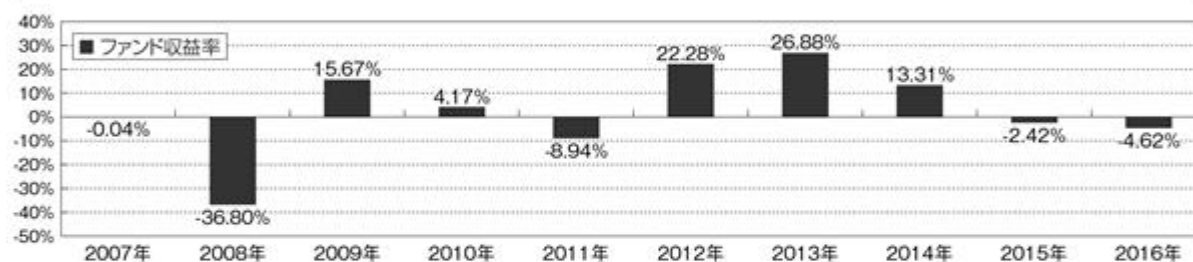
ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	47.03
内 オーストラリア	29.03
内 シンガポール	18.00
投資証券	49.90
内 イギリス	13.37
内 ベルギー	8.44
内 フランス	8.40
内 カナダ	6.60
内 オランダ	6.32
内 その他	6.77
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.07
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	6.12%
2	WAREHOUSES DE PAUW	ベルギー	6.00%
3	VICINITY CENTRES	オーストラリア	5.18%
4	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	5.05%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	4.89%
6	GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド	4.70%
7	HAMMERSON PLC	イギリス	4.02%
8	CAPITALAND MALL TRUST	シンガポール	3.95%
9	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	3.86%
10	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	オランダ	3.73%

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、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。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○ 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】

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ヵ月未満であるため、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、当特定期間(平成28年5月10日から平成28年11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】

世界6資産アクティブ・バランス・ファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成28年5月9日現在	当 期 平成28年11月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,612,621	20,080,878
親投資信託受益証券	947,575,783	847,118,354
流動資産合計	961,188,404	867,199,232
資産合計	961,188,404	867,199,232
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,806,935	2,648,959
未払受託者報酬	107,171	94,651
未払委託者報酬	2,438,462	2,153,695
その他未払費用	8,184	7,066
流動負債合計	5,360,752	4,904,371
負債合計	5,360,752	4,904,371
純資産の部		
元本等		
元本	1,122,774,376	1,059,583,756
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 166,946,724	2 197,288,895
（分配準備積立金）	28,956,587	25,540,632
元本等合計	955,827,652	862,294,861
純資産合計	955,827,652	862,294,861
負債純資産合計	961,188,404	867,199,232

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前 期 自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	当 期 自 平成28年5月10日 至 平成28年11月8日
営業収益		
受取利息	2,050	1
有価証券売買等損益	39,922,442	26,457,429
営業収益合計	39,920,392	26,457,428
営業費用		
支払利息	744	4,626
受託者報酬	320,736	294,663
委託者報酬	27,297,687	26,704,540
その他費用	25,033	22,006
営業費用合計	7,644,200	7,025,835
営業利益又は営業損失（ ）	47,564,592	33,483,263
経常利益又は経常損失（ ）	47,564,592	33,483,263
当期純利益又は当期純損失（ ）	47,564,592	33,483,263
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（ ）	136,639	717,873
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	118,052,805	166,946,724
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,277,194	10,782,054
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,277,194	10,782,054
剰余金減少額又は欠損金増加額	249,065	203,760
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	249,065	203,760
分配金	18,494,095	18,155,075
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	166,946,724	197,288,895

(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	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	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月8日及び11月8日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を平成28年5月9日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前 期 平成28年5月9日現在	当 期 平成28年11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	1,183,793,461円 1,848,230円 62,867,315円	1,122,774,376円 1,176,681円 64,367,301円
2. 受益権の総数	1,122,774,376口	1,059,583,756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166,946,724円であります。	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197,288,895円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	当 期 自 平成28年5月10日 至 平成28年11月8日
1. 1 分配金の計算過程	(自平成27年11月10日 至平成28年1月8日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,267,209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(14,765,820円)及び分配準備積立金(30,378,761円)より分配対象収益は47,411,790円(1万口当たり413.92円)であり、うち2,863,561円(1万口当たり25円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。(以下、各期間において同じ。)	(自平成28年5月10日 至平成28年7月8日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,931,074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(14,264,315円)及び分配準備積立金(28,434,954円)より分配対象収益は44,630,343円(1万口当たり404.66円)であり、うち2,757,272円(1万口当たり25円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。(以下、各期間において同じ。)

<p>2 . 2 当ファンドの主要投資対象であるDIAMUS・リート・オープン・マザーファンド、DIAMインターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド及び高金利ソブリン・マザーファンドにおいて、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</p>	<p>(自平成28年1月9日 至平成28年3月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,793,026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(14,585,317円)及び分配準備積立金(29,342,111円)より分配対象収益は46,720,454円(1万口当たり413.66円)であり、うち2,823,599円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年7月9日 至平成28年9月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,879,927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(14,231,449円)及び分配準備積立金(27,513,841円)より分配対象収益は44,625,217円(1万口当たり405.85円)であり、うち2,748,844円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>
	<p>(自平成28年3月9日 至平成28年5月9日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,636,466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(14,511,305円)及び分配準備積立金(29,127,056円)より分配対象収益は46,274,827円(1万口当たり412.15円)であり、うち2,806,935円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年9月9日 至平成28年11月8日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,558,715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(13,724,195円)及び分配準備積立金(26,630,876円)より分配対象収益は41,913,786円(1万口当たり395.57円)であり、うち2,648,959円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>
	<p>680,461円</p>	<p>628,022円</p>

（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	前 期 自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	当 期 自 平成28年5月10日 至 平成28年11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、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、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、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。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成28年5月9日現在	当 期 平成28年11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	前期 平成28年5月9日現在	当期 平成28年11月8日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	6,497,792	7,618,018
合計	6,497,792	7,618,018

(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)

	前期 平成28年5月9日現在	当期 平成28年11月8日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8513円 (8,513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11月8日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ジャパン・セレクション・マザーファンド	61,816,821	126,977,932	
	国内債券アクティブ・マザーファンド	97,951,283	136,485,317	
	J-REITオープン・アクティブ・マ ザーファンド	65,334,323	124,899,625	
	D I A M US・リート・オープン・マ ザーファンド	10,858,648	28,963,271	
	D I A M インターナショナル・リート・ インカム・オープン・マザーファンド	23,601,096	47,341,438	
	D I A M世界好配当株オープン・マザー ファンド	39,658,651	82,783,468	
	高金利ソブリン・マザーファンド	249,597,954	299,667,303	
親投資信託受益証券 合計		548,818,776	847,118,354	
合計		548,818,776	847,118,354	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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。

（参考）

当ファンドは、「ジャパン・セレクション・マザーファンド」受益証券、「国内債券アクティブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド」受益証券、「DIAM US・リート・オープン・マザーファンド」受益証券、「DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド」受益証券、「DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド」受益証券及び「高金利ソブリン・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

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。

「ジャパン・セレクション・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5月9日現在	平成28年11月8日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		117,711,573	84,855,652
株式		7,811,659,830	7,976,614,550
派生商品評価勘定		-	1,977,408
未収入金		68,983,627	136,488,950
未収配当金		78,055,660	59,025,000
前払金		4,593,268	-
差入委託証拠金		4,197,732	4,557,408
流動資産合計		8,085,201,690	8,263,518,968
資産合計		8,085,201,690	8,263,518,968
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,753,268	-
前受金		-	1,897,408
未払金		69,329,743	110,459,332
未払解約金		12,000,000	3,000,000
その他未払費用		140	-
流動負債合計		85,083,151	115,356,740
負債合計		85,083,151	115,356,740
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,027,000,311	3,966,858,481
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,973,118,228	4,181,303,747
元本等合計		8,000,118,539	8,148,162,228
純資産合計		8,000,118,539	8,148,162,228
負債純資産合計		8,085,201,690	8,263,518,968

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5月9日現在	平成28年11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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	4,255,243,932円 160,184,237円 388,427,858円	4,027,000,311円 134,386,414円 194,528,244円
元本の内訳 ファンド名		
I B J I T M ジャパン・セレクション	2,673,466,758円	2,576,774,990円
D I A M ジャパン・セレクション< D C 年金 >	1,092,116,130円	1,143,432,028円
世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	64,770,013円	61,816,821円
D I A M 世界6資産バランスファンド	196,647,410円	184,834,642円
計	4,027,000,311円	3,966,858,481円
2. 受益権の総数	4,027,000,311口	3,966,858,481口

（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	自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	自 平成28年5月10日 至 平成28年11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、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、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び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、株価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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年5月9日現在	平成28年11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 「(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。	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)

売買目的有価証券

種類	平成28年5月9日現在	平成28年11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)
株式	126,715,601	344,307,900
合計	126,715,601	344,307,900

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年3月18日から平成28年5月9日まで及び平成28年9月21日から平成28年11月8日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成28年5月9日 現在				平成28年11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	95,276,000	-	91,525,000	3,751,000	107,420,000	-	109,400,000	1,980,000
合計	95,276,000	-	91,525,000	3,751,000	107,420,000	-	109,400,000	1,980,000

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.9866円	2.0541円
(1万口当たり純資産額)	(19,866円)	(20,541円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年11月8日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
大林組	12,800	997.00	12,761,600	
鹿島建設	102,000	707.00	72,114,000	
西松建設	164,000	505.00	82,820,000	
大東建託	1,600	17,400.00	27,840,000	
九電工	29,500	3,200.00	94,400,000	
江崎グリコ	4,700	5,280.00	24,816,000	
森永乳業	69,000	852.00	58,788,000	
ぐるなび	8,800	2,605.00	22,924,000	
アサヒグループホールディングス	15,700	3,655.00	57,383,500	
サンエー	4,800	5,590.00	26,832,000	
あらた	15,400	2,433.00	37,468,200	
味の素	27,600	2,254.50	62,224,200	
キュービー	27,000	2,830.00	76,410,000	
ニチレイ	17,800	2,337.00	41,598,600	
あいホールディングス	14,600	2,588.00	37,784,800	
ウエルシアホールディングス	12,500	7,110.00	88,875,000	
セブン&アイ・ホールディングス	18,500	4,337.00	80,234,500	
T I S	47,100	2,317.00	109,130,700	
ハーツユナイテッドグループ	17,500	1,617.00	28,297,500	
東ソー	208,000	717.00	149,136,000	
信越化学工業	12,800	7,904.00	101,171,200	
三菱ケミカルホールディングス	152,700	696.00	106,279,200	
ダイセル	28,300	1,215.00	34,384,500	
セブテーニ・ホールディングス	81,900	454.00	37,182,600	
A D E K A	57,300	1,498.00	85,835,400	
日油	115,000	1,039.00	119,485,000	
アステラス製薬	41,900	1,493.50	62,577,650	
塩野義製薬	13,500	5,066.00	68,391,000	
日本新薬	5,400	5,090.00	27,486,000	
中外製薬	17,700	3,260.00	57,702,000	
キョーリン製薬ホールディングス	18,400	2,277.00	41,896,800	
サカタインクス	33,700	1,381.00	46,539,700	
フジ・メディア・ホールディングス	31,900	1,482.00	47,275,800	
デジタルガレージ	15,200	1,874.00	28,484,800	
エン・ジャパン	42,500	1,997.00	84,872,500	
東洋ゴム工業	85,400	1,600.00	136,640,000	
日新製鋼	32,300	1,355.00	43,766,500	
日本軽金属ホールディングス	219,100	238.00	52,145,800	
三井金属鉱業	171,000	237.00	40,527,000	
U A C J	224,000	334.00	74,816,000	
テクノプロ・ホールディングス	16,200	3,565.00	57,753,000	
ジャパンマテリアル	5,900	3,530.00	20,827,000	
リクルートホールディングス	27,700	4,125.00	114,262,500	

ディスコ	7,000	12,730.00	89,110,000
平田機工	3,300	6,900.00	22,770,000
ナブテスコ	26,700	2,885.00	77,029,500
S M C	2,600	30,480.00	79,248,000
荏原製作所	21,300	2,985.00	63,580,500
ダイキン工業	11,900	10,130.00	120,547,000
ダイフク	11,000	1,918.00	21,098,000
日立製作所	140,000	549.00	76,860,000
三菱電機	40,500	1,457.00	59,008,500
日本電産	9,000	10,130.00	91,170,000
ダイヘン	71,000	601.00	42,671,000
日新電機	25,200	1,276.00	32,155,200
富士通	159,000	608.80	96,799,200
日立国際電気	33,400	2,136.00	71,342,400
ソニー	42,800	3,185.00	136,318,000
T D K	15,800	7,130.00	112,654,000
アルプス電気	13,100	2,445.00	32,029,500
堀場製作所	14,000	4,870.00	68,180,000
キーエンス	2,400	74,140.00	177,936,000
イリソ電子工業	15,400	6,060.00	93,324,000
村田製作所	6,000	13,410.00	80,460,000
全国保証	17,000	4,055.00	68,935,000
日産自動車	51,100	1,035.50	52,914,050
トヨタ自動車	23,100	5,894.00	136,151,400
本田技研工業	36,200	2,968.00	107,441,600
スズキ	42,900	3,964.00	170,055,600
富士重工業	77,400	3,934.00	304,491,600
ヤマハ発動機	42,900	2,420.00	103,818,000
小糸製作所	18,900	5,450.00	103,005,000
S C R E E Nホールディングス	6,700	7,010.00	46,967,000
朝日インテック	8,900	4,480.00	39,872,000
フジシールインターナショナル	17,100	4,225.00	72,247,500
ヨネックス	8,100	4,870.00	39,447,000
ヤマハ	17,300	3,555.00	61,501,500
ニフコ	11,100	6,010.00	66,711,000
東京エレクトロン	5,000	9,583.00	47,915,000
日立ハイテクノロジーズ	27,200	4,350.00	118,320,000
三菱商事	65,100	2,319.00	150,966,900
コメリ	17,300	2,547.00	44,063,100
イズミ	8,500	4,745.00	40,332,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	484,800	533.00	258,398,400
三井住友フィナンシャルグループ	59,400	3,573.00	212,236,200
S B Iホールディングス	25,700	1,227.00	31,533,900
オリックス	102,300	1,613.50	165,061,050
第一生命ホールディングス	40,400	1,504.50	60,781,800
東京海上ホールディングス	41,400	4,051.00	167,711,400
三井不動産	11,000	2,385.00	26,235,000
東京建物	49,600	1,345.00	66,712,000
住友不動産	10,000	2,674.00	26,740,000
リログループ	2,000	17,070.00	34,140,000

名古屋鉄道	180,000	548.00	98,640,000	
日本電信電話	35,800	4,516.00	161,672,800	
KDDI	49,600	2,975.00	147,560,000	
イーレックス	10,700	3,060.00	32,742,000	
カブコン	24,800	2,598.00	64,430,400	
ニトリホールディングス	9,000	12,330.00	110,970,000	
ソフトバンクグループ	32,500	6,445.00	209,462,500	
合計	4,610,900		7,976,614,550	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

「(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。

「国内債券アクティブ・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28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		36,456,214	11,735,756
国債証券		461,196,640	592,235,340
社債券		287,432,150	108,847,220
派生商品評価勘定		138,920	-
未収入金		2,606,040	78,920
未収利息		1,219,259	1,200,921
前払金		20,540	-
前払費用		307,199	139,555
差入委託証拠金		839,460	719,460
流動資産合計		790,216,422	714,957,172
資産合計		790,216,422	714,957,172
負債の部			
流動負債			
前受金		-	9,460
その他未払費用		5	-
流動負債合計		5	9,460
負債合計		5	9,460
純資産の部			
元本等			
元本	1	562,765,529	513,091,682
剰余金			
剰余金又は欠損金()		227,450,888	201,856,030
元本等合計		790,216,417	714,947,712
純資産合計		790,216,417	714,947,712
負債純資産合計		790,216,422	714,957,172

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>国債証券及び社債券</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>
--------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年5月9日現在	平成28年11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	621,190,694円	562,765,529円
同期中追加設定元本額	- 円	- 円
同期中一部解約元本額	58,425,165円	49,673,847円
元本の内訳		
ファンド名		
世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	110,764,900円	97,951,283円
D I A M世界6資産バランスファンド	312,887,987円	276,027,757円
D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	139,112,642円	139,112,642円
計	562,765,529円	513,091,682円
2. 受益権の総数	562,765,529口	513,091,682口

（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	自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	自 平成28年5月10日 至 平成28年11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、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、債券先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び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、市場金利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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年5月9日現在	平成28年11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>	<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。	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）

売買目的有価証券

種類	平成28年5月9日現在	平成28年11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	37,156,900	8,152,800
社債券	2,431,390	545,670
合計	39,588,290	8,698,470

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年5月9日から平成28年5月9日まで及び平成28年5月10日から平成28年11月8日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

債券関連

種類	平成28年5月9日 現在				平成28年11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								
売 建	303,800,000	-	303,660,000	140,000	-	-	-	-
合計	303,800,000	-	303,660,000	140,000	-	-	-	-

（注）1．時価の算定方法

債券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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.4042円	1.3934円
（1万口当たり純資産額）	（14,042円）	（13,934円）

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11月8日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	116回 利付国庫債券(5年)	94,000,000	94,937,180	
	120回 利付国庫債券(5年)	100,000,000	101,296,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	3,000,000	4,338,780	
	7回 利付国庫債券(40年)	3,000,000	4,159,350	
	327回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	95,507,100	
	329回 利付国庫債券(10年)	5,000,000	5,331,250	
	334回 利付国庫債券(10年)	16,000,000	16,936,480	
	340回 利付国庫債券(10年)	17,000,000	17,783,700	
	341回 利付国庫債券(10年)	12,000,000	12,447,000	
	342回 利付国庫債券(10年)	8,000,000	8,147,200	
	343回 利付国庫債券(10年)	17,000,000	17,304,640	
	344回 利付国庫債券(10年)	11,000,000	11,185,570	
	33回 利付国庫債券(30年)	33,000,000	44,744,040	
	35回 利付国庫債券(30年)	1,000,000	1,366,420	
	37回 利付国庫債券(30年)	2,000,000	2,706,240	
	39回 利付国庫債券(30年)	3,000,000	4,082,160	
	40回 利付国庫債券(30年)	2,000,000	2,675,860	
	41回 利付国庫債券(30年)	4,000,000	5,258,920	
	42回 利付国庫債券(30年)	2,000,000	2,631,360	
	145回 利付国庫債券(20年)	19,000,000	23,676,280	
	146回 利付国庫債券(20年)	4,000,000	4,990,800	
	147回 利付国庫債券(20年)	9,000,000	11,084,400	
	148回 利付国庫債券(20年)	8,000,000	9,728,160	
	149回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,159,400	
	151回 利付国庫債券(20年)	38,000,000	44,216,040	
	152回 利付国庫債券(20年)	3,000,000	3,487,950	
153回 利付国庫債券(20年)	18,000,000	21,247,200		
154回 利付国庫債券(20年)	1,000,000	1,161,680		
155回 利付国庫債券(20年)	5,000,000	5,622,400		
156回 利付国庫債券(20年)	2,000,000	2,021,780		
国債証券 合計		540,000,000	592,235,340	
社債券	76回 伊藤忠商事社債	8,000,000	8,114,320	
	178回 オリックス社債	10,000,000	10,092,500	
	98回 近鉄グループホールディングス社債	10,000,000	9,972,300	
	374回 中国電力社債	10,000,000	10,236,400	
	301回 北陸電力社債	30,000,000	31,858,800	
	471回 東北電力社債	10,000,000	10,650,300	
	473回 東北電力社債	17,000,000	17,326,400	
	277回 四国電力社債	10,000,000	10,596,200	

社債券 合計	105,000,000	108,847,220	
合計	645,000,000	701,082,560	

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。

「J-REITオープン・アクティブ・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28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		34,364,393	67,734,982
投資証券		1,010,177,400	753,674,478
未収入金		4,338,107	10,042,806
未収配当金		7,392,321	6,942,352
流動資産合計		1,056,272,221	838,394,618
資産合計		1,056,272,221	838,394,618
負債の部			
流動負債			
未払金		2,239,395	3,363,210
その他未払費用		16	-
流動負債合計		2,239,411	3,363,210
負債合計		2,239,411	3,363,210
純資産の部			
元本等			
元本	1	511,792,911	436,794,704
剰余金			
剰余金又は欠損金()		542,239,899	398,236,704
元本等合計		1,054,032,810	835,031,408
純資産合計		1,054,032,810	835,031,408
負債純資産合計		1,056,272,221	838,394,618

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28年5月9日現在	平成28年11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	636,200,387円	511,792,911円
同期中追加設定元本額	- 円	- 円
同期中一部解約元本額	124,407,476円	74,998,207円
元本の内訳		
ファンド名		
世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	80,414,913円	65,334,323円
D I A M世界6資産バランスファンド	221,818,372円	191,724,623円
D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	209,559,626円	179,735,758円
計	511,792,911円	436,794,704円
2 . 受益権の総数	511,792,911口	436,794,704口

（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	自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	自 平成28年5月10日 至 平成28年11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、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、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。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年5月9日現在	平成28年11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	平成28年5月9日現在	平成28年11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）
投資証券	73,739,584	49,235,107
合計	73,739,584	49,235,107

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年5月9日から平成28年5月9日まで及び平成28年5月10日から平成28年11月8日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
1口当たり純資産額	2.0595円	1.9117円
(1万口当たり純資産額)	(20,595円)	(19,117円)

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11月8日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	191	24,791,800	
	MCUBS MidCity投資法人	20	6,580,000	
	いちごオフィスリート投資法人	49	3,498,600	
	いちごホテルリート投資法人	14	1,801,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	18	9,144,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	100	29,000,000	
	イオンリート投資法人	176	22,246,400	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	54	4,482,000	
	インヴィンシブル投資法人	244	12,590,400	
	オリックス不動産投資法人	132	22,915,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	26	10,283,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	30	18,060,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	37	10,963,100	
	ケネディクス商業リート投資法人	43	10,453,300	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	42	10,218,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	131	9,641,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	102	14,616,600	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	63	37,422,000	
	スターツプロシード投資法人	24	3,748,800	
	トーセイ・リート投資法人	14	1,423,800	
	ヒューリックリート投資法人	94	16,948,200	
	フロンティア不動産投資法人	34	16,575,000	
	プレミア投資法人	86	11,463,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	15	1,635,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	131	22,532,000	
	ラサールロジポート投資法人	172	18,816,800	
	阪急リート投資法人	129	19,001,700	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	18	5,958,000	
	産業ファンド投資法人	30	16,170,000	
	森トラスト総合リート投資法人	91	15,197,000	
	森ヒルズリート投資法人	120	17,592,000	
	星野リゾート・リート投資法人	10	5,820,000	
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	134	15,959,400	
	積水ハウス・リート投資法人	75	10,537,500	
大和ハウスリート投資法人	75	21,559,840		
大和証券オフィス投資法人	44	25,916,000		
東急リアル・エステート投資法人	39	5,389,800		
日本アコモデーションファンド投資法人	43	19,995,000		
日本ビルファンド投資法人	68	41,548,000		

日本プライムリアルティ投資法人	43	19,264,000	
日本プロロジスリート投資法人	88	20,961,600	
日本ヘルスケア投資法人	11	1,943,700	
日本リート投資法人	52	13,691,600	
日本リテールファンド投資法人	148	34,025,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	28	6,344,800	
日本賃貸住宅投資法人	113	8,780,100	
福岡リート投資法人	84	14,868,000	
平和不動産リート投資法人	135	10,597,500	
野村不動産マスターファンド投資法人	303	50,701,938	
投資証券 合計	3,923	753,674,478	
合計	3,923	753,674,478	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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。

「DIAM US・リート・オープン・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5月9日現在	平成28年11月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,755,972,638	2,014,214,433
コール・ローン		962,405,058	957,315,850
投資証券		39,069,454,131	34,144,242,749
未収入金		-	205,268,488
未収配当金		26,562,715	19,726,126
流動資産合計		41,814,394,542	37,340,767,646
資産合計		41,814,394,542	37,340,767,646
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	2,580,000
未払金		809,120,087	1,159,473,461
未払解約金		-	310,000,000
その他未払費用		869	-
流動負債合計		809,120,956	1,472,053,461
負債合計		809,120,956	1,472,053,461
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,538,321,967	13,447,495,831
剰余金			
剰余金又は欠損金()		26,466,951,619	22,421,218,354
元本等合計		41,005,273,586	35,868,714,185
純資産合計		41,005,273,586	35,868,714,185
負債純資産合計		41,814,394,542	37,340,767,646

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 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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。
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。
4 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成28年5月9日現在	平成28年11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	15,944,004,642円	14,538,321,967円
	同期中追加設定元本額	8,422,876円	5,802,922円
	同期中一部解約元本額	1,414,105,551円	1,096,629,058円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	12,657,339円	10,858,648円
	DIAM世界6資産バランスファンド	55,503,662円	51,934,909円
	DIAMグローバル・アクティブ・バランスファンド	67,555,383円	67,555,383円
	DIAM ワールド・リート・インカム・オープン（毎月決算コース）	13,396,191,994円	12,399,731,445円
	DIAM世界インカム・オープン（毎月決算コース）	228,199,146円	200,545,459円
	DIAM ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	500,914,181円	461,865,876円
	DIAM世界3資産オープン（毎月決算型）	159,343,957円	141,707,798円
	DIAMインカム3資産ファンド（毎月決算型）	27,383,125円	24,937,003円
	DIAM ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	89,237,534円	86,760,284円
	DIAM米国リート・オープン（毎月決算型）	1,335,646円	1,599,026円
	計	14,538,321,967円	13,447,495,831円
2 .	受益権の総数	14,538,321,967口	13,447,495,831口

（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	自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	自 平成28年5月10日 至 平成28年11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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年5月9日現在	平成28年11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 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>	<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>
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。	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）

売買目的有価証券

種類	平成28年5月9日現在	平成28年11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）
投資証券	3,420,478,271	540,250,029
合計	3,420,478,271	540,250,029

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年12月10日から平成28年5月9日まで及び平成27年12月10日から平成28年11月8日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年5月9日 現在				平成28年11月8日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	624,480,000	-	627,060,000	2,580,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	624,480,000	-	627,060,000	2,580,000
合計	-	-	-	-	624,480,000	-	627,060,000	2,580,000

（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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
1口当たり純資産額	2.8205円	2.6673円
(1万口当たり純資産額)	(28,205円)	(26,673円)

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11月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	236,870.000	7,748,017.700	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,384.000	5,554,275.520	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	198,244.000	9,694,131.600	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	362,930.000	7,813,882.900	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	130,870.000	5,784,454.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	62,080.000	10,598,297.600	
		BOSTON PROPERTIES INC	42,400.000	5,003,624.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	85,800.000	6,980,688.000	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	1,544,230.000	16,600,472.500	
		CBL & ASSOCIATES PROP PFD 7.375	36,530.000	918,364.200	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES PFD 6.625	12,770.000	322,570.200	
		CEDAR REALTY TRUST INC	770,420.000	4,845,941.800	
		COUSINS PROPERTIES INC	691,860.000	5,147,438.400	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	81,170.000	7,227,376.800	
		CUBESMART	210,150.000	5,428,174.500	
		CYRUSONE INC	111,778.000	4,816,514.020	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	147,977.000	6,766,988.210	
		DDR CORP	313,190.000	4,704,113.800	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	176,380.000	7,139,862.400	
		EAST GROUP	55,460.000	3,690,863.000	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	120,083.000	5,012,264.420	
		EQUITY RESIDENTIAL	195,575.000	12,049,375.750	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	50,781.000	11,173,343.430	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	64,760.000	4,798,068.400	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,360.000	5,296,153.600	
		FIRST INDUSTRIAL RT	315,450.000	8,204,854.500	
		FOREST CITY REALTY TRUST INC	309,710.000	5,878,295.800	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	208,060.000	5,238,950.800	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	168,060.000	8,117,298.000			
HOST HOTELS & RESORTS INC	252,670.000	3,969,445.700			
KITE REALTY GROUP TRUST	439,462.000	10,683,321.220			
LIFE STORAGE INC	75,250.000	6,161,470.000			
POST PROPERTIES, INC	194,100.000	12,919,296.000			

	PROLOGIS INC	210,950.000	10,720,479.000	
	PUBLIC STORAGE	59,060.000	12,504,773.800	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	596,110.000	10,062,336.800	
	REGENCY CENTERS CORP	49,000.000	3,431,470.000	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	373,650.000	7,293,648.000	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	45,530.000	957,040.600	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	107,830.000	19,617,511.900	
	SL GREEN	51,000.000	5,030,130.000	
	TERRENO REALTY CORP	475,623.000	12,171,192.570	
	VORNADO REALTY TRUST	61,426.000	5,487,184.580	
	WELLTOWER INC	145,780.000	9,656,467.200	
	WEYERHAEUSER CO	118,000.000	3,456,220.000	
	アメリカ・ドル 小計	10,048,773.000	326,676,643.220 (34,144,242,749)	
投資証券 合計		10,048,773	34,144,242,749 (34,144,242,749)	
合計			34,144,242,749 (34,144,242,749)	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (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 投資証券 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	投資証券 45銘柄	95.19%	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

「(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。

「DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・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5月9日現在	平成28年11月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,402,432,158	1,377,138,370
コール・ローン		922,621,286	905,591,727
投資信託受益証券		26,540,417,652	25,548,511,845
投資証券		32,960,094,974	26,652,409,564
派生商品評価勘定		361,807	-
未収入金		1,474,761,723	5,504,909
未収配当金		264,940,199	257,559,254
流動資産合計		64,565,629,799	54,746,715,669
資産合計		64,565,629,799	54,746,715,669
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	4,448,000
未払金		1,594,783,675	-
未払解約金		-	720,000,000
その他未払費用		1,027	-
流動負債合計		1,594,784,702	724,448,000
負債合計		1,594,784,702	724,448,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	28,792,636,976	26,931,718,072
剰余金			
剰余金又は欠損金()		34,178,208,121	27,090,549,597
元本等合計		62,970,845,097	54,022,267,669
純資産合計		62,970,845,097	54,022,267,669
負債純資産合計		64,565,629,799	54,746,715,669

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28年5月9日現在	平成28年11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	30,462,537,929円	28,792,636,976円
	同期中追加設定元本額	7,276,410円	19,375,495円
	同期中一部解約元本額	1,677,177,363円	1,880,294,399円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	23,601,096円	23,601,096円
	D I A M世界6資産バランスファンド	107,199,700円	98,090,157円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	142,429,060円	137,718,966円
	D I A M ワールド・リート・インカム・オープン（毎月決算コース）	26,636,257,355円	24,853,416,558円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	427,325,462円	406,784,189円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド（毎月決算型）	946,525,147円	911,029,507円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	294,696,390円	278,356,520円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	50,823,245円	48,998,177円
	D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金>	163,779,521円	173,722,902円
	計	28,792,636,976円	26,931,718,072円
2 .	受益権の総数	28,792,636,976口	26,931,718,072口

（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	自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	自 平成28年5月10日 至 平成28年11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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年5月9日現在	平成28年11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 「(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。	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）

売買目的有価証券

種類	平成28年5月9日現在	平成28年11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）
投資信託受益証券	2,322,941,788	406,802,482
投資証券	1,155,439,903	1,167,876,225
合計	3,478,381,691	761,073,743

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年12月10日から平成28年5月9日まで及び平成27年12月10日から平成28年11月8日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年5月9日 現在				平成28年11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）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	764,047,237	-	763,950,693	96,544	809,864,000	-	814,312,000	4,448,000
オーストラ リア・ドル	764,047,237	-	763,950,693	96,544	255,536,000	-	257,920,000	2,384,000
カナダ・ド ル	-	-	-	-	404,248,000	-	406,172,000	1,924,000
シンガポー ル・ドル	-	-	-	-	150,080,000	-	150,220,000	140,000
買 建	764,047,237	-	764,312,500	265,263	-	-	-	-
ユーロ	764,047,237	-	764,312,500	265,263	-	-	-	-
合計	1,528,094,474	-	1,528,263,193	361,807	809,864,000	-	814,312,000	4,448,000

（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取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取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はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
1口当たり純資産額	2.1870円	2.0059円
(1万口当たり純資産額)	(21,870円)	(20,059円)

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11月8日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ALE PROPERTY GROUP	2,579,620.000	10,963,385.000		
		CHARTER HALL GROUP	5,708,113.000	26,713,968.840		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	5,268,993.000	22,287,840.390		
		GOODMAN GROUP	679,426.000	4,640,479.580		
		MIRVAC GROUP	9,478,152.000	19,619,774.640		
		NATIONAL STORAGE REIT	26,930,611.000	38,780,079.840		
		SCENTRE GROUP	5,147,091.000	22,286,904.030		
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	6,514,520.000	14,201,653.600		
		VICINITY CENTRES	12,100,968.000	34,608,768.480		
	オーストラリア・ドル	小計		74,407,494.000	194,102,854.400 (15,646,631,093)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	6,204,791.000	14,333,067.210		
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	14,377,600.000	16,462,352.000		
		CACHE LOGISTICS TRUST	5,662,000.000	4,699,460.000		
		CAPITALAND MALL TRUST	14,673,800.000	29,127,493.000		
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	8,667,000.000	17,594,010.000		
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,526,500.000	2,259,220.000		
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	12,519,840.000	20,970,732.000		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	19,701,320.000	19,996,839.800		
	PARKWAY LIFE REIT	2,548,400.000	6,371,000.000			
シンガポール・ドル	小計		85,881,251.000	131,814,174.010 (9,901,880,752)		
投資信託受益証券	合計		160,288,745	25,548,511,845 (25,548,511,845)		
投資証券	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,778,892.000	10,646,668.620		
		HAMMERSON PLC	2,920,106.000	16,118,985.120		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	2,067,921.000	20,575,813.950		
		SEGRO PLC	1,550,272.000	6,624,312.250		
	イギリス・ポンド	小計		8,317,191.000	53,965,779.940 (6,992,885,765)	
	カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	280,522.000	9,762,165.600		
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,047,168.000	12,220,450.560		
CROMBIE REAL ESTATE INV		51,061.000	685,749.230			

	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	847,500.000	12,754,875.000	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	268,754.000	8,610,878.160	
カナダ・ドル 小計		2,495,005.000	44,034,118.550 (3,439,945,341)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	26,401,917.000	33,266,415.420	
ニュージーランド・ドル 小計		26,401,917.000	33,266,415.420 (2,549,205,414)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	827,220.000	9,649,521.300	
	BEFIMMO	85,074.000	4,405,131.720	
	COFINIMMO SA	66,685.000	7,005,259.250	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	506,927.000	17,851,434.300	
	GECINA SA	45,322.000	5,882,795.600	
	ICADE	96,588.000	6,283,049.400	
	KLEPIERRE	130,772.000	4,770,562.560	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	108,558.000	23,236,839.900	
	VASTNED RETAIL	348,484.000	12,106,334.160	
	WAREHOUSES DE PAUW	330,312.000	27,290,377.440	
ユーロ 小計		2,545,942.000	118,481,305.630 (13,670,373,044)	
投資証券 合計		39,760,055	26,652,409,564 (26,652,409,564)	
合計			52,200,921,409 (52,200,921,409)	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (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 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
イギリス・ポンド	投資証券 4銘柄	-%	12.94%	13.40%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 9銘柄	28.96%	-%	29.97%
カナダ・ドル	投資証券 5銘柄	-%	6.37%	6.59%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 9銘柄	18.33%	-%	18.97%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	4.72%	4.88%
ユーロ	投資証券 10銘柄	-%	25.31%	26.19%

(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
「（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。

「D I A M世界好配当株オープン・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5月9日現在	平成28年11月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		534,798,501	18,435,416
コール・ローン		302,128,795	747,132,546
株式		35,028,641,986	30,152,315,676
未収入金		-	547,347,808
未収配当金		124,855,746	34,910,694
流動資産合計		35,990,425,028	31,500,142,140
資産合計		35,990,425,028	31,500,142,140
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	280,000
未払金		182,796,709	379,460,432
その他未払費用		449	-
流動負債合計		182,797,158	379,740,432
負債合計		182,797,158	379,740,432
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,931,520,890	14,908,702,733
剰余金			
剰余金又は欠損金()		18,876,106,980	16,211,698,975
元本等合計		35,807,627,870	31,120,401,708
純資産合計		35,807,627,870	31,120,401,708
負債純資産合計		35,990,425,028	31,500,142,140

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	為替予約取引 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。
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。
4 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成28年5月9日現在	平成28年11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	17,073,939,730円	16,931,520,890円
	同期中追加設定元本額	634,351,650円	45,562,239円
	同期中一部解約元本額	776,770,490円	2,068,380,396円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M世界好配当株オープン（毎月決算コース）	8,185,653,593円	7,638,846,854円
	D I A M世界好配当株式ファンド（毎月決算型）	5,941,399,609円	5,583,306,417円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	41,958,454円	39,658,651円
	D I A M世界6資産バランスファンド	180,823,562円	180,823,562円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	247,468,590円	242,713,930円
	D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）	711,291,300円	668,880,457円
	D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）	502,065,352円	471,595,448円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	87,549,720円	82,877,414円
	D I A M世界好配当株私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,033,310,710円	- 円
	計	16,931,520,890円	14,908,702,733円
2 .	受益権の総数	16,931,520,890口	14,908,702,733口

（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	自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	自 平成28年5月10日 至 平成28年11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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年5月9日現在	平成28年11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 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>	<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>
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。	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）

売買目的有価証券

種類	平成28年5月9日現在	平成28年11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）
株式	156,067,996	466,337,538
合計	156,067,996	466,337,538

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年5月27日から平成28年5月9日まで及び平成28年5月27日から平成28年11月8日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年5月9日 現在				平成28年11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）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	77,830,000	-	78,110,000	280,000
カナダ・ドル	-	-	-	-	77,830,000	-	78,110,000	280,000
合計	-	-	-	-	77,830,000	-	78,110,000	280,000

（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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
1口当たり純資産額	2.1149円	2.0874円
(1万口当たり純資産額)	(21,149円)	(20,874円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年11月8日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	FNB CORP	115,776	13.190	1,527,085.440	
	VALERO ENERGY CORP	28,868	58.520	1,689,355.360	
	ONEOK INC	31,155	48.080	1,497,932.400	
	CISCO SYSTEMS INC	203,141	30.940	6,285,182.540	
	CUMMINS INC	12,457	130.340	1,623,645.380	
	CYPRESS SEMICONDUCTOR CORP	205,597	10.130	2,082,697.610	
	DUKE ENERGY CORP	19,645	79.130	1,554,508.850	
	EATON CORP PLC	23,950	62.430	1,495,198.500	
	EXXON MOBIL CORP	53,934	85.450	4,608,660.300	
	GREIF INC-CL A	32,276	47.800	1,542,792.800	
	REYNOLDS AMERICAN INC	66,078	55.040	3,636,933.120	
	CENTERPOINT ENERGY INC	71,416	23.620	1,686,845.920	
	INTEL CORP	163,821	34.690	5,682,950.490	
	INTERNATIONAL PAPER CO	39,157	44.470	1,741,311.790	
	JOHNSON & JOHNSON	15,603	116.660	1,820,245.980	
	KLA-TENCOR CORP	20,203	75.540	1,526,134.620	
	KOHL'S CORP	49,948	43.840	2,189,720.320	
	MDU RESOURCES GROUP INC	62,511	26.400	1,650,290.400	
	MCDONALD'S CORPORATION	15,383	112.820	1,735,510.060	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	39,973	39.790	1,590,525.670	
	MERCK & CO. INC.	108,090	60.050	6,490,804.500	
	MICROSOFT CORP	99,242	60.420	5,996,201.640	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	28,999	62.230	1,804,607.770	
	PACWEST BANCORP	36,400	43.350	1,577,940.000	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	21,833	67.250	1,468,269.250	
	OLD REPUBLIC INTL CORP	81,771	16.910	1,382,747.610	
	PFIZER INC	137,954	30.380	4,191,042.520	
	ALTRIA GROUP INC	90,528	65.270	5,908,762.560	
	PROCTER & GAMBLE CO	69,596	86.560	6,024,229.760	
	QUALCOMM INC	73,255	68.460	5,015,037.300	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	30,576	54.320	1,660,888.320	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,209	88.820	2,594,343.380	
	AT&T INC	141,220	36.810	5,198,308.200	
CHEVRON CORP	75,132	106.850	8,027,854.200		
UNITED BANKSHARES INC	41,653	38.400	1,599,475.200		
WESTERN DIGITAL CORP	42,732	57.670	2,464,354.440		
ALLETE INC	25,161	60.130	1,512,930.930		
LAS VEGAS SANDS CORP	52,488	58.890	3,091,018.320		

	B&G FOODS INC	33,418	41.800	1,396,872.400	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	66,187	81.840	5,416,744.080	
	COGENT COMMUNICATIONS GROUP	37,472	40.300	1,510,121.600	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	60,306	23.290	1,404,526.740	
	INNOFOS HOLDINGS INC	31,253	48.490	1,515,457.970	
	SPECTRA ENERGY CORP	51,763	41.500	2,148,164.500	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	64,221	97.330	6,250,629.930	
	SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP	29,668	56.710	1,682,472.280	
	SEMGROUP CORP	43,959	32.000	1,406,688.000	
	ABBVIE INC	54,321	58.910	3,200,050.110	
	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC	52,706	28.480	1,501,066.880	
	KRAFT HEINZ CO	17,940	86.030	1,543,378.200	
アメリカ・ドル 小計		2,999,945		142,152,516.140 (14,857,780,987)	
イギリス・ポンド	BBA AVIATION PLC	461,863	2.471	1,141,263.470	
	NATIONAL GRID PLC	156,185	10.085	1,575,125.720	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	76,932	45.450	3,496,559.400	
	IMPERIAL BRANDS PLC	76,072	38.030	2,893,018.160	
	RIO TINTO PLC	70,220	28.250	1,983,715.000	
	VODAFONE GROUP PLC	1,136,567	2.159	2,453,848.150	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	213,476	15.490	3,306,743.240	
	ASTRAZENECA PLC	41,313	44.305	1,830,372.460	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	75,062	21.355	1,602,949.010	
	ROYAL MAIL PLC	238,378	4.917	1,172,104.620	
イギリス・ポンド 小計		2,546,068		21,455,699.230 (2,780,229,506)	
オーストラリア・ドル	AMCOR LTD	133,775	14.560	1,947,764.000	
	ASX LTD	40,421	46.590	1,883,214.390	
	COMPUTERSHARE LT	186,704	10.500	1,960,392.000	
	COCA-COLA AMATIL LTD	235,200	9.460	2,224,992.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	384,652	4.740	1,823,250.480	
	WOOLWORTHS LTD	132,365	23.060	3,052,336.900	
	AUSNET SERVICES	1,469,921	1.505	2,212,231.100	
オーストラリア・ドル 小計		2,583,038		15,104,180.870 (1,217,548,019)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	23,464	84.940	1,993,032.160	
	BANK OF NOVA SCOTIA	60,814	71.770	4,364,620.780	
	NATIONAL BANK OF CANADA	44,107	47.210	2,082,291.470	
	BCE INC	33,318	59.700	1,989,084.600	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	20,114	99.780	2,006,974.920	

	ENERCARE INC	107,454	19.260	2,069,564.040	
	AGRIUM INC	16,525	123.790	2,045,629.750	
	EMERA INC	40,667	46.410	1,887,355.470	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	94,587	21.930	2,074,292.910	
	ROYAL BANK OF CANADA	83,401	83.080	6,928,955.080	
	TRANSCANADA CORP	35,042	58.390	2,046,102.380	
	GIBSON ENERGY INC	122,317	16.060	1,964,411.020	
	PEMBINA PIPELINE CORP	54,035	39.700	2,145,189.500	
	NORTHLAND POWER INC	296,219	23.370	6,922,638.030	
カナダ・ドル 小計		1,032,064		40,520,142.110 (3,165,433,502)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE POST LTD	1,361,700	1.535	2,090,209.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	179,000	18.490	3,309,710.000	
シンガポール・ドル 小計		1,540,700		5,399,919.500 (405,641,952)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REGISTERED	45,918	71.150	3,267,065.700	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	14,508	224.600	3,258,496.800	
	NOVARTIS AG-REG SHS	45,633	69.300	3,162,366.900	
スイス・フラン 小計		106,059		9,687,929.400 (1,039,321,066)	
スウェーデン・クローナ	SKANSKA AB-B SHS	72,172	194.500	14,037,454.000	
	SWEDBANK AB	89,542	208.900	18,705,323.800	
スウェーデン・クローナ 小計		161,714		32,742,777.800 (379,161,368)	
デンマーク・クローネ	DANSKE BANK A/S	56,126	202.700	11,376,740.200	
デンマーク・クローネ 小計		56,126		11,376,740.200 (176,453,241)	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	195,043	9.870	1,925,074.410	
ニュージーランド・ドル 小計		195,043		1,925,074.410 (147,518,452)	
ノルウェー・クローネ	TELENOR ASA	90,027	128.200	11,541,461.400	
	STATOIL ASA	100,427	134.600	13,517,474.200	
ノルウェー・クローネ 小計		190,454		25,058,935.600 (317,747,304)	
ユーロ	AXA	108,131	20.145	2,178,298.990	
	NATIXIS	525,459	4.504	2,366,667.330	
	KESKO OYJ-B	29,869	44.390	1,325,884.910	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	33,923	60.700	2,059,126.100	
	VIVENDI SA	75,680	18.140	1,372,835.200	
	TOTAL SA	100,507	42.885	4,310,242.690	
	KONECRANES OYJ	43,671	31.090	1,357,731.390	
	SIEMENS AG-REG	29,535	102.950	3,040,628.250	
	UPM-KYMMENE OYJ	126,968	20.930	2,657,440.240	

	ING GROEP NV-CVA	179,663	12.285	2,207,159.950	
	BASF SE	34,598	78.380	2,711,791.240	
	RANDSTAD HOLDINGS	34,580	46.630	1,612,465.400	
	ALLIANZ SE	14,687	140.500	2,063,523.500	
	SANOFI	36,664	72.270	2,649,707.280	
	ENGIE	100,109	12.970	1,298,413.730	
	APERAM	38,389	40.270	1,545,925.030	
	EDENRED	74,912	20.340	1,523,710.080	
	BPOST SA	59,965	23.385	1,402,281.520	
	POSTE ITALIANE SPA	204,201	5.970	1,219,079.970	
	UNIPER SE	113,210	12.850	1,454,748.500	
ユーロ 小計		1,964,721		40,357,661.300 (4,656,466,961)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	165,000	74.250	12,251,250.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,475,500	27.000	39,838,500.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	1,241,000	8.870	11,007,670.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,860,000	6.320	11,755,200.000	
香港・ドル 小計		4,741,500		74,852,620.000 (1,009,013,318)	
合計		18,117,432		30,152,315,676 (30,152,315,676)	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

(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	組入株式 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	株式 50銘柄	47.74%	49.28%
イギリス・ポンド	株式 10銘柄	8.93%	9.22%
オーストラリア・ドル	株式 7銘柄	3.91%	4.04%
カナダ・ドル	株式 14銘柄	10.17%	10.50%
シンガポール・ドル	株式 2銘柄	1.30%	1.35%
スイス・フラン	株式 3銘柄	3.34%	3.45%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	1.22%	1.26%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	0.57%	0.59%
ニュージーランド・ドル	株式 1銘柄	0.47%	0.49%
ノルウェー・クローネ	株式 2銘柄	1.02%	1.05%
ユーロ	株式 20銘柄	14.96%	15.44%
香港・ドル	株式 4銘柄	3.24%	3.35%

(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

「(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。

「高金利ソブリン・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5月9日現在	平成28年11月8日現在
資産の部			
流動資産			
預金		9,715,876	6,967,518
コール・ローン		117,136,164	67,408,388
国債証券		12,235,402,708	6,237,926,859
未収利息		27,654,645	58,918,162
前払費用		81,688,580	3,938,127
流動資産合計		12,471,597,973	6,375,159,054
資産合計		12,471,597,973	6,375,159,054
負債の部			
流動負債			
未払解約金		3,000,000	-
その他未払費用		198	-
流動負債合計		3,000,198	-
負債合計		3,000,198	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	9,998,593,117	5,309,943,363
剰余金			
剰余金又は欠損金()		2,470,004,658	1,065,215,691
元本等合計		12,468,597,775	6,375,159,054
純資産合計		12,468,597,775	6,375,159,054
負債純資産合計		12,471,597,973	6,375,159,054

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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成28年5月9日現在	平成28年11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	11,123,749,313円	9,998,593,117円
	同期中追加設定元本額	- 円	20,224,152円
	同期中一部解約元本額	1,125,156,196円	4,708,873,906円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M高金利ソブリン債券ファンド（毎月決算型）	901,392,561円	795,173,933円
	世界6資産アクティブ・バランス・ファンド	257,978,779円	249,597,954円
	D I A Mバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	217,853,812円	205,310,069円
	D I A M世界6資産バランスファンド	318,218,018円	318,218,018円
	D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド	1,056,019,702円	1,031,374,298円
	D I A Mインカム3資産ファンド（毎月決算型）	149,461,035円	142,732,125円
	D I A M高金利ソブリン私募ファンド（適格機関投資家向け）	7,097,669,210円	2,567,536,966円
	計	9,998,593,117円	5,309,943,363円
2 .	受益権の総数	9,998,593,117口	5,309,943,363口

（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	自 平成27年11月10日 至 平成28年5月9日	自 平成28年5月10日 至 平成28年11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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年5月9日現在	平成28年11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	平成28年5月9日現在	平成28年11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	61,654,141	39,530,795
合計	61,654,141	39,530,795

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年5月9日から平成28年5月9日まで及び平成28年5月10日から平成28年11月8日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年5月9日現在	平成28年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.2470円	1.2006円
(1万口当たり純資産額)	(12,470円)	(12,006円)

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11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	US T N/B 1.125 02/28/21	7,650,000.000	7,615,881.000	
	アメリカ・ドル 小計		7,650,000.000 (799,578,000)	7,615,881.000 (796,011,882)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.5 01/22/21	4,300,000.000	4,476,902.000	
	イギリス・ポンド 小計		4,300,000.000 (557,194,000)	4,476,902.000 (580,116,961)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	6,090,000.000	6,079,586.100	
	オーストラリア・ドル 小計		6,090,000.000 (490,914,900)	6,079,586.100 (490,075,436)	
	カナダ・ドル	CANADA 0.75 03/01/21	7,530,000.000	7,554,472.500	
	カナダ・ドル 小計		7,530,000.000 (588,243,600)	7,554,472.500 (590,155,392)	
	シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.25 06/01/21	7,800,000.000	8,129,862.000	
	シンガポール・ドル 小計		7,800,000.000 (585,936,000)	8,129,862.000 (610,715,233)	
	タイ・パーツ	THAILAND 3.65 12/17/21	196,000,000.000	213,353,840.000	
	タイ・パーツ 小計		196,000,000.000 (586,040,000)	213,353,840.000 (637,927,982)	
	ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 3.0 04/15/20	3,480,000.000	3,569,157.600	
		NEW ZEALAND 6.0 05/15/21	3,500,000.000	4,050,095.000	
	ニュージーランド・ドル 小計		6,980,000.000 (534,877,400)	7,619,252.600 (583,863,327)	
	ポーランド・ズロチ	POLAND 2.0 04/25/21	23,100,000.000	22,751,883.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		23,100,000.000 (616,077,000)	22,751,883.000 (606,792,720)	
	マレーシア・リングgit	MALAYSIA 4.16 07/15/21	29,000,000.000	29,957,000.000	
	マレーシア・リングgit 小計		29,000,000.000 (719,780,000)	29,957,000.000 (743,532,740)	
	メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	104,000,000.000	106,347,280.000	
メキシコ・ペソ 小計		104,000,000.000 (585,520,000)	106,347,280.000 (598,735,186)		
国債証券 合計			6,064,160,900 (6,064,160,900)	6,237,926,859 (6,237,926,859)	
合計			6,064,160,900 (6,064,160,900)	6,237,926,859 (6,237,926,859)	

(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 1銘柄	12.49%	12.76%
イギリス・ポンド	国債証券 1銘柄	9.10%	9.30%
オーストラリア・ドル	国債証券 1銘柄	7.69%	7.86%
カナダ・ドル	国債証券 1銘柄	9.26%	9.46%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	9.58%	9.79%
タイ・バーツ	国債証券 1銘柄	10.01%	10.23%
ニュージーランド・ドル	国債証券 2銘柄	9.16%	9.36%
ポーランド・ズロチ	国債証券 1銘柄	9.52%	9.73%
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	11.66%	11.92%
メキシコ・ペソ	国債証券 1銘柄	9.39%	9.60%

(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11月30日現在

資産総額	890,439,930円
負債総額	810,302円
純資産総額（ - ）	889,629,628円
発行済数量	1,059,141,230口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8400円

（参考）

ジャパン・セレクション・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産総額	8,678,126,442円
負債総額	119,753,377円
純資産総額（ - ）	8,558,373,065円
発行済数量	3,930,840,746口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1772円

国内債券アクティブ・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産総額	810,085,294円
負債総額	100,002,000円
純資産総額（ - ）	710,083,294円
発行済数量	513,091,682口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3839円

J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産総額	876,118,827円
負債総額	25,540,062円
純資産総額（ - ）	850,578,765円
発行済数量	436,794,704口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9473円

DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産総額	38,606,427,407円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	38,606,427,407円
発行済数量	13,332,927,024口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8956円

D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産総額	56,064,917,010円
負債総額	0円
純資産総額(-)	56,064,917,010円
発行済数量	26,934,600,609口
1口当たり純資産額(/)	2.0815円

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産総額	33,699,404,317円
負債総額	0円
純資産総額(-)	33,699,404,317円
発行済数量	14,836,711,731口
1口当たり純資産額(/)	2.2714円

高金利ソブリン・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産総額	6,536,641,639円
負債総額	3,000,000円
純資産総額(-)	6,533,641,639円
発行済数量	5,301,741,338口
1口当たり純資産額(/)	1.2324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・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1) 資本金の額（平成28年11月30日現在）

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成28年11月30日現在）

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。

取締役は株主総会で選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役（監査等委員である取締役を除く。）の補欠として選任された取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、現任取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

2. 運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を

作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

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。

平成28年11月30日現在、委託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	38	1,006,120,079,038
追加型株式投資信託	861	11,455,085,737,414
単位型公社債投資信託	57	341,865,599,519
単位型株式投資信託	102	714,083,798,992
合計	1,058	13,517,155,214,963

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・訂正いたします。

<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)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。

また、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)、ならびに同規則第38条及び第57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. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、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、第31期事業年度(自平成27年4月1日至平成28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、第32期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

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、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更いたしました。

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,051,921	12,951,736
金銭の信託	14,169,657	13,094,914
前払費用	57,309	44,951
未収委託者報酬	4,622,292	4,460,404
未収運用受託報酬	1,737,052	1,859,778
未収投資助言報酬	2 312,206	2 277,603
未収収益	260,845	205,097
繰延税金資産	411,797	341,078
その他	46,782	40,689
流動資産計	33,669,865	33,276,255
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 138,967	1 29,219
車両運搬具	1 941	1 549
器具備品	1 243,908	1 184,683
建設仮勘定	49,116	444,155
無形固定資産		
商標権	1 101	1 7
ソフトウェア	1 1,702,633	1 1,645,861
ソフトウェア仮勘定	202,399	53,036
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 188	1 146
投資その他の資産		
投資有価証券	4,343,365	6,497,772
関係会社株式	613,137	458,701
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
繰延税金資産	582,861	679,092
差入保証金	733,907	2,040,945
その他	96,862	89,835
固定資産計	6,688,771	8,862,580
資産合計	40,358,637	42,138,836

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,605,579	966,681
未払金	2,515,377	2,055,332
未払償還金	49,873	49,873
未払手数料	1,836,651	1,744,274
その他未払金	628,852	261,185
未払費用	2 2,196,267	2 3,076,566
未払法人税等	1,539,263	1,223,957
未払消費税等	671,243	352,820
賞与引当金	722,343	728,769
その他	30,000	-
流動負債計	9,280,074	8,404,128
固定負債		
退職給付引当金	868,928	997,396
役員退職慰労引当金	110,465	154,535
固定負債計	979,394	1,151,932
負債合計	10,259,468	9,556,060
（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	25,417,784	28,000,340
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	19,480,000	22,030,000
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	5,314,491	5,347,047
株主資本計	29,846,262	32,428,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	252,905	153,956
評価・換算差額等計	252,905	153,956
純資産合計	30,099,168	32,582,775
負債・純資産合計	40,358,637	42,138,836

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	28,170,831		30,188,445	
運用受託報酬	7,064,021		7,595,678	
投資助言報酬	1,032,659		993,027	
その他営業収益	828,240		724,211	
営業収益計		37,095,752		39,501,363
営業費用				
支払手数料	12,416,659		12,946,176	
広告宣伝費	527,620		468,931	
公告費	288		258	
調査費	6,317,052		7,616,390	
調査費	4,129,778		4,969,812	
委託調査費	2,187,273		2,646,578	
委託計算費	385,121		412,257	
営業雑経費	488,963		548,183	
通信費	34,089		34,855	
印刷費	414,215		436,756	
協会費	24,177		23,698	
諸会費	37		40	
支払販売手数料	16,443		52,833	
営業費用計		20,135,705		21,992,198
一般管理費				
給料	5,260,910		5,382,757	
役員報酬	242,666		242,446	
給料・手当	4,378,307		4,431,015	
賞与	639,936		709,295	
交際費	37,625		43,975	
寄付金	2,697		2,628	
旅費交通費	242,164		254,276	
租税公課	127,947		180,892	
不動産賃借料	686,770		1,128,367	
退職給付費用	218,863		226,460	
固定資産減価償却費	628,056		902,248	
福利厚生費	33,310		36,173	
修繕費	13,807		31,617	
賞与引当金繰入額	722,343		728,769	
役員退職慰労引当金繰入額	50,327		49,320	
役員退職慰労金	25,501		5,250	
機器リース料	87		140	
事務委託費	231,303		251,913	
事務用消耗品費	67,208		70,839	
器具備品費	5,869		14,182	
諸経費	135,032		214,532	
一般管理費計		8,489,827		9,524,346
営業利益		8,470,220		7,984,819

(単位:千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
	営業外収益			
受取配当金		17,346		25,274
受取利息		2,404		2,079
時効成立分配金・償還金		974		-
為替差益		652		3,996
雑収入		1,822		6,693
営業外収益計		23,200		38,044
営業外費用				
金銭の信託運用損		163,033		305,368
時効成立後支払分配金・償還金		65		-
外国税支払損失		47,515		-
営業外費用計		210,614		305,368
経常利益		8,282,806		7,717,494
特別利益				
投資有価証券売却益		-		3,377
特別利益計		-		3,377
特別損失				
固定資産除却損	1	12,988	1	624
固定資産売却損	2	-	2	2,653
ゴルフ会員権売却損		1,080		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,307
関係会社株式評価損		202,477		-
特別損失計		216,547		9,584
税引前当期純利益		8,066,259		7,711,286
法人税、住民税及び事業税		2,969,684		2,557,305
法人税等調整額		29,428		27,424
法人税等合計		2,940,256		2,584,730
当期純利益		5,126,003		5,126,556

(3)【株主資本等変動計算書】

第30期(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変 更による累積 的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の 積立				2,350,000			2,350,000	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変 更による累積 的影響額		131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	243,159	27,291,419
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
会計方針の変更による累積的影響額									
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の積立				2,550,000			2,550,000	-	-
当期純利益							5,126,556	5,126,556	5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556	2,582,556	2,582,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	252,905	30,099,168
会計方針の変更による累積的影響額		
会計方針の変更を反映した当期首残高	252,905	30,099,168
当期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の積立		-
当期純利益		5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	98,949	98,949
当期変動額合計	98,949	2,483,607
当期末残高	153,956	32,582,775

重要な会計方針

項目	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28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>
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、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：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（5年）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 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</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31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

（1）概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

（2）適用予定日

平成28年4月1日以後に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

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

会計上の見積りの変更

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

追加情報

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne 株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 D I A Mアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 8 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
建物	582,075	767,802
車両運搬具	3,981	4,374
器具備品	735,461	562,853
商標権	836	930
ソフトウェア	2,015,473	2,613,791
電信電話専用施設利用権	1,408	1,451

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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	311,994	276,211
流動負債	未払費用	492,035	622,004

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	0	182
ソフトウェア	12,988	442

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	-	2,653

(株主資本等変動計算書関係)

第30期(自平成26年4月1日 至平成27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26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1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27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成28年6月29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28年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(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、本社オフィス等の不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等でありませ

ず。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、株価指数先物取引及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及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30期(平成27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	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

第31期(平成28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	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	26,427,656	26,427,656	-
(1) 未払法人税等	1,223,957	1,223,957	-
負債計	1,223,957	1,223,957	-

(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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
非上場株式	80,246	77,696
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
差入保証金	733,907	2,040,945

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 其他有価証券」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。

前事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィス等の不動産賃借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30期(平成27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	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

第31期(平成28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	12,951,736	-	-	-
合計	12,951,736	-	-	-

(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30期の貸借対照表計上額2,316,596千円、第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円)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30期（平成27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	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
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）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	532,891	159,101	373,789

（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31期（平成28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	365,683	146,101	219,581
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
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）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

（注）非上場株式（貸借対照表計上額77,696千円）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
第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
該当事項はありません。

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他有価証券	5,927	3,377	-

7. 減損処理を行った有価証券
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30期（平成27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	14,169,657	2,544,066

第31期（平成28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	13,094,914	825,986

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(非積立型制度であります)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. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第30期	第31期
	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035
会計方針の変更による累積的影響額	203,600	-
会計方針の変更を反映した期首残高	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	49,633	51,531
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

	第30期	第31期
	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	973,035	1,086,550
未積立退職給付債務	973,035	1,086,550
未認識数理計算上の差異	89,550	79,449
未認識過去勤務費用	14,556	9,704
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396
退職給付引当金	868,928	997,396
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第30期	第31期
	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	174,402	179,999

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
割引率	0.89%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第30期事業年度43,461千円、第31期事業年度44,193千円であります。

(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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	118,238	79,702
未払事業所税	5,527	5,581
賞与引当金	239,095	224,898
未払法定福利費	30,557	28,395
未払確定拠出年金掛金	2,650	2,500
外国税支払損失	15,727	-
資産除去債務	-	13,244
減価償却超過額(一括償却資産)	2,158	3,389
減価償却超過額	130,844	136,503
繰延資産償却超過額(税法上)	2,710	1,339
退職給付引当金	281,232	305,591
役員退職慰労引当金	35,724	47,318
ゴルフ会員権評価損	1,940	3,768
関係会社株式評価損	176,106	166,740
その他有価証券評価差額金	-	1,196
繰延税金資産合計	1,042,515	1,020,171
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	47,855	-
繰延税金負債合計	47,855	-
差引繰延税金資産の純額	994,659	1,020,171

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。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

（資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（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30期（自平成26年4月1日 至平成27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	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

（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31期(自平成27年4月1日 至平成28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	30,188,445	8,588,706	724,211	39,501,363

(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30期(自平成26年4月1日 至平成27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	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

第31期（自平成27年4月1日 至平成28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	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

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30期（自平成26年4月1日 至平成27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	658,756	未払費用	235,583
	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	383,980	未払費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000千円	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	増資の引受	400,000	-	-

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	9,000 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 増資の引受	800,617 912,600	未払 費用 -	308,974 -
	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	473,948	未払 費用	157,130

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。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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	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	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	71
	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	-	兼務 1名	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	407,531	未払 費用	240,725
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	6,501
	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)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

第31期（自平成27年4月1日 至平成28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	14,040 億円	銀行業	-	兼務 1名	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	3,023,040	未払 手数料	372,837
								預金の預入 (純額)	879,733	現金・ 預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収 収益	123
その他の 関係会 社の子 会社	みずほ第 一ファイ 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	-	兼務 1名	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	557,013	未払 費用	292,861
	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 払戻 (純額)	700,000	金銭の 信託	13,094,914
								信託報酬の 支払	8,336		

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) 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4) 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5) 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30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,254,132円02銭	1,357,615円66銭
1株当たり当期純利益金額	213,583円46銭	213,606円51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、潜在株式が存在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30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
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。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,605,537
金銭の信託		11,792,364
前払費用		122,161
未収委託者報酬		4,755,701
未収運用受託報酬		2,465,934
未収投資助言報酬		261,221
未収収益		181,959
繰延税金資産		329,236
その他		122,804
	流動資産計	31,636,922
固定資産		
有形固定資産		1,541,889
建物	1	6,517
器具備品	1	152,176
建設仮勘定		1,383,196
無形固定資産		1,613,174
ソフトウェア		1,421,245
ソフトウェア仮勘定		184,656
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権		124
投資その他の資産		6,281,765
投資有価証券		441,519
関係会社株式		3,229,196
繰延税金資産		713,716
差入保証金		1,808,323
その他		89,010
	固定資産計	9,436,830
	資産合計	41,073,753

(単位:千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,080,224
未払金	2,651,649
未払償還金	49,873
未払手数料	1,865,871
その他未払金	735,905
未払費用	2,673,720
未払法人税等	907,554
未払消費税等	69,484
賞与引当金	724,711
訴訟損失引当金	30,000
その他	21,000
	流動負債計
	8,158,344
固定負債	
退職給付引当金	1,027,049
	固定負債計
	1,027,049
負債合計	9,185,394
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	27,317,845
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	24,580,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,114,551
	株主資本計
	31,746,323
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	142,035
	評価・換算差額等計
	142,035
純資産合計	31,888,358
負債・純資産合計	41,073,753

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	14,454,974	
運用受託報酬	3,732,759	
投資助言報酬	456,986	
その他営業収益	323,793	
	営業収益計	18,968,513
営業費用		
支払手数料	6,111,449	
広告宣伝費	108,789	
公告費	428	
調査費	3,764,163	
調査費	2,639,714	
委託調査費	1,124,449	
委託計算費	216,712	
営業雑経費	278,529	
通信費	17,844	
印刷費	212,004	
協会費	11,277	
諸会費	18	
支払販売手数料	37,384	
	営業費用計	10,480,072
一般管理費		
給料	2,330,263	
役員報酬	124,419	
給料・手当	2,205,843	
交際費	16,973	
寄付金	13,268	
旅費交通費	100,973	
租税公課	148,041	
不動産賃借料	1,329,821	
退職給付費用	121,590	
固定資産減価償却費	1 353,322	
福利厚生費	11,020	
修繕費	10,082	
賞与引当金繰入額	724,711	
役員退職慰労金	63,072	
機器リース料	146	
事務委託費	182,857	
事務用消耗品費	37,442	
器具備品費	236,524	
諸経費	58,359	
	一般管理費計	5,738,473
営業利益		2,749,968

(単位:千円)

	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	7,882	
受取利息	341	
為替差益	32,301	
雑収入	4,836	
	営業外収益計	45,361
営業外費用		
金銭の信託運用損	59,768	
	営業外費用計	59,768
経常利益		2,735,561
特別損失		
固定資産除却損	2,820	
固定資産売却損	1,780	
訴訟損失引当金繰入額	30,000	
	特別損失計	34,601
税引前中間純利益		2,700,960
法人税、住民税及び事業税		856,976
法人税等調整額		17,520
法人税等合計		839,455
中間純利益		1,861,504

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発積 立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							1,861,504	1,861,504	1,861,504
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	3,232,495	682,495	682,495
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	24,580,000	300,000	200,000	2,114,551	27,317,845	31,746,323

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証 券評価差額金	
当期首残高	153,956	32,582,775
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		1,861,504
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	11,921	11,921
当中間期変動額 合計	11,921	694,416
当中間期末残高	142,035	31,888,358

重要な会計方針

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間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
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引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	(1)有形固定資産：定率法 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、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）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、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。 (2)賞与引当金：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。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間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。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる額を計上しております。
6. 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、中間決算日の直物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。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

<p>第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)</p>
<p>法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。</p>

追加情報

<p>第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)</p>
<p>1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。 2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。 これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)		
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	790,504千円
	器具備品	...	596,199千円

(中間損益計算書関係)

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
1. 減価償却実施額	有形固定資産	...	57,752千円
	無形固定資産	...	295,570千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30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）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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

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28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、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）。

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	11,605,537	11,605,537	-
(2) 金銭の信託	11,792,364	11,792,364	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	363,823	363,823	-
資産計	23,761,725	23,761,725	-
(1) 未払法人税等	907,554	907,554	-
負債計	907,554	907,554	-

（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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	77,696
関係会社株式	3,229,196
差入保証金	1,808,323

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 其他有価証券」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、時価開示の対象としておりません。

差入保証金は、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、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

第32期中間会計期間末
(平成28年9月30日現在)

- 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
- 子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式(中間貸借対照表計上額3,229,196千円)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。
- その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	349,644	146,101	203,542
債券	-	-	-
その他(投資信託)	14,179	13,000	1,179
小計	363,823	159,101	204,721
中間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)	-	-	-
小計	-	-	-
合計	363,823	159,101	204,721

(注)非上場株式(中間貸借対照表計上額77,696千円)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。

(金銭の信託関係)

第32期中間会計期間末
(平成28年9月30日現在)

- 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。
- その他の金銭の信託(運用目的及び満期保有目的以外)
該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

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

(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	14,454,974	4,189,745	323,793	18,968,513

(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中間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中間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

顧客の名称又は氏名	営業収益 (千円)
第一生命グループ	1,928,739

(注) 第一生命グループには、第一生命保険株式会社及び第一フロンティア生命保険株式会社が含まれております。

(1株当たり情報)

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,328,681円	62銭
1株当たり中間純利益金額	77,562円	67銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

(注) 1株当たり中間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32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
中間純利益	1,861,504千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,861,504千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第32期中間会計期間
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

当社（以下「DIAM」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAM、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1．結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2．企業結合日

平成28年10月1日

3．企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5．交付した株式数

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）に対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないA種種類株式15,510株を交付しました。

6．企業結合の主な目的

当社は、みずほフィナンシャルグループ及び第一生命保険株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、みずほフィナンシャルグループと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

7．取得企業を決定するに至った主な根拠

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるみずほフィナンシャルグループが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

8．実施予定の会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3．企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理することをそれぞれ予定しております。

(参考)みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「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条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「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条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度(自平成27年4月1日至平成28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により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

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	江見 睦生 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子 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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第53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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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)1.上記は、当社が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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野	浩	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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、みずほ投信投資顧問株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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1) 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。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1)貸借対照表

	（単位： 千円）	
	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	1,092	1,185
流動資産合計	25,070,606	25,493,940
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	124,850	100,000
工具、器具及び備品（純額）	71,443	90,655
リース資産（純額）	2,140	818
有形固定資産合計	1 198,434	1 191,474
無形固定資産		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
無形固定資産合計	12,812	12,782
投資その他の資産		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	19,534	19,404
投資その他の資産合計	4,691,245	3,955,916
固定資産合計	4,902,492	4,160,172
資産合計	29,973,099	29,654,112
負債の部		
流動負債		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
未払金		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
未払金合計	912,009	851,826
未払費用	2,038,097	1,896,033
未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
流動負債合計	4,183,052	3,895,216
固定負債		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
固定負債合計	428,109	194,716
負債合計	4,611,161	4,089,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600

資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	<u>4,716,474</u>	<u>4,716,474</u>
利益剰余金		
利益準備金	128,584	128,584
その他利益剰余金		
配当準備積立金	104,600	104,600
退職慰労積立金	100,000	100,000
別途積立金	9,800,000	9,800,000
繰越利益剰余金	7,739,742	8,908,993
利益剰余金合計	<u>17,872,927</u>	<u>19,042,177</u>
自己株式	-	377,863
株主資本合計	<u>24,635,002</u>	<u>25,426,389</u>
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	726,935	137,791
評価・換算差額等合計	<u>726,935</u>	<u>137,791</u>
純資産合計	<u>25,361,937</u>	<u>25,564,180</u>
負債純資産合計	<u>29,973,099</u>	<u>29,654,112</u>

(2)損益計算書

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	17,538,139	17,358,667
運用受託報酬	4,463,429	5,050,661
営業収益合計	22,001,569	22,409,329
営業費用		
支払手数料	8,480,510	7,999,728
広告宣伝費	247,790	205,521
公告費	1,140	152
調査費		
調査費	1,259,067	1,312,466
委託調査費	4,883,037	5,299,598
図書費	4,308	3,703
調査費合計	6,146,412	6,615,769
委託計算費	101,919	116,405
営業雑経費		
通信費	59,454	46,151
印刷費	128,143	246
協会費	18,777	20,221
諸会費	2,540	2,317
その他	855,319	958,635
営業雑経費合計	1,064,234	1,027,572
営業費用合計	16,042,008	15,965,148
一般管理費		
給料		
役員報酬	142,983	143,812
給料手当	1,832,723	1,905,880
賞与	295,180	304,122
給料合計	2,270,886	2,353,814
交際費	775	775
寄付金	-	221
旅費交通費	91,851	87,228
租税公課	51,783	76,075
不動産賃借料	339,964	305,351
退職給付費用	126,451	119,608
福利厚生費	368,622	370,689
貸倒引当金繰入	-	93
賞与引当金繰入	319,122	301,698
役員退職慰労引当金繰入	27,249	47,768
固定資産減価償却費	31,216	44,257
諸経費	358,817	269,502
一般管理費合計	3,986,740	3,977,085
営業利益	1,972,819	2,467,095
営業外収益		
受取配当金	7,027	4,242
受取利息	7,340	7,633
有価証券解約益	953	50,674
有価証券償還益	-	56,303
時効到来償還金等	21,856	1,962
時効後支払損引当金戻入額	-	1,311
雑収入	51,171	20,993
営業外収益合計	88,349	143,121
営業外費用		
有価証券解約損	-	278
有価証券償還損	2,197	2,641
ヘッジ会計に係る損失	2,240	-
時効後支払損引当金繰入額	17,685	-
雑損失	63,198	6,767

営業外費用合計		85,321	9,688
経常利益		1,975,847	2,600,528
特別利益			
投資有価証券売却益		10,500	-
特別利益合計		10,500	-
特別損失			
減損損失	1	51,292	-
事業再構築費用	2	125,173	-
外国税負担損失	3	53,547	-
貸倒引当金繰入		19,534	-
特別損失合計		249,548	-
税引前当期純利益		1,736,799	2,600,528
法人税、住民税及び事業税		616,760	839,827
法人税等調整額		16,247	40,166
法人税等合計		633,008	879,993
当期純利益		1,103,790	1,720,534

(3)株主資本等変動計算書

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位: 千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本						株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	
		その他利益剰余金					
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	6,988,395	17,121,579	23,883,654
当期変動額							
剰余金の配当					352,443	352,443	352,443
当期純利益					1,103,790	1,103,790	1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)							
当期変動額合計					751,347	751,347	751,347
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	24,635,002

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	41,248	41,248	23,842,406
当期変動額			
剰余金の配当			352,443
当期純利益			1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	768,183	768,183	768,183
当期変動額合計	768,183	768,183	1,519,530
当期末残高	726,935	726,935	25,361,937

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位： 千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本							自己株式	株主資本合計
	利益剰余金						利益剰余金合計		
	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計			
		配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金				
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	-	24,635,002	
当期変動額									
剰余金の配当					551,284	551,284		551,284	
当期純利益					1,720,534	1,720,534		1,720,534	
自己株式の取得							377,863	377,863	
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計					1,169,250	1,169,250	377,863	791,386	
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177	377,863	25,426,389	

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	726,935	726,935	25,361,937
当期変動額			
剰余金の配当			551,284
当期純利益			1,720,534
自己株式の取得			377,863
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	589,143	589,143	589,143
当期変動額合計	589,143	589,143	202,242
当期末残高	137,791	137,791	25,564,180

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法（ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権について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。

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、決算日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。

(4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）

(5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物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. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

1. 概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

2. 適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

当社は、「追加情報」に記載のとおり、当社、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積りの変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ27,598千円減少しております。

追加情報

DIAMアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 西 恵正）、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 - 8 - 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成27年3月31日）		当事業年度 （平成28年3月31日）	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1	有形固定資産の減価償却累計額
	建物 111,156千円		建物 136,006千円
	工具、器具及び備品 277,249千円		工具、器具及び備品 226,657千円
	リース資産 16,185千円		リース資産 17,508千円

(損益計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額(千円)
本社(東京都港区)	除却対象資産	建物	23,139
本社(東京都港区)	除却対象資産	工具器具備品	4,253
本社(東京都港区)	除却対象資産	原状回復費用	23,900

レイアウト変更により現行オフィス内部造作等の除却が決定した資産につき、「除却対象資産」としてグルーピングを行い、平成27年3月31日時点の帳簿価額および原状回復費用を減損損失(51,292千円)として特別損失に計上しました。

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当するものはありません。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

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(円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発効日
平成26年6月11日 第51回定時株主総会	普通株式	352,443,450	335	平成26年3月31日	平成26年6月12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	配当金の総額(円)	配当の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	利益剰余金	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

2 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	-	13,662	-	13,662

(変動事由の概要)

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

3. 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 (円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発効日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

リース資産の内容

有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

(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

当社は、投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を半期ごとに把握する体制としております。

有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスクの管理

有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的な時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,801,864	20,801,864	-
(2) 未収委託者報酬	1,827,951	1,827,951	-
(3) 未収運用受託報酬	1,812,198	1,812,198	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	4,054,289	4,054,289	-
資産計	28,496,304	28,496,304	-
(1) 未払手数料	819,341	819,341	-
負債計	819,341	819,341	-
デリバティブ取引（1）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(3,601)	(3,601)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	327	327	-
デリバティブ取引計	(3,274)	(3,274)	-

（1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,903,257	20,903,257	-
(2) 未収委託者報酬	2,183,032	2,183,032	-
(3) 未収運用受託報酬	1,713,643	1,713,643	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,282,026	3,282,026	-
資産計	28,081,960	28,081,960	-
(1) 未払手数料	838,064	838,064	-
負債計	838,064	838,064	-
デリバティブ取引（1）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(220)	(220)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1,564)	(1,564)	-
デリバティブ取引計	(1,784)	(1,784)	-

（1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

負 債

(1) 未払手数料

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

(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の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	60,720	60,720

上記については、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ため、「(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(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

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,800,853	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,827,951	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,812,198	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	127,840	-	-	-	-	3,300,657
合計	24,568,844	-	-	-	-	3,300,657

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,902,546	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	2,183,032	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,713,643	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	82,540	-	-	-	-	2,395,185
合計	24,881,762	-	-	-	-	2,395,185

(有価証券関係)

1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	3,740,183	2,664,442	1,075,740
小計	3,740,183	2,664,442	1,075,740
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	314,105	316,720	2,615
小計	314,105	316,720	2,615
合計	4,054,289	2,981,163	1,073,125

当事業年度(平成28年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	2,698,875	2,500,000	198,875
小計	2,698,875	2,500,000	198,875
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	583,151	583,423	271
小計	583,151	583,423	271
合計	3,282,026	3,083,423	198,603

2 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものではありません。

3 当事業年度中に解約・償還したその他有価証券
前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	102,729	953	2,197
合計	102,729	953	2,197

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	738,178	106,977	2,920
合計	738,178	106,977	2,920

(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
株式関連
前事業年度(平成27年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	197,054	-	3,601	3,601
	合計	197,054	-	3,601	3,601

当事業年度(平成28年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	148,005	-	220	220
	合計	148,005	-	220	220

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

前事業年度(平成27年3月31日)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	131,145	-	3,325
	買建	投資有価証券	277,953	-	3,652
合計			409,098	-	327

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度(平成28年3月31日)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	117,467	-	147
	買建	投資有価証券	179,836	-	1,711
合計			297,303	-	1,564

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

(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、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。

当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	357,258千円	331,766千円
退職給付費用	150,018	51,208
退職給付の支払額	21,349	-
制度への拠出額	103,177	66,102
退職給付引当金の期末残高	331,766	346,659

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	669,318千円	727,842千円
年金資産	1,001,084	1,074,502
貸借対照表に計上された前払年金費用	331,766	346,659

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度58,362千円 当事業年度51,208千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

(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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
有価証券償却超過額	4,795千円	4,551千円
ソフトウェア償却超過額	69,263	52,651
賞与引当金損金算入限度超過額	108,734	98,134
社会保険料損金不算入額	15,665	14,233
役員退職慰労引当金	34,461	45,488
未払事業税	30,421	39,817
その他	93,137	58,782
繰延税金資産小計	356,479	313,659
評価性引当額	24,103	22,331
繰延税金資産合計	332,375	291,328
繰延税金負債		
前払年金費用	107,027	106,147
その他有価証券評価差額金	346,190	60,812
繰延税金負債合計	453,218	166,959
繰延税金資産の純額	120,843	124,368

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。

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年4月1日から平成30年3月31日までのものは30.86%、平成30年4月1日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）及び当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	2,629,803	資産運用業

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	3,061,207	資産運用業

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものではありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,833,692	未払手数料	361,219
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	13,851,610	未収委託者報酬	1,661,682

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,542,264	未払手数料	336,556
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	14,108,529	未収委託者報酬	2,053,638

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	24,106.70円	24,618.62円
1株当たり当期純利益金額	1,049.16円	1,639.16円

(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、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

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。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
普通株式に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
期中平均株式数(株)	1,052,070	1,049,643

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位: 千円)

第54期中間会計期間
(平成28年9月30日)

資産の部	
流動資産	
現金及び預金	4,120,018
未収委託者報酬	2,064,997
未収運用受託報酬	1,959,028
繰延税金資産	140,728
その他	398,383
貸倒引当金	1,207
流動資産合計	8,681,950
固定資産	
有形固定資産	
工具、器具及び備品(純額)	62,971
有形固定資産合計	1 62,971
無形固定資産	
投資その他の資産	12,767
投資有価証券	815,525
繰延税金資産	73,719
その他	638,830
貸倒引当金	19,404
投資その他の資産合計	1,508,671
固定資産合計	1,584,410
資産合計	10,266,360
負債の部	
流動負債	
未払金	793,859
未払費用	1,675,771
未払法人税等	253,697
賞与引当金	319,200
その他	221,869
流動負債合計	3,264,398
固定負債	
役員退職慰労引当金	57,860
時効後支払損引当金	7,256
固定負債合計	65,116
負債合計	3,329,515
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,045,600
資本剰余金	
資本準備金	2,266,400
その他資本剰余金	1,103,259
資本剰余金合計	3,369,659
利益剰余金	
利益準備金	128,584
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	1,777,567
利益剰余金合計	1,906,152
自己株式	377,863
株主資本合計	6,943,548
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	6,703
評価・換算差額等合計	6,703
純資産合計	6,936,845
負債純資産合計	10,266,360

(2) 中間損益計算書

(単位： 千円)

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		7,935,613
運用受託報酬		2,105,866
営業収益合計		10,041,479
営業費用及び一般管理費	1	9,415,997
営業利益		625,482
営業外収益		
受取配当金		19,694
受取利息		439
有価証券解約益		76,483
有価証券償還益		3,474
時効到来償還金等		727
雑収入		17,708
営業外収益合計		118,528
営業外費用		
有価証券解約損		96
有価証券償還損		12
雑損失		6,303
営業外費用合計		6,412
経常利益		737,598
特別利益		700
特別損失		11,641
税引前中間純利益		726,657
法人税、住民税及び事業税		236,054
法人税等調整額		26,308
法人税等合計		209,746
中間純利益		516,910

(3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位： 千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当中間期変動額				
積立金取崩				
剰余金の配当			1,346,815	1,346,815
中間純利益				
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）				
当中間期変動額合計			1,346,815	1,346,815
当中間期末残高	2,045,600	2,266,400	1,103,259	3,369,659

	株主資本					
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計
		その他利益剰余金				
		配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177
当中間期変動額						
積立金取崩		104,600	100,000	9,800,000	10,004,600	-
剰余金の配当					17,652,936	17,652,936
中間純利益					516,910	516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計		104,600	100,000	9,800,000	7,131,425	17,136,025
当中間期末残高	128,584	-	-	-	1,777,567	1,906,152

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	自己株式	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額 等合計	
当期首残高	377,863	25,426,389	137,791	137,791	25,564,180
当中間期変動額					
積立金取崩		-			-
剰余金の配当		18,999,751			18,999,751
中間純利益		516,910			516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			144,494	144,494	144,494
当中間期変動額合計		18,482,840	144,494	144,494	18,627,334
当中間期末残高	377,863	6,943,548	6,703	6,703	6,936,845

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

中間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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権について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。

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、中間決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、中間決算日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。

(4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

(5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物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。

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

	第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	476,786千円

（中間損益計算書関係）

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
1 減価償却実施額	有形固定資産	114,327千円
	無形固定資産	15千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	13,662	-	-	13,662

3 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 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

（金融商品関係）

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

（単位： 千円）

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	4,120,018	4,120,018	-
(2) 未収委託者報酬	2,064,997	2,064,997	-
(3) 未収運用受託報酬	1,959,028	1,959,028	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	754,805	754,805	-
資産計	8,898,851	8,898,851	-
(1) 未払手数料	785,089	785,089	-
負債計	785,089	785,089	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。
また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負債

(1) 未払手数料

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の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	60,720

上記については、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ため、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

1 その他有価証券

種類	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
証券投資信託	151,830	150,000	1,830
小計	151,830	150,000	1,830
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
証券投資信託	602,975	614,467	11,491
小計	602,975	614,467	11,491
合計	754,805	764,467	9,661

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

3 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益(千円)	関連するセグメント名
適格機関投資家A	1,177,474	資産運用業

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1株当たり純資産額	6,680.26円

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1株当たり中間純利益金額	497.79円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	516,910
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	516,910
普通株式の期中平均株式数(株)	1,038,408

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(重要な後発事象)

当社(以下「MHAM」という)は、平成28年7月13日付で締結した、MHAM、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

（参考）新光投信株式会社の経理状況

1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」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。）並びに同規則第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。

当社の中間財務諸表は、「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条および第57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。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第57期事業年度（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社
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 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛
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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56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、新光投信株式会社の平成28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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の統合基本合意書に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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

- () 1. 上記は、当社が、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。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野	浩	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」に掲げられている新光投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、新光投信株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、新光投信株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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1) 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。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160
有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
流動資産合計	20,404,659	21,767,367
固定資産		
有形固定資産		
建物(純額)	2 12,687	2 0
構築物(純額)	2 1,444	2 0
器具・備品(純額)	2 86,688	2 44,868
有形固定資産合計	100,820	44,868
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
無形固定資産合計	86,278	57,152
投資その他の資産		
投資有価証券	5,101,854	2,858,652
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,246	23,339
長期繰延税金資産	-	29,604
前払年金費用	396,211	378,381
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	5,706,044	3,373,710
固定資産合計	5,893,143	3,475,731
資産合計	26,297,802	25,243,098

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
未払金		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	1 1,558,682	1 1,360,372
その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
固定負債		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
純資産の部		
株主資本		
資本金	4,524,300	4,524,300
資本剰余金		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		
利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744

評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		35,876,795		39,283,623
運用受託報酬		238,412		232,145
営業収益合計		36,115,207		39,515,769
営業費用				
支払手数料	1	18,252,669	1	19,472,734
広告宣伝費		456,430		507,020
公告費		548		469
調査費				
調査費		623,792		841,825
委託調査費		5,966,340		7,419,125
図書費		5,254		4,879
調査費合計		6,595,388		8,265,830
委託計算費		1,352,318		1,711,366
営業雑経費				
通信費		32,335		30,454
印刷費		103,093		1,022
協会費		18,150		19,367
諸会費		3,300		3,117
その他		41,594		44,518
営業雑経費合計		198,475		98,480
営業費用合計		26,855,830		30,055,901
一般管理費				
給料				
役員報酬		96,445		91,205
給料・手当		1,368,552		1,480,875
賞与		336,076		428,776
給料合計		1,801,073		2,000,857
交際費		11,426		10,708
寄付金		3,198		2,346
旅費交通費		100,386		109,240
租税公課		68,508		90,795
不動産賃借料		206,753		205,671
賞与引当金繰入		451,000		547,750
役員賞与引当金繰入		66,000		22,000
役員退職慰労引当金繰入		24,930		22,210
退職給付費用		191,900		169,238
減価償却費		70,676		102,532

諸経費	573,824	647,510
一般管理費合計	3,569,678	3,930,859
営業利益	5,689,698	5,529,008

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		163,006		65,772
有価証券利息		3,853		3,333
受取利息		10,741		10,751
時効成立分配金・償還金		5,080		923
受取保険金		-		10,300
雑益		487		2,845
営業外収益合計		183,170		93,926
営業外費用				
支払利息		26		3
時効成立後支払分配金・償還金		3,083		5,532
雑損		3,261		556
営業外費用合計		6,371		6,092
経常利益		5,866,496		5,616,842
特別利益				
投資有価証券売却益		68,179		225,965
外国税支払損失引当金戻入益		-		43,200
特別利益合計		68,179		269,166
特別損失				
固定資産除却損		3,177		13,017
投資有価証券売却損		54,613		60,150
投資有価証券評価損		10,952		62,800
外国税支払損失引当金繰入額		184,111		-
訴訟損失引当金繰入額		30,000		10,000
合併関連費用	2	-	2	164,657
その他特別損失		22,227		-
特別損失合計		305,082		310,625
税引前当期純利益		5,629,593		5,575,383
法人税、住民税及び事業税		2,111,379		1,832,729
法人税等調整額		66,999		19,773
法人税等合計		2,044,380		1,852,503
当期純利益		3,585,212		3,722,880

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165
会計方針の変更による累積的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当期変動額					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自 己 株 式	株 主 資 本 合 計	その他有価証 券評価差額金	
	利 益 剰余金 合 計				
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による累積的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金 別途積立金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益						
自己株式の消却			72,415	72,415		
利益剰余金から 資本剰余金への振替			72,415	72,415		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-
当期末残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000

	株主資本				評価・換算 差額等	純資産合計
	利益剰余金		自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
当期首残高	3,981,245	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当期変動額						
剰余金の配当	3,446,341	3,446,341		3,446,341		3,446,341
当期純利益	3,722,880	3,722,880		3,722,880		3,722,880
自己株式の消却			72,415	-		-
利益剰余金から資本剰余金への振替	72,415	72,415		-		-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				-	187,941	187,941
当期変動額合計	204,122	204,122	72,415	276,538	187,941	88,597
当期末残高	4,185,368	13,445,861	-	20,731,861	94,744	20,826,605

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 関連会社株式

総平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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、総平均法により算定)

時価のないもの

総平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、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り償却しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(3) 外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

(4) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(5) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

（6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（7）執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4．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、決算日の直物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。

5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（未適用の会計基準）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

（1）概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

（2）適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

（追加情報）

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日に、新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

- 1．商号 アセットマネジメントOne株式会社
- 2．代表者 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
- 3．本店所在地 東京都千代田区丸の内1-8-2
- 4．統合日 平成28年10月1日

注記事項

（貸借対照表関係）

1．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払手数料	777,631千円	570,839千円

2．資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	573,602千円	657,201千円

（損益計算書関係）

1．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
支払手数料	9,189,399千円	8,452,937千円

2．特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
固定資産・敷金の償却	-千円	140,257千円
その他	-千円	24,400千円
合計	-千円	164,657千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	-	1,823,250

2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	9,386	-	-	9,386

3. 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26年12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	9,386	1,813,864

(変動事由の概要)

自己株式の消却

2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	9,386	-	9,386	-

(変動事由の概要)

自己株式の消却

3. 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27年11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17日

（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

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行ってまいります。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上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ることがあります。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、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

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）。

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	14,861,160	14,861,160	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,159,600	6,159,600	-
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	2,884,368	-

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

(3) 未収委託者報酬

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（単位：千円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	276,151	276,151

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(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

前事業年度(平成27年3月31日)

	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	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

当事業年度(平成28年3月31日)

	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	14,861,112	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	-	-	-

(有価証券関係)

1. 関連会社株式

関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円)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。

2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)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。

当事業年度(平成28年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,119,150	869,274	249,875
	小計	1,119,150	869,274	249,875
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,040,450	5,153,936	113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	113,485
合計		6,159,600	6,023,210	136,389

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)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。

3.売却したその他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	503,565	68,179	54,613
合計	503,565	68,179	54,613

当事業年度（平成28年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	2,209,763	225,965	60,150
合計	2,209,763	225,965	60,150

4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円（その他有価証券）減損処理を行っております。
当事業年度において、有価証券について62,800千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

（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、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

2．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,424,739	1,348,083
会計方針の変更による累積的影響額	71,902	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,352,836	1,348,083
勤務費用	90,967	91,804
利息費用	9,476	6,074
数理計算上の差異の発生額	31,927	53,747
退職給付の支払額	73,269	60,817
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,348,083	1,438,892

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
年金資産の期首残高	1,157,054	1,329,170
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の発生額	108,961	128,633
事業主からの拠出額	78,464	77,164
退職給付の支払額	38,450	28,253
年金資産の期末残高	1,329,170	1,282,678

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成27年3月31日)	(平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,111,797	1,185,792
年金資産	1,329,170	1,282,678
	217,373	96,885
非積立型制度の退職給付債務	236,285	253,099
未積立退職給付債務	18,912	156,213
未認識数理計算上の差異	270,020	387,977
未認識過去勤務費用	10,703	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764
退職給付引当金	155,806	146,617
前払年金費用	396,211	378,381
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用(注1)	119,135	124,139
利息費用	9,476	6,074
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の費用処理額	85,138	64,424
過去勤務費用の費用処理額	16,055	10,703
確定給付制度に係る退職給付費用	174,553	150,705

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額(前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円)については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

(5)年金資産に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%
現金及び預金	1.4%	3.2%
合計	100%	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
割引率	0.0720% ~ 1.625%	0.0120% ~ 0.8060%
長期期待運用収益率	2.0%	2.5%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

(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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	170,920千円	182,614千円
減価償却超過額	896	25,871
退職給付引当金	70,882	71,201
役員退職慰労引当金	12,688	14,799
投資有価証券評価損	15,033	19,229
非上場株式評価損	25,733	24,425
未払事業税	90,342	57,445
外国税支払損失引当金	60,867	-
訴訟損失引当金	9,918	12,344
その他	87,621	120,305
繰延税金資産小計	544,905	528,236
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	544,905	528,236
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	134,624	56,708
前払年金費用	127,817	115,860
繰延税金負債合計	262,442	172,568
繰延税金資産の純額	282,463	355,668

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産 - 繰延税金資産	372,215千円	326,063千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	-	29,604
固定負債 - 長期繰延税金負債	89,752	-

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。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については30.62%となります。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

セグメント情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

関連当事者情報

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る)等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	9,189,399	未払手数料	777,631

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.98 間接 7.73	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,452,937	未払手数料	570,839

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	16,314
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	96,300	その他未払金	8,725
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,163	その他未払金	1,728

(注) 1. 上記(ア)~(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
1株当たり純資産額	11,433円05銭	11,481円90銭
1株当たり当期純利益金額	1,976円56銭	2,052円45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、潜在株式が存在しないため記載していません。

（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。

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
期中平均株式数（千株）	1,813	1,813

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	7,314,360
有価証券	101,520
未収委託者報酬	3,004,856
未収運用受託報酬	74,687
繰延税金資産	281,201
その他	334,195
流動資産合計	11,110,820
固定資産	
有形固定資産	
器具・備品(純額)	31,241
建設仮勘定	3,819
有形固定資産合計	35,061
無形固定資産	
ソフトウェア	52,424
ソフトウェア仮勘定	20,936
その他	91
無形固定資産合計	73,452
投資その他の資産	
投資有価証券	2,589,863
長期繰延税金資産	22,056
前払年金費用	352,195
その他	29,332
投資その他の資産合計	2,993,448
固定資産合計	3,101,961
資産合計	14,212,782

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	
未払収益分配金	153
未払償還金	4,216
未払手数料	1,406,798
その他未払金	284,198
未払金合計	1,695,367
未払費用	801,111
未払法人税等	850,492
未払消費税等	2 113,638
賞与引当金	382,000
訴訟損失引当金	70,000
流動負債合計	3,912,609
固定負債	
退職給付引当金	160,185
固定負債合計	160,185
負債合計	4,072,794
純資産の部	
株主資本	
資本金	4,524,300
資本剰余金	
資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	2,473,372
利益剰余金合計	2,833,866
株主資本合計	10,119,866
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	20,122
評価・換算差額等合計	20,122
純資産合計	10,139,988
負債純資産合計	14,212,782

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間	
	（自 平成28年4月 1日	
	至 平成28年9月30日）	
営業収益		
委託者報酬		19,468,460
運用受託報酬		95,090
営業収益合計		19,563,551
営業費用及び一般管理費	1	16,721,767
営業利益		2,841,783
営業外収益		
受取配当金		32,758
有価証券利息		522
受取利息		2,296
時効成立分配金・償還金		10
その他		531
営業外収益合計		36,119
営業外費用		
その他		34
営業外費用合計		34
経常利益		2,877,868
特別利益		
固定資産売却益		1,354
投資有価証券売却益		9,179
特別利益合計		10,533
特別損失		
固定資産売却損		3,996
投資有価証券評価損		58,055
固定資産除却損		50
訴訟損失引当金繰入額		30,000
合併関連費用		11,926
特別損失合計		104,028
税引前中間純利益		2,784,373
法人税、住民税及び事業税		795,495
法人税等調整額		85,212
法人税等合計		880,707
中間純利益		1,903,666

(3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別途 積立金	繰越 利益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	4,185,368
当中間期変動額					
別途積立金取崩				8,900,000	8,900,000
剰余金の配当					12,515,661
中間純利益					1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	8,900,000	1,711,995
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	-	2,473,372

	株主資本		評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	株主 資本 合計	その他有価証 券評価差額金	
	利益 剰余金 合計			
当期首残高	13,445,861	20,731,861	94,744	20,826,605
当中間期変動額				
別途積立金取崩	-	-		-
剰余金の配当	12,515,661	12,515,661		12,515,661
中間純利益	1,903,666	1,903,666		1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			74,622	74,622
当中間期変動額合計	10,611,995	10,611,995	74,622	10,686,617
当中間期末残高	2,833,866	10,119,866	20,122	10,139,988

[注記事項]

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、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り償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日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。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、そ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（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

(中間貸借対照表関係)

1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	498,091千円

2. 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
有形固定資産	9,695千円
無形固定資産	9,425千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,813,864	-	-	1,813,864

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28年6月15日 取締役会	普通 株式	12,515,661	6,900	平成28年7月5日	平成28年7月27日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの該当事項はありません。

（金融商品関係）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、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）。

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	7,314,360	7,314,360	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,415,231	2,415,231	-
(3) 未収委託者報酬	3,004,856	3,004,856	-
(4) 未払手数料	1,406,798	1,406,798	-

（注）1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬

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。

(4) 未払手数料

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

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 77,100千円）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。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	921,189	730,244	190,944
	小計	921,189	730,244	190,944
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,494,041	1,656,021	161,979
	小計	1,494,041	1,656,021	161,979
合計		2,415,231	2,386,265	28,965

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額199,051千円)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。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	5,590円26銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	10,139,988
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	10,139,988
普通株式の発行済株式数(株)	1,813,864
普通株式の自己株式数(株)	-
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	1,049円50銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株式の期中平均株式数(株)	1,813,864

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載していません。

(追加情報)

役員賞与引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全取締役及び全監査役に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において74,853千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

執行役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月14日開催の取締役会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全執行役員に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において101,916千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

繰延税金資産

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。

(重要な後発事象)

当社(以下「新光投信」という)は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及びみずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

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)

(4)投資顧問会社

a. 名称

Asset Management One International Ltd.

b. 資本金の額

平成28年10月1日現在 900万ポンド

c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

(5)投資顧問会社

a. 名称

Asset Management One USA Inc.

b. 資本金の額

平成28年10月1日現在 400万米ドル

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)

<訂正後>

(略)

(4)投資顧問会社

a. 名称

Asset Management One International Ltd.

b. 資本金の額

平成28年12月末日現在 900万ポンド

c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

(5)投資顧問会社

a. 名称

Asset Management One USA Inc.

b. 資本金の額

平成28年12月末日現在 400万米ドル

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12月21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」に掲げられている世界6資産アクティブ・バランス・ファンドの平成28年5月10日から平成28年11月8日までの特定期間の財務諸表、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、世界6資産アクティブ・バランス・ファンドの平成28年11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特定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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成28年5月31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	山野 浩 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27年4月1日から平成28年3月31日までの第31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28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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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1) 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。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野	浩 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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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な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、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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1) 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。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。