

【表紙】

| | |
|---|---------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成28年12月1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 国投資信託受益証券に係 るファンドの名称】 | D I A Mアジア関連日本株ファンド |
| 【届出の対象とした募集内 国投資信託受益証券の金 額】 | 500億円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書の提出に伴い、平成28年6月1日付をもって提出した有価証券届出書(平成28年9月30日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書で訂正済。以下「原届出書」といいます。)の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

3【投資リスク】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク「参考情報」」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

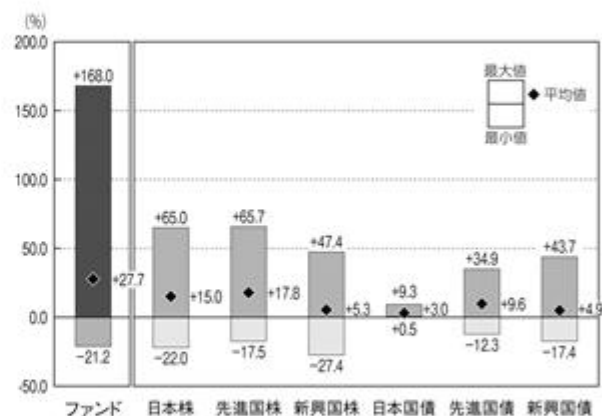
<更新・訂正後>

(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



2011年10月～2016年9月

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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日本株…… 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 - 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 日本国債… NOMURA-BPI国債
 - 先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 - 新興国債… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

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

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

(略)

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

(略)

<訂正後>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

(略)

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

(略)

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成28年9月30日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 株式 | 993,163,360 | 93.16 |
| 内 日本 | 993,163,360 | 93.16 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 72,969,327 | 6.84 |
| 純資産総額 | 1,066,132,687 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成28年9月30日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------------|------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 66,150,000 | 6.20 |
| 内 日本 | 66,150,000 | 6.20 |

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年9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 | スパークス・グループ 日本 | 株式 証券、商品先 物取引業 | 670,800 | 210.00 140,868,000 | 180.00 120,744,000 | - - | 11.33% |
| 2 | 日本電産 日本 | 株式 電気機器 | 4,800 | 7,522.00 36,105,600 | 9,262.00 44,457,600 | - - | 4.17% |
| 3 | 第一生命保険 日本 | 株式 保険業 | 22,600 | 1,409.73 31,859,918 | 1,371.50 30,995,900 | - - | 2.91% |
| 4 | 平田機工 日本 | 株式 機械 | 3,800 | 5,632.31 21,402,781 | 7,580.00 28,804,000 | - - | 2.70% |
| 5 | ソニー 日本 | 株式 電気機器 | 6,500 | 2,777.01 18,050,584 | 3,293.00 21,404,500 | - - | 2.01% |
| 6 | 三菱商事 日本 | 株式 卸売業 | 8,700 | 2,010.73 17,493,417 | 2,285.00 19,879,500 | - - | 1.86% |
| 7 | いちご 日本 | 株式 不動産業 | 41,800 | 383.00 16,009,400 | 445.00 18,601,000 | - - | 1.74% |
| 8 | 本田技研工業 日本 | 株式 輸送用機器 | 6,300 | 2,870.49 18,084,143 | 2,887.50 18,191,250 | - - | 1.71% |
| 9 | スズキ 日本 | 株式 輸送用機器 | 5,300 | 2,823.20 14,962,997 | 3,360.00 17,808,000 | - - | 1.67% |
| 10 | ソフトバンクグループ 日本 | 株式 情報・通信業 | 2,600 | 5,634.83 14,650,581 | 6,522.00 16,957,200 | - - | 1.59% |
| 11 | ダイキン工業 日本 | 株式 機械 | 1,800 | 7,561.00 13,609,800 | 9,351.00 16,831,800 | - - | 1.58% |
| 12 | 日立建機 日本 | 株式 機械 | 8,100 | 1,562.00 12,652,200 | 1,999.00 16,191,900 | - - | 1.52% |
| 13 | トヨタ自動車 日本 | 株式 輸送用機器 | 2,800 | 5,915.95 16,564,676 | 5,779.00 16,181,200 | - - | 1.52% |
| 14 | 東京製鋼 日本 | 株式 金属製品 | 9,600 | 1,400.00 13,440,000 | 1,685.00 16,176,000 | - - | 1.52% |
| 15 | 住友金属鉱山 日本 | 株式 非鉄金属 | 11,000 | 1,241.52 13,656,752 | 1,386.50 15,251,500 | - - | 1.43% |
| 16 | 寿スピリッツ 日本 | 株式 食料品 | 5,700 | 2,588.51 14,754,540 | 2,580.00 14,706,000 | - - | 1.38% |
| 17 | 三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本 | 株式 銀行業 | 28,800 | 493.19 14,203,941 | 505.10 14,546,880 | - - | 1.36% |
| 18 | ニトリホールディングス 日本 | 株式 小売業 | 1,200 | 11,267.04 13,520,450 | 12,050.00 14,460,000 | - - | 1.36% |
| 19 | タカラバイオ 日本 | 株式 化学 | 8,500 | 1,077.44 9,158,270 | 1,692.00 14,382,000 | - - | 1.35% |
| 20 | 三井住友フィナンシャルグ ループ 日本 | 株式 銀行業 | 4,200 | 3,210.00 13,482,014 | 3,380.00 14,196,000 | - - | 1.33% |

| | | | | | | | |
|----|--------------------|----------------------|--------|------------------------|-------------------------|--------|-------|
| 21 | T D K 日本 | 株式 電気機器 | 2,100 | 6,880.47 14,448,995 | 6,700.00 14,070,000 | - - | 1.32% |
| 22 | 栗田工業 日本 | 株式 機械 | 5,800 | 2,462.00 14,279,600 | 2,390.00 13,862,000 | - - | 1.30% |
| 23 | 日産自動車 日本 | 株式 輸送用機器 | 13,900 | 1,014.05 14,095,300 | 982.70 13,659,530 | - - | 1.28% |
| 24 | 小松製作所 日本 | 株式 機械 | 5,700 | 1,761.20 10,038,887 | 2,295.00 13,081,500 | - - | 1.23% |
| 25 | 日立ハイテクノロジーズ 日本 | 株式 卸売業 | 3,000 | 3,557.31 10,671,957 | 4,015.00 12,045,000 | - - | 1.13% |
| 26 | ブイ・テクノロジー 日本 | 株式 精密機器 | 1,000 | 6,651.01 6,651,015 | 11,820.00 11,820,000 | - - | 1.11% |
| 27 | 五洋建設 日本 | 株式 建設業 | 20,300 | 459.00 9,317,700 | 574.00 11,652,200 | - - | 1.09% |
| 28 | 朝日インテック 日本 | 株式 精密機器 | 2,500 | 5,040.00 12,600,000 | 4,605.00 11,512,500 | - - | 1.08% |
| 29 | ジャフコ 日本 | 株式 証券、商品先 物取引業 | 3,900 | 3,060.00 11,934,000 | 2,940.00 11,466,000 | - - | 1.08% |
| 30 | 東京海上ホールディングス 日本 | 株式 保険業 | 2,900 | 3,895.03 11,295,603 | 3,834.00 11,118,600 | - - | 1.04% |

(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9月30日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----|--------|
| 株式 | 93.16% |
| 合計 | 93.16% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年9月30日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|------------|-------|--------|
| 電気機器 | 国内 | 14.03% |
| 証券、商品先物取引業 | | 12.40% |
| 機械 | | 11.70% |
| 輸送用機器 | | 9.40% |
| 食料品 | | 5.33% |
| 不動産業 | | 4.22% |
| 保険業 | | 3.95% |
| 建設業 | | 3.56% |
| 卸売業 | | 3.50% |
| 非鉄金属 | | 3.24% |
| 銀行業 | | 2.94% |
| 精密機器 | | 2.71% |
| 化学 | | 2.65% |
| 情報・通信業 | | 2.58% |
| サービス業 | | 2.21% |
| 金属製品 | | 2.08% |
| 鉄鋼 | | 2.05% |
| 小売業 | | 1.67% |
| ガラス・土石製品 | | 1.27% |
| 医薬品 | | 0.66% |
| その他金融業 | 0.55% | |
| その他製品 | 0.45% | |
| 合計 | | 93.16% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

平成28年9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 | 66,669,620 | 66,150,000 | 6.20% |

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成28年9月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額 (分配落) (百万円) | 純資産総額 (分配付) (百万円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落)(円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付)(円) |
|------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末 (平成22年3月1日) | 2,097 | 2,180 | 1.0151 | 1.0551 |
| 第2計算期間末 (平成23年3月1日) | 1,344 | 1,417 | 1.1002 | 1.1602 |
| 第3計算期間末 (平成24年3月1日) | 1,373 | 1,373 | 0.8593 | 0.8593 |
| 第4計算期間末 (平成25年3月1日) | 1,145 | 1,272 | 1.2561 | 1.3961 |
| 第5計算期間末 (平成26年3月3日) | 2,844 | 3,009 | 1.7185 | 1.8185 |
| 第6計算期間末 (平成27年3月2日) | 2,770 | 2,913 | 1.9303 | 2.0303 |
| 第7計算期間末 (平成28年3月1日) | 1,180 | 1,180 | 1.6511 | 1.6511 |
| 平成27年9月末日 | 1,562 | - | 1.8972 | - |
| 10月末日 | 1,663 | - | 2.0835 | - |
| 11月末日 | 1,609 | - | 2.1255 | - |
| 12月末日 | 1,491 | - | 2.0500 | - |
| 平成28年1月末日 | 1,322 | - | 1.8267 | - |
| 2月末日 | 1,179 | - | 1.6512 | - |
| 3月末日 | 1,272 | - | 1.8157 | - |
| 4月末日 | 1,234 | - | 1.7774 | - |
| 5月末日 | 1,227 | - | 1.8971 | - |
| 6月末日 | 1,091 | - | 1.6944 | - |
| 7月末日 | 1,125 | - | 1.7758 | - |
| 8月末日 | 1,100 | - | 1.7508 | - |
| 9月末日 | 1,066 | - | 1.7563 | - |

【分配の推移】

| | 1口当たりの分配金(円) |
|-------------------------|--------------|
| 第1計算期間 | 0.0400 |
| 第2計算期間 | 0.0600 |
| 第3計算期間 | 0.0000 |
| 第4計算期間 | 0.1400 |
| 第5計算期間 | 0.1000 |
| 第6計算期間 | 0.1000 |
| 第7計算期間 | 0.0000 |
| 平成28年3月2日～ 平成28年9月1日 | - |

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|-------------------------|--------|
| 第1計算期間 | 5.5 |
| 第2計算期間 | 14.3 |
| 第3計算期間 | 21.9 |
| 第4計算期間 | 62.5 |
| 第5計算期間 | 44.8 |
| 第6計算期間 | 18.1 |
| 第7計算期間 | 14.5 |
| 平成28年3月2日～ 平成28年9月1日 | 6.3 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 設定口数 | 解約口数 |
|-------------------------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 3,424,489,793 | 1,357,979,298 |
| 第2計算期間 | 555,356,390 | 1,400,075,756 |
| 第3計算期間 | 1,382,331,049 | 1,005,577,739 |
| 第4計算期間 | 590,179,539 | 1,276,993,040 |
| 第5計算期間 | 5,724,112,186 | 4,980,664,801 |
| 第6計算期間 | 1,365,457,781 | 1,585,411,284 |
| 第7計算期間 | 186,289,088 | 906,621,400 |
| 平成28年3月2日～ 平成28年9月1日 | 49,613,471 | 135,450,426 |

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年9月30日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2009年5月29日)~2016年9月30日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2009年5月29日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

| | | |
|-------|--------------|--------|
| 第3期 | (2012.03.01) | 0円 |
| 第4期 | (2013.03.01) | 1,400円 |
| 第5期 | (2014.03.03) | 1,000円 |
| 第6期 | (2015.03.02) | 1,000円 |
| 第7期 | (2016.03.01) | 0円 |
| 設定来累計 | | 4,400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。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 | 93.16 |
| 内 日本 | 93.16 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 6.84 |
| 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) | 6.20 |

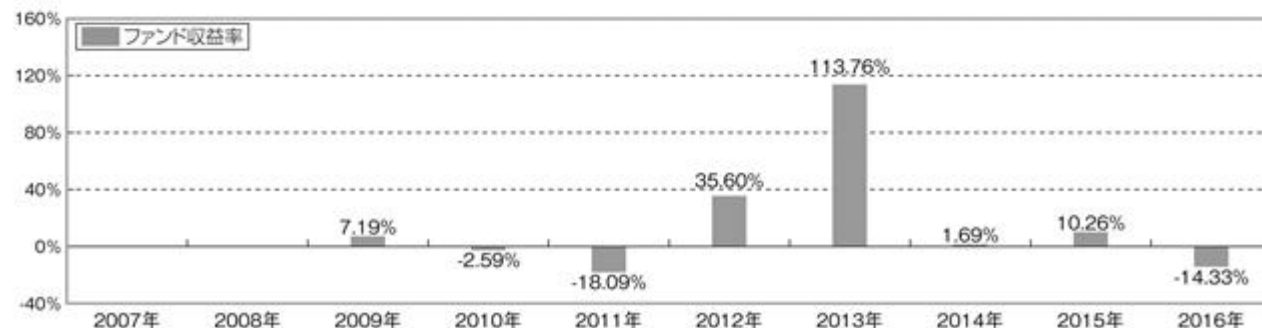
組入上位5業種(国内株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率 |
|----|------------|--------|
| 1 | 電気機器 | 14.03% |
| 2 | 証券、商品先物取引業 | 12.40% |
| 3 | 機械 | 11.70% |
| 4 | 輸送用機器 | 9.40% |
| 5 | 食料品 | 5.33% |

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 | スパークスグループ | 株式 | 日本 | 証券、商品先物取引業 | 11.33% |
| 2 | 日本電産 | 株式 | 日本 | 電気機器 | 4.17% |
| 3 | 第一生命保険 | 株式 | 日本 | 保険業 | 2.91% |
| 4 | 平田機工 | 株式 | 日本 | 機械 | 2.70% |
| 5 | ソニー | 株式 | 日本 | 電気機器 | 2.01% |
| 6 | 三菱商事 | 株式 | 日本 | 卸売業 | 1.86% |
| 7 | いちご | 株式 | 日本 | 不動産業 | 1.74% |
| 8 | 本田技研工業 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 1.71% |
| 9 | スズキ | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 1.67% |
| 10 | ソフトバンクグループ | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.59% |

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、2009年は設定日から年末までの収益率、および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】

1【財務諸表】

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

<追加>

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

【中間財務諸表】

D I A Mアジア関連日本株ファンド

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

| | 第7期 平成28年3月1日現在 | 第8期中間計算期間末 平成28年9月1日現在 |
|-----------------|--------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 104,194,402 | - |
| コール・ローン | - | 96,369,293 |
| 株式 | 1,087,214,610 | 1,015,482,990 |
| 派生商品評価勘定 | - | 1,533,056 |
| 未収入金 | 16,241,987 | 15,060,027 |
| 未収配当金 | 950,600 | 481,700 |
| 前払金 | 16,282,268 | - |
| 差入委託証拠金 | 5,457,732 | 3,508,056 |
| 流動資産合計 | 1,230,341,599 | 1,132,435,122 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 15,407,268 | - |
| 前受金 | - | 1,023,056 |
| 未払金 | 20,724,992 | 17,060,614 |
| 未払解約金 | 1,629,249 | 206,266 |
| 未払受託者報酬 | 639,486 | 512,207 |
| 未払委託者報酬 | 11,511,401 | 9,220,590 |
| その他未払費用 | 37,892 | 15,788 |
| 流動負債合計 | 49,950,288 | 28,038,521 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,714,892,508 | 1,629,055,553 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 465,498,803 | 475,341,048 |
| (分配準備積立金) | 76,934,480 | 62,834,185 |
| 元本等合計 | 1,180,391,311 | 1,104,396,601 |
| 純資産合計 | 1,180,391,311 | 1,104,396,601 |
| 負債純資産合計 | 1,230,341,599 | 1,132,435,122 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第7期中間計算期間 自 平成27年3月3日 至 平成27年9月2日 | 第8期中間計算期間 自 平成28年3月2日 至 平成28年9月1日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 19,513,430 | 12,890,939 |
| 受取利息 | 157,459 | 3 |
| 有価証券売買等損益 | 116,475,005 | 77,884,149 |
| 派生商品取引等損益 | 24,828,676 | 1,220,580 |
| その他収益 | 131 | 162 |
| 営業収益合計 | 160,974,701 | 89,554,673 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | - | 27,054 |
| 受託者報酬 | 951,667 | 512,207 |
| 委託者報酬 | 17,130,820 | 9,220,590 |
| その他費用 | 56,414 | 15,788 |
| 営業費用合計 | 18,138,901 | 9,775,639 |
| 営業利益又は営業損失() | 142,835,800 | 79,779,034 |
| 経常利益又は経常損失() | 142,835,800 | 79,779,034 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 142,835,800 | 79,779,034 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額() | 89,629,896 | 18,299,712 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 1,335,146,256 | 465,498,803 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 152,553,512 | 37,070,868 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 152,553,512 | 37,070,868 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 689,906,156 | 88,707,945 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 689,906,156 | 88,707,945 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 850,999,516 | 475,341,048 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 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。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第7期 平成28年3月1日現在 | 第8期中間計算期間末 平成28年9月1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 | 1,435,224,820円 186,289,088円 906,621,400円 | 714,892,508円 49,613,471円 135,450,426円 |
| 2. 受益権の総数 | 714,892,508口 | 629,055,553口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第7期 平成28年3月1日現在 | 第8期中間計算期間末 平成28年9月1日現在 |
|----------------------------|--|---------------------------|
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

| 種類 | 第7期 平成28年3月1日現在 | | | | 第8期中間計算期間末 平成28年9月1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 | 106,440,000 | - | 91,035,000 | 15,405,000 | 78,805,000 | - | 80,340,000 | 1,535,000 |
| 合計 | 106,440,000 | - | 91,035,000 | 15,405,000 | 78,805,000 | - | 80,340,000 | 1,535,000 |

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 第7期 平成28年3月1日現在 | 第8期中間計算期間末 平成28年9月1日現在 |
|--------------|--------------------|---------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.6511円 | 1.7556円 |
| (1万口当たり純資産額) | (16,511円) | (17,556円) |

2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

平成28年9月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,119,533,995円 |
| 負債総額 | 53,401,308円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,066,132,687円 |
| 発行済数量 | 607,018,833口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.7563円 |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

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

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

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

（ご参考）

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

・みずほ投信投資顧問株式会社

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

・新光投信株式会社

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

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月19日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
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D I A Mアジア関連日本株ファンドの平成28年3月2日から平成28年9月1日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアジア関連日本株ファンドの平成28年9月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年3月2日から平成28年9月1日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

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

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。