

【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9月16日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【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中国A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3月16日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

（４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

（略）

<基準価額の照会方法等>

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：中国A株）

<訂正後>

（略）

<基準価額の照会方法等>

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（当ファンドの略称：中国A株）

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】

(3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(略)

資本金の額

20億円（平成27年12月30日現在）

(略)

大株主の状況

（平成27年12月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
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	12,000株	50.0%

< 訂正後 >

(略)

資本金の額

20億円（平成28年6月30日現在）

(略)

大株主の状況

（平成28年6月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
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	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(3)【運用体制】

< 訂正前 >

(略)

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成27年12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。

< 訂正後 >

(略)

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成28年6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】

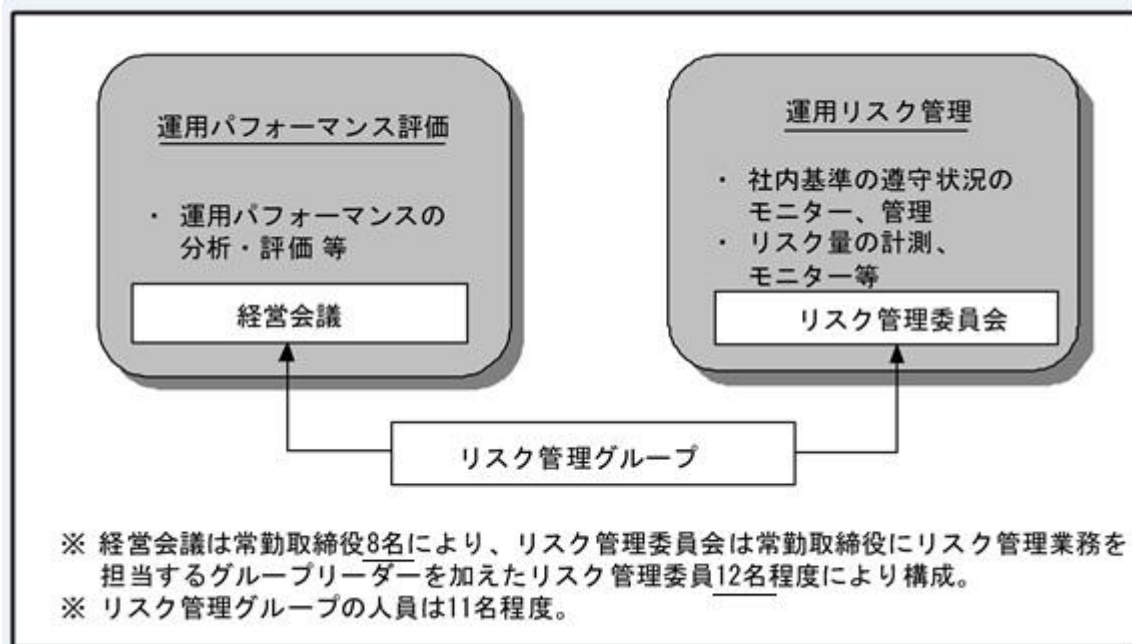
<訂正前>

(略)

中国A株投資における留意点（平成27年12月末現在）

(略)

<運用評価・運用リスク管理体制>



(略)

上記体制は平成27年12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。

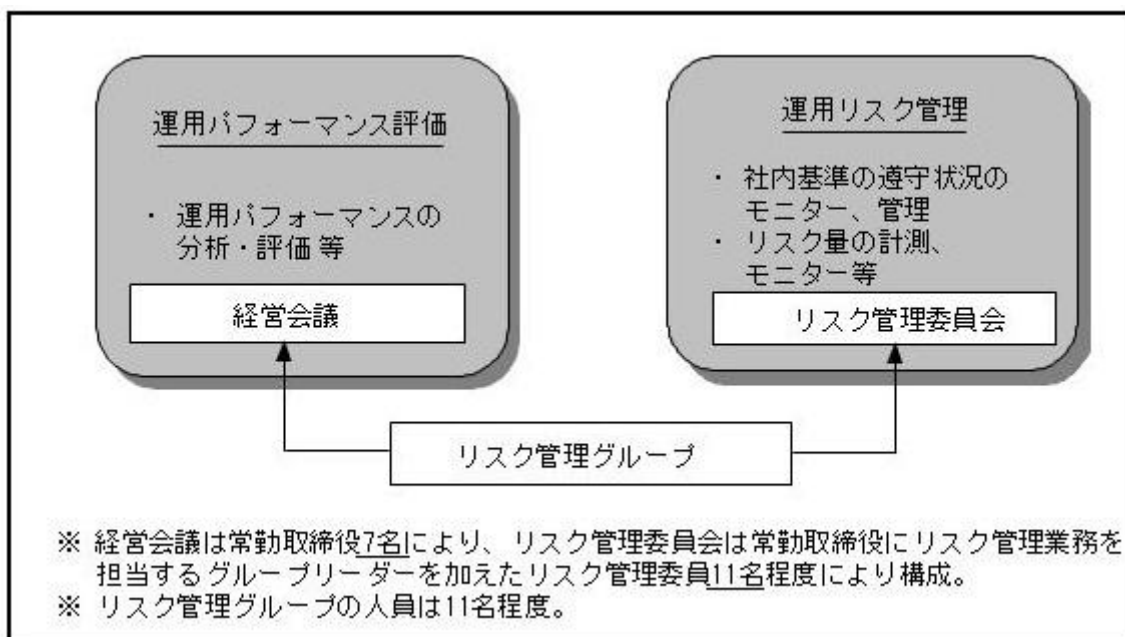
<訂正後>

(略)

中国A株投資における留意点（平成28年6月末現在）

(略)

<運用評価・運用リスク管理体制>



(略)

上記体制は平成28年6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。

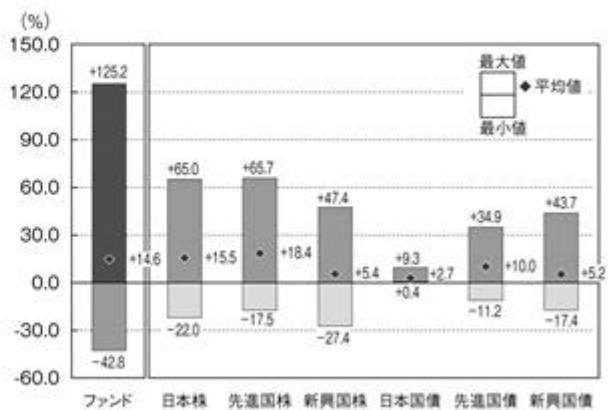
<更新・訂正後>

（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



ファンド：2011年12月～2016年6月

代表的な資産クラス：2011年7月～2016年6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・ディバースィファイド(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、知的所有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・ディバースィファイド」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)

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合

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

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

(略)

<訂正後>

(略)

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

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

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

上記は、平成28年6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6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	2,195,391,048	99.59
内 日本	2,195,391,048	99.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,013,378	0.41
純資産総額	2,204,404,426	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）

D I A M中国株式（除くA株）マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	267,865,442	95.00
内 ケイマン諸島	106,692,642	37.84
内 中国	98,472,628	34.93
内 香港	58,058,510	20.59
内 バミューダ	3,302,270	1.17
内 シンガポール	1,339,392	0.48
投資証券	5,811,923	2.06
内 シンガポール	3,308,104	1.17
内 香港	2,503,819	0.89
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,272,128	2.93
純資産総額	281,949,493	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中国A株マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,856,926,633	97.05
内 中国	1,856,926,633	97.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	56,449,715	2.95
純資産総額	1,913,376,348	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6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	D I A M中国A株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,523,688,265	1.7323 2,639,637,550	1.2558 1,913,447,723	- -	86.80%
2	D I A M中国株式(除くA株)マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	268,364,102	1.2905 346,350,710	1.0506 281,943,325	- -	12.79%

(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6月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.59%
合計	99.59%

(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)

D I A M中国株式（除くA株）マザーファンド

平成28年6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	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	20,400	1,958.51 39,953,775	2,286.02 46,634,889	- -	16.54%
2	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	19,000	1,155.70 21,958,420	1,162.90 22,095,138	- -	7.84%
3	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	313,000	68.31 21,381,880	66.69 20,876,411	- -	7.40%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	2,345	8,077.88 18,942,634	8,031.09 18,832,921	- -	6.68%
5	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	287,000	59.12 16,969,476	56.22 16,135,828	- -	5.72%
6	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	294,000	44.03 12,946,790	40.17 11,812,273	- -	4.19%
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	22,000	550.95 12,120,966	445.53 9,801,792	- -	3.48%
8	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	67,000	106.04 7,105,033	123.98 8,306,727	- -	2.95%
9	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME 香港	株式 不動産管理・ 開発	26,000	337.45 8,773,905	305.64 7,946,718	- -	2.82%
10	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	395	17,567.68 6,939,235	16,919.43 6,683,176	- -	2.37%
11	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	88,600	58.09 5,147,413	72.39 6,414,604	- -	2.28%
12	AIA GROUP LTD 香港	株式 保険	8,000	596.51 4,772,149	595.37 4,762,992	- -	1.69%
13	MINIH GROUP LTD ケイマン諸島	株式 自動車部品	14,000	184.74 2,586,440	323.54 4,529,616	- -	1.61%
14	GUANGDONG INVESTMENTS LTD 香港	株式 水道	28,000	144.25 4,039,091	148.77 4,165,761	- -	1.48%

15	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・カタログ販売	978	4,544.65 4,444,672	4,167.85 4,076,162	- -	1.45%
16	PETRO CHINA CO LTD 中国	株式 石油・ガス・消耗燃料	58,000	66.95 3,883,326	68.68 3,983,834	- -	1.41%
17	HAITONG SECURITIES CO LTD 中国	株式 資本市場	22,400	170.52 3,819,668	170.25 3,813,788	- -	1.35%
18	CITIC SECURITIES CO LTD 中国	株式 資本市場	16,500	227.89 3,760,294	225.42 3,719,430	- -	1.32%
19	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	194	17,761.18 3,445,669	18,676.10 3,623,164	- -	1.29%
20	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H 中国	株式 情報技術サービス	17,000	194.14 3,300,531	198.90 3,381,300	- -	1.20%
21	FORTUNE REAL ESTATE (HK) シンガポール	投資証券 -	27,000	118.04 3,187,157	122.52 3,308,104	- -	1.17%
22	CHINA GAS HOLDINGS LTD バミューダ	株式 ガス	22,000	136.31 2,998,881	150.10 3,302,270	- -	1.17%
23	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	15,000	331.50 4,972,500	217.99 3,269,916	- -	1.16%
24	CHINA RESOURCES LAND LTD ケイマン諸島	株式 不動産管理・開発	14,000	279.32 3,910,541	228.86 3,204,146	- -	1.14%
25	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・カタログ販売	1,445	2,992.86 4,324,689	2,098.33 3,032,093	- -	1.08%
26	TECHTRONIC INDUSTRIES CO 香港	株式 家庭用耐久財	7,000	407.87 2,855,115	419.01 2,933,112	- -	1.04%
27	ENN ENERGY HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 ガス	6,000	475.74 2,854,450	488.63 2,931,786	- -	1.04%
28	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH ケイマン諸島	株式 各種消費者サービス	662	3,247.12 2,149,596	4,294.43 2,842,915	- -	1.01%
29	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP 中国	株式 建設・土木	21,000	136.53 2,867,226	125.17 2,628,662	- -	0.93%
30	LINK REIT 香港	投資証券 -	3,500	681.66 2,385,839	715.37 2,503,819	- -	0.89%

(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6月30日現在

種類	投資比率
株式	95.00%
投資証券	2.06%
合計	97.07%

（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6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
インターネットソフトウェア・サービス	外国	27.73%
商業銀行		17.32%
無線通信サービス		7.84%
石油・ガス・消耗燃料		6.63%
保険		6.33%
不動産管理・開発		3.95%
資本市場		2.67%
インターネット販売・カタログ販売		2.52%
ガス		2.21%
建設・土木		2.18%
自動車		1.65%
自動車部品		1.61%
水道		1.48%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.39%
情報技術サービス		1.20%
電子装置・機器・部品		1.19%
家庭用耐久財		1.04%
各種消費者サービス		1.01%
各種電気通信サービス		0.81%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.77%
電力		0.75%
建設資材		0.64%
旅客航空輸送業		0.59%
機械		0.52%
医薬品		0.51%
商社・流通業		0.48%
合計		95.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

D I A M中国A株マザーファンド

平成28年6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	CHINA VANKE CO LTD 中国	株式 不動産管理・ 開発	225,300	326.95 73,662,015	378.90 85,368,265	- -	4.46%
2	PING AN INSURANCE GROUP CHINA 中国	株式 保険	157,400	546.88 86,079,321	498.80 78,511,371	- -	4.10%
3	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD 中国	株式 商業銀行	429,860	134.52 57,824,959	141.76 60,937,555	- -	3.18%
4	INDUSTRIAL BANK CO LTD 中国	株式 商業銀行	193,387	246.32 47,636,355	237.45 45,921,309	- -	2.40%
5	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD 中国	株式 商業銀行	148,100	264.13 39,118,437	270.64 40,083,190	- -	2.09%
6	KWEICHOW MOUTAI CO LTD 中国	株式 飲料	8,460	3,405.22 28,808,176	4,469.67 37,813,423	- -	1.98%
7	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK 中国	株式 商業銀行	147,070	258.17 37,969,208	240.40 35,356,363	- -	1.85%
8	HAITONG SECURITIES CO LTD 中国	株式 資本市場	128,000	243.50 31,168,896	239.62 30,672,576	- -	1.60%
9	CITIC SECURITIES CO LTD/CHINA 中国	株式 資本市場	120,900	290.34 35,102,976	250.64 30,302,569	- -	1.58%
10	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD 中国	株式 商業銀行	341,900	94.74 32,393,763	87.01 29,749,095	- -	1.55%
11	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	556,300	48.21 26,821,384	49.32 27,437,717	- -	1.43%
12	BANK OF BEIJING CO LTD 中国	株式 商業銀行	148,420	156.25 23,191,490	160.99 23,894,699	- -	1.25%
13	INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL 中国	株式 食品	89,650	231.87 20,787,548	255.29 22,887,160	- -	1.20%
14	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BK OF CHINA 中国	株式 商業銀行	318,200	70.02 22,283,348	68.55 21,813,946	- -	1.14%
15	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC 中国	株式 家庭用耐久財	73,164	329.43 24,102,592	298.10 21,810,349	- -	1.14%
16	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD 中国	株式 保険	49,700	420.65 20,906,523	417.21 20,735,784	- -	1.08%
17	CRRC CORP LTD 中国	株式 機械	139,610	196.81 27,477,512	143.31 20,007,844	- -	1.05%

18	MIDEA GROUP CO LTD 中国	株式 家庭用耐久財	49,800	299.79 14,929,724	362.46 18,050,941	- -	0.94%
19	CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING 中国	株式 建設・土木	216,900	95.32 20,675,985	82.66 17,930,754	- -	0.94%
20	WULIANGYE YIBIN CO LTD 中国	株式 飲料	33,800	408.71 13,814,454	499.26 16,875,221	- -	0.88%
21	SAIC MOTOR CORP LTD 中国	株式 自動車	51,800	315.46 16,340,883	312.83 16,204,941	- -	0.85%
22	HUATAI SECURITIES CO LTD 中国	株式 資本市場	55,900	312.15 17,449,233	287.55 16,074,346	- -	0.84%
23	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	307,200	61.96 19,035,938	49.47 15,199,303	- -	0.79%
24	CHINA YANGTZE POWER CO LTD 中国	株式 独立系発電事 業者・エネル ギー販売業者	77,000	196.20 15,108,015	192.63 14,832,833	- -	0.78%
25	JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD 中国	株式 医薬品	23,096	643.41 14,860,373	625.05 14,436,224	- -	0.75%
26	PING AN BANK CO LTD 中国	株式 商業銀行	105,120	154.06 16,195,417	134.78 14,168,273	- -	0.74%
27	CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD 中国	株式 機械	140,600	142.91 20,093,451	99.57 14,000,132	- -	0.73%
28	CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD 中国	株式 商業銀行	232,700	65.60 15,266,818	58.00 13,498,321	- -	0.71%
29	GF SECURITIES CO LTD 中国	株式 資本市場	51,800	247.35 12,813,148	258.70 13,401,012	- -	0.70%
30	PEOPLE.CN CO LTD 中国	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	51,100	257.08 13,136,939	257.93 13,180,289	- -	0.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年6月30日現在

種類	投資比率
株式	97.05%
合計	97.05%

(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6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	19.24%
資本市場		10.69%
不動産管理・開発		6.73%
保険		5.96%
医薬品		4.13%
機械		3.82%
飲料		3.81%
家庭用耐久財		3.48%
建設・土木		3.11%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		2.95%
金属・鉱業		2.65%
石油・ガス・消耗燃料		2.54%
自動車		2.20%
食品		1.98%
メディア		1.95%
化学		1.87%
電気設備		1.81%
ソフトウェア		1.73%
航空宇宙・防衛		1.49%
電子装置・機器・部品		1.28%
通信機器		1.07%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.05%
旅客航空輸送業		1.04%
コンピュータ・周辺機器		0.83%
水道		0.71%
インターネットソフトウェア・サービス		0.69%
専門小売り		0.66%
自動車部品		0.65%
運送インフラ		0.64%
陸運・鉄道		0.64%
バイオテクノロジー		0.60%
建設資材		0.58%
情報技術サービス		0.55%
ホテル・レストラン・レジャー		0.55%
食品・生活必需品小売り		0.48%
各種金融サービス		0.40%
半導体・半導体製造装置		0.38%
各種電気通信サービス		0.31%
繊維・アパレル・贅沢品		0.30%
無線通信サービス		0.26%
コングロマリット		0.25%
エネルギー設備・サービス	0.24%	
レジャー用品	0.23%	
販売	0.20%	
パーソナル用品	0.20%	
海運業	0.15%	
合計		97.05%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成28年6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23年12月16日)	5,272	5,272	0.7480	0.7480
第2計算期間末 (平成24年12月17日)	4,634	4,634	0.8973	0.8973
第3計算期間末 (平成25年12月16日)	3,395	3,395	1.1162	1.1162
第4計算期間末 (平成26年12月16日)	3,213	3,213	1.5170	1.5170
第5計算期間末 (平成27年12月16日)	3,287	3,287	1.6117	1.6117
平成27年6月末日	4,029	-	1.9059	-
7月末日	3,771	-	1.7828	-
8月末日	3,117	-	1.4975	-
9月末日	2,949	-	1.4235	-
10月末日	3,278	-	1.5788	-
11月末日	3,244	-	1.5930	-
12月末日	3,215	-	1.6376	-
平成28年1月末日	2,481	-	1.2706	-
2月末日	2,394	-	1.2336	-
3月末日	2,543	-	1.3338	-
4月末日	2,416	-	1.2785	-
5月末日	2,343	-	1.2425	-
6月末日	2,204	-	1.1782	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
平成27年12月17日～ 平成28年6月16日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	25.2
第2計算期間	20.0
第3計算期間	24.4
第4計算期間	35.9
第5計算期間	6.2
平成27年12月17日～ 平成28年6月16日	25.5

(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	12,352,579,111	5,304,518,161
第2計算期間	1,422,278,002	3,305,709,416
第3計算期間	742,307,848	2,864,722,008
第4計算期間	200,097,521	1,123,697,212
第5計算期間	652,265,839	730,867,337
平成27年12月17日～ 平成28年6月16日	2,053,430	171,008,362

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

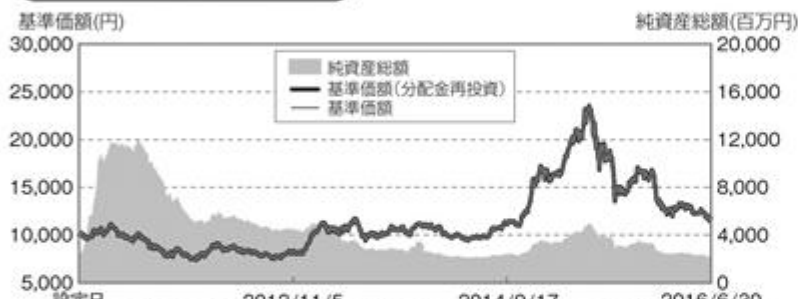
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年6月30日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2010年12月30日)~2016年6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:2010年12月30日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第1期	(2011.12.16)	0円
第2期	(2012.12.17)	0円
第3期	(2013.12.16)	0円
第4期	(2014.12.16)	0円
第5期	(2015.12.16)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(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	DIAM中国A株マザーファンド	86.80%
2	DIAM中国株式(除くA株)マザーファンド	12.79%

■DIAM中国A株マザーファンド

(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	97.05
内 中国	97.05
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.95
純資産総額	100.00

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	19.24%
2	資本市場	10.69%
3	不動産管理・開発	6.73%
4	保険	5.96%
5	医薬品	4.13%

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	CHINA VANKE CO LTD	株式	中国	不動産管理・開発	4.46%
2	PING AN INSURANCE GROUP CHINA	株式	中国	保険	4.10%
3	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	株式	中国	商業銀行	3.18%
4	INDUSTRIAL BANK CO LTD	株式	中国	商業銀行	2.40%
5	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	株式	中国	商業銀行	2.09%
6	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	株式	中国	飲料	1.98%
7	SHANGHAI PUJONG DEVELOPMENT BANK	株式	中国	商業銀行	1.85%
8	HAITONG SECURITIES CO LTD	株式	中国	資本市場	1.60%
9	CITIC SECURITIES CO LTD/CHINA	株式	中国	資本市場	1.58%
10	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	株式	中国	商業銀行	1.55%

■DIAM中国株式(除くA株)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	95.00
内 ケイマン諸島	37.84
内 中国	34.93
内 香港	20.59
内 ハミューダ	1.17
内 シンガポール	0.48
投資証券	2.06
内 シンガポール	1.17
内 香港	0.89
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.93
純資産総額	100.00

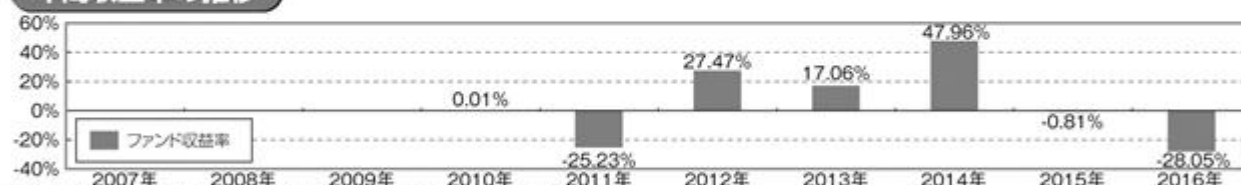
組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	インターネットソフトウェアサービス	27.73%
2	商業銀行	17.32%
3	無線通信サービス	7.84%
4	石油・ガス・消耗燃料	6.63%
5	保険	6.33%

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	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェアサービス	16.54%
2	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	7.84%
3	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	商業銀行	7.40%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェアサービス	6.68%
5	IND & COMM BK OF CHINA - H	株式	中国	商業銀行	5.72%
6	BANK OF CHINA LTD	株式	中国	商業銀行	4.19%
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	株式	中国	保険	3.48%
8	CNOOC LTD	株式	香港	石油・ガス・消耗燃料	2.95%
9	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	株式	香港	不動産管理・開発	2.82%
10	BAIDU INC -SPON ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェアサービス	2.37%

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2010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2【管理及び運営】

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

中国のQ F I I（適格国外機関投資家）制度において、中国からの回金には一定の制約事項が付されています（平成27年12月末現在）。これにより、解約に伴う支払い資金の不足が予想される場合には、委託会社の判断で、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことがあります。

（略）

<訂正後>

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

中国のQ F I I（適格国外機関投資家）制度において、中国からの回金には一定の制約事項が付されています（平成28年6月末現在）。これにより、解約に伴う支払い資金の不足が予想される場合には、委託会社の判断で、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことがあります。

（略）

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27年12月17日から平成28年6月16日まで）の中間財務諸表について、P w C 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中国A株ファンド

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第5期 平成27年12月16日現在	第6期中間計算期間末 平成28年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,937,098	42,995,051
親投資信託受益証券	3,220,175,796	2,236,772,821
流動資産合計	3,324,112,894	2,279,767,872
資産合計	3,324,112,894	2,279,767,872
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,411	5,929,500
未払受託者報酬	1,904,186	1,375,267
未払委託者報酬	34,276,050	24,755,743
その他未払費用	99,587	61,162
流動負債合計	36,287,234	32,121,672
負債合計	36,287,234	32,121,672
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,040,014,187	1 1,871,059,255
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	1,247,811,473	376,586,945
(分配準備積立金)	734,367,299	672,829,054
元本等合計	3,287,825,660	2,247,646,200
純資産合計	3,287,825,660	2,247,646,200
負債純資産合計	3,324,112,894	2,279,767,872

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第5期中間計算期間 自 平成26年12月17日 至 平成27年6月16日	第6期中間計算期間 自 平成27年12月17日 至 平成28年6月16日
営業収益		
受取利息	23,107	6,868
有価証券売買等損益	1,601,820,885	768,402,975
営業収益合計	1,601,843,992	768,396,107
営業費用		
支払利息	-	8,040
受託者報酬	2,064,456	1,375,267
委託者報酬	37,161,148	24,755,743
その他費用	147,008	61,244
営業費用合計	39,372,612	26,200,294
営業利益又は営業損失（ ）	1,562,471,380	794,596,401
経常利益又は経常損失（ ）	1,562,471,380	794,596,401
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,562,471,380	794,596,401
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（ ）	144,880,309	27,290,662
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,095,272,302	1,247,811,473
剰余金増加額又は欠損金減少額	408,886,810	666,739
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	408,886,810	666,739
剰余金減少額又は欠損金増加額	204,294,363	104,585,528
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	204,294,363	104,585,528
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,717,455,820	376,586,945

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
---------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期 平成27年12月16日現在	第6期中間計算期間末 平成28年6月16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	2,118,615,685円 652,265,839円 730,867,337円	2,040,014,187円 2,053,430円 171,008,362円
2 . 受益権の総数	2,040,014,187口	1,871,059,255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5期 平成27年12月16日現在	第6期中間計算期間末 平成28年6月16日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 平成27年12月16日現在	第6期中間計算期間末 平成28年6月16日現在
1口当たり純資産額	1,6117円	1,2013円
（1万口当たり純資産額）	（16,117円）	（12,013円）

（参考）

当ファンドは、「D I A M中国株式（除くA株）マザーファンド」受益証券及び「D I A M中国A株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「D I A M中国株式（除くA株）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27年12月16日現在	平成28年6月16日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,939,253	1,459,672
コール・ローン		5,438,138	2,131,084
株式		444,570,223	279,352,552
投資証券		-	2,147,602
派生商品評価勘定		21,394	3,725
未収入金		22,035,772	4,400,676
未収配当金		118,685	1,382,898
流動資産合計		476,123,465	290,878,209
資産合計		476,123,465	290,878,209
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		18,988	3,382
未払金		22,688,544	4,432,459
流動負債合計		22,707,532	4,435,841
負債合計		22,707,532	4,435,841
純資産の部			
元本等			
元本	1	351,320,362	268,364,102
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		102,095,571	18,078,266
元本等合計		453,415,933	286,442,368
純資産合計		453,415,933	286,442,368
負債純資産合計		476,123,465	290,878,209

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>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。</p> <p>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。</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 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 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27年12月16日現在	平成28年6月16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	211,757,112円	351,320,362円
同期中追加設定元本額	247,995,532円	- 円
同期中一部解約元本額	108,432,282円	82,956,260円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M中国A株ファンド	351,320,362円	268,364,102円
計	351,320,362円	268,364,102円
2 . 受益権の総数	351,320,362口	268,364,102口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年12月16日現在	平成28年6月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年12月16日 現在				平成28年6月16日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	4,239,856	-	4,258,844	18,988	848,742	-	845,017	3,725
香港・ドル	4,239,856	-	4,258,844	18,988	848,742	-	845,017	3,725
買 建	4,239,856	-	4,261,250	21,394	848,742	-	845,360	3,382
アメリカ・ドル	4,239,856	-	4,261,250	21,394	848,742	-	845,360	3,382
合計	8,479,712	-	8,520,094	2,406	1,697,484	-	1,690,377	343

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年12月16日現在	平成28年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.2906円	1.0674円
（1万口当たり純資産額）	(12,906円)	(10,674円)

「D I A M中国A株マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年12月16日現在	平成28年6月16日現在
資産の部			
流動資産			
預金		37,737,954	35,987,040
コール・ローン		15,267,182	15,980,957
株式		2,713,764,282	1,898,228,523
未収配当金		-	139,175
流動資産合計		2,766,769,418	1,950,335,695
資産合計		2,766,769,418	1,950,335,695
負債の部			
流動負債			
未払金		-	3,980
流動負債合計		-	3,980
負債合計		-	3,980
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,597,068,655	1,523,688,265
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		1,169,700,763	426,643,450
元本等合計		2,766,769,418	1,950,331,715
純資産合計		2,766,769,418	1,950,331,715
負債純資産合計		2,766,769,418	1,950,335,695

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 . 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。
3 . 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27年12月16日現在	平成28年6月16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	1,774,443,604円	1,597,068,655円
同期中追加設定元本額	47,380,890円	- 円
同期中一部解約元本額	224,755,839円	73,380,390円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M中国A株ファンド	1,597,068,655円	1,523,688,265円
計	1,597,068,655円	1,523,688,265円
2 . 受益権の総数	1,597,068,655口	1,523,688,265口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年12月16日現在	平成28年6月16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）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成27年12月16日現在	平成28年6月16日現在
1口当たり純資産額	1,7324円	1,2800円
（1万口当たり純資産額）	（17,324円）	（12,800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6月30日現在

資産総額	2,206,230,292円
負債総額	1,825,866円
純資産総額（ - ）	2,204,404,426円
発行済数量	1,870,946,114口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1782円

（参考）

D I A M中国株式（除くA株）マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	281,949,493円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	281,949,493円
発行済数量	268,364,102口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0506円

D I A M中国A株マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	1,913,376,348円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	1,913,376,348円
発行済数量	1,523,688,265口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2558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

本書提出日現在の資本金の額 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 24,000株（普通株式 24,000株）

種類株式の発行が可能

直近5ヵ年の資本金の変動：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

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、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

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これにあたります。

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。

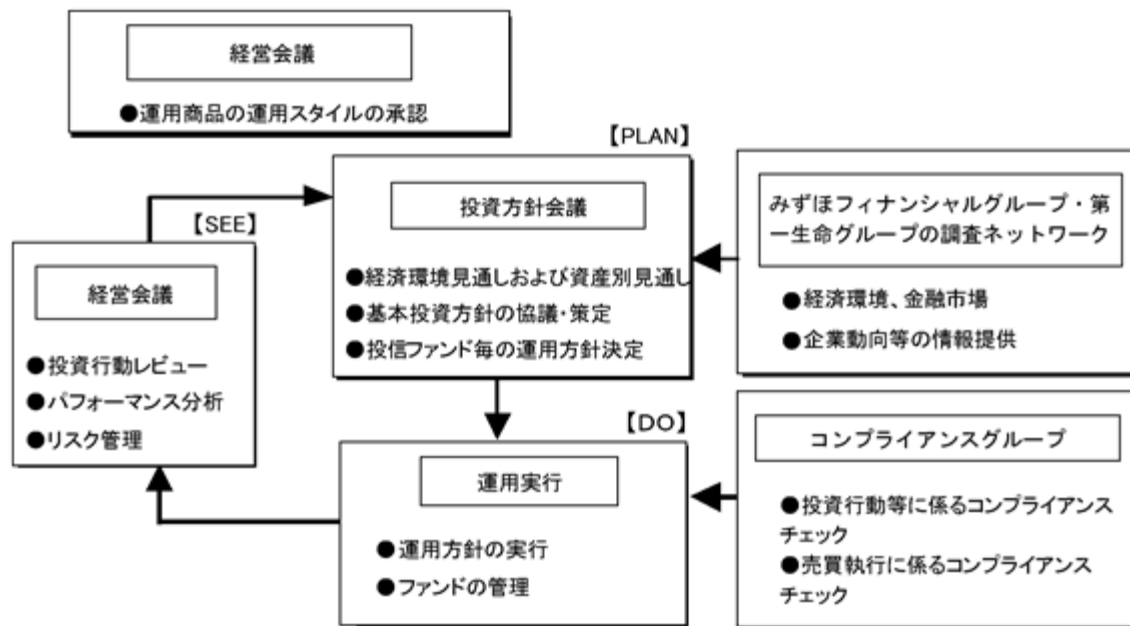
投資運用の意思決定機構

委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見通しおよび資産別市場見通しならびにファンド毎の運用方針は、投資方針会議において協議し、策定します。投資方針会議は原則として月1回開催され、議長は運用部門担当取締役とします。

各ファンドにおける有価証券の売買等の意思決定は、原則として運用担当者が行います。すなわち、運用担当者は、投資方針会議において決定された運用方針を受けて、各ファンドの投資方針に基づき運用計画を策定し、有価証券への運用指図を行います。

運用担当者による運用計画の策定および有価証券等の運用指図に関する意思決定は、運用担当者自身の調査活動、アナリスト等の調査活動、その他の活動によって得られた当該有価証券等に関する情報に基づいて行われ、それらの活動の成果である各ファンドの投資運用の実績は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月1回検討・評価されます。



上記体制は平成28年6月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

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>

委託会社は、「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り、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）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成28年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は428本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	6	74,158,972,183
追加型株式投資信託	379	5,885,771,137,238
単位型公社債投資信託	43	313,084,944,195
追加型公社債投資信託	0	0
合計	428	6,273,015,053,616

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。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第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	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								
	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	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					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	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	(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：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 定率法によっております。 (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。
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	(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。 (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。 (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 (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。
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 (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)
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 (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)
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 (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)
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	800,617	未払費用	308,974
								増資の引受	912,600	-	-
	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
	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 預金の預入 (純額) 受取利息	3,023,040 879,733 1,787	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	372,837 12,155,931 123
	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 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払 費用 未払金	292,861 7,581
	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) 信託報酬の 支払	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

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。

5【その他】

<訂正前>

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

・公告の方法の変更（電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。）に変更）

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

<訂正後>

(1) 定款の変更等

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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株式会社に変更する予定です（関係当局の認可等を前提とします）。

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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 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」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>

受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社SBI証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
あかつき証券株式会社	3,067	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
静岡東海証券株式会社	600	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社(1)	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
高木証券株式会社	11,069	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
むさし証券株式会社	5,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東洋証券株式会社	13,494	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
内藤証券株式会社	3,002	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社証券ジャパン	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
S M B Cフレンド証券株式会社	27,270	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

(1) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っていません。

投資顧問会社

a . 名称

DIAM SINGAPORE PTE. LTD.

b . 資本金の額

平成27年12月末日現在 1,100百万円

c . 事業の内容

シンガポールにおいて投資顧問業務を営んでいます。

第3【その他】

< 訂正前 >

（略）

(5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。

基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：中国A株）

< 訂正後 >

（略）

(5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。

基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（当ファンドの略称：中国A株）

独立監査人の中間監査報告書

平成28年7月20日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
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中国A株ファンドの平成27年12月17日から平成28年6月16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中国A株ファンドの平成28年6月16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27年12月17日から平成28年6月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[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。