

【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22日 |
| 【発行者名】 | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 西 恵正 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 上野 圭子 |
| 【電話番号】 | 03-6774-5100 |
| 【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券に係る ファンドの名称】 | D I A Mグローバル総合債券ファンド（毎月決算型） |
| 【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】 | 5,000億円を上限とします。 |
| 【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】

有価証券報告書の提出に伴い、平成28年6月23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】

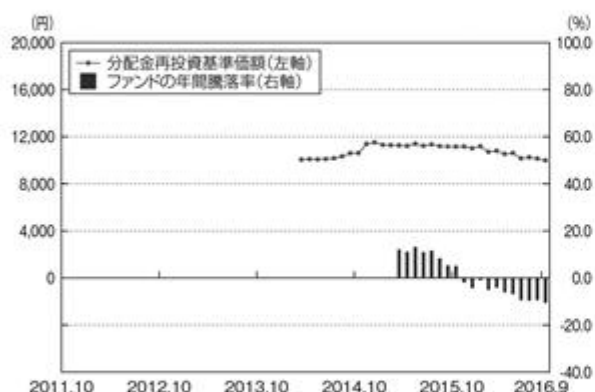
3【投資リスク】

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)

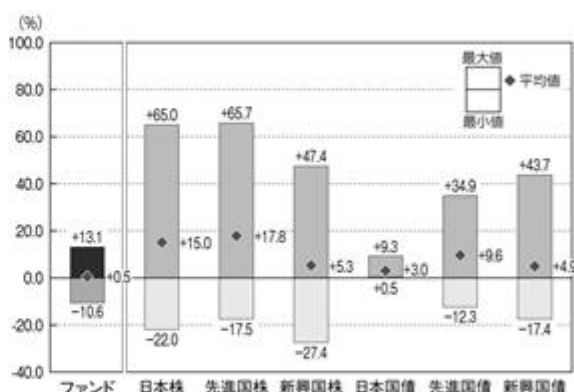
ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



*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。

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:2015年3月~2016年9月

代表的な資産クラス:2011年10月~2016年9月

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

日本株…… 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)

日本国債… NOMURA-BPI国債

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

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

●「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

●「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

●「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(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。

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)

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。

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9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 | 109,908,900 | 99.04 |
| 内 日本 | 109,908,900 | 99.04 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1,063,336 | 0.96 |
| 純資産総額 | 110,972,236 | 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)

グローバル総合債券マザーファンド

平成28年9月30日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|-------------|---------|
| 国債証券 | 174,195,663 | 80.02 |
| 内 アメリカ | 68,431,336 | 31.43 |
| 内 日本 | 37,818,931 | 17.37 |
| 内 ドイツ | 25,284,573 | 11.61 |
| 内 フランス | 15,304,619 | 7.03 |
| 内 スペイン | 7,415,211 | 3.41 |
| 内 ベルギー | 5,990,883 | 2.75 |
| 内 イタリア | 5,550,221 | 2.55 |
| 内 イギリス | 5,173,347 | 2.38 |

| | | | |
|-----------------------|--------|-------------|--------|
| | 内 カナダ | 3,226,542 | 1.48 |
| 特殊債券 | | 10,066,900 | 4.62 |
| | 内 日本 | 10,066,900 | 4.62 |
| 社債券 | | 20,271,121 | 9.31 |
| | 内 アメリカ | 20,271,121 | 9.31 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 13,168,836 | 6.05 |
| 純資産総額 | | 217,702,520 | 100.00 |

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年9月30日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|----------------------------|---------------|-------------|-----------------------|-----------------------|--------------|----------|
| 1 | グローバル総合債券マザー ファンド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 106,842,520 | 1.0256 109,588,372 | 1.0287 109,908,900 | - - | 99.04% |

(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 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.04% |
| 合計 | 99.04% |

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

グローバル総合債券マザーファンド

平成28年9月30日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|--|------|------------|----------------------|----------------------|------------------------|----------|
| 1 | DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 ドイツ | 国債証券 | 21,538,400 | 115.76 24,933,928 | 117.39 25,284,573 | 2.000000 2023/8/15 | 11.61% |
| 2 | US T N/B 2.0 02/28/21 アメリカ | 国債証券 | 23,257,600 | 102.64 23,873,461 | 103.90 24,166,041 | 2.000000 2021/2/28 | 11.10% |
| 3 | US T N/B 3.625 02/15/44 アメリカ | 国債証券 | 12,336,640 | 119.20 14,705,644 | 128.81 15,891,072 | 3.625000 2044/2/15 | 7.30% |
| 4 | US T N/B 1.125 04/30/20 アメリカ | 国債証券 | 14,156,800 | 99.25 14,050,624 | 100.57 14,238,626 | 1.125000 2020/4/30 | 6.54% |
| 5 | US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ | 国債証券 | 11,932,160 | 106.89 12,755,240 | 109.48 13,063,806 | 2.750000 2024/2/15 | 6.00% |
| 6 | CATERPILLAR INC 1.5 06/26/17 アメリカ | 社債券 | 10,112,000 | 100.39 10,152,346 | 100.36 10,149,313 | 1.500000 2017/6/26 | 4.66% |
| 7 | JPMORGAN CHASE & CO 1.35 02/15/17 アメリカ | 社債券 | 10,112,000 | 100.16 10,129,089 | 100.09 10,121,808 | 1.350000 2017/2/15 | 4.65% |
| 8 | 17回 政保日本政策投資銀行債券 日本 | 特殊債券 | 10,000,000 | 100.66 10,066,600 | 100.66 10,066,900 | 0.257000 2018/11/9 | 4.62% |
| 9 | FRANCE OAT 0.5 11/25/19 フランス | 国債証券 | 9,068,800 | 102.83 9,325,900 | 103.39 9,376,685 | 0.500000 2019/11/25 | 4.31% |
| 10 | BELGIUM 4.25 03/28/41 ベルギー | 国債証券 | 3,400,800 | 161.45 5,490,795 | 176.16 5,990,883 | 4.250000 2041/3/28 | 2.75% |
| 11 | FRANCE OAT 0.5 05/25/25 フランス | 国債証券 | 5,668,000 | 100.95 5,721,902 | 104.58 5,927,934 | 0.500000 2025/5/25 | 2.72% |
| 12 | ITALY BTPS 2.5 05/01/19 イタリア | 国債証券 | 5,214,560 | 107.45 5,603,149 | 106.43 5,550,221 | 2.500000 2019/5/1 | 2.55% |
| 13 | 334回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 5,150,000 | 106.56 5,488,200 | 106.26 5,472,596 | 0.600000 2024/6/20 | 2.51% |
| 14 | 126回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 5,350,000 | 101.59 5,435,244 | 101.53 5,431,962 | 0.100000 2020/12/20 | 2.50% |
| 15 | UK TREASURY 3.25 01/22/44 イギリス | 国債証券 | 3,668,000 | 119.23 4,373,723 | 141.03 5,173,347 | 3.250000 2044/1/22 | 2.38% |
| 16 | SPAIN 4.8 01/31/24 スペイン | 国債証券 | 2,834,000 | 127.31 3,608,248 | 130.85 3,708,430 | 4.800000 2024/1/31 | 1.70% |
| 17 | 343回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,600,000 | 102.90 3,704,606 | 101.96 3,670,560 | 0.100000 2026/6/20 | 1.69% |
| 18 | CANADA 1.5 06/01/23 カナダ | 国債証券 | 3,072,400 | 102.83 3,159,410 | 105.01 3,226,542 | 1.500000 2023/6/1 | 1.48% |
| 19 | 151回 利付国庫債券(20年) 日本 | 国債証券 | 2,750,000 | 116.95 3,216,185 | 116.34 3,199,460 | 1.200000 2034/12/20 | 1.47% |

| | | | | | | | |
|----|--------------------------------|------|-----------|---------------------|---------------------|------------------------|-------|
| 20 | 157回 利付国庫債券(20年) 日本 | 国債証券 | 2,900,000 | 98.95 2,869,749 | 97.14 2,817,176 | 0.200000 2036/6/20 | 1.29% |
| 21 | 291回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,600,000 | 102.70 2,670,237 | 102.37 2,661,852 | 1.300000 2018/3/20 | 1.22% |
| 22 | SPAIN 5.15 10/31/44 スペイン | 国債証券 | 1,473,680 | 150.65 2,220,231 | 168.90 2,489,148 | 5.150000 2044/10/31 | 1.14% |
| 23 | 302回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,250,000 | 105.33 2,369,942 | 104.60 2,353,522 | 1.400000 2019/6/20 | 1.08% |
| 24 | 124回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 1,850,000 | 101.43 1,876,529 | 101.38 1,875,641 | 0.100000 2020/6/20 | 0.86% |
| 25 | 147回 利付国庫債券(20年) 日本 | 国債証券 | 1,500,000 | 123.77 1,856,580 | 123.08 1,846,320 | 1.600000 2033/12/20 | 0.85% |
| 26 | 48回 利付国庫債券(30年) 日本 | 国債証券 | 1,400,000 | 125.96 1,763,458 | 125.95 1,763,356 | 1.400000 2045/9/20 | 0.81% |
| 27 | 42回 利付国庫債券(30年) 日本 | 国債証券 | 1,050,000 | 132.55 1,391,793 | 132.81 1,394,599 | 1.700000 2044/3/20 | 0.64% |
| 28 | SPAIN 2.75 04/30/19 スペイン | 国債証券 | 1,133,600 | 107.99 1,224,208 | 107.41 1,217,633 | 2.750000 2019/4/30 | 0.56% |
| 29 | 50回 利付国庫債券(30年) 日本 | 国債証券 | 1,100,000 | 112.72 1,239,979 | 109.67 1,206,403 | 0.800000 2046/3/20 | 0.55% |
| 30 | US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ | 国債証券 | 1,011,200 | 102.67 1,038,290 | 105.99 1,071,791 | 2.250000 2025/11/15 | 0.49% |

(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 |
|------|--------|
| 国債証券 | 80.02% |
| 特殊債券 | 4.62% |
| 社債券 | 9.31% |
| 合計 | 93.95% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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

| | 純資産総額 (分配落) (百万円) | 純資産総額 (分配付) (百万円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落)(円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付)(円) |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1特定期間末 (平成26年9月24日) | 270 | 270 | 1.0535 | 1.0545 |
| 第2特定期間末 (平成27年3月23日) | 126 | 127 | 1.1022 | 1.1082 |
| 第3特定期間末 (平成27年9月24日) | 152 | 152 | 1.0590 | 1.0620 |
| 第4特定期間末 (平成28年3月23日) | 134 | 134 | 0.9989 | 1.0019 |
| 第5特定期間末 (平成28年9月23日) | 110 | 110 | 0.9212 | 0.9227 |
| 平成27年9月末日 | 154 | - | 1.0611 | - |
| 10月末日 | 152 | - | 1.0567 | - |
| 11月末日 | 141 | - | 1.0552 | - |
| 12月末日 | 137 | - | 1.0378 | - |
| 平成28年1月末日 | 139 | - | 1.0514 | - |
| 2月末日 | 134 | - | 1.0036 | - |
| 3月末日 | 135 | - | 1.0086 | - |
| 4月末日 | 129 | - | 0.9820 | - |
| 5月末日 | 130 | - | 0.9881 | - |
| 6月末日 | 131 | - | 0.9445 | - |
| 7月末日 | 123 | - | 0.9513 | - |
| 8月末日 | 121 | - | 0.9394 | - |
| 9月末日 | 110 | - | 0.9236 | - |

【分配の推移】

| | 1口当たりの分配金(円) |
|--------|--------------|
| 第1特定期間 | 0.0030 |
| 第2特定期間 | 0.0220 |
| 第3特定期間 | 0.0300 |
| 第4特定期間 | 0.0180 |
| 第5特定期間 | 0.0090 |

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1特定期間 | 5.7 |
| 第2特定期間 | 6.7 |
| 第3特定期間 | 1.2 |
| 第4特定期間 | 4.0 |
| 第5特定期間 | 6.9 |

(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。ただし、第1特定期間については、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特定期間 | 280,581,595 | 23,620,283 |
| 第2特定期間 | 56,927,415 | 198,695,736 |
| 第3特定期間 | 38,247,136 | 9,525,478 |
| 第4特定期間 | 10,448,078 | 20,105,162 |
| 第5特定期間 | 7,188,555 | 21,335,970 |

(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(2014年3月25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:2014年3月25日)
※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

| | |
|-------------------|------|
| 第26期 (2016.05.23) | 15円 |
| 第27期 (2016.06.23) | 15円 |
| 第28期 (2016.07.25) | 15円 |
| 第29期 (2016.08.23) | 15円 |
| 第30期 (2016.09.23) | 15円 |
| 直近1年間累計 | 270円 |
| 設定来累計 | 820円 |

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄一覧

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名 | 投資比率 |
|----|------------------|--------|
| 1 | グローバル総合債券マザーファンド | 99.04% |

■グローバル総合債券マザーファンド

(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。

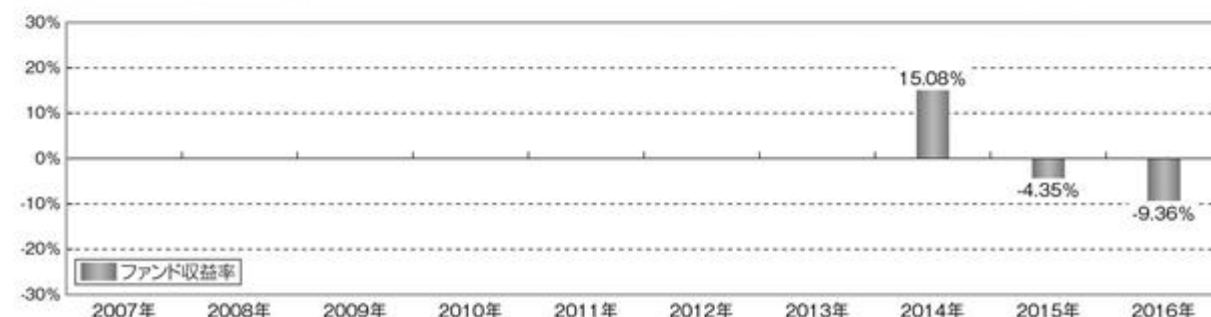
ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 国債証券 | 80.02 |
| 内 アメリカ | 31.43 |
| 内 日本 | 17.37 |
| 内 ドイツ | 11.61 |
| 内 フランス | 7.03 |
| 内 スペイン | 3.41 |
| 内 その他 | 9.17 |
| 特殊債券 | 4.62 |
| 内 日本 | 4.62 |
| 社債券 | 9.31 |
| 内 アメリカ | 9.31 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 6.05 |
| 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 | DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | 国債証券 | ドイツ | 2.000000 | 2023/8/15 | 11.61% |
| 2 | US T N/B 2.0 02/28/21 | 国債証券 | アメリカ | 2.000000 | 2021/2/28 | 11.10% |
| 3 | US T N/B 3.625 02/15/44 | 国債証券 | アメリカ | 3.625000 | 2044/2/15 | 7.30% |
| 4 | US T N/B 1.125 04/30/20 | 国債証券 | アメリカ | 1.125000 | 2020/4/30 | 6.54% |
| 5 | US T N/B 2.75 02/15/24 | 国債証券 | アメリカ | 2.750000 | 2024/2/15 | 6.00% |
| 6 | CATERPILLAR INC 1.5 08/26/17 | 社債券 | アメリカ | 1.500000 | 2017/8/26 | 4.66% |
| 7 | JPMORGAN CHASE & CO 1.35 02/15/17 | 社債券 | アメリカ | 1.350000 | 2017/2/15 | 4.65% |
| 8 | 17回 政保日本政策投資銀行債券 | 特殊債券 | 日本 | 0.257000 | 2018/11/9 | 4.62% |
| 9 | FRANCE OAT 0.5 11/25/19 | 国債証券 | フランス | 0.500000 | 2019/11/25 | 4.31% |
| 10 | BELGIUM 4.25 03/28/41 | 国債証券 | ベルギー | 4.250000 | 2041/3/28 | 2.75% |

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、2014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】

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3月24日から平成28年9月23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】

DIAMグローバル総合債券ファンド(毎月決算型)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

| | 前 期 平成28年3月23日現在 | 当 期 平成28年9月23日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 1,818,976 | - |
| コール・ローン | 73,056 | 1,366,447 |
| 親投資信託受益証券 | 132,761,214 | 109,588,372 |
| 流動資産合計 | 134,653,246 | 110,954,819 |
| 資産合計 | 134,653,246 | 110,954,819 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 402,772 | 180,165 |
| 未払受託者報酬 | 5,746 | 5,224 |
| 未払委託者報酬 | 135,802 | 123,551 |
| その他未払費用 | 522 | 412 |
| 流動負債合計 | 544,842 | 309,352 |
| 負債合計 | 544,842 | 309,352 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 134,257,565 | 120,110,150 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 2 149,161 | 2 9,464,683 |
| (分配準備積立金) | 1,365,331 | 285,179 |
| 元本等合計 | 134,108,404 | 110,645,467 |
| 純資産合計 | 134,108,404 | 110,645,467 |
| 負債純資産合計 | 134,653,246 | 110,954,819 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 前 期 自 平成27年9月25日 至 平成28年3月23日 | 当 期 自 平成28年3月24日 至 平成28年9月23日 |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 299 | - |
| 有価証券売買等損益 | 4,752,615 | 7,942,842 |
| 営業収益合計 | 4,752,316 | 7,942,842 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | - | 363 |
| 受託者報酬 | 37,780 | 34,122 |
| 委託者報酬 | 2,892,735 | 2,806,551 |
| その他費用 | 3,498 | 2,694 |
| 営業費用合計 | 934,013 | 843,730 |
| 営業利益又は営業損失() | 5,686,329 | 8,786,572 |
| 経常利益又は経常損失() | 5,686,329 | 8,786,572 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 5,686,329 | 8,786,572 |
| 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() | 185,346 | 14,123 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 8,485,220 | 149,161 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 588,913 | 1,122,158 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 1,122,158 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 588,913 | - |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,285,291 | 501,084 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,285,291 | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 501,084 |
| 分配金 | 1,243,020 | 1,164,147 |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 149,161 | 9,464,683 |

(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。 |
|--------------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 前 期 平成28年3月23日現在 | 当 期 平成28年9月23日現在 |
|------------|---|---|
| 1. 1 期首元本額 | 143,914,649円 | 134,257,565円 |
| 期中追加設定元本額 | 10,448,078円 | 7,188,555円 |
| 期中一部解約元本額 | 20,105,162円 | 21,335,970円 |
| 2. 受益権の総数 | 134,257,565口 | 120,110,150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149,161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9,464,683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9月25日 至 平成28年3月23日 | 当 期 自 平成28年3月24日 至 平成28年9月23日 |
|---------------|---|---|
| 1. 1 分配金の計算過程 | (自平成27年9月25日 至平成27年10月23日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(158,429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(9,526,989円)及び分配準備積立金(3,889,561円)より分配対象収益は13,574,979円(1万口当たり939.85円)であり、うち433,312円(1万口当たり30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3月24日 至平成28年4月25日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,069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(8,898,207円)及び分配準備積立金(1,341,901円)より分配対象収益は10,258,177円(1万口当たり776.88円)であり、うち198,064円(1万口当たり15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27年10月24日 至平成27年11月24日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,640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(8,989,180円)及び分配準備積立金(3,190,588円)より分配対象収益は12,195,408円(1万口当たり911.56円)であり、うち401,359円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自平成27年11月25日 至平成27年12月24日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,084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(8,927,849円)及び分配準備積立金(2,784,343円)より分配対象収益は11,737,276円(1万口当たり883.45円)であり、うち398,572円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自平成27年12月25日 至平成28年1月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(29,824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(8,925,206円)及び分配準備積立金(2,408,924円)より分配対象収益は11,363,954円(1万口当たり855.69円)であり、うち398,411円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自平成28年4月26日 至平成28年5月23日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,127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(8,901,960円)及び分配準備積立金(1,161,906円)より分配対象収益は10,079,993円(1万口当たり763.10円)であり、うち198,137円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自平成28年5月24日 至平成28年6月23日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,328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(9,020,195円)及び分配準備積立金(979,896円)より分配対象収益は10,015,419円(1万口当たり749.35円)であり、うち200,481円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自平成28年6月24日 至平成28年7月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(130,354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(8,759,130円)及び分配準備積立金(739,109円)より分配対象収益は9,628,593円(1万口当たり744.54円)であり、うち193,983円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

| | | |
|---|--|--|
| <p>2 . 2 当ファンドの主要投資対象であるグローバル総合債券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26日 至平成28年2月23日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,858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(9,041,750円)及び分配準備積立金(2,040,337円)より分配対象収益は11,100,945円(1万口当たり827.21円)であり、うち402,594円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> | <p>(自平成28年7月26日 至平成28年8月23日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,181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(8,729,279円)及び分配準備積立金(672,946円)より分配対象収益は9,410,406円(1万口当たり730.18円)であり、うち193,317円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> |
| | <p>(自平成28年2月24日 至平成28年3月23日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(111,502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(9,046,501円)及び分配準備積立金(1,656,601円)より分配対象収益は10,814,604円(1万口当たり805.51円)であり、うち402,772円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> | <p>(自平成28年8月24日 至平成28年9月23日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,878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(8,135,552円)及び分配準備積立金(454,466円)より分配対象収益は8,600,896円(1万口当たり716.08円)であり、うち180,165円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> |
| | 83,426円 | 75,173円 |

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 前 期 自 平成27年9月25日 至 平成28年3月23日 | 当 期 自 平成28年3月24日 至 平成28年9月23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 | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 前 期 平成28年3月23日現在 | 当 期 平成28年9月23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3月23日現在 | 当 期 平成28年9月23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 | 472,675 | 224,373 |
| 合計 | 472,675 | 224,373 |

(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3月23日現在 | 当 期 平成28年9月23日現在 |
|--------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 | 0.9989円 | 0.9212円 |
| (1万口当たり純資産額) | (9,989円) | (9,212円) |

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年9月23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 | グローバル総合債券マザーファンド | 106,842,520 | 109,588,372 | |
| 親投資信託受益証券 | 合計 | 106,842,520 | 109,588,372 | |
| 合計 | | 106,842,520 | 109,588,372 | |

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、「グローバル総合債券マザーファンド」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。

「グローバル総合債券マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年3月23日現在 | 平成28年9月23日現在 |
|-------------|----------|--------------|--------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 25,249,562 | 11,484,548 |
| 金銭信託 | | 1,245,372 | - |
| コール・ローン | | 50,018 | 985,383 |
| 国債証券 | | 197,118,388 | 173,599,897 |
| 特殊債券 | | 10,066,600 | 10,060,000 |
| 社債券 | | 22,505,735 | 20,257,578 |
| 未収入金 | | - | 288,234 |
| 未収利息 | | 977,804 | 696,769 |
| 前払費用 | | 66,479 | 1,995 |
| 流動資産合計 | | 257,279,958 | 217,374,404 |
| 資産合計 | | 257,279,958 | 217,374,404 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | - | 304,539 |
| 流動負債合計 | | - | 304,539 |
| 負債合計 | | - | 304,539 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 234,864,195 | 211,627,224 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 22,415,763 | 5,442,641 |
| 元本等合計 | | 257,279,958 | 217,069,865 |
| 純資産合計 | | 257,279,958 | 217,069,865 |
| 負債純資産合計 | | 257,279,958 | 217,374,404 |

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、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準 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3月23日現在 | 平成28年9月23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 | 239,329,735円 | 234,864,195円 |
| 同期中追加設定元本額 | 17,068,095円 | 6,372,324円 |
| 同期中一部解約元本額 | 21,533,635円 | 29,609,295円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| D I A Mグローバル総合債券 | 121,198,845円 | 106,842,520円 |
| ファンド（毎月決算型） | | |
| D I A Mグローバル総合債券 | 113,665,350円 | 104,784,704円 |
| ファンド（年1回決算型） | | |
| 計 | 234,864,195円 | 211,627,224円 |
| 2. 受益権の総数 | 234,864,195口 | 211,627,224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9月25日 至 平成28年3月23日 | 自 平成28年3月24日 至 平成28年9月23日 |
|--------------------------|--|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年3月23日現在 | 平成28年9月23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3月23日現在 | 平成28年9月23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 | 3,071,675 | 3,472,010 |
| 特殊債券 | 1,100 | 6,600 |
| 社債券 | 94,481 | 11,824 |
| 合計 | 2,976,094 | 3,453,586 |

(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3月24日から平成28年3月23日まで及び平成28年3月24日から平成28年9月23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3月23日現在 | 平成28年9月23日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0954円 | 1.0257円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,954円) | (10,257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9月23日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------------|-----|-------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------|
| 国債証券 | 日本円 | 124回 利付国庫債券 (5年) | 1,850,000 | 1,870,849 | |
| | | 126回 利付国庫債券 (5年) | 5,350,000 | 5,417,303 | |
| | | 8回 利付国庫債券(4 0年) | 250,000 | 325,757 | |
| | | 286回 利付国庫債券 (10年) | 300,000 | 304,533 | |
| | | 291回 利付国庫債券 (10年) | 3,850,000 | 3,938,433 | |
| | | 302回 利付国庫債券 (10年) | 2,250,000 | 2,349,405 | |
| | | 321回 利付国庫債券 (10年) | 1,000,000 | 1,065,260 | |
| | | 334回 利付国庫債券 (10年) | 5,150,000 | 5,454,107 | |
| | | 340回 利付国庫債券 (10年) | 1,000,000 | 1,045,780 | |
| | | 343回 利付国庫債券 (10年) | 3,600,000 | 3,659,940 | |
| | | 42回 利付国庫債券 (30年) | 1,050,000 | 1,389,633 | |
| | | 48回 利付国庫債券 (30年) | 1,400,000 | 1,756,733 | |
| | | 50回 利付国庫債券 (30年) | 1,100,000 | 1,200,188 | |
| | | 110回 利付国庫債券 (20年) | 850,000 | 1,068,705 | |
| | | 147回 利付国庫債券 (20年) | 1,500,000 | 1,843,635 | |
| | | 151回 利付国庫債券 (20年) | 2,750,000 | 3,194,345 | |
| | | 157回 利付国庫債券 (20年) | 1,900,000 | 1,838,915 | |
| | | 日本円 小計 | | | 35,150,000 |
| アメリカ・ドル | | US T N/B 1.125 04/30/20 | 140,000.000 | 140,448.000 | |
| | | US T N/B 2.0 02/28/21 | 230,000.000 | 238,319.100 | |
| | | US T N/B 2.25 11/15/25 | 10,000.000 | 10,534.300 | |
| | | US T N/B 2.75 02/15/24 | 118,000.000 | 128,555.100 | |
| | | US T N/B 3.625 02/15/44 | 122,000.000 | 154,910.720 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | | 620,000.000 (62,657,200) | 672,767.220 (67,989,855) | |

| | | | | |
|-------------|------------------------------|--------------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| イギリス・ボンド | UK TREASURY 3.25 01/22/44 | 28,000.000 | 39,418.400 | |
| イギリス・ボンド 小計 | | 28,000.000 (3,697,120) | 39,418.400 (5,204,806) | |
| カナダ・ドル | CANADA 1.5 06/01/23 | 40,000.000 | 41,699.600 | |
| カナダ・ドル 小計 | | 40,000.000 (3,094,400) | 41,699.600 (3,225,881) | |
| ユーロ | BELGIUM 4.25 03/28/41 | 30,000.000 | 52,805.100 | |
| | DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | 190,000.000 | 222,693.300 | |
| | FRANCE OAT 0.5 05/25/25 | 50,000.000 | 52,230.500 | |
| | FRANCE OAT 0.5 11/25/19 | 80,000.000 | 82,664.000 | |
| | ITALY BTPS 2.5 05/01/19 | 46,000.000 | 48,996.900 | |
| | SPAIN 2.75 04/30/19 | 10,000.000 | 10,745.600 | |
| | SPAIN 4.8 01/31/24 | 25,000.000 | 32,717.500 | |
| | SPAIN 5.15 10/31/44 | 13,000.000 | 21,911.760 | |
| ユーロ 小計 | | 444,000.000 (50,305,200) | 524,764.660 (59,455,836) | |
| 国債証券 合計 | | 154,903,920 (119,753,920) | 173,599,897 (135,876,376) | |
| 特殊債券 | 日本円 | 17回 政保日本政策投 資銀行債券 | 10,000,000 | 10,060,000 |
| | 日本円 小計 | | 10,000,000 | 10,060,000 |
| 特殊債券 合計 | | | 10,000,000 | 10,060,000 |
| 社債券 | アメリカ・ドル | CATERPILLAR INC 1.5 06/26/17 | 100,000.000 | 100,356.000 |
| | | JPMORGAN CHASE & CO 1.35 02/15/17 | 100,000.000 | 100,095.000 |
| | アメリカ・ドル 小計 | | 200,000.000 (20,212,000) | 200,451.000 (20,257,578) |
| 社債券 合計 | | | 20,212,000 (20,212,000) | 20,257,578 (20,257,578) |
| 合計 | | | 185,115,920 (139,965,920) | 203,917,475 (156,133,954) |

(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 | 5銘柄 | 43.28% |
| | 社債券 | 2銘柄 | |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 1銘柄 | 2.55% |
| カナダ・ドル | 国債証券 | 1銘柄 | 1.58% |
| ユーロ | 国債証券 | 8銘柄 | 29.16% |

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成28年9月30日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 111,000,506円 |
| 負債総額 | 28,270円 |
| 純資産総額(-) | 110,972,236円 |
| 発行済数量 | 120,147,674口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.9236円 |

(参考)

グローバル総合債券マザーファンド

平成28年9月30日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 218,007,053円 |
| 負債総額 | 304,533円 |
| 純資産総額(-) | 217,702,520円 |
| 発行済数量 | 211,627,224口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0287円 |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

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

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

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

（ご参考）

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

・みずほ投信投資顧問株式会社

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

・新光投信株式会社

| 基本的性格 | 本数 | 純資産総額(円) |
|-------|----|----------|
|-------|----|----------|

| | | |
|------------|-----|-------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 25 | 651,056,923,166 |
| 追加型株式投資信託 | 240 | 3,084,756,237,399 |
| 単位型公社債投資信託 | 7 | 42,284,286,781 |
| 単位型株式投資信託 | 79 | 290,858,982,767 |
| 合計 | 351 | 4,068,956,430,113 |

独立監査人の監査報告書

平成28年11月9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DIAMグローバル総合債券ファンド（毎月決算型）の平成28年3月24日から平成28年9月23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、DIAMグローバル総合債券ファンド（毎月決算型）の平成28年9月23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。