

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成28年12月22日
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 西 惠正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	上野 圭子
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【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】</b>	D I A Mグローバル総合債券ファンド（年1回決算型）
<b>【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】</b>	5,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

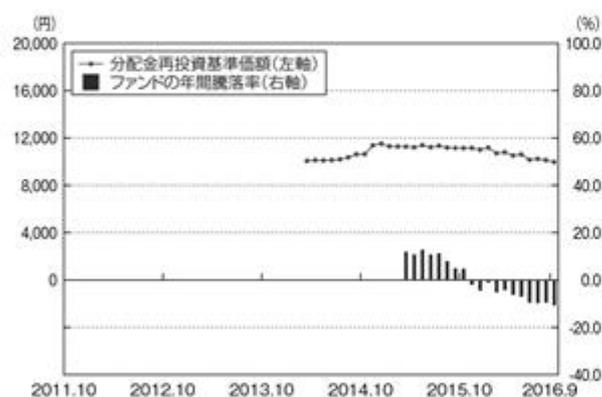
#### 3【投資リスク】

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、以下の内容に更新・訂正いたします。

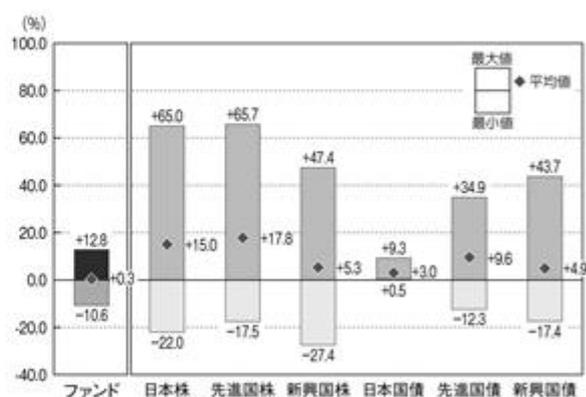
<更新・訂正後>

#### （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

\*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・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】

&lt;訂正前&gt;

(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)

&lt;訂正後&gt;

(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。

&lt;更新・訂正後&gt;

## (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	107,792,025	98.91
内 日本	107,792,025	98.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,191,280	1.09
純資産総額	108,983,305	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	104,784,704	1.0950 114,749,378	1.0287 107,792,025	- -	98.91%

(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	98.91%
合計	98.91%

(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計算期間末 (平成27年3月23日)	109	109	1.1271	1.1271
第2計算期間末 (平成28年3月23日)	125	125	1.0679	1.0679
平成27年9月末日	121	-	1.1151	-
10月末日	124	-	1.1136	-
11月末日	124	-	1.1149	-
12月末日	128	-	1.0998	-
平成28年1月末日	131	-	1.1176	-
2月末日	126	-	1.0698	-
3月末日	126	-	1.0783	-
4月末日	121	-	1.0514	-
5月末日	122	-	1.0596	-
6月末日	117	-	1.0148	-
7月末日	116	-	1.0230	-
8月末日	111	-	1.0119	-
9月末日	108	-	0.9965	-

## 【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
平成28年3月24日～ 平成28年9月23日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	12.7
第2計算期間	5.3
平成28年3月24日～ 平成28年9月23日	6.9

(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	102,742,408	5,415,943
第2計算期間	24,487,734	4,069,436
平成28年3月24日～ 平成28年9月23日	1,664,522	10,066,903

(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。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

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1期	(2015.03.23)	0円
第2期	(2016.03.23)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄一覧

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	投資比率
1	グローバル総合債券マザーファンド	98.91%

## ■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 06/26/17	社債券	アメリカ	1.500000	2017/6/26	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、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】

#### 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24日から平成28年9月23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グローバル総合債券ファンド(年1回決算型)

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 平成28年3月23日現在	第3期中間計算期間末 平成28年9月23日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,979,343	-
コール・ローン	79,497	1,983,702
親投資信託受益証券	124,509,024	107,477,670
流動資産合計	126,567,864	109,461,372
資産合計	126,567,864	109,461,372
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	33,504	32,023
未払委託者報酬	791,666	756,545
その他未払費用	3,094	2,502
流動負債合計	828,264	791,070
負債合計	828,264	791,070
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 117,744,763	1 109,342,382
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2 7,994,837	2 672,080
(分配準備積立金)	5,971,756	5,463,425
元本等合計	125,739,600	108,670,302
純資産合計	125,739,600	108,670,302
負債純資産合計	126,567,864	109,461,372

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間		第3期中間計算期間	
	自	平成27年3月24日 至 平成27年9月23日	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		227		-
有価証券売買等損益		818,383		7,721,354
営業収益合計		818,156		7,721,354
営業費用				
支払利息		-		334
受託者報酬		30,099		32,023
委託者報酬		1,711,230		1,756,545
その他費用		2,789		2,503
営業費用合計		744,118		791,405
営業利益又は営業損失( )		1,562,274		8,512,759
経常利益又は経常損失( )		1,562,274		8,512,759
中間純利益又は中間純損失( )		1,562,274		8,512,759
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( )		12,949		508,613
期首剰余金又は期首欠損金( )		12,375,038		7,994,837
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,593,163		19,137
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,593,163		19,137
剰余金減少額又は欠損金増加額		326,285		681,908
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		326,285		681,908
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金( )		12,092,591		672,080

## (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2期 平成28年3月23日現在	第3期中間計算期間末 平成28年9月23日現在
1. 1 期首元本額	97,326,465円	117,744,763円
期中追加設定元本額	24,487,734円	1,664,522円
期中一部解約元本額	4,069,436円	10,066,903円
2. 受益権の総数	117,744,763口	109,342,382口
3. 2 元本の欠損		中間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672,080円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期中間計算期間 自 平成27年3月24日 至 平成27年9月23日	第3期中間計算期間 自 平成28年3月24日 至 平成28年9月23日
1. 1 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	68,682円	70,748円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 平成28年3月23日現在	第3期中間計算期間末 平成28年9月23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2期 平成28年3月23日現在	第3期中間計算期間末 平成28年9月23日現在
1口当たり純資産額	1,0679円	0,9939円
（1万口当たり純資産額）	（10,679円）	（9,939円）

（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、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。

「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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
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</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年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	205,134,360円	234,864,195円
同期中追加設定元本額	62,917,797円	6,372,324円
同期中一部解約元本額	33,187,962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）

## 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）

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）

## 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	109,011,066円
負債総額	27,761円
純資産総額（ - ）	108,983,305円
発行済数量	109,369,074口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9965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

独立監査人の中間監査報告書

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

## P w C あらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mグローバル総合債券ファンド（年1回決算型）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グローバル総合債券ファンド（年1回決算型）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中間計算期間（平成28年3月24日から平成28年9月23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。