

【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10月14日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	J P X日経400インデックスファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【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4月15日付をもって提出した有価証券届出書（平成28年9月30日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書で訂正済。以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

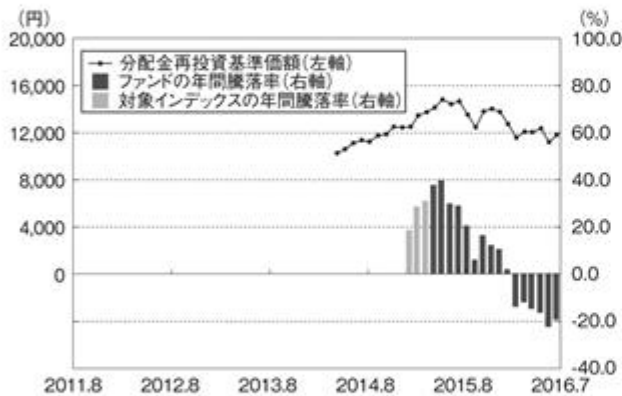
3【投資リスク】

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

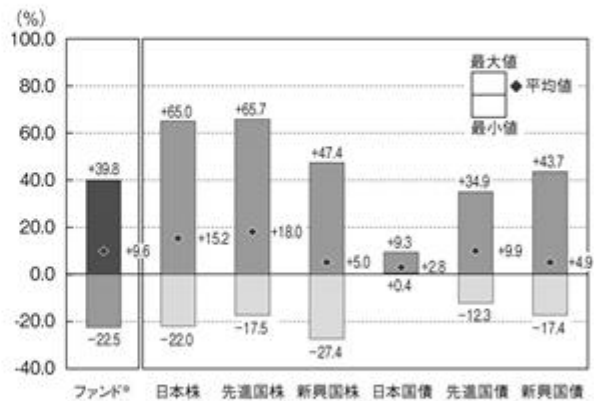
<更新・訂正後>

（参考情報）

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



ファンド:2015年1月~2016年7月(2015年1月~2015年3月は対象インデックスのデータ)
代表的な資産クラス:2011年8月~2016年7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。
- *ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。
- *ファンドの対象インデックスはJPX日経インデックス400(配当込み)であり、算出開始以降、表示しております。

- *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。
- *ファンドの年間騰落率がない期間については、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示しておりますので、ファンドの実績ではありません。
- *全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

法人の受益者に対する課税

(略)

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

(略)

<訂正後>

(略)

法人の受益者に対する課税

(略)

上記は、平成28年7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「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、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成28年7月29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	3,664,117,764	99.99
内 日本	3,664,117,764	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	350,761	0.01
純資産総額	3,664,468,525	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）

J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	9,505,664,670	97.16
内 日本	9,505,664,670	97.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	277,811,735	2.84
純資産総額	9,783,476,405	100.00

その他資産の投資状況

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	275,698,500	2.82
内 日本	275,698,500	2.82

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年7月29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	J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,435,003,060	1.1145 3,828,586,550	1.0667 3,664,117,764	- -	99.99%

(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7月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

(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)

J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29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	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	39,300	4,787.81 188,161,116	4,881.00 191,823,300	- -	1.96%
2	K D D I 日本	株式 情報・通信業	58,100	2,840.37 165,025,626	3,145.00 182,724,500	- -	1.87%
3	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	40,400	4,100.13 165,645,439	4,025.00 162,610,000	- -	1.66%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	26,200	5,513.11 144,443,489	5,703.00 149,418,600	- -	1.53%
5	N T Tドコモ 日本	株式 情報・通信業	48,800	2,424.39 118,310,511	2,749.50 134,175,600	- -	1.37%
6	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	75,300	1,585.33 119,375,399	1,721.50 129,628,950	- -	1.32%
7	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	27,600	5,579.03 153,981,336	4,588.00 126,628,800	- -	1.29%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	44,500	3,461.80 154,050,335	2,841.50 126,446,750	- -	1.29%
9	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	27,300	5,061.01 138,165,631	4,303.00 117,471,900	- -	1.20%
10	ファナック 日本	株式 電気機器	6,700	18,441.57 123,558,581	17,325.00 116,077,500	- -	1.19%

11	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	12,100	10,436.67 126,283,826	9,485.00 114,768,500	- -	1.17%
12	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	19,400	6,724.86 130,462,404	5,894.00 114,343,600	- -	1.17%
13	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	5,900	20,671.33 121,960,900	19,220.00 113,398,000	- -	1.16%
14	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	677,900	219.12 148,546,218	167.10 113,277,090	- -	1.16%
15	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	34,200	4,118.67 140,858,768	3,308.00 113,133,600	- -	1.16%
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	1,500	57,626.11 86,439,167	72,920.00 109,380,000	- -	1.12%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	26,500	4,068.50 107,815,359	4,040.00 107,060,000	- -	1.09%
18	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	200,300	662.67 132,734,648	522.00 104,556,600	- -	1.07%
19	キヤノン 日本	株式 電気機器	35,600	3,307.20 117,736,580	2,935.00 104,486,000	- -	1.07%
20	花王 日本	株式 化学	17,600	5,658.38 99,587,662	5,553.00 97,732,800	- -	1.00%
21	三菱地所 日本	株式 不動産業	49,000	2,294.14 112,413,000	1,929.00 94,521,000	- -	0.97%
22	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	90,300	1,099.68 99,301,697	1,012.00 91,383,600	- -	0.93%
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	6,900	14,336.40 98,921,200	12,825.00 88,492,500	- -	0.90%
24	信越化学工業 日本	株式 化学	12,400	6,117.28 75,854,370	7,064.00 87,593,600	- -	0.90%
25	三菱商事 日本	株式 卸売業	49,000	1,870.03 91,631,950	1,778.50 87,146,500	- -	0.89%
26	ダイキン工業 日本	株式 機械	9,600	7,817.28 75,045,942	9,012.00 86,515,200	- -	0.88%
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	71,000	1,103.86 78,374,500	1,217.50 86,442,500	- -	0.88%
28	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	23,400	3,948.28 92,389,946	3,601.00 84,263,400	- -	0.86%
29	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	20,900	4,363.33 91,193,611	4,015.00 83,913,500	- -	0.86%
30	日立製作所 日本	株式 電気機器	169,000	598.84 101,205,300	476.50 80,528,500	- -	0.82%

(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7月29日現在

種類	投資比率
株式	97.16%
合計	97.16%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年7月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.29%
情報・通信業		8.51%
輸送用機器		8.10%
医薬品		7.15%
化学		6.62%
銀行業		6.00%
陸運業		5.62%
食料品		4.96%
機械		4.96%
小売業		4.65%
卸売業		4.11%
サービス業		3.34%
建設業		3.23%
不動産業		3.14%
保険業		3.12%
精密機器		1.60%
その他金融業		1.45%
証券、商品先物取引業		1.21%
鉄鋼		1.10%
ゴム製品		1.06%
ガラス・土石製品		0.90%
非鉄金属		0.87%
電気・ガス業		0.76%
その他製品		0.62%
繊維製品		0.48%
空運業		0.37%
鉱業		0.33%
金属製品		0.29%
パルプ・紙		0.16%
海運業		0.11%
石油・石炭製品		0.06%
倉庫・運輸関連業	0.02%	
合計	97.16%	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	N K 4 0 0 先物 2 8 0 9月	買建	231	269,036,844	275,698,500	2.82%

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

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

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成28年7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1月15日)	1,239	1,239	1.2153	1.2153
第2計算期間末 (平成28年1月15日)	3,902	3,902	1.2442	1.2442
平成27年7月末日	3,057	-	1.4650	-
8月末日	3,499	-	1.3516	-
9月末日	3,940	-	1.2447	-
10月末日	4,428	-	1.3793	-
11月末日	4,221	-	1.4017	-
12月末日	4,263	-	1.3751	-
平成28年1月末日	4,142	-	1.2727	-
2月末日	3,712	-	1.1575	-
3月末日	3,911	-	1.2079	-
4月末日	3,919	-	1.2032	-
5月末日	4,008	-	1.2362	-
6月末日	3,567	-	1.1179	-
7月末日	3,664	-	1.1803	-

【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1月16日～ 平成28年7月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	21.5
第2計算期間	2.4
平成28年1月16日～ 平成28年7月15日	5.5

(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	1,340,404,822	320,576,957
第2計算期間	3,623,930,924	1,507,241,646
平成28年1月16日～ 平成28年7月15日	552,749,211	537,716,050

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日: 2016年7月29日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2014年4月14日)~2016年7月29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4月14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	(2015.01.15)	0円
第2期	(2016.01.15)	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	JPX日経400インデックスファンド・マザーファンド	99.99%

■JPX日経400インデックスファンド・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	97.16
内 日本	97.16
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.84
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.82

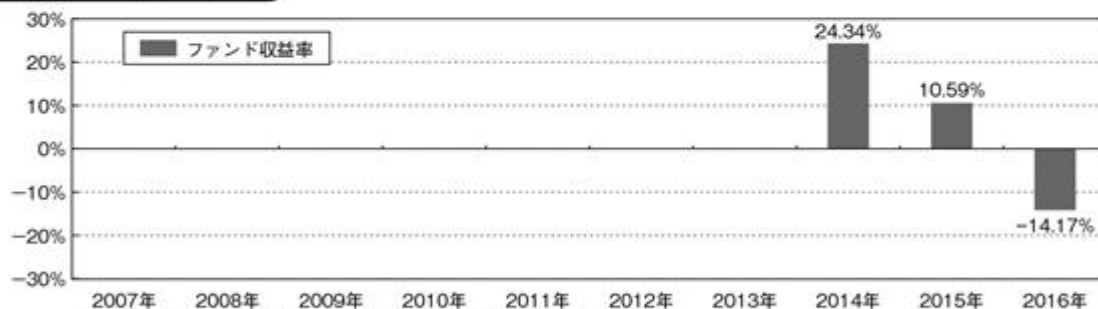
組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.29%
2	情報・通信業	8.51%
3	輸送用機器	8.10%
4	医薬品	7.15%
5	化学	6.62%

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	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.96%
2	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.87%
3	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.66%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.53%
5	NTTドコモ	株式	日本	情報・通信業	1.37%
6	アステラス製薬	株式	日本	医薬品	1.32%
7	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.29%
8	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.29%
9	セブン&アイホールディングス	株式	日本	小売業	1.20%
10	ファナック	株式	日本	電気機器	1.19%

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。
 ※当ファンドのベンチマークは「JPX日経インデックス400(配当込み)」です。当該ベンチマークは2014年1月6日より算出されているため、算出以前のベンチマークの年間収益率は表示していません。

○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「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1月16日から平成28年7月15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】

J P X日経400インデックスファンド

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成28年1月15日現在	第3期中間計算期間末 平成28年7月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,235,546	17,498,121
親投資信託受益証券	3,902,164,035	3,704,128,440
未収入金	-	41,194,000
流動資産合計	3,915,399,581	3,762,820,561
資産合計	3,915,399,581	3,762,820,561
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,620,098	47,362,997
未払受託者報酬	730,443	713,998
未払委託者報酬	10,435,376	10,200,614
その他未払費用	99,032	64,218
流動負債合計	12,884,949	58,341,827
負債合計	12,884,949	58,341,827
純資産の部		
元本等		
元本	1,313,651,143	1,315,550,304
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	765,997,489	552,928,430
（分配準備積立金）	61,905,659	52,307,762
元本等合計	3,902,514,632	3,704,478,734
純資産合計	3,902,514,632	3,704,478,734
負債純資産合計	3,915,399,581	3,762,820,561

(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1月16日 至 平成27年7月15日	自	平成28年1月16日 至 平成28年7月15日
営業収益				
受取利息		2,030		222
有価証券売買等損益		340,915,760		196,821,595
営業収益合計		340,917,790		196,821,373
営業費用				
支払利息		-		2,242
受託者報酬		375,588		713,998
委託者報酬		5,366,291		10,200,614
その他費用		50,888		64,224
営業費用合計		5,792,767		10,981,078
営業利益又は営業損失()		335,125,023		207,802,451
経常利益又は経常損失()		335,125,023		207,802,451
中間純利益又は中間純損失()		335,125,023		207,802,451
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()		111,400,541		21,711,417
期首剰余金又は期首欠損金()		219,579,482		765,997,489
剰余金増加額又は欠損金減少額		567,676,560		101,774,058
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		567,676,560		101,774,058
剰余金減少額又は欠損金増加額		212,319,281		128,752,083
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		212,319,281		128,752,083
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		798,661,243		552,928,430

(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1月15日現在	第3期中間計算期間末 平成28年7月15日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	1,019,827,865円 3,623,930,924円 1,507,241,646円	3,136,517,143円 552,749,211円 537,716,050円
2. 受益権の総数	3,136,517,143口	3,151,550,304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2期 平成28年1月15日現在	第3期中間計算期間末 平成28年7月15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1月15日現在	第3期中間計算期間末 平成28年7月15日現在
1口当たり純資産額	1,2442円	1,1754円
（1万口当たり純資産額）	（12,442円）	（11,754円）

(参考)

当ファンドは、「J P X日経400インデックスファンド・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。

「J P X日経400インデックスファンド・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1月15日現在	平成28年7月15日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		522,865,204	371,773,737
株式	2	9,529,587,730	9,479,758,140
派生商品評価勘定		157,640	6,508,044
未収配当金		14,012,750	15,240,800
前払金		28,962,000	-
流動資産合計		10,095,585,324	9,873,280,721
資産合計		10,095,585,324	9,873,280,721
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		32,811,076	2,266,844
前受金		-	1,951,400
未払金		-	33,696
未払解約金		72,150,000	61,043,000
流動負債合計		104,961,076	65,294,940
負債合計		104,961,076	65,294,940
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,912,502,480	9,234,110,143
剰余金			
剰余金又は欠損金()		1,078,121,768	573,875,638
元本等合計		9,990,624,248	9,807,985,781
純資産合計		9,990,624,248	9,807,985,781
負債純資産合計		10,095,585,324	9,873,280,721

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年1月15日現在	平成28年7月15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	8,092,243,728円	8,912,502,480円
同期中追加設定元本額	9,280,041,151円	1,102,469,562円
同期中一部解約元本額	8,459,782,399円	780,861,899円
元本の内訳		
ファンド名		
JPX日経400ノーロードオープン	2,642,964,810円	2,723,220,412円
JPX日経400インデックスファンド	3,480,967,025円	3,487,551,493円
JPX日経400インデックスファンド（適格機関投資家限定）	2,788,570,645円	3,023,338,238円
計	8,912,502,480円	9,234,110,143円
2 . 受益権の総数	8,912,502,480口	9,234,110,143口
3 . 2 差入代用有価証券	株式 54,697,600円	株式 46,716,800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	平成28年1月15日現在	平成28年7月15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)

株式関連

種類	平成28年1月15日 現在				平成28年7月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	492,085,500	-	459,550,000	32,535,500	322,369,700	-	326,700,000	4,330,300
合計	492,085,500	-	459,550,000	32,535,500	322,369,700	-	326,700,000	4,330,300

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年1月15日現在	平成28年7月15日現在
1口当たり純資産額	1.1210円	1.0621円
(1万口当たり純資産額)	(11,210円)	(10,621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、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

平成28年7月29日現在

資産総額	3,670,728,083円
負債総額	6,259,558円
純資産総額(-)	3,664,468,525円
発行済数量	3,104,758,348口
1口当たり純資産額(/)	1.1803円

(参考)

J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	9,811,066,025円
負債総額	27,589,620円
純資産総額(-)	9,783,476,405円
発行済数量	9,172,108,920口
1口当たり純資産額(/)	1.0667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7月29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	389	5,918,600,293,964
単位型公社債投資信託	48	353,027,465,726
単位型株式投資信託	7	79,600,055,072
合計	444	6,351,227,814,762

（ご参考）

平成28年7月29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	250,148,557,515
追加型株式投資信託	234	2,260,638,584,910
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,491,433,486
合計	250	2,512,278,575,911

・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	622,747,870,142
追加型株式投資信託	244	3,210,390,488,192
単位型公社債投資信託	6	40,614,819,596
単位型株式投資信託	75	269,539,047,169
合計	350	4,143,292,225,099

独立監査人の中間監査報告書

平成28年8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

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J P X日経400インデックスファンドの平成28年1月16日から平成28年7月15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、J P X日経400インデックスファンドの平成28年7月15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1月16日から平成28年7月15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。