

【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12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外国リートインデックスファンド < D C年金 >
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	200億円を上限とします。
【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4月12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】

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

平成28年1月29日現在、当ファンドが実質的に純資産総額の10%を超えて投資している不動産投資信託証券はありません。

(略)

<訂正後>

(略)

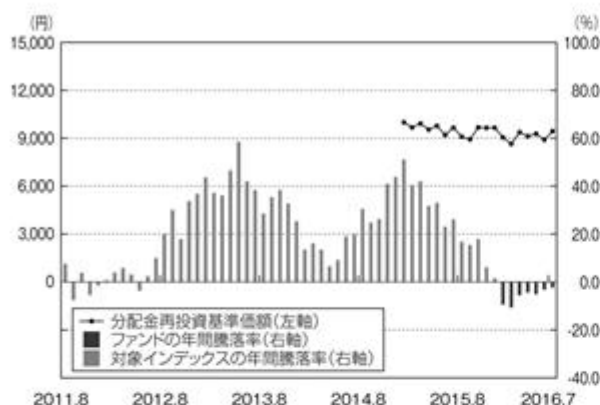
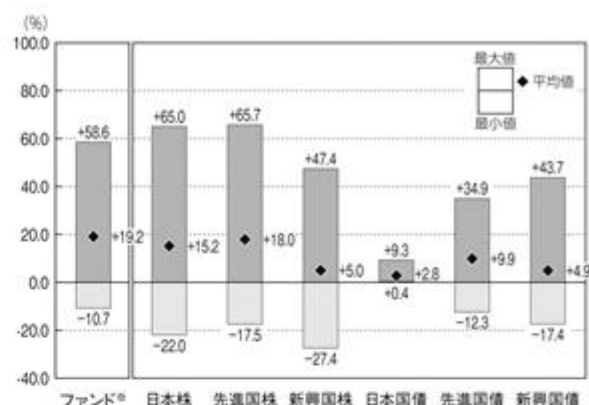
平成28年7月29日現在、当ファンドが実質的に純資産総額の10%を超えて投資している不動産投資信託証券はありません。

(略)

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:2011年8月~2016年7月

(2011年8月~2015年12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。

*対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。

*ファンドの対象インデックスはS&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)です。

*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・表示していますので、ファンドの実績ではありません。

*対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。

*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>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個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>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個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	5,889,588	99.95
内 日本	5,889,588	99.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,175	0.05
純資産総額	5,892,763	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）

外国リート・パッシブ・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（％）
投資信託受益証券	3,971,604,878	11.37
内 オーストラリア	2,963,399,862	8.48
内 シンガポール	999,566,797	2.86
内 カナダ	8,638,219	0.02
投資証券	30,795,076,650	88.15
内 アメリカ	25,388,052,520	72.67
内 イギリス	1,653,695,718	4.73
内 フランス	1,477,782,066	4.23
内 カナダ	651,663,461	1.87
内 香港	624,067,516	1.79
内 ベルギー	228,738,600	0.65
内 ニュージーランド	174,014,738	0.50
内 オランダ	164,446,881	0.47
内 スペイン	148,285,962	0.42
内 アイルランド	78,442,953	0.22
内 ドイツ	65,427,659	0.19
内 シンガポール	53,624,640	0.15
内 イタリア	29,008,990	0.08
内 マン島	21,133,295	0.06
内 ガーンジー	20,771,430	0.06
内 イスラエル	15,920,221	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	167,599,111	0.48
純資産総額	34,934,280,639	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	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,127,177	1.0948 5,613,343	1.1487 5,889,588	- -	99.95%

(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	99.95%
合計	99.95%

(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。

(参考)

外国リート・パッシブ・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	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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	89,960	21,934.07 1,973,189,675	23,397.38 2,104,829,150	- -	6.03%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	42,860	25,451.39 1,090,846,999	24,916.70 1,067,929,779	- -	3.06%
3	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	152,500	5,207.62 794,162,086	5,600.04 854,006,801	- -	2.44%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	103,630	7,712.44 799,240,259	8,183.39 848,045,265	- -	2.43%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	28,520	27,612.92 787,520,562	28,003.70 798,665,723	- -	2.29%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	98,160	7,352.98 721,768,991	7,781.37 763,820,103	- -	2.19%
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	39,820	18,395.26 732,499,302	19,033.67 757,921,042	- -	2.17%
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	106,100	6,948.62 737,248,861	6,980.47 740,628,609	- -	2.12%
9	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	1,546,635	374.40 579,067,406	421.86 652,474,576	- -	1.87%
10	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	44,600	13,402.17 597,737,133	14,560.32 649,390,486	- -	1.86%
11	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	51,530	10,216.27 526,444,583	11,017.35 567,724,261	- -	1.63%

12	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	169,260	3,022.10 511,522,119	3,305.93 559,562,930	- -	1.60%
13	HCP INC アメリカ	投資証券	135,640	3,664.06 496,994,000	4,074.46 552,660,893	- -	1.58%
14	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	74,810	6,821.48 510,315,554	7,380.40 552,128,142	- -	1.58%
15	LINK REIT 香港	投資証券	652,023	686.03 447,311,762	784.71 511,654,184	- -	1.46%
16	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	42,640	10,966.29 467,602,922	11,244.98 479,486,365	- -	1.37%
17	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	555,516	844.06 468,889,616	838.23 465,653,065	- -	1.33%
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	19,010	23,126.01 439,625,480	23,034.00 437,876,488	- -	1.25%
19	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	121,890	3,127.14 381,167,476	3,323.68 405,124,403	- -	1.16%
20	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	217,090	1,729.94 375,553,240	1,804.37 391,712,333	- -	1.12%
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	20,600	16,568.16 341,304,198	17,616.69 362,903,982	- -	1.04%
22	SL GREEN アメリカ	投資証券	29,130	10,688.63 311,360,033	12,144.04 353,756,059	- -	1.01%
23	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	232,960	1,581.07 368,326,534	1,497.70 348,904,588	- -	1.00%
24	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	36,670	8,587.98 314,921,518	9,305.91 341,247,734	- -	0.98%
25	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	36,380	9,207.26 334,960,424	8,978.03 326,620,789	- -	0.93%
26	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	69,460	4,021.61 279,341,104	4,306.28 299,114,264	- -	0.86%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	77,630	3,706.24 287,715,462	3,817.59 296,359,915	- -	0.85%
28	VEREIT INC アメリカ	投資証券	262,950	1,033.83 271,847,184	1,125.64 295,989,036	- -	0.85%
29	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	100,540	2,694.07 270,862,061	2,940.46 295,634,572	- -	0.85%
30	STOCKLAND オーストラリア	投資信託受益 証券	691,897	370.52 256,364,815	395.94 273,951,358	- -	0.78%

(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
投資信託受益証券	11.37%
投資証券	88.15%
合計	99.52%

（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28年1月12日)	1	1	0.9007	0.9007
平成27年7月末日	1	-	0.9665	-
8月末日	1	-	0.9097	-
9月末日	1	-	0.8929	-
10月末日	1	-	0.9681	-
11月末日	1	-	0.9653	-
12月末日	1	-	0.9658	-
平成28年1月末日	1	-	0.9054	-
2月末日	7	-	0.8643	-
3月末日	8	-	0.9372	-
4月末日	8	-	0.9126	-
5月末日	11	-	0.9280	-
6月末日	5	-	0.8906	-
7月末日	5	-	0.9438	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成28年1月13日～ 平成28年7月12日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.9
平成28年1月13日～ 平成28年7月12日	1.5

(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	1,948,778	22,737
平成28年1月13日 ~ 平成28年7月12日	13,366,919	9,336,455

(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(2015年1月30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:2015年1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 (2016.01.12)	0円
直近1年間累計	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	外国リート・バッシュ・ファンド・マザーファンド	99.95%

■外国リート・バッシュ・ファンド・マザーファンド

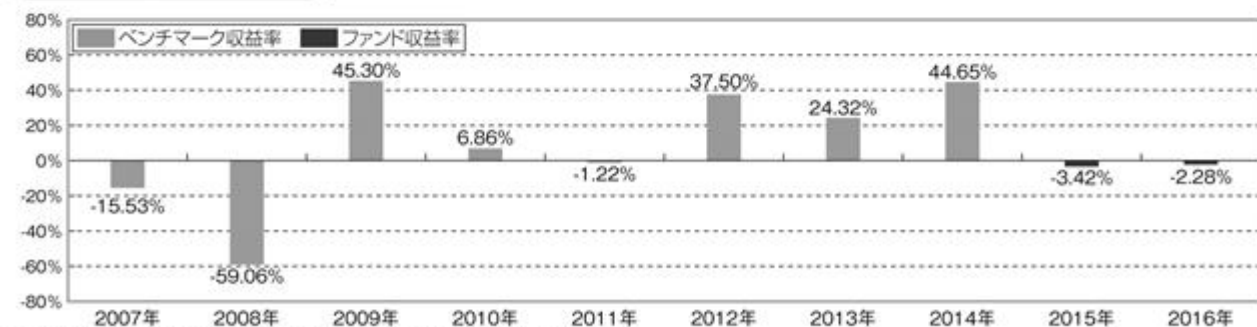
(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

組入上位10銘柄

資産の種類	投資比率(%)	順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
投資信託受益証券	11.37	1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	6.03%
内 オーストラリア	8.48	2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.06%
内 シンガポール	2.86	3	PROLOGIS INC	アメリカ	2.44%
内 カナダ	0.02	4	WELLTOWER INC	アメリカ	2.43%
投資証券	88.15	5	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.29%
内 アメリカ	72.67	6	VENTAS INC	アメリカ	2.19%
内 イギリス	4.73	7	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.17%
内 フランス	4.23	8	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.12%
内 カナダ	1.87	9	SCENTRE GROUP	オーストラリア	1.87%
内 香港	1.79	10	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	1.86%
内 その他	2.86				
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.48				
純資産総額	100.00				

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、2015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。

※2014年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは「S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」です。

- 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。
- 当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- 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1月13日から平成28年7月12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外国リートインデックスファンド<DC年金>

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成28年1月12日現在	第2期中間計算期間末 平成28年7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,711	24,563
親投資信託受益証券	1,733,841	5,440,534
流動資産合計	1,738,552	5,465,097
資産合計	1,738,552	5,465,097
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	159	917
未払委託者報酬	3,545	19,615
その他未払費用	-	73
流動負債合計	3,704	20,605
負債合計	3,704	20,605
純資産の部		
元本等		
元本	1,926,041	5,956,505
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2 191,193	2 512,013
(分配準備積立金)	40,530	7,971
元本等合計	1,734,848	5,444,492
純資産合計	1,734,848	5,444,492
負債純資産合計	1,738,552	5,465,097

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間		第2期中間計算期間	
	自	平成27年1月30日 至 平成27年7月29日	自	平成28年1月13日 至 平成28年7月12日
営業収益				
受取利息		3		1
有価証券売買等損益		34,581		102,693
営業収益合計		34,578		102,694
営業費用				
支払利息		-		21
受託者報酬		121		917
委託者報酬		2,801		19,615
その他費用		-		73
営業費用合計		2,922		20,626
営業利益又は営業損失()		37,500		82,068
経常利益又は経常損失()		37,500		82,068
中間純利益又は中間純損失()		37,500		82,068
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()		-		8,835
期首剰余金又は期首欠損金()		-		191,193
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		918,282
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		918,282
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,304		1,330,005
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,304		1,330,005
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		47,804		512,013

(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1期 平成28年1月12日現在	第2期中間計算期間末 平成28年7月12日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	1,926,041円
期中追加設定元本額	948,778円	13,366,919円
期中一部解約元本額	22,737円	9,336,455円
2. 受益権の総数	1,926,041口	5,956,505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191,193円であります。	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512,013円であります。

(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1期 平成28年1月12日現在	第2期中間計算期間末 平成28年7月12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1期 平成28年1月12日現在	第2期中間計算期間末 平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額	0.9007円	0.9140円
(1万口当たり純資産額)	(9,007円)	(9,140円)

（参考）

当ファンドは、「外国リート・パッシブ・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。

「外国リート・パッシブ・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12日現在	平成28年7月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		70,002,610	884,678,726
コール・ローン		76,993,840	46,162,071
投資信託受益証券		2,607,796,512	3,847,993,381
投資証券		22,646,538,651	29,792,500,300
派生商品評価勘定		230,738	7,520
未収入金		3,783,993,877	-
未収配当金		115,614,586	104,133,978
流動資産合計		29,301,170,814	34,675,475,976
資産合計		29,301,170,814	34,675,475,976
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	1,898
未払金		-	807,257,409
未払解約金		11,000,000	22,000,000
流動負債合計		11,000,000	829,259,307
負債合計		11,000,000	829,259,307
純資産の部			
元本等			
元本	1	26,797,491,574	30,432,201,770
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		2,492,679,240	3,414,014,899
元本等合計		29,290,170,814	33,846,216,669
純資産合計		29,290,170,814	33,846,216,669
負債純資産合計		29,301,170,814	34,675,475,976

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>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、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28年1月12日現在	平成28年7月12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	24,356,777,119円	26,797,491,574円
同期中追加設定元本額	32,632,713,622円	14,768,972,344円
同期中一部解約元本額	30,191,999,167円	11,134,262,148円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	12,611,597円	85,146,602円
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	12,656,404円	31,624,429円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	7,026,995円	13,199,640円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	21,123,438円	30,478,935円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	53,331,821円	70,478,490円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	17,211,192円	27,512,661円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,333,148円	26,962,207円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	17,993,861円	28,522,170円
たわらノーロード 先進国リート	137,172,128円	860,500,318円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	- 円	8,288,672円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	- 円	26,181,578円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	- 円	543,841,270円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	- 円	80,620,116円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	13,941,746円	15,564,819円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	35,855,071円	43,803,050円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	88,055,265円	94,210,786円
投資のソムリエ	815,172,778円	1,786,627,593円
投資のソムリエ<DC年金>	14,675,192円	41,327,733円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	39,421,540円	55,490,458円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	277,120円	6,032,939円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	613,211円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	- 円	1,447,767,054円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	1,586,314円	4,891,687円
為替フルヘッジ型外国リート・パッシブ・ファンド(適格機関投資家限定)	641,640,313円	235,476,312円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	134,590,667円	105,114,015円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	4,975,148,032円	4,746,502,433円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	- 円	50,484,750円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	12,695,405,659円	12,778,876,412円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,895,193,944円	3,036,946,149円

	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドI I (適格機関投資家限 定)	3,587,011,770円	3,586,745,115円
	D I A M海外リートインデック スファンド(適格機関投資家限 定)	563,055,579円	562,370,166円
	計	26,797,491,574円	30,432,201,770円
2 .	受益権の総数	26,797,491,574口	30,432,201,770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1月12日現在	平成28年7月12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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年1月12日 現在				平成28年7月12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)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	3,796,381,438	-	3,796,150,700	230,738	26,247,789	-	26,240,380	7,409
アメリカ・ドル	2,759,955,594	-	2,759,819,700	135,894	-	-	-	-
イギリス・ポンド	250,283,128	-	250,273,200	9,928	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	280,324,560	-	280,296,000	28,560	-	-	-	-
カナダ・ドル	59,692,896	-	59,688,000	4,896	-	-	-	-
シンガポール・ドル	105,075,840	-	105,075,200	640	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	17,773,710	-	17,772,100	1,610	-	-	-	-
ユーロ	255,725,600	-	255,720,000	5,600	15,664,269	-	15,664,380	111
香港・ドル	67,550,110	-	67,506,500	43,610	10,583,520	-	10,576,000	7,520
買 建	-	-	-	-	33,366,287	-	33,364,500	1,787
アメリカ・ドル	-	-	-	-	33,366,287	-	33,364,500	1,787
合計	3,796,381,438	-	3,796,150,700	230,738	59,614,076	-	59,604,880	5,622

(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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額	1.0930円	1.1122円
(1万口当たり純資産額)	(10,930円)	(11,122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7月29日現在

資産総額	5,894,255円
負債総額	1,492円
純資産総額（ - ）	5,892,763円
発行済数量	6,243,858口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9438円

（参考）

外国リート・パッシブ・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	34,948,764,639円
負債総額	14,484,000円
純資産総額（ - ）	34,934,280,639円
発行済数量	30,411,475,690口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1487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25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 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外国リートインデックスファンド< D C年金>の平成28年1月13日から平成28年7月12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外国リートインデックスファンド< D C年金>の平成28年7月12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13日から平成28年7月12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。