

【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8月31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 恵正
【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】	M I T O ラップ型ファンド（安定型） M I T O ラップ型ファンド（中立型） M I T O ラップ型ファンド（積極型） 当初申込期間： M I T O ラップ型ファンド（安定型） 500億円を上限とします。 M I T O ラップ型ファンド（中立型） 500億円を上限とします。 M I T O ラップ型ファンド（積極型） 500億円を上限とします。
【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。 継続申込期間： M I T O ラップ型ファンド（安定型） 5,000億円を上限とします。 M I T O ラップ型ファンド（中立型） 5,000億円を上限とします。 M I T O ラップ型ファンド（積極型） 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】

半期報告書の提出に伴い、平成27年10月23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>

(略)

(委託会社の略称：D I A M、

ファンドの略称 安定型：グッドラ安定、中立型：グッドツ中立、積極型：グッドブ積極)

<訂正後>

(略)

<基準価額の照会方法等>

(略)

(ファンドの略称 安定型：グッドラ安定、中立型：グッドツ中立、積極型：グッドブ積極)

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】****(2)【ファンドの沿革】**

<訂正前>

平成27年12月1日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始(予定)

<訂正後>

平成27年12月1日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円(平成27年7月31日現在)

(略)

大株主の状況

(平成27年7月31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)

委託会社の概況

(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】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

(参考)各ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

(略)

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF												
(略)													
運用報酬等	<p>運用会社は、運用報酬として、当該ETFの属するファンドグループの純資産総額の日々平均残高の合計額に対して以下の料率にしたがって計算される運用報酬の合計額のうち、当該ETFにかかる割当額を受領します。</p> <p>ただし、平成30年2月28日までの期間については、運用報酬の一時引き下げが適用され、年間総経費率が0.40%を超えないこととしております。(終了日は変更される可能性があります)。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>ファンドグループの純資産総額の合計額</th> <th>左記の残高レンジに適用される運用報酬率(年率)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>190億ドル以下</td> <td>0.6000%</td> </tr> <tr> <td>190億ドル超330億ドル以下</td> <td>0.5700%</td> </tr> <tr> <td>330億ドル超580億ドル以下</td> <td>0.5415%</td> </tr> <tr> <td>580億ドル超</td> <td>0.5145%</td> </tr> </tbody> </table>			ファンドグループの純資産総額の合計額	左記の残高レンジに適用される運用報酬率(年率)	190億ドル以下	0.6000%	190億ドル超330億ドル以下	0.5700%	330億ドル超580億ドル以下	0.5415%	580億ドル超	0.5145%
ファンドグループの純資産総額の合計額	左記の残高レンジに適用される運用報酬率(年率)												
190億ドル以下	0.6000%												
190億ドル超330億ドル以下	0.5700%												
330億ドル超580億ドル以下	0.5415%												
580億ドル超	0.5145%												

(略)

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
(略)	

投資態度

(略)

Standard & Poor's®並びに S&P®は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(以下「S&P」)の登録商標です。Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、DIAMアセットマネジメント株式会社に対しては特定の目的のために使用するサブライセンスが与えられています。S&P 先進国 REITインデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、DIAMアセットマネジメント株式会社に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ、S&P、およびその関連会社(以下総称してS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとする)は、DIAMアセットマネジメント株式会社の商品を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または商品に関する投資について、またS&P 先進国 REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスのDIAMアセットマネジメント株式会社に対するS&P 先進国 REITインデックスに関わる唯一の関係は、該当する指数、登録商標、サービスマーク、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの商号についての使用許諾を与えることです。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくはDIAMアセットマネジメント株式会社~~が~~得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害(利益の損失、トレーディング損失、損失時間、のれんを含む)について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとDIAMアセットマネジメント株式会社~~間~~での合意及び協定において、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。

(略)

ファンド名	コモディティインデックス・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>(略)</p> <p>S&P GSCI商品指数（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、それを利用するライセンスがD I A Mアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに付与されています。S&P®、S&P GSCI®およびS&P GSCI商品指数はS&Pの商標であり、これらを利用するライセンスがSPDJIとその関連会社に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがD I A Mアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。S&P GSCI商品指数は、Goldman Sachs & Co.またはその関連会社によって所有、保証、または承認されたものではなく、これら会社とは一切関係がありません。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、SPDJI、Dow Jones、S&P、それぞれの関連会社、または第三者のライセンスのいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行いません。</p>
(略)	

(注1) 上記内容は原則として、有価証券届出書提出時点の情報をもとに作成したものであり、今後、投資信託証券は追加・除外・入替等が行われることがあります。

(注2) 「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF」はブラックロック・ジャパン株式会社提供の資料を基に作成し、同社の確認のもと掲載したものです。

(略)

<訂正後>

(略)

(参考) 各ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

(略)

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF	
(略)		
運用報酬等	<p>運用会社は、運用報酬として、当該ETFの属するファンドグループの純資産総額の日々平均残高の合計額に対して以下の料率にしたがって計算される運用報酬の合計額のうち、当該ETFにかかる割当額を受領します。</p> <p>ただし、平成30年2月28日までの期間については、運用報酬の一時引き下げが適用され、年間総経費率が0.40%を超えないこととしております。(終了日は変更される可能性があります)。</p>	
	ファンドグループの純資産総額の合計額	左記の残高レンジに適用される運用報酬率（年率）
	190億ドル以下	0.6000%
	190億ドル超330億ドル以下	0.5700%
	330億ドル超470億ドル以下	0.5415%
	470億ドル超	0.5145%

(略)

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>(略)</p> <p>Standard & Poor's®並びに S&P®は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシズLLC(以下「S&P」)の登録商標です。Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、<u>委託会社</u>に対しては特定の目的のために使用するサブライセンスが与えられています。S&P 先進国 REITインデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、<u>委託会社</u>に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ、S&P、およびその関連会社(以下総称してS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとする)は、<u>委託会社</u>の商品を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または商品に関する投資について、またS&P 先進国 REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの<u>委託会社</u>に対するS&P 先進国 REITインデックスに関わる唯一の関係は、該当する指数、登録商標、サービスマーク、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの商号についての使用許諾を与えることです。</p> <p>S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、<u>委託会社</u>又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、<u>委託会社</u>又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。</p> <p>S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくは<u>委託会社</u>が得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害(利益の損失、トレーディング損失、損失時間、のれんを含む)について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスと<u>委託会社</u>間での合意及び協定において、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。</p>

(略)

ファンド名	コモディティインデックス・マザーファンド
(略)	
投資態度	<p>(略)</p> <p>S&P GSCI商品指数（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、それを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones TrademarkHoldings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに付与されています。S&P®、S&P GSCI®およびS&P GSCI商品指数はS&Pの商標であり、これらを利用するライセンスがSPDJIとその関連会社に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。S&P GSCI商品指数は、Goldman Sachs & Co.またはその関連会社によって所有、保証、または承認されたものではなく、これら会社とは一切関係がありません。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、SPDJI、Dow Jones、S&P、それぞれの関連会社、または第三者のライセンサーのいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行いません。</p>
(略)	

(注1) 上記内容は原則として、平成28年6月末時点の情報をもとに作成したものであり、今後、投資信託証券は追加・除外・入替等が行われることがあります。

(注2) 「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF」はブラックロック・ジャパン株式会社提供の平成28年7月1日時点の資料を基に作成し、同社の確認のもと掲載したものです。

(略)

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

(略)

上記体制は平成27年7月31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 >

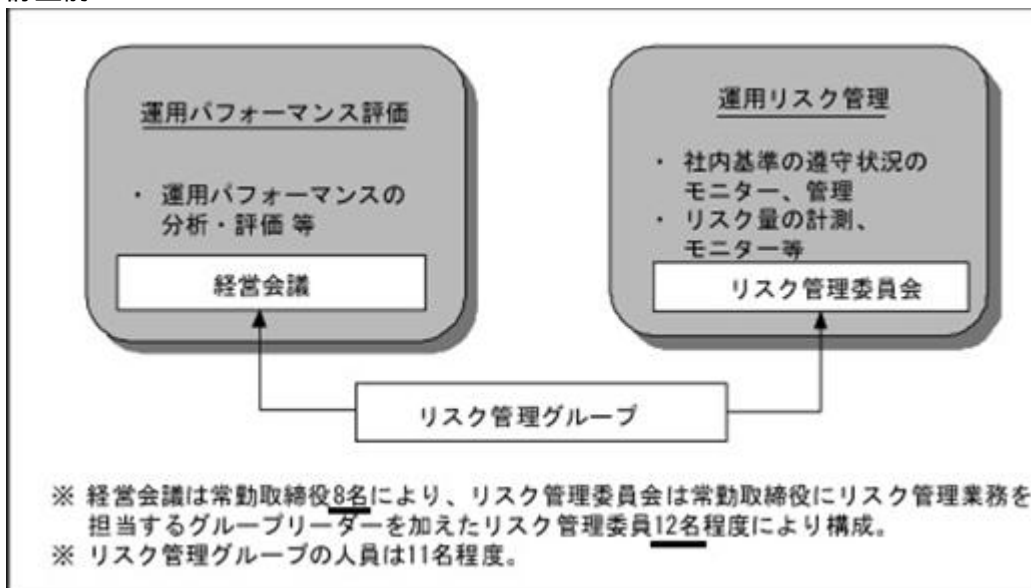
(略)

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】

< 運用評価・運用リスク管理体制 >

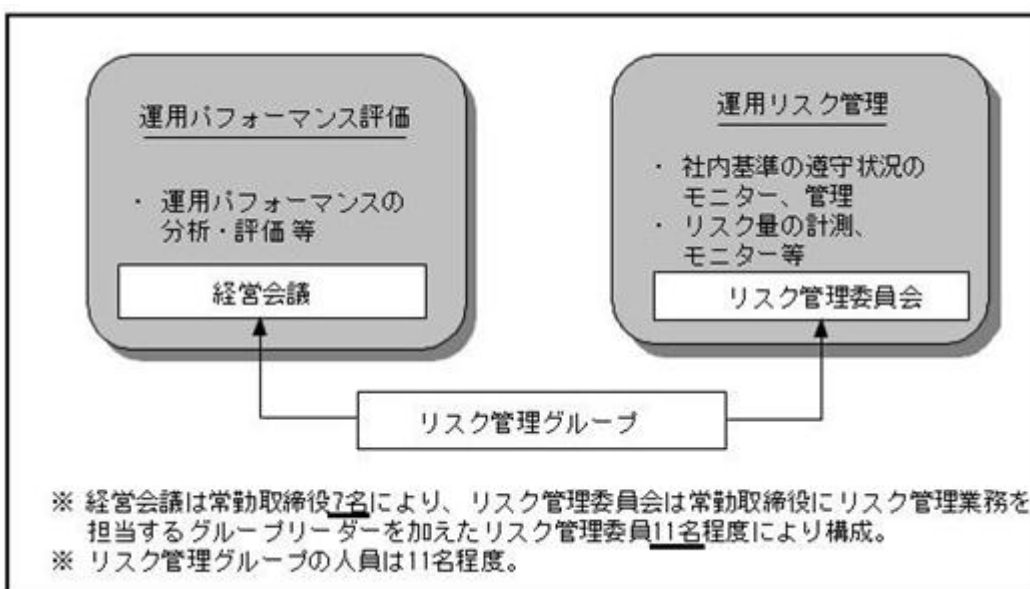
< 訂正前 >



(略)

上記体制は平成27年7月31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)

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。

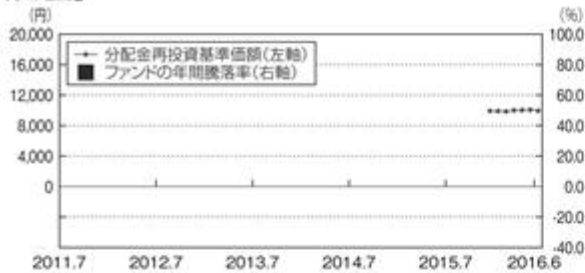
「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<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

「安定型」



「中立的型」

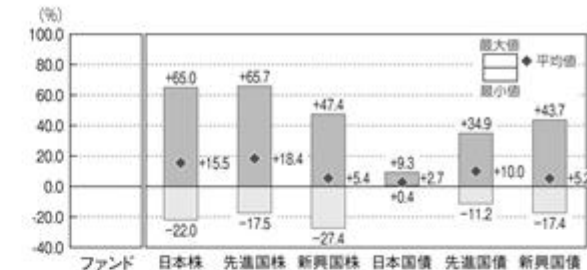


「積極型」

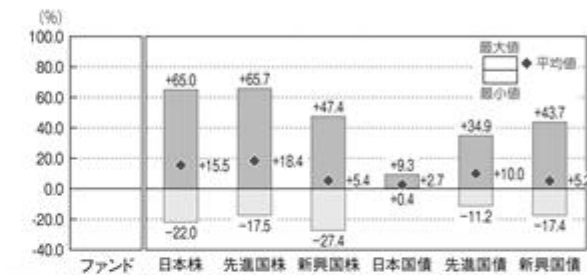


*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
*ファンドは2016年6月末現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

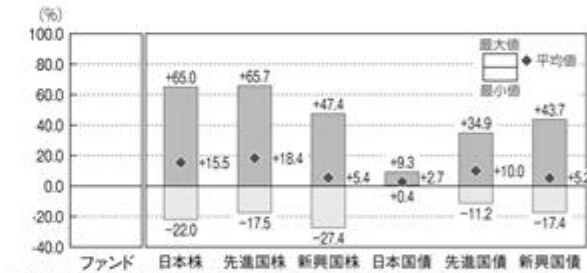
ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



ファンド:2016年6月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。
代表的な資産クラス:2011年7月～2016年6月



ファンド:2016年6月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。
代表的な資産クラス:2011年7月～2016年6月



ファンド:2016年6月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。
代表的な資産クラス:2011年7月～2016年6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・レディバース・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LLCIに帰属します。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・レディバース・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】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

(略)	
実質的な負担	<p>各ファンドの日々の純資産総額に対して年率<u>1.34544%</u>～<u>1.43060%</u>程度 (<u>税抜1.24704%</u>～<u>1.33220%</u>程度)(概算)</p> <p>上記の概算は、各ファンドの信託報酬率と投資対象とする投資信託証券の信託報酬率を合わせた実質的な信託報酬率であり、各ファンドの長期的戦略および短・中期的戦略に基づいて決定される資産配分に基づき算出したものです(設定当初予定している資産配分に基づき算出)。この値は目安であり、投資対象とする投資信託証券の実際の組入比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることなどから、実質的な信託報酬率は変動することがあり、あらかじめ上限額等を記載することができません。そのため、実質的な信託報酬率は概算で表示しています。</p>

(略)

<訂正後>

(略)	
実質的な負担	<p>各ファンドの日々の純資産総額に対して年率<u>1.344744%</u>～<u>1.421864%</u>程度 (<u>税抜1.246344%</u>～<u>1.323464%</u>程度)(概算)</p> <p>上記の概算は、各ファンドの信託報酬率と投資対象とする投資信託証券の信託報酬率を合わせた実質的な信託報酬率であり、各ファンドの長期的戦略および短・中期的戦略に基づいて決定される資産配分に基づき算出したものです(平成28年6月末時点の資産配分に基づき算出)。この値は目安であり、投資対象とする投資信託証券の実際の組入比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることなどから、実質的な信託報酬率は変動することがあり、あらかじめ上限額等を記載することができません。そのため、実質的な信託報酬率は概算で表示しています。</p>

(略)

(4)【その他の手数料等】

<訂正前>

(略)

・その他の費用

(略)

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。

(略)

不動産投資信託(リート)は市場の需給により価格形成されるため、不動産投資信託(リート)の費用は表示しておりません。

(略)

<訂正後>

（略）

・その他の費用

（略）

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

（略）

上場不動産投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託（リート）の費用は表示しておりません。

（略）

（５）【課税上の取扱い】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」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>

各ファンドは、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

収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

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。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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。

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。

個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動引き落とし投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金(特別分配金)が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

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】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

平成28年6月30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	23,709,043	6.54
内 アメリカ	23,709,043	6.54
親投資信託受益証券	321,278,092	88.68
内 日本	321,278,092	88.68
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,304,071	4.78
純資産総額	362,291,206	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。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

平成28年6月30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	65,052,426	13.56
内 アメリカ	65,052,426	13.56
親投資信託受益証券	390,683,314	81.43
内 日本	390,683,314	81.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	24,035,557	5.01
純資産総額	479,771,297	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。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

平成28年6月30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	101,323,724	16.70
内 アメリカ	101,323,724	16.70
親投資信託受益証券	476,182,037	78.49
内 日本	476,182,037	78.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	29,179,486	4.81
純資産総額	606,685,247	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)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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	257,396,762,910	97.56
内 日本	257,396,762,910	97.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,444,515,920	2.44
純資産総額	263,841,278,830	100.00

その他資産の投資状況

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,501,510,000	2.46
内 日本	6,501,510,000	2.46

(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。

国内債券パッシブ・ファンド・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（％）
国債証券	324,426,949,400	82.78
内 日本	324,426,949,400	82.78
地方債証券	25,159,579,361	6.42
内 日本	25,159,579,361	6.42
特殊債券	21,731,183,431	5.55
内 日本	21,731,183,431	5.55
社債券	19,489,216,910	4.97
内 日本	19,188,135,910	4.90
内 オランダ	201,822,000	0.05
内 イギリス	99,259,000	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,092,642,293	0.28
純資産総額	391,899,571,395	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。

J - R E I Tインデックスファンド・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（％）
投資証券	21,593,385,400	98.92
内 日本	21,593,385,400	98.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	236,415,349	1.08
純資産総額	21,829,800,749	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。

外国株式パッシブ・ファンド・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	227,393,624,867	93.78
内 アメリカ	140,106,455,773	57.78
内 イギリス	17,395,223,632	7.17
内 スイス	9,430,551,520	3.89
内 カナダ	9,197,649,158	3.79
内 フランス	8,265,633,223	3.41
内 ドイツ	8,133,135,674	3.35
内 オーストラリア	6,011,515,667	2.48
内 アイルランド	4,006,947,443	1.65
内 オランダ	3,946,212,272	1.63
内 スペイン	2,769,885,574	1.14
内 スウェーデン	2,565,857,844	1.06
内 香港	2,145,639,038	0.88
内 デンマーク	1,856,296,806	0.77
内 イタリア	1,645,621,087	0.68
内 シンガポール	1,645,502,805	0.68
内 ベルギー	1,394,573,444	0.58
内 ジャージー	1,355,945,701	0.56
内 フィンランド	925,350,379	0.38
内 オランダ領キュラソー	878,736,651	0.36
内 バミューダ	753,818,543	0.31
内 イスラエル	659,860,126	0.27
内 ノルウェー	601,030,663	0.25
内 ケイマン諸島	597,365,711	0.25
内 ルクセンブルグ	221,992,566	0.09
内 オーストリア	167,041,562	0.07
内 ニューゼaland	154,359,264	0.06
内 パナマ	148,605,110	0.06
内 ポルトガル	138,184,572	0.06
内 リベリア	94,702,887	0.04
内 イギリス領バージン諸島	72,182,321	0.03
内 パプアニューギニア	58,549,830	0.02
内 マン島	31,481,072	0.01
内 モーリシャス	17,716,949	0.01
投資信託受益証券	787,151,279	0.32

	内 オーストラリア	667,185,880	0.28
	内 シンガポール	119,965,399	0.05
投資証券		5,998,523,982	2.47
	内 アメリカ	5,175,053,286	2.13
	内 フランス	371,094,521	0.15
	内 イギリス	273,127,834	0.11
	内 香港	123,402,532	0.05
	内 カナダ	55,845,809	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,304,087,444	3.42
純資産総額		242,483,387,572	100.00

その他資産の投資状況

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	5,041,922,400	2.08
-	5,041,922,400	2.08
株価指数先物取引（買建）	8,559,616,160	3.53
内 アメリカ	5,742,748,476	2.37
内 ドイツ	1,470,442,269	0.61
内 イギリス	652,170,618	0.27
内 カナダ	362,043,500	0.15
内 オーストラリア	332,211,297	0.14

（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）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（注4）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。

外国債券パッシブ・ファンド・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（％）
国債証券	244,366,030,876	97.32
内 アメリカ	105,972,531,412	42.21
内 フランス	24,533,961,635	9.77
内 イタリア	23,813,604,084	9.48
内 イギリス	19,168,260,949	7.63
内 ドイツ	18,512,515,663	7.37
内 スペイン	13,382,097,960	5.33
内 ベルギー	6,566,557,769	2.62
内 オランダ	5,888,325,538	2.35
内 カナダ	5,123,014,778	2.04
内 オーストラリア	4,684,945,412	1.87
内 オーストリア	3,758,773,182	1.50
内 メキシコ	2,173,521,329	0.87
内 アイルランド	1,869,872,755	0.74
内 デンマーク	1,622,388,606	0.65
内 フィンランド	1,442,188,048	0.57
内 ポーランド	1,324,286,467	0.53
内 マレーシア	1,085,923,309	0.43
内 スウェーデン	1,081,991,528	0.43
内 南アフリカ	1,003,996,248	0.40
内 シンガポール	813,765,305	0.32
内 ノルウェー	543,508,899	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,719,150,571	2.68
純資産総額	251,085,181,447	100.00

その他資産の投資状況

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	248,450,820	0.10
-	248,450,820	0.10
為替予約取引（売建）	88,995,420	0.04
-	88,995,420	0.04

（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）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

外国リート・パッシブ・ファンド・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（％）
投資信託受益証券	3,141,228,514	11.13
内 オーストラリア	2,313,080,470	8.19
内 シンガポール	819,659,517	2.90
内 カナダ	8,488,527	0.03
投資証券	24,870,786,929	88.09
内 アメリカ	20,536,656,296	72.74
内 イギリス	1,323,822,528	4.69
内 フランス	1,184,274,662	4.19
内 カナダ	547,053,215	1.94
内 香港	490,381,674	1.74
内 ベルギー	182,787,141	0.65
内 ニュージーランド	136,862,917	0.48
内 オランダ	131,563,907	0.47
内 スペイン	111,781,770	0.40
内 アイルランド	61,844,025	0.22
内 ドイツ	52,797,871	0.19
内 シンガポール	40,922,481	0.14
内 イタリア	23,440,523	0.08
内 マン島	18,369,553	0.07
内 ガーンジー	15,866,978	0.06
内 イスラエル	12,361,388	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	222,276,089	0.79
純資産総額	28,234,291,532	100.00

その他資産の投資状況

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	24,930,000	0.09
-	24,930,000	0.09

（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）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

コモディティインデックス・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（％）
社債券	1,987,255,523	99.20
内 イギリス	1,987,255,523	99.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,926,394	0.80
純資産総額	2,003,181,917	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。

エマージング株式パッシブ・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	32,678,248,317	95.78
内 韓国	4,850,232,276	14.22
内 台湾	3,945,705,041	11.56
内 ケイマン諸島	3,516,501,526	10.31
内 中国	3,357,868,942	9.84
内 インド	2,779,519,611	8.15
内 ブラジル	2,378,950,361	6.97
内 南アフリカ	2,158,413,965	6.33
内 香港	1,402,132,092	4.11
内 ロシア	1,241,222,649	3.64
内 メキシコ	1,083,512,612	3.18
内 マレーシア	978,922,093	2.87
内 インドネシア	914,099,001	2.68
内 タイ	740,007,388	2.17
内 フィリピン	525,079,875	1.54
内 トルコ	430,754,472	1.26
内 チリ	404,910,350	1.19
内 ポーランド	368,954,690	1.08
内 バミューダ	365,685,346	1.07
内 カタール	298,244,948	0.87
内 アラブ首長国連邦	291,198,288	0.85
内 コロンビア	160,813,027	0.47
内 オランダ	142,896,944	0.42
内 ハンガリー	94,331,136	0.28
内 ギリシャ	65,981,672	0.19
内 チェコ	53,350,503	0.16
内 エジプト	42,812,219	0.13
内 マルタ	27,787,241	0.08
内 ペルー	21,888,722	0.06
内 マン島	20,514,556	0.06
内 アメリカ	15,956,771	0.05
投資信託受益証券	222,594,110	0.65
内 メキシコ	222,594,110	0.65
投資証券	106,275,109	0.31
内 メキシコ	47,501,394	0.14
内 南アフリカ	42,369,380	0.12
内 トルコ	16,404,335	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,112,590,636	3.26
純資産総額	34,119,708,172	100.00

その他資産の投資状況

平成28年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	172,870,200	0.51
-	172,870,200	0.51
為替予約取引（売建）	205,800,000	0.60
-	205,800,000	0.60
株価指数先物取引（買建）	1,049,413,919	3.08
内 アメリカ	1,049,413,919	3.08

（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）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（注4）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】

M I T O ラップ型ファンド（安定型）

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	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	176,315,701	1.2482 220,090,834	1.3251 233,635,935	- -	64.49%
2	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	16,955,080	1.8547 31,448,235	1.6765 28,425,191	- -	7.85%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	2,010	11,042.59 22,195,618	11,795.54 23,709,043	- -	6.54%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	6,557,911	2.7733 18,187,349	2.4069 15,784,235	- -	4.36%
5	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	7,691,091	2.1604 16,616,429	1.8243 14,030,857	- -	3.87%
6	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	12,753,401	1.1357 14,484,620	1.0835 13,818,309	- -	3.81%
7	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	19,264,420	0.4100 7,899,668	0.3772 7,266,539	- -	2.01%
8	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	8,709,705	0.9093 7,920,193	0.8051 7,012,183	- -	1.94%
9	J - R E I T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	729,126	1.7414 1,269,771	1.7896 1,304,843	- -	0.36%

（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
投資信託受益証券	6.54%
親投資信託受益証券	88.68%
合計	95.22%

（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。

MITO ラップ型ファンド（中立型）

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	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	129,810,216	1.2429 161,349,155	1.3251 172,011,517	- -	35.85%
2	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	47,073,483	1.8616 87,633,154	1.6765 78,918,694	- -	16.45%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	5,515	11,008.11 60,709,760	11,795.54 65,052,426	- -	13.56%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	15,524,269	2.7608 42,860,000	2.4069 37,365,363	- -	7.79%
5	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	30,050,323	1.1471 34,472,111	1.0835 32,559,524	- -	6.79%
6	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	15,572,830	2.1860 34,043,000	1.8243 28,409,513	- -	5.92%
7	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	24,120,072	0.9161 22,097,776	0.8051 19,419,069	- -	4.05%
8	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	50,225,712	0.4061 20,398,579	0.3772 18,945,138	- -	3.95%
9	J-REIT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	1,706,804	1.7036 2,907,828	1.7896 3,054,496	- -	0.64%

(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
投資信託受益証券	13.56%
親投資信託受益証券	81.43%
合計	94.99%

(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。

MITO ラップ型ファンド（積極型）

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	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	72,323,993	1.8617 134,645,707	1.6765 121,251,174	- -	19.99%
2	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	8,590	11,054.69 94,959,832	11,795.54 101,323,724	- -	16.70%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	36,280,227	2.7551 99,955,864	2.4069 87,322,878	- -	14.39%
4	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	70,084,204	1.1452 80,265,498	1.0835 75,936,235	- -	12.52%
5	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	48,709,972	1.2449 60,639,979	1.3251 64,545,583	- -	10.64%
6	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	33,264,479	2.1994 73,164,982	1.8243 60,684,389	- -	10.00%
7	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	79,370,420	0.4130 32,782,154	0.3772 29,938,522	- -	4.93%
8	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	36,509,345	0.9202 33,598,468	0.8051 29,393,673	- -	4.84%
9	J-REIT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	3,972,722	1.7181 6,825,645	1.7896 7,109,583	- -	1.17%

(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
投資信託受益証券	16.70%
親投資信託受益証券	78.49%
合計	95.19%

(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)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・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	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,736,300	6,540.53 11,356,332,477	5,052.00 8,771,787,600	- -	3.32%
2	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,065,000	5,291.89 5,635,864,911	4,800.00 5,112,000,000	- -	1.94%
3	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	11,054,800	538.70 5,955,249,820	455.90 5,039,883,320	- -	1.91%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	780,700	5,132.96 4,007,306,784	5,789.00 4,519,472,300	- -	1.71%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,362,600	3,193.02 4,350,809,733	3,113.00 4,241,773,800	- -	1.61%
6	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	924,700	4,648.79 4,298,741,902	4,103.00 3,794,044,100	- -	1.44%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,256,300	3,130.80 3,933,229,820	2,572.50 3,231,831,750	- -	1.22%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,103,200	3,419.36 3,772,240,032	2,926.00 3,227,963,200	- -	1.22%
9	ソニー 日本	株式 電気機器	985,000	2,567.11 2,528,611,631	2,988.00 2,943,180,000	- -	1.12%
10	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	19,523,800	181.67 3,546,889,348	148.30 2,895,379,540	- -	1.10%
11	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,029,200	2,832.96 2,915,683,090	2,766.50 2,847,281,800	- -	1.08%
12	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,637,300	1,661.06 2,719,655,566	1,600.00 2,619,680,000	- -	0.99%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	582,300	5,833.89 3,397,079,815	4,424.00 2,576,095,200	- -	0.98%
14	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	576,300	5,145.34 2,965,261,124	4,281.00 2,467,140,300	- -	0.94%
15	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	255,200	10,847.18 2,768,200,376	9,433.00 2,407,301,600	- -	0.91%
16	ファナック 日本	株式 電気機器	142,800	16,431.21 2,346,378,039	16,535.00 2,361,198,000	- -	0.89%
17	花王 日本	株式 化学	393,200	6,194.39 2,435,636,932	5,929.00 2,331,282,800	- -	0.88%
18	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	125,000	22,387.46 2,798,433,144	18,125.00 2,265,625,000	- -	0.86%
19	キヤノン 日本	株式 電気機器	751,600	3,368.84 2,532,026,408	2,912.50 2,189,035,000	- -	0.83%
20	キーエンス 日本	株式 電気機器	31,600	58,095.66 1,835,822,906	69,140.00 2,184,824,000	- -	0.83%

21	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,025,000	2,251.54 2,307,829,840	1,873.00 1,919,825,000	- -	0.73%
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	558,200	3,950.12 2,204,958,104	3,367.00 1,879,459,400	- -	0.71%
23	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,033,800	1,874.98 1,938,362,936	1,788.00 1,848,434,400	- -	0.70%
24	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,489,000	1,145.86 1,706,185,880	1,208.00 1,798,712,000	- -	0.68%
25	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,947,700	1,081.69 2,106,811,263	917.90 1,787,793,830	- -	0.68%
26	ダイキン工業 日本	株式 機械	203,300	7,723.80 1,570,250,340	8,514.00 1,730,896,200	- -	0.66%
27	三井不動産 日本	株式 不動産業	731,000	2,671.12 1,952,590,600	2,331.50 1,704,326,500	- -	0.65%
28	村田製作所 日本	株式 電気機器	147,200	13,989.02 2,059,184,430	11,380.00 1,675,136,000	- -	0.63%
29	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	493,400	4,140.07 2,042,713,620	3,269.00 1,612,924,600	- -	0.61%
30	信越化学工業 日本	株式 化学	262,200	5,982.68 1,568,660,768	5,962.00 1,563,236,400	- -	0.59%

(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	97.56%
合計	97.56%

(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
電気機器	国内	11.52%
輸送用機器		8.76%
情報・通信業		8.60%
銀行業		6.94%
化学		6.09%
医薬品		5.88%
食料品		5.26%
小売業		5.00%
陸運業		4.65%
機械		4.58%
卸売業		4.11%
サービス業		3.86%
建設業		3.26%
不動産業		2.67%
保険業		2.09%
電気・ガス業		1.94%
その他製品		1.59%
精密機器		1.55%
その他金融業		1.18%
鉄鋼		1.14%
証券、商品先物取引業		0.89%
ガラス・土石製品		0.86%
ゴム製品		0.82%
非鉄金属		0.80%
繊維製品		0.71%
空運業		0.62%
金属製品		0.60%
石油・石炭製品		0.50%
鋳業		0.29%
パルプ・紙		0.26%
海運業		0.22%
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.11%	
合計		97.56%

(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。

国内債券パッシブ・ファンド・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	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	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	102.31 5,115,935,000	103.43 5,171,550,000	0.100000 2026/3/20	1.32%
2	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	101.02 4,546,125,000	101.64 4,573,980,000	0.100000 2020/6/20	1.17%
3	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	101.41 4,563,765,000	0.100000 2019/12/20	1.16%
4	106回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.54 4,524,705,000	100.62 4,527,945,000	0.200000 2017/9/20	1.16%
5	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	101.25 4,252,626,000	0.200000 2018/12/20	1.09%
6	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	103.35 4,134,275,000	106.28 4,251,200,000	0.400000 2025/9/20	1.08%
7	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.06 4,042,440,000	101.77 4,070,880,000	0.100000 2020/9/20	1.04%
8	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.10 4,044,000,000	101.37 4,055,160,000	0.200000 2019/3/20	1.03%
9	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.00 3,535,210,000	101.51 3,553,165,000	0.100000 2020/3/20	0.91%
10	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,650,000	101.50 3,552,815,000	0.200000 2019/6/20	0.91%
11	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	101.33 3,546,795,000	0.300000 2018/9/20	0.91%
12	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,300,000,000	100.64 3,321,285,000	100.74 3,324,486,000	0.200000 2017/12/20	0.85%
13	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	103.03 3,297,024,000	102.65 3,284,864,000	1.500000 2017/12/20	0.84%
14	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,200,000,000	101.37 3,244,044,000	101.87 3,260,096,000	0.100000 2020/12/20	0.83%
15	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	107.64 3,229,290,000	1.300000 2021/3/20	0.82%

16	339回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	103.25 3,097,560,000	106.20 3,186,030,000	0.400000 2025/6/20	0.81%
17	341回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	103.34 3,100,200,000	105.38 3,161,430,000	0.300000 2025/12/20	0.81%
18	296回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	104.30 3,129,060,000	103.97 3,119,280,000	1.500000 2018/9/20	0.80%
19	127回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	101.57 3,047,255,000	101.98 3,059,490,000	0.100000 2021/3/20	0.78%
20	301回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	105.39 3,056,426,000	1.500000 2019/6/20	0.78%
21	355回 利付国庫債券（2年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.36 3,010,950,000	100.46 3,013,920,000	0.100000 2017/8/15	0.77%
22	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	105.57 2,955,960,000	1.000000 2020/9/20	0.75%
23	321回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.86 2,671,625,000	107.67 2,691,900,000	1.000000 2022/3/20	0.69%
24	143回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	2,100,000,000	116.03 2,436,735,000	127.58 2,679,348,000	1.600000 2033/3/20	0.68%
25	325回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	106.22 2,655,660,000	107.10 2,677,500,000	0.800000 2022/9/20	0.68%
26	149回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	2,100,000,000	113.46 2,382,670,000	126.94 2,665,782,000	1.500000 2034/6/20	0.68%
27	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	105.61 2,640,425,000	1.300000 2019/12/20	0.67%
28	123回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	1,900,000,000	123.98 2,355,715,000	132.38 2,515,258,000	2.100000 2030/12/20	0.64%
29	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,300,000,000	105.26 2,421,080,000	107.34 2,468,820,000	0.600000 2024/6/20	0.63%
30	141回 利付国庫債券（20年） 日本	国債証券	1,900,000,000	117.81 2,238,435,000	129.04 2,451,931,000	1.700000 2032/12/20	0.63%

（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
国債証券	82.78%
地方債証券	6.42%
特殊債券	5.55%
社債券	4.97%
合計	99.72%

(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。

J - R E I Tインデックスファンド・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	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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	2,629	653,989.64 1,719,338,771	633,000.00 1,664,157,000	- -	7.62%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,438	639,310.51 1,558,639,029	634,000.00 1,545,692,000	- -	7.08%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	4,753	258,634.89 1,229,291,672	262,100.00 1,245,761,300	- -	5.71%
4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	6,931	172,223.89 1,193,683,799	162,700.00 1,127,673,700	- -	5.17%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	5,477	179,669.72 984,051,058	185,100.00 1,013,792,700	- -	4.64%
6	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	3,430	239,231.33 820,563,487	251,000.00 860,930,000	- -	3.94%
7	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	4,509	179,913.60 811,230,447	177,300.00 799,445,700	- -	3.66%
8	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,626	455,800.84 741,132,171	441,000.00 717,066,000	- -	3.28%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,421	287,400.15 695,795,781	275,300.00 666,501,300	- -	3.05%
10	G L P 投資法人 日本	投資証券	4,830	125,805.53 607,640,719	129,800.00 626,934,000	- -	2.87%
11	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,117	571,095.20 637,913,340	544,000.00 607,648,000	- -	2.78%
12	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	901	658,815.73 593,592,978	609,000.00 548,709,000	- -	2.51%

13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	6,186	96,065.64 594,262,063	86,500.00 535,089,000	- -	2.45%
14	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,260	164,979.98 537,834,762	161,200.00 525,512,000	- -	2.41%
15	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	924	528,449.94 488,287,751	534,000.00 493,416,000	- -	2.26%
16	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,458	205,602.41 505,370,739	194,800.00 478,818,400	- -	2.19%
17	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	754	640,717.55 483,101,033	613,000.00 462,202,000	- -	2.12%
18	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	6,845	76,636.60 524,577,529	64,800.00 443,556,000	- -	2.03%
19	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	902	456,872.43 412,098,939	468,000.00 422,136,000	- -	1.93%
20	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	653	593,016.01 387,239,461	604,000.00 394,412,000	- -	1.81%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,639	246,101.65 403,360,617	239,700.00 392,868,300	- -	1.80%
22	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,392	274,573.62 382,206,481	279,100.00 388,507,200	- -	1.78%
23	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	657	569,129.28 373,917,940	573,000.00 376,461,000	- -	1.72%
24	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	1,782	187,894.70 334,828,359	187,800.00 334,659,600	- -	1.53%
25	プレミア投資法人 日本	投資証券	2,453	141,819.76 347,883,872	135,100.00 331,400,300	- -	1.52%
26	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,355	151,013.84 355,637,598	140,600.00 331,113,000	- -	1.52%
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,438	138,796.84 338,386,698	117,500.00 286,465,000	- -	1.31%
28	福岡リート投資法人 日本	投資証券	1,391	205,420.97 285,740,571	203,400.00 282,929,400	- -	1.30%
29	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	1,820	153,662.22 279,665,251	146,100.00 265,902,000	- -	1.22%
30	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	3,054	84,630.96 258,462,953	84,200.00 257,146,800	- -	1.18%

(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
投資証券	98.92%
合計	98.92%

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・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	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	436,496	9,676.20 4,223,622,997	9,714.70 4,240,429,437	- -	1.75%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	327,188	8,348.44 2,731,510,835	9,515.05 3,113,212,993	- -	1.28%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	591,114	5,196.95 3,071,992,857	5,201.07 3,074,426,119	- -	1.27%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	217,510	10,478.29 2,279,134,206	12,280.25 2,671,077,242	- -	1.10%
5	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	31,487	52,233.03 1,644,661,578	73,642.39 2,318,778,122	- -	0.96%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	734,624	2,908.23 2,136,460,404	3,143.90 2,309,584,760	- -	0.95%
7	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	487,453	3,753.12 1,829,473,356	4,377.79 2,133,967,551	- -	0.88%
8	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	180,764	10,568.06 1,910,325,546	11,748.20 2,123,652,637	- -	0.88%
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	251,220	7,554.53 1,897,849,780	7,853.98 1,973,077,483	- -	0.81%
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	212,967	8,334.68 1,775,011,987	8,635.17 1,839,007,974	- -	0.76%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	379,452	4,868.67 1,847,427,365	4,833.68 1,834,150,567	- -	0.76%
12	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	321,217	5,156.82 1,656,458,282	5,666.22 1,820,087,667	- -	0.75%
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	288,744	5,925.40 1,710,924,046	6,298.09 1,818,536,276	- -	0.75%

14	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	485,977	3,021.43 1,468,349,180	3,602.87 1,750,916,376	- -	0.72%
15	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	24,506	70,298.05 1,722,724,058	70,401.76 1,725,265,533	- -	0.71%
16	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	23,011	72,828.15 1,675,848,655	71,542.00 1,646,253,028	- -	0.68%
17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	148,050	8,811.27 1,304,508,825	10,642.95 1,575,689,073	- -	0.65%
18	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	178,695	7,474.90 1,335,727,613	8,379.33 1,497,344,821	- -	0.62%
19	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	326,767	4,436.45 1,449,685,489	4,573.32 1,494,410,187	- -	0.62%
20	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	55,255	25,668.60 1,418,318,548	26,708.79 1,475,794,412	- -	0.61%
21	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	93,989	13,214.57 1,242,024,758	14,625.56 1,374,642,623	- -	0.57%
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	99,328	12,025.79 1,194,497,866	13,107.64 1,301,956,331	- -	0.54%
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	218,294	5,045.67 1,101,441,080	5,871.01 1,281,607,457	- -	0.53%
24	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	191,735	5,843.22 1,120,351,665	6,580.06 1,261,628,839	- -	0.52%
25	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	122,250	9,165.16 1,120,441,372	10,148.98 1,240,713,318	- -	0.51%
26	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	122,749	9,380.24 1,151,415,877	9,980.21 1,225,061,018	- -	0.51%
27	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	370,915	2,953.34 1,095,441,499	3,285.91 1,218,795,644	- -	0.50%
28	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	113,970	10,135.60 1,155,155,004	10,612.07 1,209,458,666	- -	0.50%
29	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	151,890	7,246.92 1,100,735,012	7,897.31 1,199,522,932	- -	0.49%
30	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	396,526	2,584.07 1,024,650,980	2,908.23 1,153,191,426	- -	0.48%

(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	93.78%
投資信託受益証券	0.32%
投資証券	2.47%
合計	96.58%

（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	7.69%
医薬品		6.62%
石油・ガス・消耗燃料		6.52%
保険		3.83%
ソフトウェア		3.14%
各種電気通信サービス		2.94%
メディア		2.72%
インターネットソフトウェア・サービス		2.68%
情報技術サービス		2.59%
化学		2.50%
飲料		2.48%
食品		2.40%
バイオテクノロジー		2.36%
コンピュータ・周辺機器		2.21%
食品・生活必需品小売り		2.13%
コングロマリット		2.11%
半導体・半導体製造装置		2.11%
航空宇宙・防衛		2.01%
電力		2.00%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.98%
専門小売り		1.88%
ヘルスケア機器・用品		1.81%
ホテル・レストラン・レジャー		1.77%
タバコ		1.69%
資本市場		1.62%
家庭用品		1.61%
各種金融サービス		1.45%
インターネット販売・カタログ販売		1.41%
金属・鉱業		1.33%
機械		1.24%
総合公益事業		1.23%
繊維・アパレル・贅沢品		1.16%
自動車		0.89%
通信機器		0.82%
陸運・鉄道		0.78%
パーソナル用品		0.73%
エネルギー設備・サービス		0.72%
電気設備		0.69%

不動産管理・開発	0.65%
航空貨物・物流サービス	0.58%
自動車部品	0.50%
複合小売り	0.49%
消費者金融	0.48%
専門サービス	0.46%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.45%
家庭用耐久財	0.43%
商業サービス・用品	0.43%
無線通信サービス	0.39%
電子装置・機器・部品	0.36%
建設資材	0.33%
建設・土木	0.33%
商社・流通業	0.30%
容器・包装	0.29%
建設関連製品	0.26%
ガス	0.25%
運送インフラ	0.24%
旅客航空輸送業	0.13%
水道	0.10%
販売	0.10%
レジャー用品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
紙製品・林産品	0.07%
海運業	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
合計	93.78%

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・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	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	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,852,380,000	109.69 2,031,968,241	110.03 2,038,192,237	3.625000 2020/2/15	0.81%
2	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,955,290,000	99.98 1,954,898,942	100.23 1,959,943,590	0.750000 2017/12/31	0.78%
3	US T N/B 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	1,903,835,000	101.43 1,931,193,108	101.60 1,934,467,705	1.375000 2018/9/30	0.77%
4	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,852,380,000	99.70 1,846,952,526	99.97 1,851,861,333	0.500000 2017/7/31	0.74%
5	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,698,015,000	106.17 1,802,799,505	106.85 1,814,481,848	2.625000 2020/8/15	0.72%
6	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,749,470,000	101.72 1,779,665,852	102.02 1,784,861,778	1.500000 2018/12/31	0.71%
7	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,543,650,000	105.93 1,635,234,754	104.70 1,616,247,859	4.750000 2017/8/15	0.64%
8	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,543,650,000	103.65 1,600,033,359	103.47 1,597,245,528	2.375000 2018/6/30	0.64%
9	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,543,650,000	101.82 1,571,744,430	103.35 1,595,501,203	1.750000 2022/5/15	0.64%
10	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,440,740,000	109.57 1,578,618,818	109.93 1,583,906,333	3.500000 2020/5/15	0.63%
11	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,543,650,000	100.54 1,552,035,106	102.57 1,583,445,297	1.625000 2022/8/15	0.63%
12	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,440,740,000	105.34 1,517,776,367	104.66 1,507,979,335	3.500000 2018/2/15	0.60%
13	US T N/B 1.875 08/31/17 アメリカ	国債証券	1,440,740,000	101.71 1,465,434,283	101.53 1,462,912,988	1.875000 2017/8/31	0.58%
14	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,389,285,000	102.29 1,421,182,983	104.70 1,454,720,323	2.000000 2025/2/15	0.58%
15	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	1,440,740,000	99.93 1,439,774,704	100.10 1,442,252,777	0.625000 2017/5/31	0.57%
16	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,337,830,000	106.89 1,430,113,513	106.86 1,429,698,786	3.125000 2019/5/15	0.57%
17	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,337,830,000	104.20 1,394,041,500	106.81 1,428,962,979	2.250000 2025/11/15	0.57%
18	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,389,285,000	100.85 1,401,107,815	101.80 1,414,347,701	1.375000 2020/5/31	0.56%
19	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,389,285,000	99.95 1,388,688,122	100.23 1,392,591,498	0.750000 2018/2/28	0.55%
20	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,306,957,000	104.09 1,360,450,750	105.44 1,378,120,808	2.125000 2021/12/31	0.55%
21	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,337,830,000	101.06 1,352,118,024	101.77 1,361,603,239	1.375000 2019/2/28	0.54%
22	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,234,920,000	108.00 1,333,713,600	107.26 1,324,636,938	4.000000 2018/8/15	0.53%
23	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,234,920,000	103.48 1,277,994,009	104.67 1,292,701,906	2.000000 2021/5/31	0.51%

24	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,234,920,000	101.92 1,258,716,908	104.64 1,292,220,288	2.000000 2025/8/15	0.51%
25	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,234,920,000	100.88 1,245,799,645	101.84 1,257,679,575	1.375000 2020/4/30	0.50%
26	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,183,465,000	104.38 1,235,324,950	105.78 1,251,975,788	2.250000 2021/3/31	0.50%
27	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,132,010,000	104.15 1,179,056,335	105.35 1,192,629,135	2.125000 2021/8/15	0.47%
28	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,109,583,000	108.60 1,205,007,138	107.24 1,190,027,767	4.500000 2018/2/1	0.47%
29	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,052,388,000	112.58 1,184,883,649	112.64 1,185,462,462	2.500000 2020/10/25	0.47%
30	US T N/B 2.0 02/28/21 アメリカ	国債証券	1,132,010,000	103.10 1,167,161,997	104.56 1,183,652,296	2.000000 2021/2/28	0.47%

(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
国債証券	97.32%
合計	97.32%

(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。

外国リート・パッシブ・ファンド・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	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	76,770	21,453.17 1,646,960,117	22,118.44 1,698,033,122	- -	6.01%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	36,580	24,823.22 908,033,654	26,140.16 956,207,385	- -	3.39%
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	88,640	7,557.80 669,923,789	7,771.76 688,889,090	- -	2.44%
4	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	130,460	5,140.75 670,662,516	5,053.91 659,333,111	- -	2.34%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	24,340	27,594.12 671,640,893	26,601.39 647,477,942	- -	2.29%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	90,760	6,793.63 616,590,015	6,998.90 635,220,989	- -	2.25%
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	34,060	18,019.02 613,727,824	18,333.41 624,436,165	- -	2.21%
8	VENTAS INC アメリカ	投資証券	83,970	7,193.46 604,034,911	7,414.66 622,609,462	- -	2.21%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	38,150	13,131.61 500,971,031	13,532.66 516,271,169	- -	1.83%
10	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,319,720	362.25 478,079,032	370.65 489,159,760	- -	1.73%
11	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	64,010	6,624.02 424,004,101	7,045.21 450,964,442	- -	1.60%
12	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	44,090	10,033.49 442,376,844	10,193.23 449,419,753	- -	1.59%
13	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	144,840	2,958.26 428,475,282	3,073.92 445,226,819	- -	1.58%
14	HCP INC アメリカ	投資証券	116,070	3,602.85 418,183,698	3,639.92 422,486,292	- -	1.50%
15	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	36,480	10,706.54 390,574,781	11,134.86 406,199,765	- -	1.44%
16	LINK REIT 香港	投資証券	557,523	670.60 373,878,844	715.37 398,839,131	- -	1.41%
17	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	473,750	822.35 389,592,226	817.28 387,186,873	- -	1.37%
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	16,260	22,631.35 367,985,851	23,105.35 375,693,043	- -	1.33%
19	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	104,330	3,053.25 318,545,642	3,181.97 331,975,681	- -	1.18%
20	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	185,870	1,711.90 318,192,025	1,651.70 307,002,501	- -	1.09%
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	17,630	16,170.24 285,081,432	16,875.18 297,509,455	- -	1.05%
22	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	31,140	8,990.82 279,974,347	9,401.85 292,773,845	- -	1.04%

23	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	199,330	1,637.07 326,318,391	1,414.55 281,962,291	- -	1.00%
24	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	31,400	8,390.90 263,474,355	8,637.23 271,209,219	- -	0.96%
25	SL GREEN アメリカ	投資証券	24,940	10,514.18 262,223,755	10,601.78 264,408,597	- -	0.94%
26	UDR INC アメリカ	投資証券	66,470	3,622.21 240,768,369	3,747.98 249,128,376	- -	0.88%
27	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	59,480	3,934.67 234,034,290	4,070.09 242,088,982	- -	0.86%
28	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	86,100	2,642.23 227,496,012	2,698.30 232,323,647	- -	0.82%
29	VEREIT INC アメリカ	投資証券	225,200	1,011.59 227,810,095	1,028.07 231,521,566	- -	0.82%
30	KLEPIERRE フランス	投資証券	46,960	4,594.90 215,776,626	4,559.01 214,091,271	- -	0.76%

(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
投資信託受益証券	11.13%
投資証券	88.09%
合計	99.21%

(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。

コモディティインデックス・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	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	GS Commodity Index Certificate 06/08/2017 イギリス	社債券	83,010	24,071.67 1,998,189,999	23,939.95 1,987,255,523	- 2017/6/8	99.20%

(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
社債券	99.20%
合計	99.20%

（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。

エマージング株式パッシブ・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	488,800	2,198.43 1,074,594,367	2,286.02 1,117,408,531	- -	3.27%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	8,784	116,471.41 1,023,084,882	125,081.59 1,098,716,774	- -	3.22%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,133,083	506.97 1,081,416,403	505.61 1,078,529,426	- -	3.16%
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	85,800	8,281.08 710,516,984	8,031.09 689,068,071	- -	2.02%
5	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	531,500	1,191.88 633,487,592	1,162.90 618,082,413	- -	1.81%
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	37,874	14,993.19 567,852,181	15,271.26 578,384,079	- -	1.70%
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	7,269,530	67.21 488,586,331	66.69 484,861,658	- -	1.42%
8	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	23,500	19,130.88 449,575,713	16,919.43 397,606,677	- -	1.17%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,372,235	57.64 367,308,341	56.22 358,262,345	- -	1.05%
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,211,120	263.31 318,908,204	262.35 317,737,332	- -	0.93%
11	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	159,109	1,797.18 285,949,094	1,800.58 286,488,562	- -	0.84%
12	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,849,200	42.95 294,174,390	40.17 275,185,787	- -	0.81%

13	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	129,665	1,706.45 221,267,303	1,910.28 247,696,650	- -	0.73%
14	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	406,695	606.77 246,773,232	607.49 247,066,724	- -	0.72%
15	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	248,308	1,051.82 261,176,442	945.74 234,835,652	- -	0.69%
16	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	523,175	452.31 236,639,774	444.57 232,588,537	- -	0.68%
17	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	239,629	777.39 186,286,102	903.54 216,516,735	- -	0.63%
18	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	448,500	501.60 224,969,353	445.53 199,822,896	- -	0.59%
19	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	240,715	836.83 201,439,153	799.77 192,518,464	- -	0.56%
20	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,539,000	129.06 198,624,101	123.98 190,806,759	- -	0.56%
21	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,707,278	75.37 204,060,880	63.05 170,700,375	- -	0.50%
22	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	112,346	1,628.87 182,997,696	1,479.35 166,199,841	- -	0.49%
23	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	38,007	4,329.94 164,568,371	4,270.76 162,318,965	- -	0.48%
24	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,590	96,247.19 153,033,045	101,248.00 160,984,320	- -	0.47%
25	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,201,200	70.47 155,131,366	72.39 159,365,999	- -	0.47%
26	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	40,871	3,863.27 157,895,800	3,829.43 156,512,919	- -	0.46%
27	NAVER CORP 韓国	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	2,411	60,247.38 145,256,453	63,884.79 154,026,252	- -	0.45%
28	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	12,219	13,577.49 165,903,419	12,454.39 152,180,313	- -	0.45%
29	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV メキシコ	投資信託受益 証券 -	159,000	898.13 142,802,970	938.87 149,281,792	- -	0.44%

30	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信サー ビス	145,822	994.20 144,976,339	1,004.30 146,450,099	- -	0.43%
----	------------------------	--------------------	---------	-----------------------	-------------------------	--------	-------

（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	95.78%
投資信託受益証券	0.65%
投資証券	0.31%
合計	96.74%

（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	15.36%
インターネットソフトウェア・サービス		7.68%
石油・ガス・消耗燃料		7.15%
コンピュータ・周辺機器		4.84%
半導体・半導体製造装置		4.83%
無線通信サービス		4.41%
保険		3.16%
金属・鉱業		2.76%
自動車		2.57%
メディア		2.40%
不動産管理・開発		2.29%
電子装置・機器・部品		2.21%
食品		2.14%
情報技術サービス		2.07%
コングロマリット		2.05%
各種電気通信サービス		2.02%
化学		1.98%
食品・生活必需品小売り		1.91%
医薬品		1.64%
各種金融サービス		1.61%
電力		1.34%
飲料		1.23%
パーソナル用品		1.19%
資本市場		1.12%
運送インフラ		1.06%
建設・土木		0.92%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.86%
インターネット販売・カタログ販売		0.85%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.85%
タバコ		0.84%
建設資材		0.83%
家庭用耐久財		0.82%
自動車部品		0.80%

複合小売り	0.77%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.62%
機械	0.56%
繊維・アパレル・贅沢品	0.52%
ホテル・レストラン・レジャー	0.50%
ガス	0.47%
家庭用品	0.45%
専門小売り	0.43%
各種消費者サービス	0.37%
紙製品・林産品	0.33%
水道	0.30%
バイオテクノロジー	0.25%
航空宇宙・防衛	0.23%
消費者金融	0.23%
不動産投資信託	0.23%
電気設備	0.23%
旅客航空輸送業	0.22%
陸運・鉄道	0.17%
ソフトウェア	0.16%
商業サービス・用品	0.16%
海運業	0.12%
総合公益事業	0.10%
航空貨物・物流サービス	0.10%
レジャー用品	0.08%
エネルギー設備・サービス	0.07%
商社・流通業	0.07%
容器・包装	0.07%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
建設関連製品	0.05%
販売	0.04%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.03%
通信機器	0.02%
合計	95.78%

(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】

M I T O ラップ型ファンド（安定型）

該当事項はありません。

M I T O ラップ型ファンド（中立型）

該当事項はありません。

M I T O ラップ型ファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年6月30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	TOPIX 先物 2809月	買建	522	6,681,460,128	6,501,510,000	2.46%

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年6月30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
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年07月	買建	34,300,000	3,514,782,500	3,529,444,000	1.46%
		ユーロ買/円売201 6年07月	買建	7,900,000	895,605,510	903,681,000	0.37%
		イギリス・ポンド買/ 円売2016年07月	買建	2,710,000	369,322,870	375,061,800	0.15%
		オーストラリア・ドル 買/円売2016年0 7月	買建	2,870,000	217,419,260	220,212,100	0.09%
		カナダ・ドル買/円売 2016年07月	買建	170,000	13,524,860	13,523,500	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 5 0 0 F U T U R E S e p 1 6	買建	108	5,692,839,698	5,742,748,476	2.37%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 S e p 1 6	買建	456	1,471,315,065	1,470,442,269	0.61%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E S e p 1 6	買建	75	633,632,675	652,170,618	0.27%
	モントリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T S e p 1 6	買建	28	358,995,969	362,043,500	0.15%
	シドニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S S e p 1 6	買建	34	333,928,354	332,211,297	0.14%

(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。

(注3) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年6月30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
為替予約取引	-	ユーロ買/円売201 6年07月	買建	1,088,000	123,251,577	124,456,320	0.05%
		アメリカ・ドル買/円 売2016年07月	買建	1,205,000	123,436,585	123,994,500	0.05%
		ユーロ売/円買201 6年07月	売建	778,000	88,995,653	88,995,420	0.04%

(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) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年6月30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
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年07月	買建	220,000	22,536,140	22,638,000	0.08%
		シンガポール・ドル 買/円売2016年0 7月	買建	30,000	2,270,430	2,292,000	0.01%

(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) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

コモディティインデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年6月30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
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年07月	買建	1,680,000	172,176,780	172,870,200	0.51%
		アメリカ・ドル売/円 買2016年07月	売建	2,000,000	203,174,000	205,800,000	0.60%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Se p16	買建	247	1,019,544,806	1,049,413,919	3.08%

(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。

(注3) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(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。

M I T O ラップ型ファンド（安定型）

	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)
平成27年12月末日	276	-	0.9927	-
平成28年1月末日	362	-	0.9903	-
2月末日	342	-	0.9846	-
3月末日	359	-	1.0005	-
4月末日	372	-	1.0024	-
5月末日	384	-	1.0074	-
6月末日	362	-	0.9944	-

M I T O ラップ型ファンド（中立型）

	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)
平成27年12月末日	356	-	0.9824	-
平成28年1月末日	479	-	0.9707	-
2月末日	470	-	0.9453	-
3月末日	489	-	0.9697	-
4月末日	488	-	0.9660	-
5月末日	496	-	0.9730	-
6月末日	479	-	0.9409	-

M I T O ラップ型ファンド（積極型）

	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)
平成27年12月末日	611	-	0.9732	-
平成28年1月末日	672	-	0.9456	-
2月末日	649	-	0.9042	-
3月末日	676	-	0.9404	-
4月末日	693	-	0.9322	-
5月末日	638	-	0.9414	-
6月末日	606	-	0.8916	-

【分配の推移】

M I T O ラップ型ファンド（安定型）

	1口当たりの分配金(円)
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	-

M I T O ラップ型ファンド（中立型）

	1口当たりの分配金(円)
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	-

M I T O ラップ型ファンド（積極型）

	1口当たりの分配金(円)
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	-

【収益率の推移】

M I T O ラップ型ファンド（安定型）

	収益率(%)
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	0.7

（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。

M I T O ラップ型ファンド（中立型）

	収益率(%)
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	2.7

（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。

M I T O ラップ型ファンド（積極型）

	収益率(%)
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	5.9

（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】

M I T O ラップ型ファンド（安定型）

	設定口数	解約口数
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	419,045,822	37,301,670

（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。

M I T O ラップ型ファンド（中立型）

	設定口数	解約口数
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	513,678,146	3,000,000

（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。

M I T O ラップ型ファンド（積極型）

	設定口数	解約口数
平成27年12月1日～ 平成28年5月31日	796,781,816	118,794,054

（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。

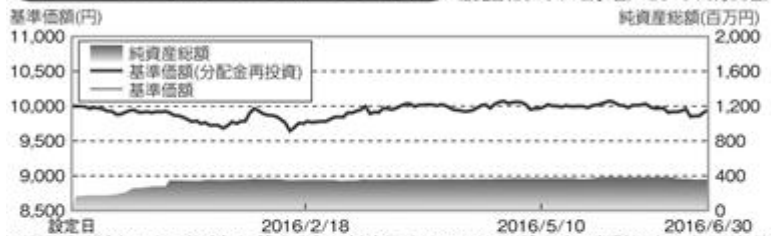
参考情報

データの基準日:2016年6月30日

MITO ラップ型ファンド(安定型)

➤ 基準価額・純資産の推移

(設定日(2015年12月1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:2015年12月1日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

➤ 分配の推移

初回決算が2016年10月12日のため
 基準日現在分配実績はありません。

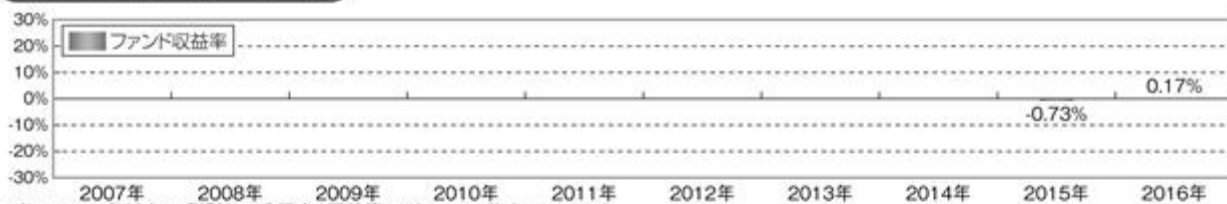
➤ 主要な資産の状況

(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	国内債券バシブ・ファンド・マザーファンド	64.49%
2	外国債券バシブ・ファンド・マザーファンド	7.85%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	6.54%
4	外国株式バシブ・ファンド・マザーファンド	4.36%
5	国内株式バシブ・ファンド(最適化法):マザーファンド	3.87%
6	外国リートバシブ・ファンド・マザーファンド	3.81%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	2.01%
8	エマージング株式バシブ・マザーファンド	1.94%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.36%

➤ 年間収益率の推移

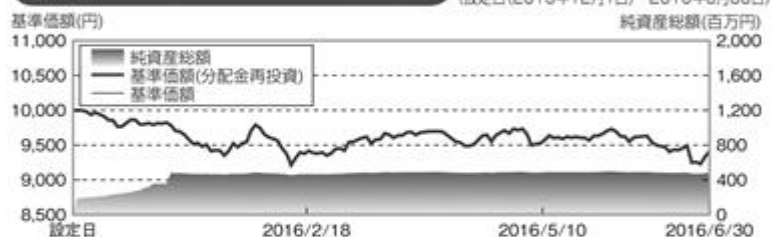


※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

➤ 基準価額・純資産の推移

(設定日(2015年12月1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:2015年12月1日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

➤ 分配の推移

初回決算が2016年10月12日のため
 基準日現在分配実績はありません。

○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。

データの基準日:2016年6月30日

✦ 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	国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	35.85%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	16.45%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	13.56%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	7.79%
5	外国リートパッシブ・ファンド・マザー・ファンド	6.79%
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	5.92%
7	エマージング株式パッシブ・マザー・ファンド	4.05%
8	コモディティインデックス・マザー・ファンド	3.95%
9	J-REITインデックスファンド・マザー・ファンド	0.64%

✦ 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。

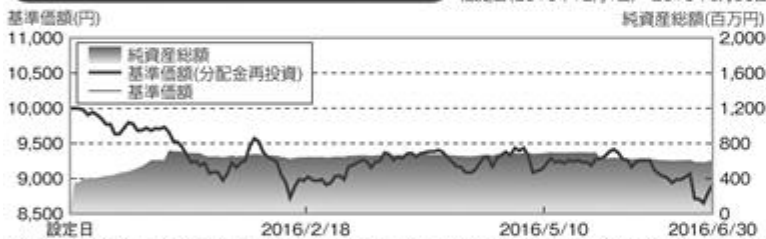
※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

✦ 基準価額・純資産の推移

(設定日(2015年12月1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:2015年12月1日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

✦ 分配の推移

初回決算が2016年10月12日のため
基準日現在分配実績はありません。

✦ 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	外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	19.99%
2	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	16.70%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	14.39%
4	外国リートパッシブ・ファンド・マザー・ファンド	12.52%
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド	10.64%
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	10.00%
7	コモディティインデックス・マザー・ファンド	4.93%
8	エマージング株式パッシブ・マザー・ファンド	4.84%
9	J-REITインデックスファンド・マザー・ファンド	1.17%

✦ 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。

※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>

MITO ラップ型ファンド(安定型)

- (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1日から平成28年5月31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。

1【財務諸表】

【MITO ラップ型ファンド(安定型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期中間計算期間末 平成28年5月31日現在
資産の部	
流動資産	
預金	414,319
コール・ローン	25,115,289
投資信託受益証券	24,760,743
親投資信託受益証券	336,480,771
流動資産合計	386,771,122
資産合計	386,771,122
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	71,875
未払委託者報酬	2,139,662
その他未払費用	8,308
流動負債合計	2,219,845
負債合計	2,219,845
純資産の部	
元本等	
元本	1 381,744,152
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	2,807,125
(分配準備積立金)	-
元本等合計	384,551,277
純資産合計	384,551,277
負債純資産合計	386,771,122

（ 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 自 平成27年12月1日 至 平成28年5月31日
営業収益	
受取配当金	402,105
受取利息	3,038
有価証券売買等損益	8,369,986
為替差損益	2,222,788
営業収益合計	6,552,341
営業費用	
支払利息	2,086
受託者報酬	71,875
委託者報酬	2,139,662
その他費用	36,746
営業費用合計	2,250,369
営業利益又は営業損失（ ）	4,301,972
経常利益又は経常損失（ ）	4,301,972
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,301,972
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（ ）	197,856
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	179,385
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	179,385
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,872,088
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,872,088
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,807,125

(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	<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>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。</p>
2 . 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>
3 . 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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間末 平成28年5月31日現在
1 . 1 期首元本額	167,312,285円
期中追加設定元本額	251,733,537円
期中一部解約元本額	37,301,670円
2 . 受益権の総数	381,744,152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1期中間計算期間末 平成28年5月31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。
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）は短時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。
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。

（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期中間計算期間末 平成28年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0074円 (10,074円)

MITO ラップ型ファンド（中立型）

（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1日から平成28年5月31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。

【MITO ラップ型ファンド（中立型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

		第1期中間計算期間末 平成28年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,158,941
コール・ローン		26,925,905
投資信託受益証券		67,938,058
親投資信託受益証券		403,787,806
流動資産合計		499,810,710
資産合計		499,810,710
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		94,754
未払委託者報酬		2,820,443
その他未払費用		10,967
流動負債合計		2,926,164
負債合計		2,926,164
純資産の部		
元本等		
元本	1	510,678,146
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	13,793,600
（分配準備積立金）		-
元本等合計		496,884,546
純資産合計		496,884,546
負債純資産合計		499,810,710

（ 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 自 平成27年12月1日 至 平成28年5月31日
営業収益	
受取配当金	1,140,761
受取利息	4,162
有価証券売買等損益	228,415
為替差損益	6,460,307
営業収益合計	5,086,969
営業費用	
支払利息	2,413
受託者報酬	94,754
委託者報酬	2,820,443
その他費用	44,603
営業費用合計	2,962,213
営業利益又は営業損失（ ）	8,049,182
経常利益又は経常損失（ ）	8,049,182
中間純利益又は中間純損失（ ）	8,049,182
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（ ）	113,934
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	33,366
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	33,366
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,891,718
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,891,718
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	13,793,600

(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	<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>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。</p>
2 . 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>
3 . 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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間末 平成28年5月31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	<p>189,882,036円</p> <p>323,796,110円</p> <p>3,000,000円</p>
2 . 受益権の総数	510,678,146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13,793,600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期中間計算期間末 平成28年5月31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。
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）は短時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。
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。

（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期中間計算期間末 平成28年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9730円 (9,730円)

MITO ラップ型ファンド(積極型)

(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1日から平成28年5月31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。

【MITO ラップ型ファンド(積極型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

		第1期中間計算期間末 平成28年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,654,088
コール・ローン		30,608,264
投資信託受益証券		105,818,300
親投資信託受益証券		504,406,362
流動資産合計		642,487,014
資産合計		642,487,014
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		136,711
未払委託者報酬		4,068,388
その他未払費用		15,874
流動負債合計		4,220,973
負債合計		4,220,973
純資産の部		
元本等		
元本	1	677,987,762
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2	39,721,721
(分配準備積立金)		-
元本等合計		638,266,041
純資産合計		638,266,041
負債純資産合計		642,487,014

（ 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 自 平成27年12月1日 至 平成28年5月31日
営業収益	
受取配当金	2,110,559
受取利息	6,193
有価証券売買等損益	21,682,695
為替差損益	12,250,964
営業収益合計	31,816,907
営業費用	
支払利息	3,558
受託者報酬	136,711
委託者報酬	4,068,388
その他費用	49,670
営業費用合計	4,258,327
営業利益又は営業損失（ ）	36,075,234
経常利益又は経常損失（ ）	36,075,234
中間純利益又は中間純損失（ ）	36,075,234
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（ ）	7,126,052
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,715,342
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,715,342
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,487,881
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,487,881
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	39,721,721

(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	<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>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。</p>
2 . 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>
3 . 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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間末 平成28年5月31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	<p>355,418,559円</p> <p>441,363,257円</p> <p>118,794,054円</p>
2 . 受益権の総数	677,987,762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39,721,721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期中間計算期間末 平成28年5月31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。
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）は短時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。
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。

（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期中間計算期間末 平成28年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9414円 (9,414円)

（参考）

「MITO ラップ型ファンド（安定型）」、「MITO ラップ型ファンド（中立型）」、「MITO ラップ型ファンド（積極型）」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「コモディティインデックス・マザーファンド」受益証券及び「エマージング株式パッシブ・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。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		6,292,797,035
株式	2	285,150,370,470
派生商品評価勘定		392,294,052
未収入金		4,272,000
未収配当金		2,657,164,480
流動資産合計		294,496,898,037
資産合計		294,496,898,037
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		8,315,736
前受金		314,066,000
未払金		14,317,800
未払解約金		205,431,000
その他未払費用		9,664
流動負債合計		542,140,200
負債合計		542,140,200
純資産の部		
元本等		
元本	1	145,701,756,912
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		148,253,000,925
元本等合計		293,954,757,837
純資産合計		293,954,757,837
負債純資産合計		294,496,898,037

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5月31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	138,472,968,255円
同期中追加設定元本額	25,578,707,405円
同期中一部解約元本額	18,349,918,748円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	6,194,232,559円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,672,158,428円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	7,969,513円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	15,572,830円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	33,230,312円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	15,686,198円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	13,111,801円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	13,331,289円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	38,742,019,556円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	864,432,791円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	3,004,349,341円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,082,834,995円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	393,144,809円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,271,210,066円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,123,921,895円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	64,639,412円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,339,335,589円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	31,255,824円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	27,108,805円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	57,589,607円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	115,843,830円
投資のソムリエ	1,308,855,015円
クルーズコントロール	1,294,096,180円
投資のソムリエ<DC年金>	26,900,337円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	93,168,304円
D I A M D C バランス・F(成長型)	70,018,834円
クルーズコントロール<DC年金>	377,493円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	15,625,695円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	46,895,758円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,576,964円
ダイナミック・ナビゲーション	623,006円
D I A M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)	250,610,082円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	119,079,554円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	302,590,832円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	468,885,365円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	38,152,176円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	149,237,351円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	38,390,977円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	52,626,753円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	4,165,348,810円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,539,036,084円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,947,998,472円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,583,928,964円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,179,864,612円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	336,147,255円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	864,363,356円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,003,560,655円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	4,049,994,325円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	46,003,219円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,417,023,804円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	5,463,403,198円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	21,733,296,382円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	807,559,659円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	2,484,178,413円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	13,710,160,711円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	39,346円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	16,520,550円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	6,079,256円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	12,374,359,147円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	115,773,861円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	43,536,154円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	24,107,623円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	25,021,194円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	129,034円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	729,123,003円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,971,158,603円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	2,597,804,800円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	105,546,296円
計	145,701,756,912円
2 . 受益権の総数	145,701,756,912口
3 . 2 差入代用有価証券	株式 2,891,500,000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5月31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。
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。
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。

（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5月31日 現在			
	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	8,442,384,000	-	8,826,570,000	384,186,000
合計	8,442,384,000	-	8,826,570,000	384,186,000

(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5月31日現在
1口当たり純資産額	2.0175円
(1万口当たり純資産額)	(20,175円)

「国内債券パッシブ・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5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,149,496,472
国債証券		329,164,285,500
地方債証券		25,141,676,530
特殊債券		21,760,555,565
社債券		19,458,508,980
未収入金		7,178,217,000
未収利息		1,221,173,162
前払費用		14,685,614
流動資産合計		407,088,598,823
資産合計		407,088,598,823
負債の部		
流動負債		
未払金		8,893,295,000
未払解約金		415,188,000
その他未払費用		2,616
流動負債合計		9,308,485,616
負債合計		9,308,485,616
純資産の部		
元本等		
元本	1	303,845,930,723
剰余金		
剰余金又は欠損金()		93,934,182,484
元本等合計		397,780,113,207
純資産合計		397,780,113,207
負債純資産合計		407,088,598,823

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	国債証券、地方債証券、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。
--------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年5月31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	341,377,581,143円
同期中追加設定元本額	27,847,075,157円
同期中一部解約元本額	65,378,725,577円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	10,124,716,709円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	182,858,474円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	129,810,216円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	48,670,716円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	359,067,260円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	109,330,234円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	19,551,322円
たわらノーロード 国内債券	749,582,689円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金 >	11,993,653,805円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型	4,466,583,771円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型	6,502,094,560円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型	2,591,875,059円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,649,157,000円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,800,077,841円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	256,020,970円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	107,252,650円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	2,221,643,035円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,834,431円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	233,524,025円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	179,673,796円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	43,959,434円
投資のソムリエ	7,062,630,150円
クルーズコントロール	2,316,380,287円
投資のソムリエ< D C年金 >	142,370,083円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金 >	794,498,015円
D I A M D C バランス・F（成長型）	56,698,325円
クルーズコントロール< D C年金 >	677,349円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	7,455,194円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	22,393,140円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	29,181,131円
ダイナミック・ナビゲーション	1,873,219円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	31,096,487,907円
D I A M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)	1,017,679,760円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	588,646,388円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	548,071,720円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	282,525,121円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	134,387,444円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	337,844,652円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	144,425,308円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	105,421,817円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	9,430,906,935円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,484,638,483円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,801,843,410円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,586,405,496円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,296,687,788円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	759,019,720円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	3,259,844,172円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,525,731,019円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	6,098,157,038円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	839,267,900円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,392,540,666円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	6,813,634,806円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	87,393,880,339円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,222,519,113円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,530,703,845円

D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機 関投資家限定)	27,585,075,091円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	475,954円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	62,492,317円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	9,141,967円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機 関投資家限定)	31,037,334,261円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	573,848,380円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	152,633,329円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	363,008,569円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	131,370,232円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	324,047円
計	303,845,930,723円
2 . 受益権の総数	303,845,930,723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5月31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。
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。
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。

（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5月31日現在
1口当たり純資産額	1.3092円
（1万口当たり純資産額）	（13,092円）

「J-REIT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5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		40,566,117
投資証券		25,509,827,200
未収入金		133,063,005
未収配当金		152,457,928
流動資産合計		25,835,914,250
資産合計		25,835,914,250
負債の部		
流動負債		
未払金		74,032,569
未払解約金		1,634,000
その他未払費用		395
流動負債合計		75,666,964
負債合計		75,666,964
純資産の部		
元本等		
元本	1	14,049,170,733
剰余金		
剰余金又は欠損金()		11,711,076,553
元本等合計		25,760,247,286
純資産合計		25,760,247,286
負債純資産合計		25,835,914,250

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	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。
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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年5月31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	14,550,922,737円
同期中追加設定元本額	7,334,259,234円
同期中一部解約元本額	7,836,011,238円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド（安定型）	758,001円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,706,804円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	3,968,863円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,487,532円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,438,851円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,598,350円
たわらノーロード 国内リート	444,105,540円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	16,107,496円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	339,451,754円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,918,001円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	8,895,922円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	25,030,169円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	56,514,834円
投資のソムリエ	677,960,463円
投資のソムリエ<DC年金>	13,950,674円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	29,459,022円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	851,935円
ダイナミック・ナビゲーション	498,207円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201210（適格機関投資家限定）	1,984,057,603円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212（適格機関投資家限定）	1,072,040,993円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401（適格機関投資家限定）	2,103,474,745円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家向け）	6,146,331,009円

	D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	59,812,821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(適格機関投資家限定)	469,037,792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)	549,235,684円
	D I A M リスクコントロールJ - R E I Tファンド(適格機関投資家限定)	37,477,668円
	計	14,049,170,733円
2 .	受益権の総数	14,049,170,733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5月31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。
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。
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。

（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5月31日現在
1口当たり純資産額	1.8336円
（1万口当たり純資産額）	（18,336円）

「外国株式パッシブ・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5月31日現在
資産の部		
流動資産		
預金		4,945,593,792
コール・ローン		248,800,288
株式		252,364,782,117
投資信託受益証券		839,651,162
投資証券		6,124,902,730
派生商品評価勘定		202,544,484
未収入金		29,652,142
未収配当金		611,491,484
差入委託証拠金		1,811,991,767
流動資産合計		267,179,409,966
資産合計		267,179,409,966
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		494,236
未払解約金		260,680,000
その他未払費用		258
流動負債合計		261,174,494
負債合計		261,174,494
純資産の部		
元本等		
元本	1	100,282,377,995
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		166,635,857,477
元本等合計		266,918,235,472
純資産合計		266,918,235,472
負債純資産合計		267,179,409,966

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>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。</p> <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>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<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>
<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>	<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5月31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	98,425,773,739円
	同期中追加設定元本額	12,763,084,153円
	同期中一部解約元本額	10,906,479,897円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,783,460,602円
	M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,801,135円
	M I T O ラップ型ファンド（中立型）	15,524,269円
	M I T O ラップ型ファンド（積極型）	36,244,299円
	グローバル8資産ラップファンド（安定型）	13,389,807円
	グローバル8資産ラップファンド（中立型）	13,070,780円
	グローバル8資産ラップファンド（積極型）	14,523,807円
	たわらノーロード 先進国株式	1,326,436,616円
	D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	35,060,845,602円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	173,020,656円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	913,310,847円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,111,350,088円
	D I A M D C バランス30インデックスファンド	144,751,647円
	D I A M D C バランス50インデックスファンド	406,671,520円
	D I A M D C バランス70インデックスファンド	341,050,273円
	マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	45,745,734円
	マネックス資産設計ファンド< 育成型>	946,829,388円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	235,605,782円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	20,561,555円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	43,285,058円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	87,623,854円
	投資のソムリエ	502,249,600円
	クルーズコントロール	482,059,315円
	投資のソムリエ< D C年金>	10,310,911円
	D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	69,428,445円
	D I A M D C バランス・F（成長型）	25,153,879円
	クルーズコントロール< D C年金>	140,944円
	D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	3,898,124円
	D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	11,647,557円
	投資のソムリエ< D C年金>リスク抑制型	789,783円
	ダイナミック・ナビゲーション	1,758,852円
	D I A M外国株式インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	219,924,897円
	D I A M外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	3,256,209,692円
	D I A M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）	145,609,101円
	D I A M先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	392,381円

D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	38,026,581円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	227,377,453円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	350,407,691円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	28,668,638円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	168,239,221円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	14,311,535円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,419,772円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,130,170,737円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,735,109,417円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	974,341,393円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,038,251,232円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,125,340,024円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	1,297,904,254円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	1,990,825,640円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,501,646,390円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	1,004,417,054円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	12,333,699円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,905,888,686円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	1,674,529,782円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	10,845,809,224円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	606,180,522円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,866,320,121円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	6,837,456,673円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	146,181円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	51,051,782円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	16,823,598円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	9,231,599,390円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	55,324,700円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	57,492,107円

D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	287,698円
計	100,282,377,995円
2. 受益権の総数	100,282,377,995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5月31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。
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>
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。

(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5月31日 現在			
	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	35,043,900	-	35,185,500	141,600
アメリカ・ドル	16,608,750	-	16,639,500	30,750
ユーロ	18,435,150	-	18,546,000	110,850
合計	35,043,900	-	35,185,500	141,600

(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。

株式関連

種類	平成28年5月31日 現在			
	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	7,240,685,911	-	7,442,877,759	202,191,848
合計	7,240,685,911	-	7,442,877,759	202,191,848

(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はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年5月31日現在
1口当たり純資産額	2.6617円
(1万口当たり純資産額)	(26,617円)

「外国債券パッシブ・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5月31日現在
資産の部		
流動資産		
預金		5,123,697,143
コール・ローン		461,314,237
国債証券		262,846,826,625
派生商品評価勘定		128,771
未収利息		2,364,652,114
前払費用		68,216,653
流動資産合計		270,864,835,543
資産合計		270,864,835,543
負債の部		
流動負債		
未払解約金		233,357,000
その他未払費用		629
流動負債合計		233,357,629
負債合計		233,357,629
純資産の部		
元本等		
元本	1	152,489,857,044
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		118,141,620,870
元本等合計		270,631,477,914
純資産合計		270,631,477,914
負債純資産合計		270,864,835,543

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</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 . 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</p> <p>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 . 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5月31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	160,412,378,404円
同期中追加設定元本額	15,488,888,831円
同期中一部解約元本額	23,411,410,191円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	4,460,374,637円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	17,594,666円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	47,073,483円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	72,261,199円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	34,593,365円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	39,642,832円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	29,033,326円
たわらノーロード 先進国債券	290,081,348円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C 年金 >	4,673,503,793円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	406,766,515円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	1,342,108,909円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,393,357,463円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	329,414,218円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	702,091,373円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	509,233,277円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	27,830,899円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	572,545,701円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,882,350円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	9,068,260円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	17,188,650円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	32,320,299円
クルーズコントロール	1,726,134,192円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	31,131,223円
D I A M D C バランス・F(成長型)	31,098,970円
クルーズコントロール<DC年金>	504,402円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	11,116,850円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	33,388,985円
ダイナミック・ナビゲーション	347,263円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,723,875,581円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	7,443,059,408円
D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,609,095,578円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,389,669,712円
D I A M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)	246,920,518円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	132,799,843円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,626,334,658円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	838,638,709円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	99,646,836円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	166,980,093円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	42,826,594円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	19,545,057円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,992,736,256円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,722,233,829円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,078,540,246円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,880,873,623円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,673,829,924円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	942,764,295円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	3,386,490,959円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,529,174,790円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	16,982,402,530円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	56,954,254円

D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	2,380,641,049円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	11,247,000,900円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	16,220,215,303円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	20,456,141,401円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	132,229円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	46,631,411円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	6,782,828円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	18,411,092,693円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	128,983,987円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	80,744,516円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	70,264,839円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	144,147円
計	152,489,857,044円
2 . 受益権の総数	152,489,857,044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5月31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。
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>
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。

（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5月31日 現在			
	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				
買 建	27,009,679	-	27,138,450	128,771
アメリカ・ドル	8,082,925	-	8,097,890	14,965
ユーロ	18,926,754	-	19,040,560	113,806
合計	27,009,679	-	27,138,450	128,771

(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5月31日現在
1口当たり純資産額	1.7748円
(1万口当たり純資産額)	(17,748円)

「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5月31日現在
資産の部		
流動資産		
預金		83,033,826
コール・ローン		33,602,665
投資信託受益証券		3,611,233,875
投資証券		29,052,926,845
未収入金		531,706
未収配当金		45,167,386
流動資産合計		32,826,496,303
資産合計		32,826,496,303
負債の部		
流動負債		
未払金		40,491,171
未払解約金		5,592,000
その他未払費用		69
流動負債合計		46,083,240
負債合計		46,083,240
純資産の部		
元本等		
元本	1	29,047,068,545
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		3,733,344,518
元本等合計		32,780,413,063
純資産合計		32,780,413,063
負債純資産合計		32,826,496,303

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</p> <p>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</p> <p>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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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>
3. 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5月31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	26,841,967,994円
同期中追加設定元本額	12,978,783,574円
同期中一部解約元本額	10,773,683,023円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	89,629,741円
D I A M先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	28,229,695円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	13,231,585円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	30,050,323円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	70,017,028円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	26,059,600円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	25,313,419円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,099,171円
たわらノーロード 先進国リート	723,221,396円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	26,158,481円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	541,334,449円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	68,814,812円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	14,377,508円

D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	40,874,489円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	92,297,896円
投資のソムリエ	852,642,168円
投資のソムリエ<DC年金>	17,352,978円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	49,393,389円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	3,725,197円
ダイナミック・ナビゲーション	833,084円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,466,048,590円
D I A M外国リートインデックスファンド<DC年金>	10,232,637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）	677,280,262円
D I A M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）	105,114,015円
D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	4,785,672,326円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	50,484,750円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	12,856,889,993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（適格機関投資家限定）	2,660,105,306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II（適格機関投資家限定）	3,130,943,431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）	562,640,826円
計	29,047,068,545円
2. 受益権の総数	29,047,068,545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5月31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。
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。

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。
----------------------------	---

（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5月31日現在	
1口当たり純資産額	1,1285円
（1万口当たり純資産額）	（11,285円）

「コモディティインデックス・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5月31日現在
資産の部		
流動資産		
預金		5,665,201
コール・ローン		2,030,037
社債券		2,109,708,142
流動資産合計		2,117,403,380
資産合計		2,117,403,380
負債の部		
流動負債		
その他未払費用		4
流動負債合計		4
負債合計		4
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,287,069,554
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2	3,169,666,178
元本等合計		2,117,403,376
純資産合計		2,117,403,376
負債純資産合計		2,117,403,380

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	社債券 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。
2 . 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28年5月31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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	4,928,968,096円 913,606,333円 555,504,875円
元本の内訳 ファンド名 D I A Mコモディティバッシュ・ファンド M I T O ラップ型ファンド（安定型） M I T O ラップ型ファンド（中立型） M I T O ラップ型ファンド（積極型） グローバル8資産ラップファンド（安定型） グローバル8資産ラップファンド（中立型） グローバル8資産ラップファンド（積極型） D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け） 計	4,766,484,161円 19,264,420円 50,225,712円 79,370,420円 42,161,269円 43,418,038円 31,039,365円 255,106,169円 5,287,069,554円
2 . 受益権の総数	5,287,069,554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3,169,666,178円であります。

（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5月31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。
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。
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。

（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5月31日現在
1口当たり純資産額	0.4005円
（1万口当たり純資産額）	（4,005円）

「エマージング株式パッシブ・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5月31日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,041,969,464
コール・ローン		73,620,480
株式		33,857,428,131
投資信託受益証券		250,209,135
投資証券		110,877,824
派生商品評価勘定		11,333,843
未収入金		1,159,688
未収配当金		43,393,707
差入委託証拠金		430,606,955
流動資産合計		35,820,599,227
資産合計		35,820,599,227
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		31,356,008
未払解約金		2,010,000
その他未払費用		41
流動負債合計		33,366,049
負債合計		33,366,049
純資産の部		
元本等		
元本	1	42,315,173,811
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2	6,527,940,633
元本等合計		35,787,233,178
純資産合計		35,787,233,178
負債純資産合計		35,820,599,227

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>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。</p> <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>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<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>
<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>	<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5月31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	39,619,567,643円
	同期中追加設定元本額	12,428,161,477円
	同期中一部解約元本額	9,732,555,309円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	1,179,235,125円
	D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし >（ファンドラップ）	110,295,882円
	M I T O ラップ型ファンド（安定型）	9,030,695円
	M I T O ラップ型ファンド（中立型）	24,120,072円
	M I T O ラップ型ファンド（積極型）	36,472,161円
	グローバル8資産ラップファンド（安定型）	17,775,466円
	グローバル8資産ラップファンド（中立型）	20,318,816円
	グローバル8資産ラップファンド（積極型）	14,660,263円
	たわらノーロード 新興国株式	309,507,667円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	548,903,025円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	32,059,420円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	90,959,881円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	207,076,325円
	投資のソムリエ	1,553,905,650円
	クルーズコントロール	1,450,777,913円
	投資のソムリエ< D C 年金 >	32,006,632円
	D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金 >	104,958,241円
	クルーズコントロール< D C 年金 >	426,017円
	D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	23,407,785円
	D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	70,149,508円
	投資のソムリエ< D C 年金 > リスク抑制型	2,496,865円
	ダイナミック・ナビゲーション	752,352円
	エマージング株式パッシブファンドV A（適格機関投資家専用）	7,446,445,817円
	新興国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）	190,433,666円
	エマージング株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,193,601,345円
	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	16,337,908,464円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	10,307,488,758円
	計	42,315,173,811円
2 .	受益権の総数	42,315,173,811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6,527,940,633円であります。
-----	---------	---

（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5月31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。
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>
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。

（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5月31日 現在			
	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	113,589,491	-	113,794,656	205,165
アメリカ・ドル	113,589,491	-	113,794,656	205,165
買 建	157,879,491	-	158,912,000	1,032,509
アメリカ・ドル	44,290,000	-	44,372,000	82,000
インド・ルピー	113,589,491	-	114,540,000	950,509
合計	271,468,982	-	272,706,656	827,344

(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。

株式関連

種類	平成28年5月31日 現在			
	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	1,565,855,419	-	1,545,005,910	20,849,509
合計	1,565,855,419	-	1,545,005,910	20,849,509

(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はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年5月31日現在
1口当たり純資産額	0.8457円
(1万口当たり純資産額)	(8,457円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

M I T O ラップ型ファンド（安定型）

平成28年6月30日現在

資産総額	362,703,657円
負債総額	412,451円
純資産総額（ - ）	362,291,206円
発行済数量	364,324,616口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9944円

M I T O ラップ型ファンド（中立型）

平成28年6月30日現在

資産総額	480,300,308円
負債総額	529,011円
純資産総額（ - ）	479,771,297円
発行済数量	509,926,655口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9409円

M I T O ラップ型ファンド（積極型）

平成28年6月30日現在

資産総額	607,969,011円
負債総額	1,283,764円
純資産総額（ - ）	606,685,247円
発行済数量	680,411,322口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8916円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	265,317,861,778円
負債総額	1,476,582,948円
純資産総額（ - ）	263,841,278,830円
発行済数量	144,624,137,587口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8243円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	394,905,125,395円
負債総額	3,005,554,000円
純資産総額（ - ）	391,899,571,395円
発行済数量	295,750,441,894口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3251円

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	22,394,938,548円
負債総額	565,137,799円
純資産総額（ - ）	21,829,800,749円
発行済数量	12,198,320,449口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7896円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	243,165,401,709円
負債総額	682,014,137円
純資産総額（ - ）	242,483,387,572円
発行済数量	100,746,585,992口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4069円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	251,290,443,447円
負債総額	205,262,000円
純資産総額（ - ）	251,085,181,447円
発行済数量	149,766,657,991口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6765円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	32,700,502,522円
負債総額	4,466,210,990円
純資産総額（ - ）	28,234,291,532円
発行済数量	26,058,702,231口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0835円

コモディティインデックス・マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	2,003,181,917円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	2,003,181,917円
発行済数量	5,310,035,915口
1口当たり純資産額（ / ）	0.3772円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年6月30日現在

資産総額	34,614,707,502円
負債総額	494,999,330円
純資産総額（ - ）	34,119,708,172円
発行済数量	42,379,981,030口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8051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	80,000株
発行済株式総数	24,000株

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。

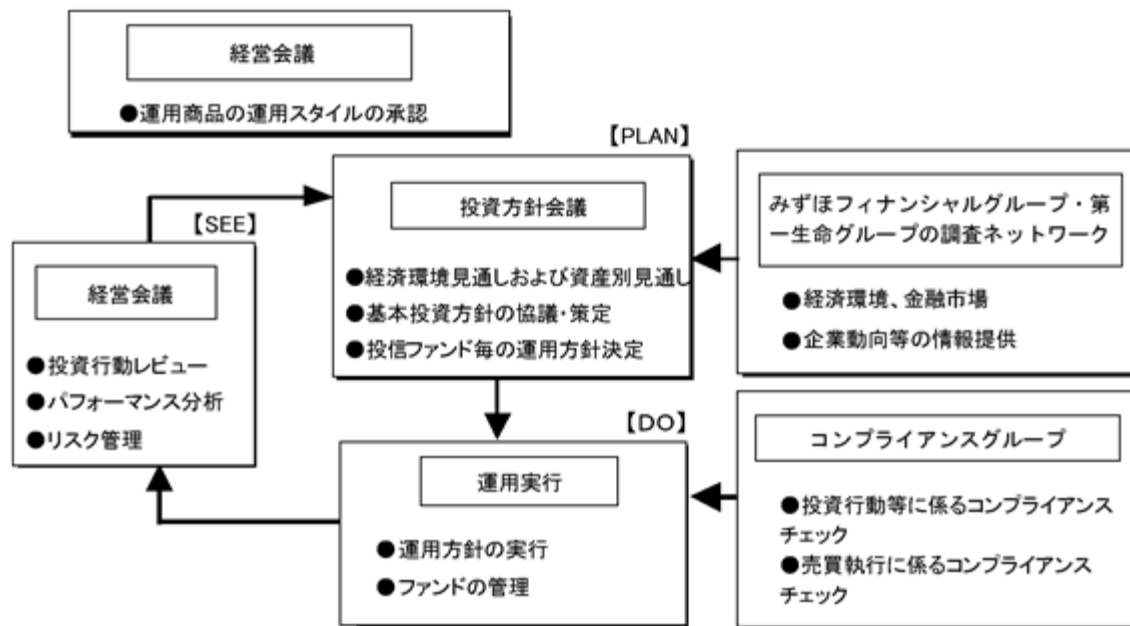
投資運用の意思決定機構

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	1,912,472	1,706,201
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	4,343,365	6,497,772
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	<p>(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</p> <p>(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</p>
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	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(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。</p>
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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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</p> <p>(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。</p>
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
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	6,501
	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>

（略）

(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>

（略）

(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>

(1)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。

(2)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
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。

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

(3)投資顧問会社

a. 名称

水戸証券株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末日現在 12,272百万円

c. 事業の内容

日本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、

ファンドの略称 安定型：グッドラ安定、中立型：グッドツ中立、積極型：グッドプ積極)

<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。

(ファンドの略称 安定型：グッドラ安定、中立型：グッドツ中立、積極型：グッドプ積極)

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 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M I T O ラップ型ファンド（安定型）の平成27年12月1日から平成28年5月31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、M I T O ラップ型ファンド（安定型）の平成28年5月31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1日から平成28年5月31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 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M I T O ラップ型ファンド（中立型）の平成27年12月1日から平成28年5月31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、M I T O ラップ型ファンド（中立型）の平成28年5月31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1日から平成28年5月31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 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M I T O ラップ型ファンド（積極型）の平成27年12月1日から平成28年5月31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、M I T O ラップ型ファンド（積極型）の平成28年5月31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1日から平成28年5月31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。