

【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29年7月12日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	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） グローバル8資産ラップファンド（安定型） 5,000億円を上限とします。
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	グローバル8資産ラップファンド（中立型） 5,000億円を上限とします。 グローバル8資産ラップファンド（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29年1月12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。)について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、あわせて委託会社の統合に伴い一部記載を統一するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

原届出書の「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 (1) ファンドの目的及び基本的性格」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、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドは、別に定める投資信託証券を投資対象とする「ファンド・オブ・ファンズ方式」で運用します。

別に定める投資信託証券とは、以下の投資信託証券をいいます。

国内株式	親投資信託	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
国内債券	親投資信託	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
先進国株式	親投資信託	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
先進国債券	親投資信託	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
新興国株式	親投資信託	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
新興国債券	外国投資信託証券	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
世界リート	親投資信託	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
	親投資信託	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
コモディティ	親投資信託	コモディティインデックス・マザーファンド

上記の投資信託証券のうち親投資信託のことを以下「マザーファンド」という場合があります。

各ファンドの信託金限度額は、各々5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1

世界の様々な資産に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。

- ・主として、投資信託証券への投資を通じて、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、世界リート、コモディティ^(*)等の資産に実質的に投資します。なお、短期金融資産等に直接投資する場合があります。
- ・投資対象となる投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、必要な場合は追加、除外、入替えを行う場合があります。
- ・実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円で為替ヘッジを行いません。

(*) コモディティ(商品)への投資に際しては、投資信託証券への投資を通じて、商品指数の動きに概ね連動する投資成果をめざす債券等に実質的に投資を行います。

2

「安定型」、「中立的」、「積極型」の3つのファンドから選択できます。

- ・お客さまのリスク許容度に応じて、目標リスク水準の異なる以下の3つのファンドがあります。

<各ファンドの目標リスク水準>

「安定型」:年率標準偏差 2.5~5.0%程度

「中立的」:年率標準偏差 5.0~8.0%程度

「積極型」:年率標準偏差 8.0~12.0%程度

- ・各ファンド間でスイッチングが可能です。

※目標リスク水準は、各ファンドの基準価額の変動リスクの目安を示したものであり、ポートフォリオを構築する際の目標値として使用します。なお、市場環境等によっては、実際の基準価額の変動が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

※スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

3

各資産への投資割合の決定にあたっては、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

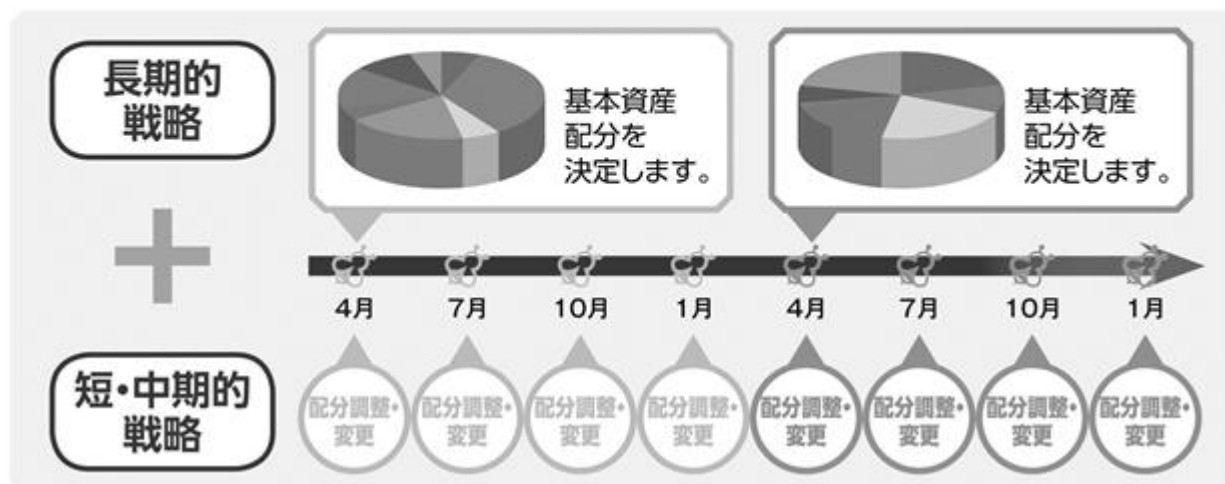
- ・各ファンドの目標リスク水準に応じて、長期的見通しと短・中期的見通しを組み合わせ、市場環境の変化に対応した適切な資産配分をめざします。
- ・長期的視点に基づく資産配分戦略により、基本資産配分を決定します(長期的戦略)。当該戦略は、原則として年1回見直しを行います。
- ・上記に加え、短・中期的視点に基づく資産配分戦略により、市場環境の変化に対応した資産配分を行います(短・中期的戦略)。当該戦略は、原則として四半期毎に見直しを行います。
- ・なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合等には、適宜、資産配分の見直しを行う場合があります。

※市場環境等によっては、一部の資産への投資割合がゼロとなる場合があります。

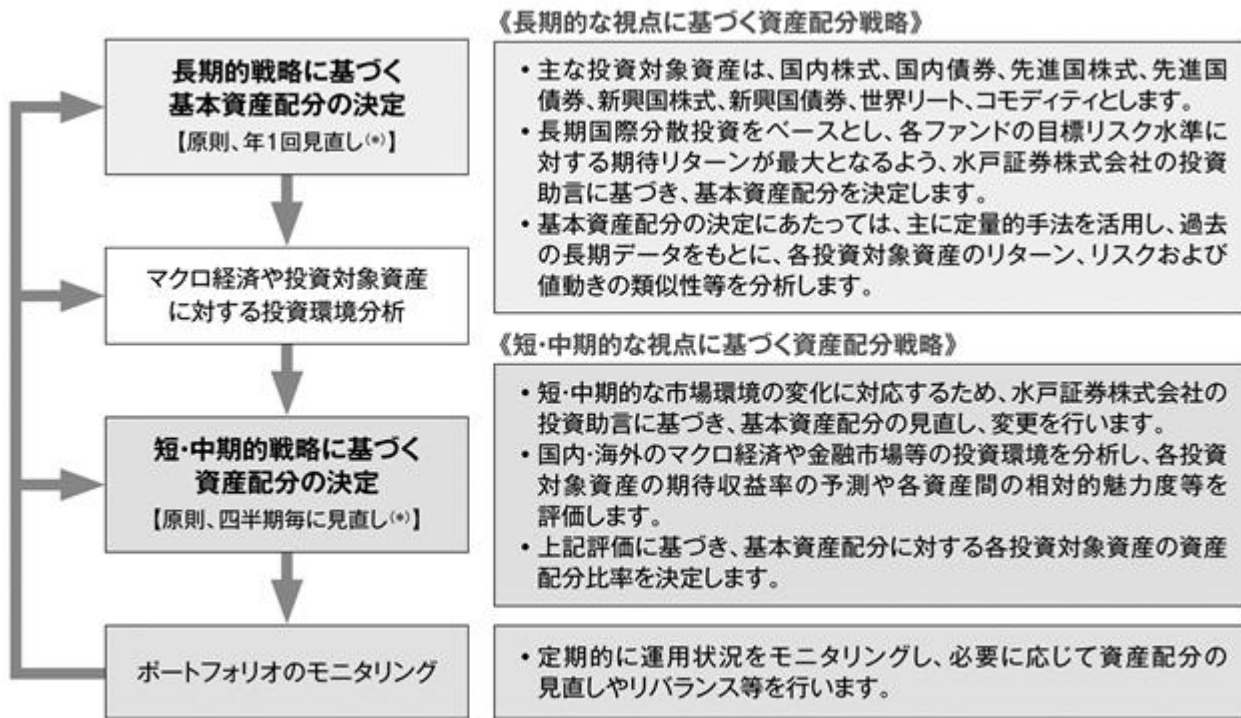
※コモディティへの投資割合は、原則として、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

資産配分のイメージ

年に1回、長期的戦略に基づき基本資産配分を決定し、それに対して、四半期毎に、短・中期的戦略に基づき機動的な資産配分の調整・変更を行います。



運用プロセス



※各資産への投資割合の決定にあたっては、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

(*) 市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合等には、適宜、資産配分の見直しを行う場合があります。

商品分類表

各ファンド

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
		不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

各ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分変更型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年一回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ なし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（３）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

資本金の額

20億円（平成28年10月31日現在）

（略）

大株主の状況

（平成28年10月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
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	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

<訂正後>

（略）

資本金の額

20億円（平成29年4月28日現在）

（略）

大株主の状況

（平成29年4月28日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
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	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

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	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。 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）。	
	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）

（注1）上記内容は原則として、平成28年10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。

（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35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" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">ファンドグループの純資産総額の合計額</th> <th style="text-align: center;">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 style="text-align: center;">190億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.6000%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">190億ドル超330億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.5700%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">330億ドル超470億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.5415%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">470億ドル超</td> <td style="text-align: center;">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470億ドル以下	0.5415%	470億ドル超	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470億ドル以下	0.5415%										
470億ドル超	0.5145%										

(略)

(注1)上記内容は原則として、平成29年4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。

(略)

(3) 【運用体制】

<訂正前>

(略)

運用体制は平成28年10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。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

<訂正後>

(略)

運用体制は平成29年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

3 【投資リスク】

<訂正前>

<基準価額の主な変動要因>

ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き、為替変動等により影響を受けませんが、運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

資産配分リスク

(略)

<分配金に関する留意点>

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

<その他の留意点>

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

ファンドは、一部マザーファンドに投資を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

（略）

<リスク管理体制>

（略）

上記体制は平成28年10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>

<基準価額の主な変動要因>

各ファンドは、投資信託証券への投資を通じて値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

資産配分リスク

（略）

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと
で、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

ファンドは、一部マザーファンドに投資を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

(略)

<リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成29年4月28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および分配金再投資基準価額の推移

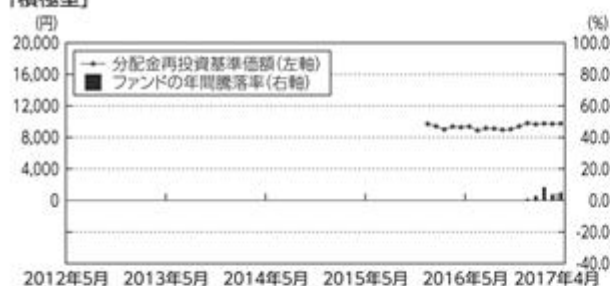
[安定型]



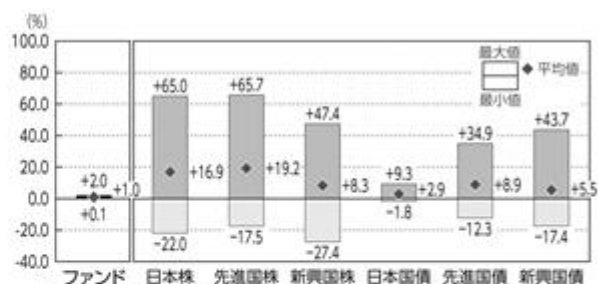
[中立型]



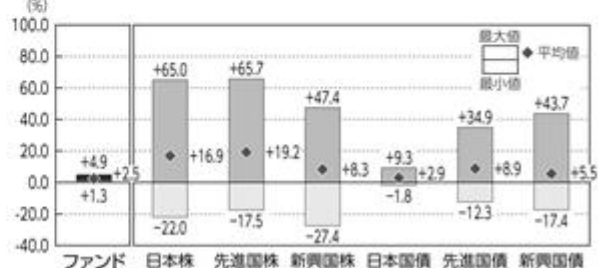
[積極型]



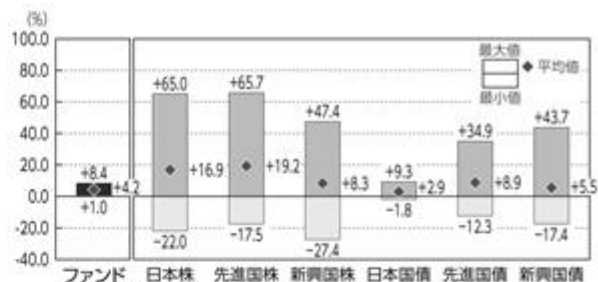
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年12月~2017年4月
代表的な資産クラス:2012年5月~2017年4月



ファンド:2016年12月~2017年4月
代表的な資産クラス:2012年5月~2017年4月



ファンド:2016年12月~2017年4月
代表的な資産クラス:2012年5月~2017年4月

- *ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

*各資産クラスの指数

- 日本株… 東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
- 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
- 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、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、円換算しております。

- 日本国債… NOMURA-BPI国債
- 先進国債… シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
- 新興国債… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース)

- [東証株価指数 (TOPIX)] は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所 (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、東京証券取引所が有しています。
- [MSCIコクサイ・インデックス] は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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. に帰属します。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。
- [MSCIエマージング・マーケット・インデックス] は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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. に帰属します。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国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- [シティ世界国債インデックス (除く日本)] は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- [JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド] は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数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。また、同社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。

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

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 (3)信託報酬等」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	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.3284%（税抜1.23%） 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。</p>												
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>支払先</th> <th>内訳（税抜）</th> <th>主な役務</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率0.69%</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率0.50%</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率0.04%</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table>	支払先	内訳（税抜）	主な役務	委託会社	年率0.69%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	販売会社	年率0.50%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	受託会社	年率0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
	支払先	内訳（税抜）	主な役務										
	委託会社	年率0.69%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価										
販売会社	年率0.50%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価											
受託会社	年率0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価											
<p>委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（水戸証券株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。</p>													
投資対象とする 外国投資信託	<p>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の 純資産総額に対して年率0.40%程度 （注）ただし、当該外国投資信託の信託報酬には、年間最低報酬額が定められている場合があり、純資産総額等によっては年率換算で上記の信託報酬率を上回る場合があります。</p>												
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1.337712%～1.421864%程度（税抜1.239312%～1.323464%程度）（概算） 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29年4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>												

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(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（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）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かかる消費税等に相当する金額を含みます。）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

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。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：NISA（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NISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISA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。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

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。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成29年4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に相当する金額は含まれません。）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「分配金自動けいぞく投資コース」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】

グローバル8資産ラップファンド（安定型）

平成29年4月28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	14,697,625	3.90
内 アメリカ	14,697,625	3.90
親投資信託受益証券	341,528,769	90.68
内 日本	341,528,769	90.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	20,398,346	5.42
純資産総額	376,624,740	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。

グローバル8資産ラップファンド（中立型）

平成29年4月28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	66,586,632	14.90
内 アメリカ	66,586,632	14.90
親投資信託受益証券	356,523,068	79.80
内 日本	356,523,068	79.80
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	23,681,790	5.30
純資産総額	446,791,490	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。

グローバル8資産ラップファンド（積極型）

平成29年4月28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	54,572,921	16.35
内 アメリカ	54,572,921	16.35
親投資信託受益証券	257,891,149	77.28
内 日本	257,891,149	77.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	21,225,882	6.36
純資産総額	333,689,952	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29年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	280,524,834,620	96.08
内 日本	280,524,834,620	96.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,455,294,680	3.92
純資産総額	291,980,129,300	100.00

その他資産の投資状況

平成29年4月28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）	11,199,600,000	3.84
内 日本	11,199,600,000	3.84

(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29年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	311,550,853,400	84.08
内 日本	311,550,853,400	84.08
地方債証券	23,739,591,436	6.41
内 日本	23,739,591,436	6.41
特殊債券	17,395,332,027	4.69
内 日本	17,395,332,027	4.69
社債券	16,363,047,340	4.42
内 日本	16,062,868,340	4.34
内 オランダ	200,198,000	0.05
内 イギリス	99,981,000	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,489,419,322	0.40
純資産総額	370,538,243,525	100.00

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

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成29年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	28,048,775,900	98.13
内 日本	28,048,775,900	98.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	534,986,698	1.87
純資産総額	28,583,762,598	100.00

その他資産の投資状況

平成29年4月28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)	442,240,000	1.55
内 日本	442,240,000	1.55

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	264,204,929,750	95.77
内 アメリカ	162,233,107,904	58.81
内 イギリス	18,438,445,500	6.68
内 スイス	10,463,790,743	3.79
内 ドイツ	10,442,058,660	3.79
内 フランス	10,394,979,265	3.77
内 カナダ	10,380,991,881	3.76
内 オーストラリア	7,267,191,669	2.63
内 オランダ	5,176,342,054	1.88
内 アイルランド	4,433,795,258	1.61
内 スペイン	3,720,558,591	1.35
内 スウェーデン	3,151,849,192	1.14
内 香港	2,642,691,992	0.96
内 シンガポール	2,026,401,180	0.73
内 イタリア	1,992,008,884	0.72
内 デンマーク	1,885,171,019	0.68
内 ジャージー	1,613,765,533	0.58
内 バミューダ	1,333,385,849	0.48
内 ベルギー	1,266,976,396	0.46
内 フィンランド	1,102,097,568	0.40
内 オランダ領キュラソー	839,576,078	0.30
内 ケイマン諸島	689,951,599	0.25
内 ノルウェー	665,251,866	0.24
内 イスラエル	632,583,598	0.23
内 ルクセンブルグ	346,434,924	0.13
内 オーストリア	245,480,112	0.09
内 ポルトガル	175,913,618	0.06
内 パナマ	169,091,542	0.06

	内 ニュージーランド	158,821,591	0.06
	内 リベリア	151,742,078	0.06
	内 パプアニューギニア	56,946,107	0.02
	内 イギリス領バージン諸島	50,435,874	0.02
	内 マン島	37,506,105	0.01
	内 モーリシャス	19,585,520	0.01
投資信託受益証券		839,785,555	0.30
	内 オーストラリア	712,237,034	0.26
	内 シンガポール	127,548,521	0.05
投資証券		6,292,787,842	2.28
	内 アメリカ	5,475,391,878	1.98
	内 フランス	366,437,287	0.13
	内 イギリス	272,361,278	0.10
	内 香港	130,813,897	0.05
	内 カナダ	47,783,502	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		4,537,552,278	1.64
純資産総額		275,875,055,425	100.00

その他資産の投資状況

平成29年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	1,986,325,900	0.72
-	1,986,325,900	0.72
株価指数先物取引(買建)	4,102,154,428	1.49
内 アメリカ	2,827,979,061	1.03
内 ドイツ	736,186,779	0.27
内 イギリス	278,344,177	0.10
内 カナダ	148,974,750	0.05
内 オーストラリア	110,669,661	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。

(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29年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	243,477,228,861	96.95
内 アメリカ	108,922,911,208	43.37
内 フランス	24,485,730,097	9.75
内 イタリア	23,168,254,311	9.23
内 イギリス	17,885,176,094	7.12
内 ドイツ	17,669,612,640	7.04
内 スペイン	13,589,454,446	5.41
内 ベルギー	6,071,645,991	2.42
内 オランダ	5,537,394,681	2.20
内 オーストラリア	5,190,718,075	2.07
内 カナダ	5,005,864,673	1.99
内 オーストリア	3,460,384,609	1.38
内 メキシコ	1,981,701,096	0.79
内 アイルランド	1,828,055,103	0.73
内 ポーランド	1,474,609,959	0.59
内 デンマーク	1,373,838,275	0.55
内 フィンランド	1,364,515,590	0.54
内 南アフリカ	1,198,732,893	0.48
内 スウェーデン	997,651,897	0.40
内 マレーシア	895,737,545	0.36
内 シンガポール	865,454,159	0.34
内 ノルウェー	509,785,519	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,667,424,587	3.05
純資産総額	251,144,653,448	100.00

その他資産の投資状況

平成29年4月28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）	1,187,931,440	0.47
-	1,187,931,440	0.47
為替予約取引（売建）	172,318,430	0.07
-	172,318,430	0.07

（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29年4月28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	4,552,617,986	11.25
内 オーストラリア	3,316,826,153	8.20
内 シンガポール	1,224,340,124	3.03
内 カナダ	11,451,709	0.03
投資証券	35,707,883,655	88.25
内 アメリカ	28,947,263,114	71.54
内 イギリス	2,240,772,508	5.54
内 フランス	1,735,885,658	4.29
内 カナダ	744,765,516	1.84
内 香港	704,222,841	1.74
内 スペイン	322,241,290	0.80
内 ベルギー	295,125,073	0.73
内 ニューゼーランド	186,528,551	0.46
内 オランダ	183,066,549	0.45
内 アイルランド	88,882,345	0.22
内 ドイツ	79,944,594	0.20
内 シンガポール	75,070,749	0.19
内 イタリア	34,315,464	0.08
内 ガーンジー	28,344,708	0.07
内 マン島	21,952,376	0.05
内 イスラエル	19,502,319	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	201,787,524	0.50
純資産総額	40,462,289,165	100.00

その他資産の投資状況

平成29年4月28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）	752,335,960	1.86
-	752,335,960	1.86

（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29年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	2,639,505,456	99.32
内 イギリス	2,639,505,456	99.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	18,036,453	0.68
純資産総額	2,657,541,909	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29年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	40,556,283,653	93.01
内 韓国	6,154,038,611	14.11
内 ケイマン諸島	5,131,245,492	11.77
内 台湾	4,965,705,097	11.39
内 中国	4,128,318,551	9.47
内 インド	3,654,083,203	8.38
内 ブラジル	3,008,421,486	6.90
内 南アフリカ	2,564,822,045	5.88
内 ロシア	1,495,719,144	3.43
内 香港	1,491,012,456	3.42
内 メキシコ	1,177,748,607	2.70
内 インドネシア	1,050,072,905	2.41
内 マレーシア	1,006,966,406	2.31
内 タイ	897,814,011	2.06
内 ポーランド	546,338,210	1.25
内 チリ	488,883,859	1.12
内 フィリピン	484,184,161	1.11
内 トルコ	433,175,131	0.99
内 バミューダ	390,864,165	0.90
内 カタール	315,070,598	0.72
内 アラブ首長国連邦	305,810,415	0.70
内 コロンビア	172,410,438	0.40
内 アメリカ	152,371,256	0.35
内 オランダ	139,481,069	0.32
内 ハンガリー	125,107,173	0.29
内 ギリシャ	82,178,576	0.19
内 チェコ	70,353,994	0.16
内 エジプト	46,879,051	0.11
内 マン島	28,479,208	0.07
内 ペルー	28,108,159	0.06
内 マルタ	20,620,176	0.05
投資信託受益証券	272,781,638	0.63
内 メキシコ	272,781,638	0.63
投資証券	91,408,053	0.21
内 南アフリカ	40,400,652	0.09
内 メキシコ	36,065,784	0.08
内 トルコ	14,941,617	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,683,124,093	6.15
純資産総額	43,603,597,437	100.00

その他資産の投資状況

平成29年4月28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)	632,013,600	1.45
-	632,013,600	1.45
株価指数先物取引(買建)	2,622,343,519	6.01
内 アメリカ	2,622,343,519	6.01

(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) 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】

グローバル8資産ラップファンド(安定型)

平成29年4月28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	184,721,207	1.2957 239,355,237	1.2847 237,311,334	- -	63.01%
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	24,427,323	1.6784 41,000,284	1.7422 42,557,282	- -	11.30%
3	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	6,652,891	2.0150 13,405,610	2.2878 15,220,484	- -	4.04%
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	4,937,515	2.5680 12,679,887	3.0529 15,073,739	- -	4.00%
5	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	1,150	12,892.94 14,826,888	12,780.54 14,697,625	- -	3.90%
6	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	10,255,975	0.9462 9,704,861	1.0487 10,755,440	- -	2.86%
7	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	8,478,426	1.0525 8,924,308	1.1651 9,878,214	- -	2.62%
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	26,273,194	0.3733 9,808,965	0.3750 9,852,447	- -	2.62%
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	506,931	1.7578 891,110	1.7356 879,829	- -	0.23%

(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29年4月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	3.90%
親投資信託受益証券	90.68%
合計	94.58%

(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

該当事項はありません。

グローバル8資産ラップファンド（中立型）

平成29年4月28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	119,488,795	1.2957 154,821,647	1.2847 153,507,254	- -	34.36%
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	50,055,547	1.6736 83,774,232	1.7422 87,206,773	- -	19.52%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	5,210	12,817.98 66,781,699	12,780.54 66,586,632	- -	14.90%
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	8,890,588	2.5563 22,727,056	3.0529 27,142,076	- -	6.07%
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	11,810,649	2.0236 23,901,161	2.2878 27,020,402	- -	6.05%
6	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	20,973,753	0.9258 19,418,754	1.0487 21,995,174	- -	4.92%
7	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	17,243,942	1.0584 18,251,866	1.1651 20,090,916	- -	4.50%
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	47,393,107	0.3678 17,435,846	0.3750 17,772,415	- -	3.98%
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	1,030,225	1.7612 1,814,464	1.7356 1,788,058	- -	0.40%

（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29年4月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	14.90%
親投資信託受益証券	79.80%
合計	94.70%

（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。

グローバル8資産ラップファンド(積極型)

平成29年4月28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	39,777,260	1.6747 66,614,985	1.7422 69,299,942	- -	20.77%
2	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	4,270	12,858.45 54,905,611	12,780.54 54,572,921	- -	16.35%
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	16,375,405	2.5632 41,974,184	3.0529 49,992,473	- -	14.98%
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	31,648,133	1.0643 33,686,150	1.1651 36,873,239	- -	11.05%
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	14,652,884	2.0341 29,806,057	2.2878 33,522,868	- -	10.05%
6	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	25,864,018	1.2947 33,486,551	1.2847 33,227,503	- -	9.96%
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	16,690,965	0.9151 15,274,875	1.0487 17,503,814	- -	5.25%
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	37,791,488	0.3682 13,914,881	0.3750 14,171,808	- -	4.25%
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	1,901,073	1.7651 3,355,700	1.7356 3,299,502	- -	0.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年4月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	16.35%
親投資信託受益証券	77.28%
合計	93.64%

(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29年4月28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	1,526,000	6,346.00 9,683,996,000	6,035.00 9,209,410,000	- -	3.15%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	9,387,800	751.20 7,052,115,360	709.20 6,657,827,760	- -	2.28%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	994,500	4,874.00 4,847,193,000	4,769.00 4,742,770,500	- -	1.62%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	557,700	8,664.00 4,831,912,800	8,442.00 4,708,103,400	- -	1.61%
5	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	992,000	4,479.00 4,443,168,000	4,124.00 4,091,008,000	- -	1.40%
6	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,129,500	3,541.00 3,999,559,500	3,232.00 3,650,544,000	- -	1.25%
7	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,225,600	2,947.00 3,611,843,200	2,955.50 3,622,260,800	- -	1.24%
8	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	16,819,100	208.50 3,506,782,350	203.60 3,424,368,760	- -	1.17%
9	ソニー 日本	株式 電気機器	886,200	3,599.00 3,189,433,800	3,759.00 3,331,225,800	- -	1.14%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	779,500	3,632.00 2,831,144,000	3,706.00 2,888,827,000	- -	0.99%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	127,300	21,565.00 2,745,224,500	22,655.00 2,883,981,500	- -	0.99%
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	492,900	5,021.00 2,474,850,900	5,342.00 2,633,071,800	- -	0.90%
13	キーエンス 日本	株式 電気機器	56,900	43,880.00 2,496,772,000	44,800.00 2,549,120,000	- -	0.87%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	675,700	3,252.00 2,197,376,400	3,696.00 2,497,387,200	- -	0.86%
15	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	911,600	2,690.00 2,452,204,000	2,688.00 2,450,380,800	- -	0.84%
16	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	518,500	4,428.00 2,295,918,000	4,710.00 2,442,135,000	- -	0.84%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	242,800	9,995.00 2,426,786,000	9,954.00 2,416,831,200	- -	0.83%
18	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	498,700	4,705.00 2,346,383,500	4,692.00 2,339,900,400	- -	0.80%
19	信越化学工業 日本	株式 化学	235,800	9,505.00 2,241,279,000	9,684.00 2,283,487,200	- -	0.78%
20	三菱商事 日本	株式 卸売業	929,600	2,541.00 2,362,113,600	2,403.50 2,234,293,600	- -	0.77%

21	任天堂 日本	株式 その他製品	77,300	23,230.00 1,795,679,000	28,045.00 2,167,878,500	- -	0.74%
22	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,338,900	1,608.50 2,153,620,650	1,554.00 2,080,650,600	- -	0.71%
23	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	443,600	4,054.00 1,798,354,400	4,648.00 2,061,852,800	- -	0.71%
24	花王 日本	株式 化学	327,800	5,863.00 1,921,891,400	6,148.00 2,015,314,400	- -	0.69%
25	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,343,100	1,490.50 2,001,890,550	1,468.00 1,971,670,800	- -	0.68%
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	131,700	15,385.00 2,026,204,500	14,945.00 1,968,256,500	- -	0.67%
27	三菱地所 日本	株式 不動産業	921,000	2,194.50 2,021,134,500	2,130.00 1,961,730,000	- -	0.67%
28	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	104,400	17,995.00 1,878,678,000	18,685.00 1,950,714,000	- -	0.67%
29	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,441,500	1,175.50 1,694,490,576	1,330.50 1,917,915,750	- -	0.66%
30	ダイキン工業 日本	株式 機械	171,400	11,245.00 1,927,393,000	10,825.00 1,855,405,000	- -	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29年4月28日現在

種類	投資比率
株式	96.08%
合計	96.08%

(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29年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.34%
輸送用機器		8.59%
銀行業		7.81%
情報・通信業		7.56%
化学		6.58%
機械		4.99%
小売業		4.58%
医薬品		4.55%
食料品		4.40%
卸売業		4.29%
陸運業		4.04%
サービス業		3.67%
建設業		2.90%
保険業		2.50%
不動産業		2.34%
その他製品		1.82%
電気・ガス業		1.76%
精密機器		1.53%
その他金融業		1.19%
鉄鋼		1.18%
証券、商品先物取引業		1.11%
ガラス・土石製品		0.97%
ゴム製品		0.96%
非鉄金属		0.92%
金属製品		0.70%
繊維製品		0.69%
空運業		0.54%
石油・石炭製品		0.51%
鋳業		0.31%
パルプ・紙		0.25%
海運業		0.23%
倉庫・運輸関連業	0.18%	
水産・農林業	0.11%	
合計		96.08%

(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29年4月28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	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	100.82 4,234,524,000	100.68 4,228,938,000	0.200000 2018/12/20	1.14%
2	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.18 4,007,400,000	101.09 4,043,920,000	0.100000 2026/6/20	1.09%
3	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.34 4,013,635,000	100.96 4,038,520,000	0.100000 2026/12/20	1.09%
4	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.84 4,033,960,000	100.79 4,031,720,000	0.200000 2019/3/20	1.09%
5	366回 利付国庫債券(25年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.50 4,020,040,000	100.37 4,014,920,000	0.100000 2018/7/15	1.08%
6	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.91 3,733,892,000	100.85 3,731,709,000	0.200000 2019/6/20	1.01%
7	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.74 3,727,440,000	100.78 3,728,897,000	0.100000 2019/12/20	1.01%
8	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	102.02 3,570,700,000	102.94 3,603,110,000	0.300000 2025/12/20	0.97%
9	129回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.92 3,532,270,000	101.19 3,541,755,000	0.100000 2021/9/20	0.96%
10	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.84 3,529,680,000	101.04 3,536,505,000	0.100000 2020/12/20	0.95%
11	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.14 3,504,970,000	101.03 3,536,155,000	0.100000 2026/9/20	0.95%
12	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.78 3,527,580,000	100.91 3,531,990,000	0.100000 2020/6/20	0.95%
13	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.87 3,530,450,000	100.70 3,524,815,000	0.300000 2018/9/20	0.95%
14	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	105.76 3,173,010,000	105.78 3,173,580,000	1.300000 2021/3/20	0.86%
15	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	102.90 3,087,180,000	103.78 3,113,670,000	0.400000 2025/9/20	0.84%

16	130回 年)	利付国庫債券(5 日本)	国債証券	3,000,000,000	101.06 3,031,845,000	101.30 3,039,240,000	0.100000 2021/12/20	0.82%
17	342回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	3,000,000,000	100.22 3,006,675,000	101.15 3,034,710,000	0.100000 2026/3/20	0.82%
18	128回 年)	利付国庫債券(5 日本)	国債証券	3,000,000,000	100.91 3,027,450,000	101.14 3,034,350,000	0.100000 2021/6/20	0.82%
19	127回 年)	利付国庫債券(5 日本)	国債証券	3,000,000,000	100.88 3,026,490,000	101.09 3,032,820,000	0.100000 2021/3/20	0.82%
20	125回 年)	利付国庫債券(5 日本)	国債証券	3,000,000,000	100.81 3,024,330,000	100.97 3,029,130,000	0.100000 2020/9/20	0.82%
21	123回 年)	利付国庫債券(5 日本)	国債証券	3,000,000,000	100.75 3,022,770,000	100.85 3,025,650,000	0.100000 2020/3/20	0.82%
22	301回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,900,000,000	103.95 3,014,811,000	103.64 3,005,647,000	1.500000 2019/6/20	0.81%
23	339回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,800,000,000	102.94 2,882,557,000	103.71 2,904,076,000	0.400000 2025/6/20	0.78%
24	325回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,700,000,000	104.79 2,829,465,000	105.13 2,838,510,000	0.800000 2022/9/20	0.77%
25	321回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,500,000,000	105.49 2,637,250,000	105.70 2,642,675,000	1.000000 2022/3/20	0.71%
26	305回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,500,000,000	104.15 2,603,800,000	103.96 2,599,000,000	1.300000 2019/12/20	0.70%
27	310回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,300,000,000	104.04 2,392,920,000	104.02 2,392,460,000	1.000000 2020/9/20	0.65%
28	297回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,300,000,000	103.01 2,369,299,000	102.65 2,360,950,000	1.400000 2018/12/20	0.64%
29	312回 0年)	利付国庫債券(1 日本)	国債証券	2,200,000,000	105.07 2,311,606,000	105.05 2,311,100,000	1.200000 2020/12/20	0.62%
30	141回 0年)	利付国庫債券(2 日本)	国債証券	1,900,000,000	119.10 2,262,900,000	121.08 2,300,691,000	1.700000 2032/12/20	0.62%

(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29年4月28日現在

種類	投資比率
国債証券	84.08%
地方債証券	6.41%
特殊債券	4.69%
社債券	4.42%
合計	99.60%

(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-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成29年4月28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	3,489	639,467.28 2,231,101,342	593,000.00 2,068,977,000	- -	7.24%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,370	623,498.20 2,101,188,935	587,000.00 1,978,190,000	- -	6.92%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,337	169,914.11 1,756,402,242	160,700.00 1,661,155,900	- -	5.81%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,859	246,847.50 1,693,127,058	217,800.00 1,493,890,200	- -	5.23%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,864	178,205.37 1,401,407,039	168,500.00 1,325,084,000	- -	4.64%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,879	178,387.40 1,227,126,951	176,800.00 1,216,207,200	- -	4.25%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	3,796	278,161.17 1,055,899,812	281,800.00 1,069,712,800	- -	3.74%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,318	240,592.33 1,038,877,717	235,700.00 1,017,752,600	- -	3.56%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,336	287,883.09 960,377,995	293,600.00 979,449,600	- -	3.43%
10	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,275	450,779.97 1,025,524,439	418,500.00 952,087,500	- -	3.33%
11	アクティブ・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,575	547,585.00 862,446,382	531,000.00 836,325,000	- -	2.93%
12	GLP投資法人 日本	投資証券	6,463	127,071.97 821,266,192	125,700.00 812,399,100	- -	2.84%

13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	9,683	87,781.00 849,983,488	75,900.00 734,939,700	- -	2.57%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,042	635,611.02 662,306,693	632,000.00 658,544,000	- -	2.30%
15	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,226	518,804.78 636,054,667	486,500.00 596,449,000	- -	2.09%
16	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,965	159,483.45 632,351,900	144,800.00 574,132,000	- -	2.01%
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,197	463,956.80 555,356,292	479,000.00 573,363,000	- -	2.01%
18	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,265	240,514.28 544,764,858	237,900.00 538,843,500	- -	1.89%
19	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	979	547,058.41 535,570,191	492,000.00 481,668,000	- -	1.69%
20	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,718	193,638.23 526,308,735	174,100.00 473,203,800	- -	1.66%
21	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	871	629,017.61 547,874,345	543,000.00 472,953,000	- -	1.65%
22	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,367	185,450.29 438,960,845	179,000.00 423,693,000	- -	1.48%
23	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,226	146,279.50 471,897,684	130,500.00 420,993,000	- -	1.47%
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,337	132,174.02 441,064,715	121,900.00 406,780,300	- -	1.42%
25	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,254	137,272.81 446,685,738	119,900.00 390,154,600	- -	1.36%
26	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	8,348	67,078.28 559,969,530	42,700.00 356,459,600	- -	1.25%
27	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,416	147,694.20 356,829,193	138,300.00 334,132,800	- -	1.17%
28	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,329	239,771.80 318,656,729	246,800.00 327,997,200	- -	1.15%
29	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	4,053	83,399.94 338,019,975	80,100.00 324,645,300	- -	1.14%
30	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	2,732	119,354.19 326,075,658	117,600.00 321,283,200	- -	1.12%

(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29年4月28日現在

種類	投資比率
投資証券	98.13%
合計	98.13%

(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29年4月28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	393,589	15,026.37 5,914,216,224	16,002.38 6,298,364,323	- -	2.28%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	545,504	7,185.99 3,919,989,180	7,597.76 4,144,612,998	- -	1.50%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・通信販売	29,810	93,084.96 2,774,862,695	102,206.51 3,046,776,069	- -	1.10%
4	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	172,787	14,897.88 2,574,161,358	16,437.53 2,840,192,014	- -	1.03%
5	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消 耗燃料	305,988	9,217.03 2,820,302,962	9,043.42 2,767,179,651	- -	1.00%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	200,623	12,949.70 2,598,008,545	13,771.02 2,762,784,268	- -	1.00%
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	264,149	9,967.13 2,632,808,056	9,750.11 2,575,483,629	- -	0.93%
8	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	23,033	91,309.32 2,103,127,755	97,295.28 2,241,002,241	- -	0.81%
9	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	21,745	93,490.31 2,032,946,817	99,208.35 2,157,285,736	- -	0.78%
10	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	351,766	6,452.59 2,269,803,251	6,058.62 2,131,219,196	- -	0.77%
11	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリッ ト	651,483	3,369.86 2,195,407,284	3,236.31 2,108,403,032	- -	0.76%
12	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	454,046	4,535.06 2,059,129,258	4,441.58 2,016,683,403	- -	0.73%

13	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	229,749	8,169.42 1,876,918,373	8,667.42 1,991,333,260	- -	0.72%
14	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	744,517	2,677.63 1,993,546,564	2,632.00 1,959,575,072	- -	0.71%
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	188,523	9,777.93 1,843,366,469	9,759.02 1,839,799,746	- -	0.67%
16	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	446,309	3,644.74 1,626,683,611	3,768.27 1,681,817,010	- -	0.61%
17	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	90,525	18,579.86 1,681,942,324	18,535.34 1,677,912,513	- -	0.61%
18	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	139,242	12,522.35 1,743,637,170	11,737.75 1,634,388,662	- -	0.59%
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	300,584	5,371.96 1,614,727,719	5,193.90 1,561,204,530	- -	0.57%
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	89,743	15,731.95 1,411,832,783	17,374.59 1,559,248,261	- -	0.57%
21	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	352,277	4,234.02 1,491,550,699	4,405.97 1,552,122,281	- -	0.56%
22	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	51,656	26,567.43 1,372,367,370	29,130.17 1,504,748,216	- -	0.55%
23	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	348,818	3,998.64 1,394,800,991	4,165.58 1,453,030,923	- -	0.53%
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	301,590	4,510.58 1,360,346,938	4,786.58 1,443,585,536	- -	0.52%
25	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	111,404	12,278.62 1,367,888,017	12,891.83 1,436,201,830	- -	0.52%
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	202,834	7,307.30 1,482,169,172	6,964.52 1,412,643,112	- -	0.51%
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	164,106	8,404.44 1,379,219,194	8,605.87 1,412,276,379	- -	0.51%
28	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	137,669	9,665.53 1,330,644,744	10,194.16 1,403,420,363	- -	0.51%
29	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	114,289	11,416.12 1,304,737,875	12,263.04 1,401,531,161	- -	0.51%
30	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	369,699	3,595.77 1,329,356,233	3,756.03 1,388,603,307	- -	0.50%

(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29年4月28日現在

種類	投資比率
株式	95.77%
投資信託受益証券	0.30%
投資証券	2.28%
合計	98.36%

（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。

投資株式の業種別投資比率

平成29年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.33%
石油・ガス・消耗燃料		6.04%
医薬品		5.77%
保険		4.11%
ソフトウェア		3.60%
インターネットソフトウェア・サービス		3.04%
資本市場		2.78%
化学		2.68%
メディア		2.68%
情報技術サービス		2.68%
コンピュータ・周辺機器		2.65%
半導体・半導体製造装置		2.48%
各種電気通信サービス		2.42%
バイオテクノロジー		2.28%
コングロマリット		2.15%
食品		2.11%
飲料		2.04%
航空宇宙・防衛		1.96%
ヘルスケア機器・用品		1.95%
食品・生活必需品小売り		1.90%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.90%
電力		1.87%
ホテル・レストラン・レジャー		1.81%
専門小売り		1.78%
インターネット販売・通信販売		1.68%
タバコ		1.63%
機械		1.55%
家庭用品		1.44%
金属・鉱業		1.38%
繊維・アパレル・贅沢品		1.23%
総合公益事業		1.11%
自動車		1.00%
陸運・鉄道		0.91%
各種金融サービス		0.89%
通信機器		0.83%
電気設備		0.77%
パーソナル用品		0.72%
エネルギー設備・サービス		0.66%

専門サービス	0.61%
不動産管理・開発	0.55%
航空貨物・物流サービス	0.54%
消費者金融	0.53%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.52%
自動車部品	0.47%
家庭用耐久財	0.45%
電子装置・機器・部品	0.41%
建設関連製品	0.40%
複合小売り	0.38%
商業サービス・用品	0.37%
建設資材	0.36%
無線通信サービス	0.36%
建設・土木	0.33%
商社・流通業	0.30%
容器・包装	0.29%
運送インフラ	0.26%
旅客航空輸送業	0.15%
ガス	0.15%
紙製品・林産品	0.10%
水道	0.09%
販売	0.08%
海運業	0.08%
レジャー用品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.04%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
合計	95.77%

(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29年4月28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 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	3,950,795,000	100.42 3,967,743,910	100.24 3,960,671,987	1.375000 2018/9/30	1.58%
2	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	2,337,090,000	101.09 2,362,634,393	101.71 2,377,054,239	2.125000 2021/8/15	0.95%
3	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,891,930,000	106.25 2,010,175,625	106.10 2,007,432,326	3.625000 2020/2/15	0.80%
4	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,947,575,000	100.44 1,956,258,402	100.97 1,966,583,332	2.000000 2022/2/15	0.78%
5	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,836,285,000	103.32 1,897,396,564	103.53 1,901,197,674	2.625000 2020/8/15	0.76%
6	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,891,930,000	100.57 1,902,865,355	100.46 1,900,632,878	1.500000 2018/12/31	0.76%
7	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,747,253,000	100.98 1,764,445,969	101.51 1,773,723,882	2.125000 2021/12/31	0.71%
8	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,669,350,000	101.83 1,700,049,346	101.42 1,693,205,011	2.375000 2018/6/30	0.67%
9	US T N/B 1.625 03/31/19 アメリカ	国債証券	1,669,350,000	100.75 1,681,870,125	100.74 1,681,736,577	1.625000 2019/3/31	0.67%
10	US T N/B 1.25 12/15/18 アメリカ	国債証券	1,669,350,000	100.13 1,671,620,316	100.07 1,670,585,319	1.250000 2018/12/15	0.67%
11	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,558,060,000	106.09 1,653,054,918	106.06 1,652,509,597	3.500000 2020/5/15	0.66%
12	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,669,350,000	97.64 1,629,953,340	98.55 1,645,211,199	1.750000 2023/5/15	0.66%
13	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,446,770,000	104.00 1,504,640,800	103.73 1,500,792,391	3.125000 2019/5/15	0.60%
14	US T N/B 1.375 06/30/23 アメリカ	国債証券	1,558,060,000	95.30 1,484,893,502	96.26 1,499,866,459	1.375000 2023/6/30	0.60%
15	US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ	国債証券	1,502,415,000	99.08 1,488,727,999	99.26 1,491,372,249	1.000000 2019/8/31	0.59%
16	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,446,770,000	100.29 1,450,994,568	100.25 1,450,430,328	1.375000 2019/2/28	0.58%
17	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,413,383,000	100.64 1,422,541,721	100.41 1,419,234,405	1.500000 2018/8/31	0.57%
18	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,335,480,000	104.39 1,394,214,410	103.65 1,384,251,729	4.000000 2018/8/15	0.55%
19	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,335,480,000	103.01 1,375,691,302	102.71 1,371,724,927	2.750000 2019/2/15	0.55%
20	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,335,480,000	100.78 1,345,910,098	101.17 1,351,225,309	2.000000 2021/5/31	0.54%
21	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,335,480,000	99.45 1,328,174,924	99.76 1,332,341,622	1.375000 2020/4/30	0.53%
22	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,335,480,000	97.01 1,295,615,922	98.22 1,311,788,584	2.000000 2025/8/15	0.52%
23	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,279,835,000	101.85 1,303,627,132	102.20 1,308,119,353	2.250000 2021/3/31	0.52%

24	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,302,093,000	99.15 1,291,071,283	99.63 1,297,405,465	1.750000 2022/3/31	0.52%
25	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,172,245,000	110.02 1,289,703,949	110.23 1,292,259,443	2.500000 2020/10/25	0.51%
26	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	1,335,480,000	92.08 1,229,776,758	93.43 1,247,832,447	1.500000 2026/8/15	0.50%
27	US T N/B 2.0 02/28/21 アメリカ	国債証券	1,224,190,000	100.97 1,236,138,094	101.30 1,240,153,437	2.000000 2021/2/28	0.49%
28	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,224,190,000	100.93 1,235,660,660	101.17 1,238,623,200	1.875000 2020/6/30	0.49%
29	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	1,224,190,000	99.60 1,219,354,449	99.70 1,220,554,155	1.125000 2019/5/31	0.49%
30	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証券	1,279,835,000	93.35 1,194,841,157	94.68 1,211,837,366	1.625000 2026/5/15	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29年4月28日現在

種類	投資比率
国債証券	96.95%
合計	96.95%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年4月28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	103,450	22,063.01 2,282,418,650	18,682.25 1,932,679,000	- -	4.78%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	48,310	25,847.66 1,248,700,746	23,704.76 1,145,177,438	- -	2.83%
3	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	171,260	5,572.21 954,296,929	6,109.82 1,046,367,944	- -	2.59%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	117,310	7,897.58 926,466,224	8,030.68 942,079,821	- -	2.33%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	44,430	19,569.26 869,462,244	20,948.11 930,724,824	- -	2.30%
6	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	32,140	27,787.61 893,093,912	27,390.65 880,335,571	- -	2.18%
7	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	118,780	7,181.60 853,031,535	7,181.54 853,023,760	- -	2.11%
8	VENTAS INC アメリカ	投資証券	114,750	7,462.31 856,300,294	7,135.91 818,846,223	- -	2.02%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	49,780	14,347.91 714,239,238	14,021.42 697,986,641	- -	1.73%
10	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	51,540	11,339.63 584,444,821	12,608.04 649,818,592	- -	1.61%
11	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,724,100	383.13 660,568,055	362.09 624,286,265	- -	1.54%
12	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	55,710	11,012.34 613,497,722	10,740.59 598,358,709	- -	1.48%
13	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	87,740	6,960.29 610,696,358	6,616.19 580,504,554	- -	1.43%
14	LINK REIT 香港	投資証券	716,520	752.49 539,176,026	800.08 573,276,904	- -	1.42%
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	21,210	24,782.15 525,629,433	26,869.85 569,909,679	- -	1.41%
16	HCP INC アメリカ	投資証券	151,530	3,491.46 529,061,101	3,506.74 531,377,509	- -	1.31%
17	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	239,280	1,890.77 452,424,880	2,141.21 512,351,025	- -	1.27%
18	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	619,290	829.62 513,778,090	752.48 466,009,284	- -	1.15%
19	GGP INC アメリカ	投資証券	189,060	3,032.62 573,348,616	2,463.96 465,836,391	- -	1.15%
20	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	256,230	1,572.82 403,004,455	1,605.00 411,249,354	- -	1.02%
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	36,760	10,708.99 393,662,764	10,906.41 400,919,999	- -	0.99%
22	SL GREEN アメリカ	投資証券	32,560	11,626.28 378,551,805	11,699.91 380,949,320	- -	0.94%

23	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	28,780	11,704.95 336,868,595	12,571.31 361,802,543	- -	0.89%
24	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	115,130	2,857.93 329,034,295	3,111.66 358,246,382	- -	0.89%
25	UDR INC アメリカ	投資証券	86,540	3,936.06 340,627,318	4,121.06 356,637,285	- -	0.88%
26	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	516,200	599.32 309,371,408	679.23 350,622,862	- -	0.87%
27	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	23,350	16,737.06 390,810,483	14,819.37 346,032,438	- -	0.86%
28	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	40,770	9,149.78 373,036,708	8,463.60 345,061,155	- -	0.85%
29	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	47,290	8,138.92 384,889,895	7,109.20 336,194,313	- -	0.83%
30	STOCKLAND オーストラリア	投資信託受益 証券	779,790	384.56 299,879,109	408.70 318,706,723	- -	0.79%

(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29年4月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	11.25%
投資証券	88.25%
合計	99.50%

(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29年4月28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	110,555	25,302.37 2,797,303,829	23,875.04 2,639,505,456	- 2017/6/8	99.32%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年4月28日現在

種類	投資比率
社債券	99.32%
合計	99.32%

(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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年4月28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	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・ 周辺機器	8,080	205,306.40 1,658,875,712	216,569.60 1,749,882,368	- -	4.01%
2	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	466,400	3,297.58 1,537,991,312	3,497.78 1,631,364,592	- -	3.74%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体 製造装置	2,021,083	691.87 1,398,336,800	712.16 1,439,354,680	- -	3.30%
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	92,000	12,437.77 1,144,274,876	12,846.20 1,181,850,832	- -	2.71%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	35,896	20,596.63 739,336,659	21,049.82 755,604,568	- -	1.73%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	6,889,530	89.51 616,736,946	90.66 624,618,568	- -	1.43%
7	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	502,500	1,208.35 607,195,875	1,195.48 600,728,700	- -	1.38%
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	22,200	19,287.66 428,186,271	20,906.93 464,134,054	- -	1.06%
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,273,532	359.03 457,245,108	362.72 461,944,441	- -	1.06%
10	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,016,235	71.78 431,881,445	73.07 439,624,340	- -	1.01%
11	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	264,198	1,354.19 357,776,297	1,362.22 359,898,230	- -	0.83%
12	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,500,200	53.05 344,855,110	54.05 351,361,810	- -	0.81%
13	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不 動産金融	124,288	2,574.41 319,969,140	2,725.70 338,773,044	- -	0.78%
14	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	229,514	1,210.83 277,903,630	1,322.12 303,446,243	- -	0.70%

15	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	431,500	605.60 261,318,557	629.20 271,499,800	- -	0.62%
16	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	230,815	1,124.42 259,533,925	1,169.47 269,931,402	- -	0.62%
17	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	108,163	2,421.81 261,951,208	2,452.52 265,273,002	- -	0.61%
18	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	47,696	4,860.95 231,848,348	5,295.67 252,582,753	- -	0.58%
19	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	390,795	630.65 246,456,898	635.54 248,367,417	- -	0.57%
20	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	150,733	1,609.32 242,578,535	1,609.93 242,670,332	- -	0.56%
21	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	1,428	156,696.79 223,763,030	169,837.19 242,527,521	- -	0.56%
22	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	457,219	484.33 221,446,742	518.05 236,864,565	- -	0.54%
23	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,711,378	79.07 214,398,419	86.19 233,716,445	- -	0.54%
24	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	55,400	3,641.40 201,734,047	3,928.53 217,640,949	- -	0.50%
25	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	621,000	329.61 204,690,915	339.62 210,907,125	- -	0.48%
26	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	36,509	5,733.66 209,330,222	5,631.27 205,592,182	- -	0.47%
27	NETEASE INC-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	6,500	29,627.62 192,579,554	29,568.64 192,196,160	- -	0.44%
28	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,071,200	91.09 188,667,679	90.66 187,779,134	- -	0.43%
29	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,442,000	134.84 194,452,258	129.27 186,410,224	- -	0.43%
30	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	12,572	14,227.19 178,864,358	14,523.59 182,590,699	- -	0.42%

(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29年4月28日現在

種類	投資比率
株式	93.01%
投資信託受益証券	0.63%
投資証券	0.21%
合計	93.85%

（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29年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	15.62%
インターネットソフトウェア・サービス		8.65%
石油・ガス・消耗燃料		6.72%
コンピュータ・周辺機器		5.65%
半導体・半導体製造装置		4.89%
無線通信サービス		3.52%
保険		3.24%
金属・鉱業		2.88%
電子装置・機器・部品		2.65%
自動車		2.42%
化学		2.34%
メディア		2.28%
不動産管理・開発		1.96%
コングロマリット		1.81%
食品・生活必需品小売り		1.72%
各種電気通信サービス		1.71%
食品		1.63%
情報技術サービス		1.55%
医薬品		1.37%
各種金融サービス		1.26%
資本市場		1.14%
電力		1.12%
運送インフラ		1.01%
インターネット販売・通信販売		1.01%
飲料		0.96%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.94%
建設資材		0.91%
建設・土木		0.85%
パーソナル用品		0.76%
家庭用耐久財		0.73%
ホテル・レストラン・レジャー		0.69%
自動車部品		0.69%
タバコ		0.68%
複合小売り		0.66%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.64%
機械		0.63%
繊維・アパレル・贅沢品		0.53%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.49%

ガス	0.46%
各種消費者サービス	0.43%
家庭用品	0.39%
専門小売り	0.35%
紙製品・林産品	0.35%
旅客航空輸送業	0.26%
水道	0.24%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.23%
消費者金融	0.22%
電気設備	0.22%
バイオテクノロジー	0.20%
航空宇宙・防衛	0.20%
ソフトウェア	0.18%
陸運・鉄道	0.16%
商業サービス・用品	0.13%
総合公益事業	0.08%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.07%
エネルギー設備・サービス	0.07%
航空貨物・物流サービス	0.06%
容器・包装	0.06%
レジャー用品	0.06%
商社・流通業	0.06%
海運業	0.05%
販売	0.04%
ヘルスケア機器・用品	0.04%
建設関連製品	0.04%
通信機器	0.03%
ヘルスケア・テクノロジー	0.03%
合計	93.01%

(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】

グローバル8資産ラップファンド(安定型)

該当事項はありません。

グローバル8資産ラップファンド(中立型)

該当事項はありません。

グローバル8資産ラップファンド(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29年4月28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 2906月	買建	732	11,119,611,368	11,199,600,000	3.84%

(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-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成29年4月28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	TREIT 先物 2906月	買建	256	449,485,824	442,240,000	1.55%

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年4月28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・ドル売/円 買2017年05月	売建	12,160,000	1,353,762,310	1,353,043,200	0.49%
		ユーロ売/円買201 7年05月	売建	2,920,000	354,380,775	352,882,000	0.13%
		イギリス・ポンド売/ 円買2017年05月	売建	1,030,000	147,367,520	147,856,500	0.05%
		カナダ・ドル売/円買 2017年05月	売建	900,000	73,485,720	73,458,000	0.03%
		オーストラリア・ドル 売/円買2017年0 5月	売建	710,000	59,127,120	59,086,200	0.02%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Jun 17	買建	213	2,793,692,003	2,827,979,061	1.03%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Jun 17	買建	174	720,018,257	736,186,779	0.27%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Jun17	買建	27	280,883,035	278,344,177	0.10%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT J un17	買建	10	150,352,664	148,974,750	0.05%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Jun1 7	買建	9	109,770,669	110,669,661	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) 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29年4月28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2017年05月	買建	6,412,000	713,905,668	713,463,240	0.28%
		ユーロ買/円売201 7年05月	買建	2,939,000	356,890,117	355,178,150	0.14%
		イギリス・ポンド買/ 円売2017年05月	買建	831,000	118,842,972	119,290,050	0.05%
		アメリカ・ドル売/円 買2017年05月	売建	929,000	103,371,688	103,369,830	0.04%
		ユーロ売/円買201 7年05月	売建	428,000	51,728,508	51,723,800	0.02%
		イギリス・ポンド売/ 円買2017年05月	売建	120,000	17,225,520	17,224,800	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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年4月28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2017年05月	買建	5,520,000	614,591,280	614,210,400	1.52%
		オーストラリア・ドル 買/円売2017年0 5月	買建	880,000	73,291,680	73,233,600	0.18%
		シンガポール・ドル 買/円売2017年0 5月	買建	335,000	26,727,137	26,699,500	0.07%
		香港・ドル買/円売2 017年05月	買建	1,165,000	16,670,684	16,647,850	0.04%
		カナダ・ドル買/円売 2017年05月	買建	203,000	16,575,762	16,568,860	0.04%
		ニュージーランド・ド ル買/円売2017年 05月	買建	65,000	4,992,390	4,975,750	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29年4月28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2017年05月	買建	5,680,000	632,405,520	632,013,600	1.45%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Jun 17	買建	483	2,607,940,368	2,622,343,519	6.01%

(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) 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29年4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。

グローバル8資産ラップファンド(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)
第1計算期間末 (平成28年10月12日)	789	789	0.9850	0.9850
平成28年4月末日	839	-	1.0014	-
5月末日	748	-	1.0067	-
6月末日	755	-	0.9932	-
7月末日	764	-	0.9986	-
8月末日	773	-	0.9909	-
9月末日	788	-	0.9844	-
10月末日	786	-	0.9860	-
11月末日	806	-	0.9961	-
12月末日	821	-	1.0084	-
平成29年1月末日	814	-	0.9998	-
2月末日	831	-	1.0038	-
3月末日	354	-	1.0004	-
4月末日	376	-	1.0038	-

グローバル8資産ラップファンド(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)
第1計算期間末 (平成28年10月12日)	421	421	0.9420	0.9420
平成28年4月末日	404	-	0.9634	-
5月末日	415	-	0.9703	-
6月末日	423	-	0.9384	-
7月末日	434	-	0.9541	-
8月末日	424	-	0.9493	-
9月末日	419	-	0.9379	-
10月末日	452	-	0.9435	-
11月末日	468	-	0.9667	-
12月末日	443	-	0.9943	-
平成29年1月末日	430	-	0.9835	-
2月末日	443	-	0.9890	-
3月末日	445	-	0.9853	-
4月末日	446	-	0.9884	-

グローバル8資産ラップファンド（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)
第1計算期間末 （平成28年10月12日）	279	279	0.9010	0.9010
平成28年4月末日	250	-	0.9281	-
5月末日	254	-	0.9373	-
6月末日	245	-	0.8880	-
7月末日	269	-	0.9156	-
8月末日	269	-	0.9115	-
9月末日	278	-	0.8962	-
10月末日	280	-	0.9038	-
11月末日	289	-	0.9406	-
12月末日	304	-	0.9802	-
平成29年1月末日	329	-	0.9673	-
2月末日	332	-	0.9757	-
3月末日	329	-	0.9713	-
4月末日	333	-	0.9750	-

【分配の推移】

グローバル8資産ラップファンド（安定型）

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	-

グローバル8資産ラップファンド（中立型）

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	-

グローバル8資産ラップファンド（積極型）

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	-

【収益率の推移】

グローバル8資産ラップファンド(安定型)

	収益率(%)
第1計算期間	1.5
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	1.2

(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。

グローバル8資産ラップファンド(中立型)

	収益率(%)
第1計算期間	5.8
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	3.5

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配落の額)に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円(1万口当たり)を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

グローバル8資産ラップファンド(積極型)

	収益率(%)
第1計算期間	9.9
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	6.1

(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】

グローバル8資産ラップファンド(安定型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	966,188,060	164,729,152
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	79,327,952	505,576,044

(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。

グローバル8資産ラップファンド(中立型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	460,757,286	12,980,810
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	79,807,476	75,549,727

(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。

グローバル8資産ラップファンド(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	320,872,310	10,138,060
平成28年10月13日～ 平成29年4月12日	36,783,495	7,985,996

(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。

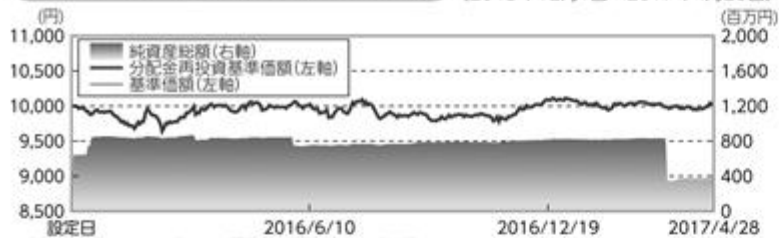
<< 参考情報 >>

データの基準日:2017年4月28日

グローバル8資産ラップファンド(安定型)

基準価額・純資産の推移

(2015年12月1日～2017年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第1期 (2016.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

※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	63.01%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.30%
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	4.04%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.00%
5	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	3.90%
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.86%
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.62%
8	コモディティインデックス・マザーファンド	2.62%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.23%

年間収益率の推移(暦年ベース)

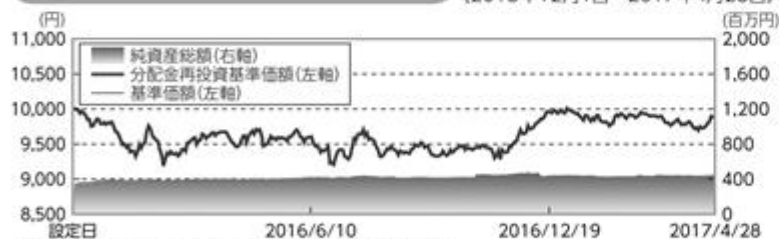


※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2015年は設定日から年末までの収益率、および2017年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

グローバル8資産ラップファンド(中立型)

基準価額・純資産の推移

(2015年12月1日～2017年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第1期 (2016.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
 ○委託会社の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。

主要な資産の状況

※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	34.36%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.52%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	14.90%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.07%
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.05%
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.92%
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.50%
8	コモディティインデックス・マザーファンド	3.98%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.40%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2017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。

グローバル8資産ラップファンド(積極型)

基準価額・純資産の推移

(2015年12月1日~2017年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※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ものであり、

実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第1期 (2016.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

※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	20.77%
2	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	16.35%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.98%
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.05%
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10.05%
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.96%
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.25%
8	コモディティインデックス・マザーファンド	4.25%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.99%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2017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、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社の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2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 3 資産管理等の概要 (1)資産の評価」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>

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
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	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

4【受益者の権利等】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 4 受益者の権利等」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)収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。ま

た、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3)一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

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 1 財務諸表」につきましては、以下の内容を追加いたします。

<追加>

1【財務諸表】

グローバル8資産ラップファンド(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28年10月13日から平成29年4月12日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【グローバル8資産ラップファンド（安定型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,039,997	594,638
コール・ローン	47,541,780	21,280,474
投資信託受益証券	54,750,525	14,344,515
親投資信託受益証券	688,890,453	342,712,176
流動資産合計	793,222,755	378,931,803
資産合計	793,222,755	378,931,803
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	121,380	164,845
未払委託者報酬	3,611,975	4,905,346
その他未払費用	13,588	18,447
流動負債合計	3,746,943	5,088,638
負債合計	3,746,943	5,088,638
純資産の部		
元本等		
元本	1,801,458,908	1,375,210,816
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2 11,983,096	2 1,367,651
（分配準備積立金）	1,784,357	711,044
元本等合計	789,475,812	373,843,165
純資産合計	789,475,812	373,843,165
負債純資産合計	793,222,755	378,931,803

(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	第2期中間計算期間 自 平成28年10月13日 至 平成29年4月12日
営業収益		
受取配当金	1,022,141	985,654
受取利息	8,567	306
有価証券売買等損益	17,703,466	10,121,454
為替差損益	5,714,917	4,122,310
営業収益合計	13,019,257	15,229,724
営業費用		
支払利息	4,434	15,511
受託者報酬	177,664	164,845
委託者報酬	5,287,066	4,905,346
その他費用	46,690	22,402
営業費用合計	5,515,854	5,108,104
営業利益又は営業損失()	7,503,403	10,121,620
経常利益又は経常損失()	7,503,403	10,121,620
中間純利益又は中間純損失()	7,503,403	10,121,620
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()	520,950	6,601,925
期首剰余金又は期首欠損金()	-	11,983,096
剰余金増加額又は欠損金減少額	411,497	7,357,614
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	411,497	7,357,614
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,390,819	261,864
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,390,819	261,864
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	5,003,131	1,367,651

(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 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12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	640,435,532円 325,752,528円 164,729,152円	801,458,908円 79,327,952円 505,576,044円
2. 受益権の総数	801,458,908口	375,210,816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11,983,096円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,367,651円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.9850円	0.9964円
（1万口当たり純資産額）	（9,850円）	（9,964円）

グローバル8資産ラップファンド(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28年10月13日から平成29年4月12日まで)の中間財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【グローバル8資産ラップファンド(中立型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,082,145	880,369
コール・ローン	27,263,815	26,001,483
投資信託受益証券	60,393,671	64,986,891
親投資信託受益証券	335,115,753	351,716,921
流動資産合計	423,855,384	443,585,664
資産合計	423,855,384	443,585,664
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	67,005	95,693
未払委託者報酬	1,994,290	2,848,567
その他未払費用	7,477	10,695
流動負債合計	2,068,772	2,954,955
負債合計	2,068,772	2,954,955
純資産の部		
元本等		
元本	1,447,776,476	1,452,034,225
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,25,989,864	2,11,403,516
(分配準備積立金)	2,898,696	2,457,525
元本等合計	421,786,612	440,630,709
純資産合計	421,786,612	440,630,709
負債純資産合計	423,855,384	443,585,664

(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	第2期中間計算期間 自 平成28年10月13日 至 平成29年4月12日
営業収益		
受取配当金	1,034,284	1,215,362
受取利息	4,451	180
有価証券売買等損益	3,335,143	13,608,209
為替差損益	5,940,703	4,045,096
営業収益合計	8,237,111	18,868,847
営業費用		
支払利息	1,907	9,541
受託者報酬	84,848	95,693
委託者報酬	2,525,634	2,848,567
その他費用	36,881	18,062
営業費用合計	2,649,270	2,971,863
営業利益又は営業損失()	10,886,381	15,896,984
経常利益又は経常損失()	10,886,381	15,896,984
中間純利益又は中間純損失()	10,886,381	15,896,984
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()	-	2,903,716
期首剰余金又は期首欠損金()	-	25,989,864
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	4,319,800
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	4,319,800
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,803,535	2,726,720
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,803,535	2,726,720
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	12,689,916	11,403,516

(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 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12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	348,320,809円 112,436,477円 12,980,810円	447,776,476円 79,807,476円 75,549,727円
2. 受益権の総数	447,776,476口	452,034,225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25,989,864円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は11,403,516円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.9420円	0.9748円
（1万口当たり純資産額）	（9,420円）	（9,748円）

グローバル8資産ラップファンド(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28年10月13日から平成29年4月12日まで)の中間財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【グローバル8資産ラップファンド(積極型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,784,986	901,555
コール・ローン	20,458,699	19,949,256
投資信託受益証券	47,306,374	53,261,808
親投資信託受益証券	212,871,441	252,560,827
流動資産合計	283,421,500	326,673,446
資産合計	283,421,500	326,673,446
負債の部		
流動負債		
未払金	2,169,413	-
未払受託者報酬	41,196	66,615
未払委託者報酬	1,226,808	1,983,119
その他未払費用	4,568	7,406
流動負債合計	3,441,985	2,057,140
負債合計	3,441,985	2,057,140
純資産の部		
元本等		
元本	1 310,734,250	1 339,531,749
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2 30,754,735	2 14,915,443
(分配準備積立金)	2,835,530	2,764,091
元本等合計	279,979,515	324,616,306
純資産合計	279,979,515	324,616,306
負債純資産合計	283,421,500	326,673,446

(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	第2期中間計算期間 自 平成28年10月13日 至 平成29年4月12日
営業収益		
受取配当金	801,296	1,007,475
受取利息	2,761	119
有価証券売買等損益	9,183,245	15,082,222
為替差損益	4,574,922	2,586,628
営業収益合計	12,954,110	18,676,444
営業費用		
支払利息	1,022	6,362
受託者報酬	52,277	66,615
委託者報酬	1,556,699	1,983,119
その他費用	31,749	11,052
営業費用合計	1,641,747	2,067,148
営業利益又は営業損失()	14,595,857	16,609,296
経常利益又は経常損失()	14,595,857	16,609,296
中間純利益又は中間純損失()	14,595,857	16,609,296
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()	-	480,258
期首剰余金又は期首欠損金()	-	30,754,735
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	779,460
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	779,460
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,426,730	1,069,206
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,426,730	1,069,206
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	17,022,587	14,915,443

(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 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12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	222,264,448円 98,607,862円 10,138,060円	310,734,250円 36,783,495円 7,985,996円
2. 受益権の総数	310,734,250口	339,531,749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30,754,735円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は14,915,443円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.9010円	0.9561円
（1万口当たり純資産額）	（9,010円）	（9,561円）

（参考）

「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）」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10月12日現在	平成29年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,889,323,978	8,812,046,308
株式	2	274,144,773,250	270,513,187,804
派生商品評価勘定		90,428,948	-
未収入金		4,319,728	-
未収配当金		2,350,262,725	2,629,140,221
前払金		-	224,604,200
流動資産合計		282,479,108,629	282,178,978,533
資産合計		282,479,108,629	282,178,978,533
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		182,916	329,588,820
前受金		136,187,200	-
未払金		-	1,241,296
未払解約金		828,535,000	113,674,000
流動負債合計		964,905,116	444,504,116
負債合計		964,905,116	444,504,116
純資産の部			
元本等			
元本	1	141,984,682,751	127,509,889,186
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		139,529,520,762	154,224,585,231
元本等合計		281,514,203,513	281,734,474,417
純資産合計		281,514,203,513	281,734,474,417
負債純資産合計		282,479,108,629	282,178,978,533

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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	138,472,968,255円 37,509,003,652円 33,997,289,156円	141,984,682,751円 11,784,080,316円 26,258,873,881円
元本の内訳 ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	6,549,280,589円	6,677,536,302円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,575,376,249円	1,751,900,416円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,822,033円	5,691,950円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,618,708円	13,349,563円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	25,144,181円	27,933,578円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	13,903,705円	6,729,720円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,101,393円	11,810,649円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	12,262,597円	14,652,884円
たわらノーロード TOPIX DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	- 円 39,026,844,057円	18,812,204円 36,860,930,157円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	892,175,848円	822,959,098円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	3,085,053,451円	2,890,023,632円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,110,638,487円	2,947,445,443円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	406,578,514円	377,967,462円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,299,706,406円	1,234,820,243円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,135,404,057円	1,089,559,999円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	63,391,188円	54,791,296円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,361,434,988円	1,226,177,773円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	29,855,862円	26,165,942円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	34,618,530円	36,856,400円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	70,908,730円	74,194,384円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	134,667,581円	147,152,481円
投資のソムリエ	1,532,512,647円	2,089,074,047円
クルーズコントロール	1,361,224,064円	1,688,273,411円
投資のソムリエ<DC年金>	42,045,295円	71,764,386円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	111,572,421円	121,532,776円
DIAM DC バランス・F(成長型)	107,729,591円	131,523,206円
クルーズコントロール<DC年金>	435,072円	584,746円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	16,553,351円	12,325,502円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	41,655,765円	38,565,546円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	13,516,086円	26,284,223円
ダイナミック・ナビゲーション	2,259,439円	1,427,701円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	- 円	255,671,590円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	249,214,122円	336,334,626円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	108,351,515円	87,502,060円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	256,516,116円	195,042,761円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	448,843,778円	375,146,296円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	32,496,190円	25,941,336円

D I A M国際分散バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	138,048,923円	111,644,665円
D I A M国内重視バランスファン ド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	35,339,487円	29,188,697円
D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	44,104,951円	30,322,386円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	2,613,101,420円	270,855,154円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	921,644,988円	183,618,948円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,759,630,851円	1,427,102,636円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	1,488,934,009円	1,294,400,984円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	3,941,172,402円	3,509,436,468円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	332,873,979円	273,754,224円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	731,561,485円	365,943,174円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	937,888,973円	787,331,336円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	3,833,571,575円	3,106,845,684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)	51,147,517円	31,157,719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)	1,360,969,610円	976,483,858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)	5,436,117,474円	4,778,996,031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)	21,190,612,731円	18,656,467,459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)	778,556,088円	678,007,567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)	2,431,224,796円	2,120,504,870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)	13,422,317,174円		11,858,825,717円
	D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	7,865,270円		6,612,978円
	D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	3,381,053円		123,197円
	D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	1,215,517円		4,749,000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)	12,044,427,017円		10,599,834,213円
	D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	109,073,229円		92,092,267円
	D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	38,767,272円		33,194,928円
	D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	43,596,204円		35,965,541円
	D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	81,496円		73,962円
	D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	128,550円		120,897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)	693,705,071円		598,137,528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)	1,859,845,103円		1,622,373,744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)	2,451,073,369円		2,159,696,264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)	100,992,561円		91,571,301円
	計	141,984,682,751円		127,509,889,186円
2 .	受益権の総数	141,984,682,751口		127,509,889,186口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 2,978,500,000円		株式 2,899,000,000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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400	11,495,794,200	-	11,166,450,000	329,344,200
合計	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400	11,495,794,200	-	11,166,450,000	329,344,200

(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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.9827円	2.2095円
(1万口当たり純資産額)	(19,827円)	(22,095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10月12日現在	平成29年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,747,530,910	4,598,150,057
国債証券		314,821,199,800	311,311,945,000
地方債証券		23,892,646,241	23,741,821,569
特殊債券		20,116,560,490	17,401,926,842
社債券		18,355,103,890	15,619,334,380
未収入金		-	1,223,923,495
未収利息		676,597,865	649,501,377
前払費用		10,464,910	5,688,795
流動資産合計		379,620,104,106	374,552,291,515
資産合計		379,620,104,106	374,552,291,515
負債の部			
流動負債			
未払金		-	3,484,946,000
未払解約金		531,583,000	225,045,000
流動負債合計		531,583,000	3,709,991,000
負債合計		531,583,000	3,709,991,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	291,973,791,531	289,011,703,001
剰余金			
剰余金又は欠損金()		87,114,729,575	81,830,597,514
元本等合計		379,088,521,106	370,842,300,515
純資産合計		379,088,521,106	370,842,300,515
負債純資産合計		379,620,104,106	374,552,291,515

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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	341,377,581,143円 52,776,738,530円 102,180,528,142円	291,973,791,531円 33,965,893,497円 36,927,982,027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	10,458,069,463円	12,354,775,771円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	159,532,734円	159,640,467円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	125,209,751円	135,111,086円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	43,871,381円	49,389,213円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	381,270,488円	186,858,731円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	110,183,872円	119,488,795円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	21,400,757円	25,864,018円
たわらノーロード 国内債券	885,657,182円	1,211,008,689円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円	755,274円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,268,043,060円	12,205,065,919円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	4,632,761,411円	4,978,629,396円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	6,578,817,520円	7,131,121,393円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,554,204,766円	2,817,267,576円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,609,638,301円	1,689,670,048円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,690,614,896円	1,790,113,677円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	237,929,018円	265,940,984円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	105,278,258円	104,084,188円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,257,679,789円	2,343,403,240円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	3,112,040円	3,393,292円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	302,015,090円	369,139,324円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	221,948,921円	268,506,258円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	50,978,906円	64,454,782円
投資のソムリエ	6,567,663,875円	6,187,327,446円
クルーズコントロール	2,610,923,070円	3,683,002,031円
投資のソムリエ<DC年金>	180,275,881円	210,665,010円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	961,890,169円	1,233,467,851円
DIAM DC バランス・F(成長型)	90,184,473円	128,085,057円
クルーズコントロール<DC年金>	833,577円	1,276,686円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	8,493,906円	7,149,924円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	21,306,101円	22,446,258円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	59,777,173円	214,797,697円
ダイナミック・ナビゲーション	1,495,303円	460,972円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	- 円	2,096,463,414円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	31,050,583,696円	25,396,866,662円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	936,406,293円	425,538,233円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	534,261,862円	508,600,683円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	462,575,957円	413,704,875円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	269,246,072円	264,834,602円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	113,762,861円	106,974,757円

D I A M国際分散バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	310,994,299円	296,028,135円
D I A M国内重視バランスファン ド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	132,470,850円	128,997,799円
D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	88,267,911円	71,442,780円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	5,881,081,105円	718,245,291円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	2,074,303,601円	486,727,146円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	7,043,095,308円	6,727,835,429円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	3,351,334,587円	3,431,683,400円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	5,912,828,633円	6,199,892,764円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	749,275,470円	726,031,676円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	2,758,515,887円	1,620,116,193円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	4,223,738,820円	4,183,153,160円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	5,752,830,754円	5,488,370,370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)	812,385,968円	586,191,715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)	6,129,868,013円	5,188,810,574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)	6,389,387,464円	6,745,903,203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)	84,823,847,127円	87,926,268,879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)	1,168,090,154円	1,197,806,535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)	7,298,174,808円	7,495,501,264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)	26,880,783,364円	27,943,005,710円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	94,584,425円	93,842,436円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	12,678,405円	545,872円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	1,822,460円	8,386,834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)	30,149,878,097円	31,230,675,739円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	537,946,652円	535,380,536円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	135,725,739円	137,542,612円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	660,620,390円	637,296,110円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	426,081円	459,544円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	321,173円	356,177円
計	291,973,791,531円	289,011,703,001円
2 . 受益権の総数	291,973,791,531口	289,011,703,001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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成28年10月12日現在	平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	1,2984円	1,2831円
（1万口当たり純資産額）	（12,984円）	（12,831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10月12日現在	平成29年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		245,750,070	454,538,055
投資証券		26,253,479,756	27,372,019,000
未収入金		9,520,050	-
未収配当金		199,681,769	263,755,877
前払金		-	973,824
差入委託証拠金		-	11,053,056
流動資産合計		26,708,431,645	28,102,339,812
資産合計		26,708,431,645	28,102,339,812
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	5,197,824
未払金		167,325,764	244,166,186
未払解約金		-	1,772,000
流動負債合計		167,325,764	251,136,010
負債合計		167,325,764	251,136,010
純資産の部			
元本等			
元本	1	15,180,336,252	15,963,728,016
剰余金			
剰余金又は欠損金()		11,360,769,629	11,887,475,786
元本等合計		26,541,105,881	27,851,203,802
純資産合計		26,541,105,881	27,851,203,802
負債純資産合計		26,708,431,645	28,102,339,812

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. 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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,550,922,737円	15,180,336,252円
同期中追加設定元本額	12,085,387,213円	4,894,580,720円
同期中一部解約元本額	11,455,973,698円	4,111,188,956円
元本の内訳 ファンド名		
MITO ラップ型ファンド （安定型）	610,789円	437,594円
MITO ラップ型ファンド （中立型）	1,551,539円	1,165,553円
MITO ラップ型ファンド （積極型）	3,359,219円	3,630,587円
グローバル8資産ラップファン ド（安定型）	1,458,959円	512,613円
グローバル8資産ラップファン ド（中立型）	1,365,431円	1,030,225円
グローバル8資産ラップファン ド（積極型）	1,638,645円	1,901,073円
たわらノーロード 国内リート	498,813,334円	550,909,635円
たわらノーロード 国内リート <ラップ向け>	32,348,443円	94,732,213円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	15,802,327円	16,131,239円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	344,976,938円	359,974,759円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,262,040円	3,962,722円
DIAM DC 8資産バラン スファンド（新興国10）	11,428,642円	14,047,781円

DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	31,357,057円	37,674,824円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	67,624,587円	84,186,367円
投資のソムリエ	686,059,285円	1,405,533,033円
投資のソムリエ<DC年金>	18,941,627円	48,174,139円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	36,986,155円	46,535,069円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	3,505,706円	23,466,943円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バラン スファンド	469,965円 - 円	161,885円 226,087,691円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 10(適格機関投資家限定)	978,666,133円	961,105,748円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	1,054,623,756円	95,923,087円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	1,900,673,417円	1,866,407,691円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	7,772,152,934円	7,643,894,903円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	57,813,260円	41,595,106円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	661,075,280円	1,051,110,564円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	954,293,116円	1,345,957,304円
DIAM リスクコントロール J-REITファンド(適格機 関投資家限定)	37,477,668円	37,477,668円
計	15,180,336,252円	15,963,728,016円
2. 受益権の総数	15,180,336,252口	15,963,728,016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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<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 該当事項はありません。</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>	<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。	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10月12日 現在				平成29年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	-	-	-	-	449,402,880	-	444,288,000	5,114,880
合計	-	-	-	-	449,402,880	-	444,288,000	5,114,880

(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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.7484円	1.7447円
(1万口当たり純資産額)	(17,484円)	(17,447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10月12日現在	平成29年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,972,546,971	3,516,308,443
コール・ローン		98,225,753	1,254,919,777
株式		240,970,135,633	255,263,642,570
投資信託受益証券		819,369,297	822,702,348
投資証券		5,741,105,528	6,233,558,007
派生商品評価勘定		36,397,654	14,840,601
未収入金		2,921,921	5,909,842
未収配当金		280,921,804	423,219,466
差入委託証拠金		1,171,790,039	1,556,352,225
流動資産合計		254,093,414,600	269,091,453,279
資産合計		254,093,414,600	269,091,453,279
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		34,581,305	26,195,861
未払解約金		377,050,000	186,344,000
流動負債合計		411,631,305	212,539,861
負債合計		411,631,305	212,539,861
純資産の部			
元本等			
元本	1	100,403,068,668	91,223,037,107
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		153,278,714,627	177,655,876,311
元本等合計		253,681,783,295	268,878,913,418
純資産合計		253,681,783,295	268,878,913,418
負債純資産合計		254,093,414,600	269,091,453,279

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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	98,425,773,739円	100,403,068,668円
同期中追加設定元本額	20,806,177,728円	7,889,098,543円
同期中一部解約元本額	18,828,882,799円	17,069,130,104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	1,951,069,361円	1,632,453,170円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,302,436円	4,265,510円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	15,885,054円	10,061,120円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	34,557,068円	31,288,288円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	15,053,332円	4,995,847円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,976,337円	8,890,588円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,854,378円	16,375,405円
たわらノーロード 先進国株式	1,925,384,634円	2,748,214,551円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	426,031円	425,695円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	12,210,923円	136,427,403円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	35,775,985,290円	35,782,235,434円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	184,975,989円	163,119,472円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	953,771,814円	901,624,198円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,154,273,058円	1,072,918,151円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	154,219,442円	147,028,268円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	424,912,023円	414,379,447円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	351,218,100円	331,133,134円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	44,877,625円	38,250,275円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	962,087,439円	856,021,775円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	228,191,393円	206,248,871円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	27,448,009円	27,760,757円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	55,450,918円	55,588,777円

DIAM DC 8資産バ ランスファンド(新興国30)	106,709,231円	110,094,579円
投資のソムリエ	543,340,779円	2,155,397,605円
クルーズコントロール	531,098,739円	631,673,738円
投資のソムリエ<DC年金>	14,886,372円	73,812,188円
DIAM 8資産バ ランスファ ンドN<DC年金>	87,691,558円	93,085,128円
DIAM DC バ ランス・F (成長型)	40,468,070円	47,393,760円
クルーズコントロール<DC年 金>	169,726円	218,747円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	4,309,803円	3,074,636円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	10,831,563円	9,607,002円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	4,359,505円	26,843,076円
ダイナミック・ナビゲーション	439,073円	1,578,725円
リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド	- 円	254,759,984円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	- 円	143,422,151円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	- 円	236,792,132円
DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用)	199,567,957円	157,346,325円
DIAM外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,233,690,106円	3,223,630,632円
DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	147,200,968円	194,249,091円
DIAM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	162,510,217円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	- 円	43,803,381円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	36,367,478円	27,933,000円
DIAMグローバル・バ ランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	201,127,434円	145,323,560円
DIAMグローバル・バ ランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	351,435,122円	279,150,813円
DIAM国際分散バ ランス ファンド30VA(適格機関投 資家 限定)	25,425,328円	19,303,264円
DIAM国際分散バ ランス ファンド50VA(適格機関投 資家 限定)	162,351,419円	124,808,247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)	13,816,919円	10,853,211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)	23,041,123円	15,058,188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)	2,048,221,117円	201,641,148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)	1,083,778,037円	204,996,747円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	919,211,282円	707,472,930円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,021,084,457円	843,742,901円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	3,089,092,005円	2,611,494,262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)	1,300,978,067円	1,030,086,345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)	1,728,448,000円	830,518,176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)	1,470,108,607円	1,174,888,996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)	999,380,756円	769,177,648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)	13,494,600円	8,099,193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)	4,787,679,095円	3,321,620,299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)	1,708,239,056円	1,486,311,767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)	11,069,827,660円	9,260,776,060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)	610,228,493円	504,588,661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)	1,905,576,749円	1,578,137,083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)	7,010,880,357円	5,889,818,136円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	30,570,864円	24,692,245円

	D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	10,518,093円	367,806円
	D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	3,463,728円	12,968,022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)	9,440,136,846円	7,898,936,923円
	D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	103,812,926円	80,834,551円
	D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	188,138円	166,343円
	D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	298,427円	271,349円
	計	100,403,068,668円	91,223,037,107円
2 .	受益権の総数	100,403,068,668口	91,223,037,107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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	426,548,102	-	424,879,200	1,668,902	38,317,235	-	38,315,000	2,235
アメリカ・ドル	261,702,840	-	261,147,600	555,240	-	-	-	-
イギリス・ポンド	43,453,250	-	43,210,600	242,650	34,207,000	-	34,205,000	2,000
オーストラリア・ドル	27,557,260	-	27,422,500	134,760	4,110,235	-	4,110,000	235
カナダ・ドル	16,514,808	-	16,430,400	84,408	-	-	-	-
ユーロ	77,319,944	-	76,668,100	651,844	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	1,046,998,546	-	1,035,642,900	11,355,646
アメリカ・ドル	-	-	-	-	748,062,000	-	739,597,500	8,464,500
イギリス・ポンド	-	-	-	-	56,456,754	-	56,096,200	360,554
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	24,125,680	-	23,838,000	287,680
カナダ・ドル	-	-	-	-	39,930,432	-	39,441,600	488,832
ユーロ	-	-	-	-	178,423,680	-	176,669,600	1,754,080
合計	426,548,102	-	424,879,200	1,668,902	1,085,315,781	-	1,073,957,900	11,353,411

(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10月12日 現在				平成29年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,952,255,095	-	5,952,402,542	147,447	6,424,038,394	-	6,424,036,545	1,849
合計	5,952,255,095	-	5,952,402,542	147,447	6,424,038,394	-	6,424,036,545	1,849

(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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	2.5266円	2.9475円
(1万口当たり純資産額)	(25,266円)	(29,475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10月12日現在	平成29年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,622,897,664	5,391,428,122
コール・ローン		292,048,366	3,244,206,235
国債証券		248,004,631,992	237,143,112,216
派生商品評価勘定		3,962,181	2,198
未収利息		2,264,031,939	2,189,419,482
前払費用		79,137,813	40,157,895
流動資産合計		255,266,709,955	248,008,326,148
資産合計		255,266,709,955	248,008,326,148
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	31,273,949
未払金		-	3,452,631,848
未払解約金		663,989,000	151,853,000
流動負債合計		663,989,000	3,635,758,797
負債合計		663,989,000	3,635,758,797
純資産の部			
元本等			
元本	1	153,207,422,796	144,186,472,957
剰余金			
剰余金又は欠損金()		101,395,298,159	100,186,094,394
元本等合計		254,602,720,955	244,372,567,351
純資産合計		254,602,720,955	244,372,567,351
負債純資産合計		255,266,709,955	248,008,326,148

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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	160,412,378,404円	153,207,422,796円
同期中追加設定元本額	27,602,214,764円	13,011,716,187円
同期中一部解約元本額	34,807,170,372円	22,032,666,026円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・	4,923,309,794円	6,069,923,106円
ファンド		
M I T O ラップ型ファンド	17,010,648円	21,353,060円
（安定型）		
M I T O ラップ型ファンド	50,032,973円	56,513,169円
（中立型）		
M I T O ラップ型ファンド	71,577,949円	75,374,466円
（積極型）		
グローバル8資産ラップファン	40,389,489円	24,714,028円
ド（安定型）		
グローバル8資産ラップファン	43,876,816円	50,055,547円
ド（中立型）		
グローバル8資産ラップファン	34,916,201円	39,777,260円
ド（積極型）		
たわらノーロード 先進国債券	425,744,276円	607,419,983円
たわらノーロード 先進国債券	606,412円	606,412円
<ラップ向け>		
D I A M外国債券インデックス	4,782,952,941円	4,810,129,421円
ファンド< D C 年金 >		
D I A Mバランス・ファンド<	445,944,676円	456,064,854円
D C 年金 > 1 安定型		

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,429,659,466円	1,429,659,466円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,455,334,787円	1,509,994,281円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	353,883,541円	361,249,152円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	730,899,335円	745,371,868円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	531,495,396円	571,646,882円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	27,312,327円	27,592,039円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	581,807,796円	618,395,946円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	8,340,436円	10,665,669円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	12,331,966円	14,482,290円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	22,428,978円	25,792,292円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	39,976,566円	48,026,772円
クルーズコントロールDIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	2,024,754,282円	2,754,247,450円
DIAM DC バランス・F(成長型)	39,881,567円	48,132,959円
クルーズコントロール<DC年金>	51,403,963円	69,458,612円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	646,905円	953,804円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	13,148,246円	10,741,423円
ダイナミック・ナビゲーション	33,073,415円	33,548,728円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	333,384円	344,571円
DIAM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)	1,651,641,769円	1,541,959,665円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,895,832,420円	7,286,920,270円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	4,286,933,742円	4,718,935,346円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	4,756,637,427円	4,021,419,275円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	281,150,448円	446,669,864円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	-円	577,394,424円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	127,409,910円	114,196,296円
	1,449,457,258円	1,222,186,978円

D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	843,885,824円	781,013,785円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	89,083,952円	78,729,461円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	162,342,227円	145,656,401円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	41,481,518円	38,023,601円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	17,272,003円	13,175,853円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	4,610,042,461円	528,554,283円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	1,083,797,795円	238,745,413円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	4,830,307,899円	4,335,238,137円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	2,845,837,057円	2,739,755,417円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	4,634,610,481円	4,562,989,441円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	977,493,356円	891,264,247円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	3,036,652,050円	1,670,929,106円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	4,400,424,719円	4,132,301,722円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	16,488,444,970円	14,967,422,861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)	64,131,288円	43,088,324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)	2,401,530,036円	1,906,726,270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)	11,168,532,699円	11,186,558,463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)	16,608,296,167円	16,181,006,324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)	21,048,962,914円	20,601,612,263円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	27,742,137円	25,966,885円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	9,926,790円	401,766円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	1,425,740円	6,172,216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)	18,889,807,936円	18,427,921,765円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	128,259,731円	120,196,417円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	154,605,081円	140,706,418円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	237,762円	241,367円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	150,698円	157,123円
計	153,207,422,796円	144,186,472,957円
2 . 受益権の総数	153,207,422,796口	144,186,472,957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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年4月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	710,939,851	-	706,977,670	3,962,181	120,419,628	-	120,417,430	2,198
アメリカ・ドル	368,553,984	-	367,679,240	874,744	120,419,628	-	120,417,430	2,198
イギリス・ポンド	58,094,079	-	57,571,770	522,309	-	-	-	-
ユーロ	284,291,788	-	281,726,660	2,565,128	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	2,937,230,579	-	2,905,956,630	31,273,949
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,292,651,136	-	1,278,024,480	14,626,656
イギリス・ポンド	-	-	-	-	234,915,176	-	233,414,920	1,500,256
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	117,467,104	-	116,066,400	1,400,704
カナダ・ドル	-	-	-	-	58,731,010	-	58,012,020	718,990
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	117,613,849	-	115,556,430	2,057,419
ユーロ	-	-	-	-	1,115,852,304	-	1,104,882,380	10,969,924
合計	710,939,851	-	706,977,670	3,962,181	3,057,650,207	-	3,026,374,060	31,271,751

(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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.6618円	1.6948円
(1万口当たり純資産額)	(16,618円)	(16,948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10月12日現在	平成29年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		72,308,226	122,941,866
コール・ローン		72,617,518	51,234,388
投資信託受益証券		3,799,644,381	4,336,244,068
投資証券		29,332,846,273	34,545,895,147
派生商品評価勘定		-	28,129
未収入金		213,389	416,840,790
未収配当金		124,253,600	122,492,862
流動資産合計		33,401,883,387	39,595,677,250
資産合計		33,401,883,387	39,595,677,250
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		102,960	8,522
未払金		29,595,231	49,557,944
未払解約金		11,476,000	12,701,000
流動負債合計		41,174,191	62,267,466
負債合計		41,174,191	62,267,466
純資産の部			
元本等			
元本	1	32,289,268,109	34,322,169,827
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		1,071,441,087	5,211,239,957
元本等合計		33,360,709,196	39,533,409,784
純資産合計		33,360,709,196	39,533,409,784
負債純資産合計		33,401,883,387	39,595,677,250

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	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	26,841,967,994円	32,289,268,109円
同期中追加設定元本額	23,087,438,568円	15,371,630,587円
同期中一部解約元本額	17,640,138,453円	13,338,728,869円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM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)	90,931,487円	120,159,271円
DIAM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)	27,194,088円	41,954,692円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	10,655,424円	7,328,579円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	26,796,979円	19,507,638円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	58,355,776円	60,443,597円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,458,475円	8,577,864円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,584,286円	17,243,942円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	28,465,922円	31,648,133円
たわらノーロード 先進国リート	1,069,507,663円	1,159,343,658円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	52,479,179円	144,203,070円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	- 円	8,392,557円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,666,170円	25,524,107円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	550,156,660円	565,265,661円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	93,463,454円	71,175,282円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	18,933,972円	21,779,489円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	51,803,674円	58,082,446円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	113,496,055円	128,680,910円
投資のソムリエ	2,441,448,202円	4,337,019,306円
投資のソムリエ<DC年金>	66,691,954円	148,610,790円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	61,217,576円	73,397,750円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	8,663,431円	52,030,717円
ダイナミック・ナビゲーション	267,265円	252,875円

リスク抑制世界8資産バランス ファンド	- 円	504,990,385円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	- 円	364,348,556円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	- 円	601,502,904円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,447,767,054円	1,397,093,926円
D I A M外国リートインデック スファンド< D C年金>	6,888,886円	11,542,671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)	712,540,766円	632,341,255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)	138,086,616円	171,105,157円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A(適格機関投資家 向け)	4,638,206,163円	4,071,606,144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	34,702,295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)	12,805,943,579円	12,200,540,938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)	2,898,424,533円	2,148,923,294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)	4,183,723,745円	2,759,224,513円
P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	- 円	1,762,407,360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)	561,964,325円	561,218,095円
計	32,289,268,109円	34,322,169,827円
2 . 受益権の総数	32,289,268,109口	34,322,169,827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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年4月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	406,596,491	-	406,568,860	27,631
アメリカ・ドル	-	-	-	-	282,706,080	-	282,690,600	15,480
イギリス・ポンド	-	-	-	-	23,944,900	-	23,943,500	1,400
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	41,102,350	-	41,100,000	2,350
カナダ・ドル	-	-	-	-	6,985,155	-	6,984,450	705
シンガポール・ドル	-	-	-	-	15,533,442	-	15,533,940	498
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	2,819,955	-	2,819,770	185
ユーロ	-	-	-	-	22,083,852	-	22,083,700	152
香港・ドル	-	-	-	-	11,420,757	-	11,412,900	7,857
買 建	34,300,860	-	34,197,900	102,960	554,444	-	546,420	8,024
アメリカ・ドル	34,300,860	-	34,197,900	102,960	-	-	-	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	554,444	-	546,420	8,024
合計	34,300,860	-	34,197,900	102,960	407,150,935	-	407,115,280	19,607

(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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.0332円	1.1518円
(1万口当たり純資産額)	(10,332円)	(11,518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10月12日現在	平成29年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		29,194,253	3,762,348
コール・ローン		3,273,161	10,478,673
社債券		2,485,876,372	2,402,861,107
流動資産合計		2,518,343,786	2,417,102,128
資産合計		2,518,343,786	2,417,102,128
負債の部			
流動負債			
未払金		22,797,500	-
未払解約金		2,000,000	-
流動負債合計		24,797,500	-
負債合計		24,797,500	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,786,925,196	6,193,907,996
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	4,293,378,910	3,776,805,868
元本等合計		2,493,546,286	2,417,102,128
純資産合計		2,493,546,286	2,417,102,128
負債純資産合計		2,518,343,786	2,417,102,128

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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,928,968,096円	6,786,925,196円
同期中追加設定元本額	2,460,719,218円	1,321,998,526円
同期中一部解約元本額	602,762,118円	1,915,015,726円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A Mコモディティパッシブ・ファンド	6,227,100,392円	5,769,318,385円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	19,989,336円	22,698,923円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	58,983,541円	53,458,153円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	84,913,094円	71,630,110円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	47,644,368円	26,273,194円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	51,905,759円	47,393,107円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	41,282,537円	37,791,488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）	255,106,169円	165,344,636円
計	6,786,925,196円	6,193,907,996円
2. 受益権の総数	6,786,925,196口	6,193,907,996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4,293,378,910円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,776,805,868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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.3674円	0.3902円
(1万口当たり純資産額)	(3,674円)	(3,902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10月12日現在	平成29年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,065,962,937	360,732,518
コール・ローン		34,538,081	1,166,066,752
株式		35,920,091,690	38,939,036,147
投資信託受益証券		260,189,850	274,909,378
投資証券		98,681,275	86,755,646
派生商品評価勘定		15,045,065	10,567,347
未収入金		880,097	26,133,981
未収配当金		46,814,137	95,404,609
差入委託証拠金		311,085,929	481,521,075
流動資産合計		37,753,289,061	41,441,127,453
資産合計		37,753,289,061	41,441,127,453
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		699,052	16,753,084
未払金		792,710	6,673
未払解約金		436,732,000	207,578,750
流動負債合計		438,223,762	224,338,507
負債合計		438,223,762	224,338,507
純資産の部			
元本等			
元本	1	41,601,299,999	40,943,306,698
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	4,286,234,700	273,482,248
元本等合計		37,315,065,299	41,216,788,946
純資産合計		37,315,065,299	41,216,788,946
負債純資産合計		37,753,289,061	41,441,127,453

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>株式</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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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、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</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. 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>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,619,567,643円	41,601,299,999円
同期中追加設定元本額	18,703,237,598円	10,175,428,304円
同期中一部解約元本額	16,721,505,242円	10,833,421,605円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>	1,460,950,989円	1,885,685,118円
DIAM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)	116,851,142円	138,745,636円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	6,895,928円	8,967,201円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	20,266,691円	23,679,248円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	29,076,623円	31,629,335円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	16,465,885円	10,378,159円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,826,533円	20,973,753円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,181,088円	16,690,965円
たわらノーロード 新興国株式	659,631,630円	1,161,350,091円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	81,047,957円	398,197,946円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	539,443,143円	492,729,458円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	38,882,124円	40,319,646円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	104,443,992円	107,682,860円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	226,045,440円	240,364,059円
投資のソムリエ	1,547,904,861円	2,130,954,844円
クルーズコントロール	1,491,958,601円	1,838,719,680円
投資のソムリエ<DC年金>	42,390,510円	72,542,075円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	125,353,913円	134,489,753円
クルーズコントロール<DC年金>	476,753円	636,746円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	24,199,715円	17,901,347円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	60,932,800円	55,952,243円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,554,863円	30,515,163円
ダイナミック・ナビゲーション	1,866,081円	1,749,384円

	リスク抑制世界8資産バランス ファンド	- 円	299,410,402円
	ワールドアセットバランス(基 本コース)	- 円	607,540,370円
	ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	- 円	1,005,779,068円
	エマージング株式パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	7,078,939,545円	6,007,694,006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)	189,946,132円	- 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	2,135,654,775円
	DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	15,625,917,469円	13,451,539,795円
	DIAM世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	9,875,248,246円	8,574,833,572円
	計	41,601,299,999円	40,943,306,698円
2 .	受益権の総数	41,601,299,999口	40,943,306,698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4,286,234,700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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600	-	-	-	-
アメリカ・ドル	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	1,056,921,350	-	1,046,382,000	10,539,350
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,056,921,350	-	1,046,382,000	10,539,350
合計	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600	1,056,921,350	-	1,046,382,000	10,539,350

(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10月12日 現在				平成29年4月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	991,418,685	-	1,004,485,098	13,066,413	1,974,960,340	-	1,979,313,953	4,353,613
合計	991,418,685	-	1,004,485,098	13,066,413	1,974,960,340	-	1,979,313,953	4,353,613

(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10月12日現在	平成29年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.8970円	1.0067円
(1万口当たり純資産額)	(8,970円)	(10,067円)

2【ファンドの現況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

グローバル8資産ラップファンド（安定型）

平成29年4月28日現在

資産総額	376,843,475円
負債総額	218,735円
純資産総額（ - ）	376,624,740円
発行済数量	375,210,816口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0038円

グローバル8資産ラップファンド（中立型）

平成29年4月28日現在

資産総額	447,049,426円
負債総額	257,936円
純資産総額（ - ）	446,791,490円
発行済数量	452,034,225口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9884円

グローバル8資産ラップファンド（積極型）

平成29年4月28日現在

資産総額	333,880,300円
負債総額	190,348円
純資産総額（ - ）	333,689,952円
発行済数量	342,242,346口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9750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29年4月28日現在

資産総額	293,346,836,692円
負債総額	1,366,707,392円
純資産総額（ - ）	291,980,129,300円
発行済数量	127,622,533,092口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2878円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年4月28日現在

資産総額	373,594,844,525円
負債総額	3,056,601,000円
純資産総額（ - ）	370,538,243,525円
発行済数量	288,417,036,689口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2847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29年4月28日現在

資産総額	29,632,205,294円
負債総額	1,048,442,696円
純資産総額（ - ）	28,583,762,598円
発行済数量	16,469,304,587口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7356円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年4月28日現在

資産総額	278,736,365,592円
負債総額	2,861,310,167円
純資産総額（ - ）	275,875,055,425円
発行済数量	90,365,987,205口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0529円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年4月28日現在

資産総額	251,358,496,843円
負債総額	213,843,395円
純資産総額（ - ）	251,144,653,448円
発行済数量	144,155,427,910口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7422円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年4月28日現在

資産総額	41,845,437,330円
負債総額	1,383,148,165円
純資産総額（ - ）	40,462,289,165円
発行済数量	34,727,178,102口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1651円

コモディティインデックス・マザーファンド

平成29年4月28日現在

資産総額	2,662,041,909円
負債総額	4,500,000円
純資産総額（ - ）	2,657,541,909円
発行済数量	7,086,305,410口
1口当たり純資産額（ / ）	0.3750円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年4月28日現在

資産総額	43,676,782,720円
負債総額	73,185,283円
純資産総額（ - ）	43,603,597,437円
発行済数量	41,579,096,087口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0487円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第4 内国投資信託受益証券事務の概要」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) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

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（平成29年4月28日現在）

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成29年4月28日現在）

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。

取締役は株主総会で選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役（監査等委員である取締役を除く。）の補欠として選任された取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、現任取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

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>

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

平成29年4月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,069,987,719,281
追加型株式投資信託	874	11,800,003,846,051
単位型公社債投資信託	56	303,906,568,207
単位型株式投資信託	116	788,963,608,074
合計	1,084	13,962,861,741,613

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. 委託会社であるアセットマネジメントOne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32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29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。

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、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更いたしました。

委託会社の財務諸表に引き続き、D I A Mアセットマネジメント株式会社の第32期中間会計期間の中間財務諸表、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	-	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	1 29,219	1 1,243,812
車両運搬具	1 549	1 -
器具備品	1 184,683	1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	-	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	-	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	-	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	-
時効後支払損引当金	-	216,466
本社移転費用引当金	-	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
(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	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	-	17,124,479
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	24,580,000
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	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	-		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		-	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

（単位：千円）

	第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）		第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		-		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		-		2
雑収入	1	6,693	1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		-		31,945
投資信託償還損		-		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
時効成立後支払分配金・償還金		-		39
時効後支払損引当金繰入額		-		209,210
営業外費用計		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	2	-	2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		-
貸倒引当金戻入益		-		8,883
訴訟損失引当金戻入益		-		21,677
その他特別利益		-		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	3	624	3	23,600
固定資産売却損	4	2,653	4	10,323
投資有価証券評価損		-		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		-		30,000
本社移転費用	5	-	5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

(3) 【株主資本等変動計算書】

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				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
					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	-	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
当期変動額									
剰余金の配当									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
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
当期末残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
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	-	-			-
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)			98,949	98,949	98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	98,949	98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期(自平成28年4月1日至平成29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				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						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	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
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	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

重要な会計方針

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. 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。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、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。</p>
4. 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。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 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、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分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、退職一時金制度及び確定給付型企業年金制度（キャッシュバランスタイプ）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 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 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10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しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</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> <p>(5) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(6) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ42,532千円増加しております。

追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 「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）を当事業年度から適用しております。

2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
雑収入	4,715	8,183

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	-	16,052

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	543
器具備品	2,653	9,779

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	-	942,315
旧本社不動産賃借料	-	418,583
賃貸借契約解約損	-	150,723

(株主資本等変動計算書関係)

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) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29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	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

（注）普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

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28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成29年6月21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29年6月21日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種 類株式					

(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

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定してあります。

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っている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。当該デリバティブ取引は、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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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（為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されてあります。

有価証券及び投資有価証券は、主に其他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されてあります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(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

預金の預入先については、余資運用規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としています。

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

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り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) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	32,747,840	32,747,840	-
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	-
負債計	1,744,274	1,744,274	-

第32期（平成29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	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

(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) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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。

(5) 有価証券及び投資有価証券

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) 未払手数料

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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	77,696	337,468
関係会社株式	3,229,196	3,306,296

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、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」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。

(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) 現金・預金	12,951,736	-	-	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	-	-	-

第32期(平成29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) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円)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。

2. その他有価証券

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
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	-	-	-
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。

第32期(平成29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	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)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。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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)
株式	5,927	3,377	-

第32期(自平成28年4月1日 至平成29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)
投資信託	717,905	2	79,146

(注) 投資信託の「売却額」、「売却の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

(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確定給付企業年金制度(積立型制度であります)及び退職一時金制度(非積立型制度であります)を採用しております。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。

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度(複数事業主制度を含む)

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	51,531	144,062
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による増加	-	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	-	-
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の発生額	-	1,894
事業主からの拠出額	-	37,402
退職給付の支払額	-	28,876
合併による増加	-	1,336,984
年金資産の期末残高	-	1,363,437

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	1,275,346
年金資産	-	1,363,437
	-	88,090
非積立型制度の退職給付債務	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	79,449	430,203
未認識過去勤務費用	9,704	4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
前払年金費用	-	325,140
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
株式	-	31.5%
債券	-	29.0%
共同運用資産	-	24.1%
生命保険一般勘定	-	10.5%
現金及び預金	-	4.6%
合計	-	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02% ~ 1.09%
長期期待運用収益率	-	2.50%
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 8.73%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	-
退職給付費用	-	22,562
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	-	36,177
合併による増加	-	287,313
退職給付引当金の期末残高	-	300,927

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	789,261
年金資産	-	1,150,443
		361,181
非積立型制度の退職給付債務	-	60,254
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927
退職給付引当金	-	60,254
前払年金費用	-	361,181
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 - 千円 当事業年度22,562千円

4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

(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31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額(一括償却資産)	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額(税法上)	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	-
時効後支払損引当金	-	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	-	12,344
本社移転費用引当金	-	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	-
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
繰延税金負債		
前払年金費用	-	210,151
その他有価証券評価差額金	-	114,171
繰延税金負債合計	-	324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

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。

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM （存続会社）	MHAM （消滅会社）
合併比率（*）	1	0.0154

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成28年10月1日から平成29年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	- 千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん金額74,319,216千円及び顧客関連資産の金額50,434,199千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,483,082千円
経常利益	4,483,082千円
税引前当期純利益	4,483,082千円
当期純利益	3,693,863千円
1株当たり当期純利益	115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千円が含まれております。

(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、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

(1) サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

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

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

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) 子会社及び関連会社等

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 増資の引受	800,617	未払費用	308,974
	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	912,600	-	-
									473,948	未払費用	157,130

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 当社預り資産の運用の顧問料は、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	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	みずほ第 一ファイ 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 金融技術の 開発業務委 託	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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29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				
親会社 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	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	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	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信 託銀行株 式会社	東京都 中央区	2,473 億円	信託銀 行業	-	-	投資一任契 約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

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) 当社預り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) 業務委託料は、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4) 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。
- (注5) 運用受託報酬は、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6) 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せん。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	-	7,449,532
固定資産合計	-	124,292
流動負債合計	-	1,665,547
固定負債合計	-	114,110
純資産合計	-	5,794,167
営業収益	-	1,093,658
税引前当期純利益	-	5,546,153
当期純利益	-	3,891,816

(1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株主及び普通株主と同等の 株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の 株式に係る当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(-)	(7,734株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(参考)DIAMアセットマネジメント株式会社の経理状況

1. 委託会社であるDIAMアセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という。)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)、ならびに同規則第38条及び第57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. 中間財務諸表の金額は、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、第32期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

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。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,605,537
金銭の信託		11,792,364
前払費用		122,161
未収委託者報酬		4,755,701
未収運用受託報酬		2,465,934
未収投資助言報酬		261,221
未収収益		181,959
繰延税金資産		329,236
その他		122,804
	流動資産計	31,636,922
固定資産		
有形固定資産		1,541,889
建物	1	6,517
器具備品	1	152,176
建設仮勘定		1,383,196
無形固定資産		1,613,174
ソフトウェア		1,421,245
ソフトウェア仮勘定		184,656
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権		124
投資その他の資産		6,281,765
投資有価証券		441,519
関係会社株式		3,229,196
繰延税金資産		713,716
差入保証金		1,808,323
その他		89,010
	固定資産計	9,436,830
	資産合計	41,073,753

(単位:千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,080,224
未払金	2,651,649
未払償還金	49,873
未払手数料	1,865,871
その他未払金	735,905
未払費用	2,673,720
未払法人税等	907,554
未払消費税等	69,484
賞与引当金	724,711
訴訟損失引当金	30,000
その他	21,000
	流動負債計
	8,158,344
固定負債	
退職給付引当金	1,027,049
	固定負債計
	1,027,049
負債合計	9,185,394
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	27,317,845
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	24,580,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,114,551
	株主資本計
	31,746,323
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	142,035
	評価・換算差額等計
	142,035
純資産合計	31,888,358
負債・純資産合計	41,073,753

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	14,454,974	
運用受託報酬	3,732,759	
投資助言報酬	456,986	
その他営業収益	323,793	
	営業収益計	18,968,513
営業費用		
支払手数料	6,111,449	
広告宣伝費	108,789	
公告費	428	
調査費	3,764,163	
調査費	2,639,714	
委託調査費	1,124,449	
委託計算費	216,712	
営業雑経費	278,529	
通信費	17,844	
印刷費	212,004	
協会費	11,277	
諸会費	18	
支払販売手数料	37,384	
	営業費用計	10,480,072
一般管理費		
給料	2,330,263	
役員報酬	124,419	
給料・手当	2,205,843	
交際費	16,973	
寄付金	13,268	
旅費交通費	100,973	
租税公課	148,041	
不動産賃借料	1,329,821	
退職給付費用	121,590	
固定資産減価償却費	1 353,322	
福利厚生費	11,020	
修繕費	10,082	
賞与引当金繰入額	724,711	
役員退職慰労金	63,072	
機器リース料	146	
事務委託費	182,857	
事務用消耗品費	37,442	
器具備品費	236,524	
諸経費	58,359	
	一般管理費計	5,738,473
営業利益		2,749,968

（単位：千円）

	第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日至平成28年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	7,882	
受取利息	341	
為替差益	32,301	
雑収入	4,836	
	営業外収益計	45,361
営業外費用		
金銭の信託運用損	59,768	
	営業外費用計	59,768
経常利益		2,735,561
特別損失		
固定資産除却損	2,820	
固定資産売却損	1,780	
訴訟損失引当金繰入額	30,000	
	特別損失計	34,601
税引前中間純利益		2,700,960
法人税、住民税及び事業税		856,976
法人税等調整額		17,520
法人税等合計		839,455
中間純利益		1,861,504

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30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	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818
当中間期変動額									
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	-	-
中間純利益							1,861,504	1,861,504	1,861,504
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	3,232,495	682,495	682,495
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	24,580,000	300,000	200,000	2,114,551	27,317,845	31,746,323

	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	153,956	32,582,775
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		1,861,504
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	11,921	11,921
当中間期変動額 合計	11,921	694,416
当中間期末残高	142,035	31,888,358

重要な会計方針

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間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
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引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	(1)有形固定資産：定率法 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、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）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、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。 (2)賞与引当金：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。 (3)退職給付引当金：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、当中間会計期間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中間会計期間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、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 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 (4)訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる額を計上しております。
6. 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、中間決算日の直物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。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

<p>第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)</p>
<p>法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。</p>

追加情報

<p>第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)</p>
<p>1. 「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)を当中間会計期間から適用しております。</p> <p>2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。 これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)		
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	790,504千円
	器具備品	...	596,199千円

(中間損益計算書関係)

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
1. 減価償却実施額	有形固定資産	...	57,752千円
	無形固定資産	...	295,570千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30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）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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

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28年6月29日 定時株主総会	普通株式	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）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、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）。

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
（1）現金・預金	11,605,537	11,605,537	-
（2）金銭の信託	11,792,364	11,792,364	-
（3）投資有価証券 その他有価証券	363,823	363,823	-
資産計	23,761,725	23,761,725	-
（1）未払法人税等	907,554	907,554	-
負債計	907,554	907,554	-

（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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	77,696
関係会社株式	3,229,196
差入保証金	1,808,323

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、時価開示の対象としておりません。

差入保証金は、本社オフィス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、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)			
1. 満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2. 子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式(中間貸借対照表計上額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。			
3. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	349,644	146,101	203,542
債券	-	-	-
その他(投資信託)	14,179	13,000	1,179
小計	363,823	159,101	204,721
中間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	363,823	159,101	204,721
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額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。			

(金銭の信託関係)

第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
1. 満期保有目的の金銭の信託 該当事項はありません。	
2. その他の金銭の信託(運用目的及び満期保有目的以外) 該当事項はありません。	

(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)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

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

(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	14,454,974	4,189,745	323,793	18,968,513

(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中間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中間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

顧客の名称又は氏名	営業収益 (千円)
第一生命グループ	1,928,739

(注) 第一生命グループには、第一生命保険株式会社及び第一フロンティア生命保険株式会社が含まれております。

(1株当たり情報)

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,328,681円	62銭
1株当たり中間純利益金額	77,562円	67銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

(注) 1株当たり中間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32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
中間純利益	1,861,504千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,861,504千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第32期中間会計期間
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

当社（以下「DIAM」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAM、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1．結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2．企業結合日

平成28年10月1日

3．企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5．交付した株式数

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）に対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないA種種類株式15,510株を交付しました。

6．企業結合の主な目的

当社は、みずほフィナンシャルグループ及び第一生命保険株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、みずほフィナンシャルグループと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

7．取得企業を決定するに至った主な根拠

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるみずほフィナンシャルグループが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

8．実施予定の会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3．企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理することをそれぞれ予定しております。

(参考)みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「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条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53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により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

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	江見 睦生 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子 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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第53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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成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、当社が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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、みずほ投信投資顧問株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

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。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1)貸借対照表

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	1,092	1,185
流動資産合計	25,070,606	25,493,940
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	124,850	100,000
工具、器具及び備品（純額）	71,443	90,655
リース資産（純額）	2,140	818
有形固定資産合計	1 198,434	1 191,474
無形固定資産		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
無形固定資産合計	12,812	12,782
投資その他の資産		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	19,534	19,404
投資その他の資産合計	4,691,245	3,955,916
固定資産合計	4,902,492	4,160,172
資産合計	29,973,099	29,654,112
負債の部		
流動負債		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
未払金		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
未払金合計	912,009	851,826
未払費用	2,038,097	1,896,033
未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
流動負債合計	4,183,052	3,895,216
固定負債		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
固定負債合計	428,109	194,716
負債合計	4,611,161	4,089,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600

資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	<u>4,716,474</u>	<u>4,716,474</u>
利益剰余金		
利益準備金	128,584	128,584
その他利益剰余金		
配当準備積立金	104,600	104,600
退職慰労積立金	100,000	100,000
別途積立金	9,800,000	9,800,000
繰越利益剰余金	7,739,742	8,908,993
利益剰余金合計	<u>17,872,927</u>	<u>19,042,177</u>
自己株式	-	377,863
株主資本合計	<u>24,635,002</u>	<u>25,426,389</u>
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	726,935	137,791
評価・換算差額等合計	<u>726,935</u>	<u>137,791</u>
純資産合計	<u>25,361,937</u>	<u>25,564,180</u>
負債純資産合計	<u>29,973,099</u>	<u>29,654,112</u>

(2)損益計算書

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (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	17,538,139	17,358,667
運用受託報酬	4,463,429	5,050,661
営業収益合計	22,001,569	22,409,329
営業費用		
支払手数料	8,480,510	7,999,728
広告宣伝費	247,790	205,521
公告費	1,140	152
調査費		
調査費	1,259,067	1,312,466
委託調査費	4,883,037	5,299,598
図書費	4,308	3,703
調査費合計	6,146,412	6,615,769
委託計算費	101,919	116,405
営業雑経費		
通信費	59,454	46,151
印刷費	128,143	246
協会費	18,777	20,221
諸会費	2,540	2,317
その他	855,319	958,635
営業雑経費合計	1,064,234	1,027,572
営業費用合計	16,042,008	15,965,148
一般管理費		
給料		
役員報酬	142,983	143,812
給料手当	1,832,723	1,905,880
賞与	295,180	304,122
給料合計	2,270,886	2,353,814
交際費	775	775
寄付金	-	221
旅費交通費	91,851	87,228
租税公課	51,783	76,075
不動産賃借料	339,964	305,351
退職給付費用	126,451	119,608
福利厚生費	368,622	370,689
貸倒引当金繰入	-	93
賞与引当金繰入	319,122	301,698
役員退職慰労引当金繰入	27,249	47,768
固定資産減価償却費	31,216	44,257
諸経費	358,817	269,502
一般管理費合計	3,986,740	3,977,085
営業利益	1,972,819	2,467,095
営業外収益		
受取配当金	7,027	4,242
受取利息	7,340	7,633
有価証券解約益	953	50,674
有価証券償還益	-	56,303
時効到来償還金等	21,856	1,962
時効後支払損引当金戻入額	-	1,311
雑収入	51,171	20,993
営業外収益合計	88,349	143,121
営業外費用		
有価証券解約損	-	278
有価証券償還損	2,197	2,641
ヘッジ会計に係る損失	2,240	-
時効後支払損引当金繰入額	17,685	-
雑損失	63,198	6,767

営業外費用合計		85,321	9,688
経常利益		1,975,847	2,600,528
特別利益			
投資有価証券売却益		10,500	-
特別利益合計		10,500	-
特別損失			
減損損失	1	51,292	-
事業再構築費用	2	125,173	-
外国税負担損失	3	53,547	-
貸倒引当金繰入		19,534	-
特別損失合計		249,548	-
税引前当期純利益		1,736,799	2,600,528
法人税、住民税及び事業税		616,760	839,827
法人税等調整額		16,247	40,166
法人税等合計		633,008	879,993
当期純利益		1,103,790	1,720,534

(3)株主資本等変動計算書

前事業年度(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		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本						株主資本 合計
	利益 準備金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		その他利益剰余金					
	配当準備 積立金	退職慰労 積立金	別途 積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	6,988,395	17,121,579	23,883,654
当期変動額							
剰余金の配当					352,443	352,443	352,443
当期純利益					1,103,790	1,103,790	1,103,790
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)							
当期変動額合計					751,347	751,347	751,347
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	24,635,002

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	41,248	41,248	23,842,406
当期変動額			
剰余金の配当			352,443
当期純利益			1,103,790
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	768,183	768,183	768,183
当期変動額合計	768,183	768,183	1,519,530
当期末残高	726,935	726,935	25,361,937

当事業年度(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		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本							
	利益剰余金						自己株式	株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計		
		配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	-	24,635,002
当期変動額								
剰余金の配当					551,284	551,284		551,284
当期純利益					1,720,534	1,720,534		1,720,534
自己株式の取得							377,863	377,863
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計					1,169,250	1,169,250	377,863	791,386
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177	377,863	25,426,389

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	726,935	726,935	25,361,937
当期変動額			
剰余金の配当			551,284
当期純利益			1,720,534
自己株式の取得			377,863
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	589,143	589,143	589,143
当期変動額合計	589,143	589,143	202,242
当期末残高	137,791	137,791	25,564,180

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法（ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権について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。

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、決算日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。

(4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）

(5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物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. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

「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

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

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、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

当社は、「追加情報」に記載のとおり、当社、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行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認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積りの変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ27,598千円減少しております。

追加情報

DIAMアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 西 恵正）、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）間での平成27年9月30日付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 DIAM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）

前事業年度 （平成27年3月31日）		当事業年度 （平成28年3月31日）	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1	有形固定資産の減価償却累計額
	建物 111,156千円		建物 136,006千円
	工具、器具及び備品 277,249千円		工具、器具及び備品 226,657千円
	リース資産 16,185千円		リース資産 17,508千円

(損益計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額(千円)
本社(東京都港区)	除却対象資産	建物	23,139
本社(東京都港区)	除却対象資産	工具器具備品	4,253
本社(東京都港区)	除却対象資産	原状回復費用	23,900

レイアウト変更により現行オフィス内部造作等の除却が決定した資産につき、「除却対象資産」としてグルーピングを行い、平成27年3月31日時点の帳簿価額および原状回復費用を減損損失(51,292千円)として特別損失に計上しました。

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

該当するものはありません。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

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(円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発効日
平成26年6月11日 第51回定時株主総会	普通株式	352,443,450	335	平成26年3月31日	平成26年6月12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	配当金の総額(円)	配当の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	利益剰余金	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

2 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	-	13,662	-	13,662

(変動事由の概要)

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

3. 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 (円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発効日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

リース資産の内容

有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

(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

当社は、投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を半期ごとに把握する体制としております。

有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスクの管理

有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的な時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,801,864	20,801,864	-
(2) 未収委託者報酬	1,827,951	1,827,951	-
(3) 未収運用受託報酬	1,812,198	1,812,198	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	4,054,289	4,054,289	-
資産計	28,496,304	28,496,304	-
(1) 未払手数料	819,341	819,341	-
負債計	819,341	819,341	-
デリバティブ取引（1）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(3,601)	(3,601)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	327	327	-
デリバティブ取引計	(3,274)	(3,274)	-

（1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,903,257	20,903,257	-
(2) 未収委託者報酬	2,183,032	2,183,032	-
(3) 未収運用受託報酬	1,713,643	1,713,643	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,282,026	3,282,026	-
資産計	28,081,960	28,081,960	-
(1) 未払手数料	838,064	838,064	-
負債計	838,064	838,064	-
デリバティブ取引（1）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(220)	(220)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1,564)	(1,564)	-
デリバティブ取引計	(1,784)	(1,784)	-

（1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

負 債

(1) 未払手数料

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

(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の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	60,720	60,720

上記については、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ため、「(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(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

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,800,853	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,827,951	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,812,198	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	127,840	-	-	-	-	3,300,657
合計	24,568,844	-	-	-	-	3,300,657

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,902,546	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	2,183,032	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,713,643	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	82,540	-	-	-	-	2,395,185
合計	24,881,762	-	-	-	-	2,395,185

(有価証券関係)

1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	3,740,183	2,664,442	1,075,740
小計	3,740,183	2,664,442	1,075,740
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	314,105	316,720	2,615
小計	314,105	316,720	2,615
合計	4,054,289	2,981,163	1,073,125

当事業年度(平成28年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	2,698,875	2,500,000	198,875
小計	2,698,875	2,500,000	198,875
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	583,151	583,423	271
小計	583,151	583,423	271
合計	3,282,026	3,083,423	198,603

2 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものではありません。

3 当事業年度中に解約・償還したその他有価証券
前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	102,729	953	2,197
合計	102,729	953	2,197

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	738,178	106,977	2,920
合計	738,178	106,977	2,920

(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
株式関連
前事業年度(平成27年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	197,054	-	3,601	3,601
	合計	197,054	-	3,601	3,601

当事業年度(平成28年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	148,005	-	220	220
	合計	148,005	-	220	220

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

前事業年度(平成27年3月31日)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	131,145	-	3,325
	買建	投資有価証券	277,953	-	3,652
合計			409,098	-	327

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度(平成28年3月31日)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	117,467	-	147
	買建	投資有価証券	179,836	-	1,711
合計			297,303	-	1,564

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

(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、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。

当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	357,258千円	331,766千円
退職給付費用	150,018	51,208
退職給付の支払額	21,349	-
制度への拠出額	103,177	66,102
退職給付引当金の期末残高	331,766	346,659

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	669,318千円	727,842千円
年金資産	1,001,084	1,074,502
貸借対照表に計上された前払年金費用	331,766	346,659

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度58,362千円 当事業年度51,208千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

(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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
有価証券償却超過額	4,795千円	4,551千円
ソフトウェア償却超過額	69,263	52,651
賞与引当金損金算入限度超過額	108,734	98,134
社会保険料損金不算入額	15,665	14,233
役員退職慰労引当金	34,461	45,488
未払事業税	30,421	39,817
その他	93,137	58,782
繰延税金資産小計	356,479	313,659
評価性引当額	24,103	22,331
繰延税金資産合計	332,375	291,328
繰延税金負債		
前払年金費用	107,027	106,147
その他有価証券評価差額金	346,190	60,812
繰延税金負債合計	453,218	166,959
繰延税金資産の純額	120,843	124,368

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」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年4月1日から平成30年3月31日までのものは30.86%、平成30年4月1日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。

その結果、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）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

(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)

[セグメント情報]

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）及び当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	2,629,803	資産運用業

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	3,061,207	資産運用業

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,833,692	未払手数料	361,219
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	13,851,610	未収委託者報酬	1,661,682

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,542,264	未払手数料	336,556
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473億円	信託銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	14,108,529	未収委託者報酬	2,053,638

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (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	24,106.70円	24,618.62円
1株当たり当期純利益金額	1,049.16円	1,639.16円

(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、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

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。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
普通株式に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
期中平均株式数(株)	1,052,070	1,049,643

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位: 千円)

第54期中間会計期間
(平成28年9月30日)

資産の部	
流動資産	
現金及び預金	4,120,018
未収委託者報酬	2,064,997
未収運用受託報酬	1,959,028
繰延税金資産	140,728
その他	398,383
貸倒引当金	1,207
流動資産合計	8,681,950
固定資産	
有形固定資産	
工具、器具及び備品(純額)	62,971
有形固定資産合計	1 62,971
無形固定資産	
投資その他の資産	12,767
投資有価証券	815,525
繰延税金資産	73,719
その他	638,830
貸倒引当金	19,404
投資その他の資産合計	1,508,671
固定資産合計	1,584,410
資産合計	10,266,360
負債の部	
流動負債	
未払金	793,859
未払費用	1,675,771
未払法人税等	253,697
賞与引当金	319,200
その他	221,869
流動負債合計	3,264,398
固定負債	
役員退職慰労引当金	57,860
時効後支払損引当金	7,256
固定負債合計	65,116
負債合計	3,329,515
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,045,600
資本剰余金	
資本準備金	2,266,400
その他資本剰余金	1,103,259
資本剰余金合計	3,369,659
利益剰余金	
利益準備金	128,584
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	1,777,567
利益剰余金合計	1,906,152
自己株式	377,863
株主資本合計	6,943,548
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	6,703
評価・換算差額等合計	6,703
純資産合計	6,936,845
負債純資産合計	10,266,360

(2) 中間損益計算書

(単位: 千円)

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		7,935,613
運用受託報酬		2,105,866
営業収益合計		10,041,479
営業費用及び一般管理費	1	9,415,997
営業利益		625,482
営業外収益		
受取配当金		19,694
受取利息		439
有価証券解約益		76,483
有価証券償還益		3,474
時効到来償還金等		727
雑収入		17,708
営業外収益合計		118,528
営業外費用		
有価証券解約損		96
有価証券償還損		12
雑損失		6,303
営業外費用合計		6,412
経常利益		737,598
特別利益		700
特別損失		11,641
税引前中間純利益		726,657
法人税、住民税及び事業税		236,054
法人税等調整額		26,308
法人税等合計		209,746
中間純利益		516,910

(3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位： 千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当中間期変動額				
積立金取崩				
剰余金の配当			1,346,815	1,346,815
中間純利益				
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）				
当中間期変動額合計			1,346,815	1,346,815
当中間期末残高	2,045,600	2,266,400	1,103,259	3,369,659

	株主資本					
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計
		その他利益剰余金				
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177
当中間期変動額						
積立金取崩		104,600	100,000	9,800,000	10,004,600	-
剰余金の配当					17,652,936	17,652,936
中間純利益					516,910	516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計		104,600	100,000	9,800,000	7,131,425	17,136,025
当中間期末残高	128,584	-	-	-	1,777,567	1,906,152

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	自己株式	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額 等合計	
当期首残高	377,863	25,426,389	137,791	137,791	25,564,180
当中間期変動額					
積立金取崩		-			-
剰余金の配当		18,999,751			18,999,751
中間純利益		516,910			516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			144,494	144,494	144,494
当中間期変動額合計		18,482,840	144,494	144,494	18,627,334
当中間期末残高	377,863	6,943,548	6,703	6,703	6,936,845

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

中間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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権について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。

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、中間決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、中間決算日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。

(4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

(5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物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。

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

追加情報

「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）を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

	第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	476,786千円

（中間損益計算書関係）

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
1 減価償却実施額	有形固定資産	114,327千円
	無形固定資産	15千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

2 . 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	13,662	-	-	13,662

3 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 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

（金融商品関係）

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

（単位： 千円）

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	4,120,018	4,120,018	-
(2) 未収委託者報酬	2,064,997	2,064,997	-
(3) 未収運用受託報酬	1,959,028	1,959,028	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	754,805	754,805	-
資産計	8,898,851	8,898,851	-
(1) 未払手数料	785,089	785,089	-
負債計	785,089	785,089	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。
また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負債

(1) 未払手数料

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の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	60,720

上記については、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ため、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

1 其他有価証券

種類	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
証券投資信託	151,830	150,000	1,830
小計	151,830	150,000	1,830
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
証券投資信託	602,975	614,467	11,491
小計	602,975	614,467	11,491
合計	754,805	764,467	9,661

(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)

[セグメント情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

3 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益(千円)	関連するセグメント名
適格機関投資家A	1,177,474	資産運用業

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1株当たり純資産額	6,680.26円

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1株当たり中間純利益金額	497.79円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	516,910
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	516,910
普通株式の期中平均株式数(株)	1,038,408

(注)潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(重要な後発事象)

当社(以下「MHAM」という)は、平成28年7月13日付で締結した、MHAM、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

（参考）新光投信株式会社の経理状況

1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」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。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第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。

当社の中間財務諸表は、「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条および第57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。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第57期事業年度（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社
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 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛
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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56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、新光投信株式会社の平成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

- () 1. 上記は、当社が、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。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	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」に掲げられている新光投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、新光投信株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、新光投信株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社と統合した。

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。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160
有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
流動資産合計	20,404,659	21,767,367
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 12,687	2 0
構築物（純額）	2 1,444	2 0
器具・備品（純額）	2 86,688	2 44,868
有形固定資産合計	100,820	44,868
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
無形固定資産合計	86,278	57,152
投資その他の資産		
投資有価証券	5,101,854	2,858,652
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,246	23,339
長期繰延税金資産	-	29,604
前払年金費用	396,211	378,381
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	5,706,044	3,373,710
固定資産合計	5,893,143	3,475,731
資産合計	26,297,802	25,243,098

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
未払金		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	1 1,558,682	1 1,360,372
その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
固定負債		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
純資産の部		
株主資本		
資本金	4,524,300	4,524,300
資本剰余金		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		
利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744

評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(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		35,876,795		39,283,623
運用受託報酬		238,412		232,145
営業収益合計		36,115,207		39,515,769
営業費用				
支払手数料	1	18,252,669	1	19,472,734
広告宣伝費		456,430		507,020
公告費		548		469
調査費				
調査費		623,792		841,825
委託調査費		5,966,340		7,419,125
図書費		5,254		4,879
調査費合計		6,595,388		8,265,830
委託計算費		1,352,318		1,711,366
営業雑経費				
通信費		32,335		30,454
印刷費		103,093		1,022
協会費		18,150		19,367
諸会費		3,300		3,117
その他		41,594		44,518
営業雑経費合計		198,475		98,480
営業費用合計		26,855,830		30,055,901
一般管理費				
給料				
役員報酬		96,445		91,205
給料・手当		1,368,552		1,480,875
賞与		336,076		428,776
給料合計		1,801,073		2,000,857
交際費		11,426		10,708
寄付金		3,198		2,346
旅費交通費		100,386		109,240
租税公課		68,508		90,795
不動産賃借料		206,753		205,671
賞与引当金繰入		451,000		547,750
役員賞与引当金繰入		66,000		22,000
役員退職慰労引当金繰入		24,930		22,210
退職給付費用		191,900		169,238
減価償却費		70,676		102,532

諸経費	573,824	647,510
一般管理費合計	3,569,678	3,930,859
営業利益	5,689,698	5,529,008

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (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	163,006	65,772
有価証券利息	3,853	3,333
受取利息	10,741	10,751
時効成立分配金・償還金	5,080	923
受取保険金	-	10,300
雑益	487	2,845
営業外収益合計	183,170	93,926
営業外費用		
支払利息	26	3
時効成立後支払分配金・償還金	3,083	5,532
雑損	3,261	556
営業外費用合計	6,371	6,092
経常利益	5,866,496	5,616,842
特別利益		
投資有価証券売却益	68,179	225,965
外国税支払損失引当金戻入益	-	43,200
特別利益合計	68,179	269,166
特別損失		
固定資産除却損	3,177	13,017
投資有価証券売却損	54,613	60,150
投資有価証券評価損	10,952	62,800
外国税支払損失引当金繰入額	184,111	-
訴訟損失引当金繰入額	30,000	10,000
合併関連費用	2	2
その他特別損失	22,227	-
特別損失合計	305,082	310,625
税引前当期純利益	5,629,593	5,575,383
法人税、住民税及び事業税	2,111,379	1,832,729
法人税等調整額	66,999	19,773
法人税等合計	2,044,380	1,852,503
当期純利益	3,585,212	3,722,880

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（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	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165
会計方針の変更による累積的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当期変動額					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自 己 株 式	株 主 資 本 合 計	その他有価証 券評価差額金	
	利 益 剰余金 合 計				
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による累積的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

当事業年度（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	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金 別途積立金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益						
自己株式の消却			72,415	72,415		
利益剰余金から 資本剰余金への振替			72,415	72,415		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-
当期末残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000

	株主資本				評価・換算 差額等	純資産合計
	利益剰余金		自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
当期首残高	3,981,245	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当期変動額						
剰余金の配当	3,446,341	3,446,341		3,446,341		3,446,341
当期純利益	3,722,880	3,722,880		3,722,880		3,722,880
自己株式の消却			72,415	-		-
利益剰余金から資本剰余金への振替	72,415	72,415		-		-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				-	187,941	187,941
当期変動額合計	204,122	204,122	72,415	276,538	187,941	88,597
当期末残高	4,185,368	13,445,861	-	20,731,861	94,744	20,826,605

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 関連会社株式

総平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、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り償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(3) 外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

(4) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(5) 退職給付引当金

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及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

過去勤務費用は、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

（6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（7）執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4．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、決算日の直物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。

5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（未適用の会計基準）

「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

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

（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。

（追加情報）

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付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日に、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 DIAM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．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払手数料	777,631千円	570,839千円

2．資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	573,602千円	657,201千円

（損益計算書関係）

1．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
支払手数料	9,189,399千円	8,452,937千円

2．特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
固定資産・敷金の償却	-千円	140,257千円
その他	-千円	24,400千円
合計	-千円	164,657千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	-	1,823,250

2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	-	9,386

3．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12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	9,386	1,813,864

(変動事由の概要)

自己株式の消却

2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	9,386	-

(変動事由の概要)

自己株式の消却

3．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11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17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

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行ってまいります。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上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ることがあります。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、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

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）。

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	14,861,160	14,861,160	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,159,600	6,159,600	-
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	2,884,368	-

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

(3) 未収委託者報酬

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（単位：千円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	276,151	276,151

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(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

前事業年度(平成27年3月31日)

	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	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

当事業年度(平成28年3月31日)

	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	14,861,112	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	-	-	-

(有価証券関係)

1. 関連会社株式

関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円)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。

2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)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。

当事業年度（平成28年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,119,150	869,274	249,875
	小計	1,119,150	869,274	249,875
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,040,450	5,153,936	113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	113,485
合計		6,159,600	6,023,210	136,389

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）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。

3．売却したその他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	503,565	68,179	54,613
合計	503,565	68,179	54,613

当事業年度(平成28年3月31日)

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	2,209,763	225,965	60,150
合計	2,209,763	225,965	60,150

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について62,800千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

(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、確定給付企業年金制度(キャッシュバランス型)、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

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

(単位:千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(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	1,424,739	1,348,083
会計方針の変更による累積的影響額	71,902	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,352,836	1,348,083
勤務費用	90,967	91,804
利息費用	9,476	6,074
数理計算上の差異の発生額	31,927	53,747
退職給付の支払額	73,269	60,817
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,348,083	1,438,892

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
年金資産の期首残高	1,157,054	1,329,170
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の発生額	108,961	128,633
事業主からの拠出額	78,464	77,164
退職給付の支払額	38,450	28,253
年金資産の期末残高	1,329,170	1,282,678

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成27年3月31日)	(平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,111,797	1,185,792
年金資産	1,329,170	1,282,678
	217,373	96,885
非積立型制度の退職給付債務	236,285	253,099
未積立退職給付債務	18,912	156,213
未認識数理計算上の差異	270,020	387,977
未認識過去勤務費用	10,703	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764
退職給付引当金	155,806	146,617
前払年金費用	396,211	378,381
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用(注1)	119,135	124,139
利息費用	9,476	6,074
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の費用処理額	85,138	64,424
過去勤務費用の費用処理額	16,055	10,703
確定給付制度に係る退職給付費用	174,553	150,705

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額(前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円)については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

(5)年金資産に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%
現金及び預金	1.4%	3.2%
合計	100%	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)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

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
割引率	0.0720% ~ 1.625%	0.0120% ~ 0.8060%
長期期待運用収益率	2.0%	2.5%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

（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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	170,920千円	182,614千円
減価償却超過額	896	25,871
退職給付引当金	70,882	71,201
役員退職慰労引当金	12,688	14,799
投資有価証券評価損	15,033	19,229
非上場株式評価損	25,733	24,425
未払事業税	90,342	57,445
外国税支払損失引当金	60,867	-
訴訟損失引当金	9,918	12,344
その他	87,621	120,305
繰延税金資産小計	544,905	528,236
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	544,905	528,236
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	134,624	56,708
前払年金費用	127,817	115,860
繰延税金負債合計	262,442	172,568
繰延税金資産の純額	282,463	355,668

（注）繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産 - 繰延税金資産	372,215千円	326,063千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	-	29,604
固定負債 - 長期繰延税金負債	89,752	-

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29日に成立し、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等の引下げが行われることとなりました。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32.26%から、平成28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等については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等については30.62%となります。

その結果、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）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

(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)

セグメント情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

関連当事者情報

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る)等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	9,189,399	未払手数料	777,631

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.98 間接 7.73	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,452,937	未払手数料	570,839

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	16,314
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	96,300	その他未払金	8,725
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,163	その他未払金	1,728

(注) 1. 上記(ア)~(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （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	11,433円05銭	11,481円90銭
1株当たり当期純利益金額	1,976円56銭	2,052円45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、潜在株式が存在しないため記載していません。

（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。

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	3,585,212	3,722,880
期中平均株式数（千株）	1,813	1,813

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	7,314,360
有価証券	101,520
未収委託者報酬	3,004,856
未収運用受託報酬	74,687
繰延税金資産	281,201
その他	334,195
流動資産合計	11,110,820
固定資産	
有形固定資産	
器具・備品(純額)	31,241
建設仮勘定	3,819
有形固定資産合計	35,061
無形固定資産	
ソフトウェア	52,424
ソフトウェア仮勘定	20,936
その他	91
無形固定資産合計	73,452
投資その他の資産	
投資有価証券	2,589,863
長期繰延税金資産	22,056
前払年金費用	352,195
その他	29,332
投資その他の資産合計	2,993,448
固定資産合計	3,101,961
資産合計	14,212,782

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	
未払収益分配金	153
未払償還金	4,216
未払手数料	1,406,798
その他未払金	284,198
未払金合計	1,695,367
未払費用	801,111
未払法人税等	850,492
未払消費税等	2 113,638
賞与引当金	382,000
訴訟損失引当金	70,000
流動負債合計	3,912,609
固定負債	
退職給付引当金	160,185
固定負債合計	160,185
負債合計	4,072,794
純資産の部	
株主資本	
資本金	4,524,300
資本剰余金	
資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	2,473,372
利益剰余金合計	2,833,866
株主資本合計	10,119,866
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	20,122
評価・換算差額等合計	20,122
純資産合計	10,139,988
負債純資産合計	14,212,782

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		19,468,460
運用受託報酬		95,090
営業収益合計		19,563,551
営業費用及び一般管理費	1	16,721,767
営業利益		2,841,783
営業外収益		
受取配当金		32,758
有価証券利息		522
受取利息		2,296
時効成立分配金・償還金		10
その他		531
営業外収益合計		36,119
営業外費用		
その他		34
営業外費用合計		34
経常利益		2,877,868
特別利益		
固定資産売却益		1,354
投資有価証券売却益		9,179
特別利益合計		10,533
特別損失		
固定資産売却損		3,996
投資有価証券評価損		58,055
固定資産除却損		50
訴訟損失引当金繰入額		30,000
合併関連費用		11,926
特別損失合計		104,028
税引前中間純利益		2,784,373
法人税、住民税及び事業税		795,495
法人税等調整額		85,212
法人税等合計		880,707
中間純利益		1,903,666

(3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別途 積立金	繰越 利益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	4,185,368
当中間期変動額					
別途積立金取崩				8,900,000	8,900,000
剰余金の配当					12,515,661
中間純利益					1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	8,900,000	1,711,995
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	-	2,473,372

	株主資本		評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	株主 資本 合計	その他有価証 券評価差額金	
	利益 剰余金 合計			
当期首残高	13,445,861	20,731,861	94,744	20,826,605
当中間期変動額				
別途積立金取崩	-	-		-
剰余金の配当	12,515,661	12,515,661		12,515,661
中間純利益	1,903,666	1,903,666		1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			74,622	74,622
当中間期変動額合計	10,611,995	10,611,995	74,622	10,686,617
当中間期末残高	2,833,866	10,119,866	20,122	10,139,988

[注記事項]

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、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り償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

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及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日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。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間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

過去勤務費用については、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、そ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（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

(中間貸借対照表関係)

1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	498,091千円

2. 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
有形固定資産	9,695千円
無形固定資産	9,425千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,813,864	-	-	1,813,864

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28年6月15日 取締役会	普通 株式	12,515,661	6,900	平成28年7月5日	平成28年7月27日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの該当事項はありません。

（金融商品関係）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、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）。

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金及び預金	7,314,360	7,314,360	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,415,231	2,415,231	-
(3) 未収委託者報酬	3,004,856	3,004,856	-
(4) 未払手数料	1,406,798	1,406,798	-

（注）1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬

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。

(4) 未払手数料

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

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 77,100千円）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。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	921,189	730,244	190,944
	小計	921,189	730,244	190,944
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,494,041	1,656,021	161,979
	小計	1,494,041	1,656,021	161,979
	合計	2,415,231	2,386,265	28,965

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額199,051千円)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。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	5,590円26銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	10,139,988
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	10,139,988
普通株式の発行済株式数(株)	1,813,864
普通株式の自己株式数(株)	-
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	1,049円50銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株式の期中平均株式数(株)	1,813,864

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載していません。

（追加情報）

役員賞与引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全取締役及び全監査役に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において74,853千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

執行役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月14日開催の取締役会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全執行役員に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において101,916千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

繰延税金資産

「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)を当中間会計期間から適用しております。

(重要な後発事象)

当社(以下「新光投信」という)は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及びみずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

4【利害関係人との取引制限】

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 4 利害関係人との取引制限」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、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

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
めぶき証券株式会社	3,000	「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。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年5月31日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル8資産ラップファンド（安定型）の平成28年10月13日から平成29年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル8資産ラップファンド（安定型）の平成29年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年10月13日から平成29年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成29年5月31日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 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」に掲げられているグローバル8資産ラップファンド（中立型）の平成28年10月13日から平成29年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル8資産ラップファンド（中立型）の平成29年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年10月13日から平成29年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

XBR 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29年5月31日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル8資産ラップファンド（積極型）の平成28年10月13日から平成29年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル8資産ラップファンド（積極型）の平成29年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年10月13日から平成29年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年6月7日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32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、アセットマネジメントOne株式会社の平成29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。

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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。