

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年10月17日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 西 恵正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	国内金先物価格連動型上場投信
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成28年10月1日から平成29年4月17日まで) 3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年 9月15日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項について、半期報告書の提出等に伴ない、訂正すべき事項および追加すべき事項がありましたので、関係事項を下記のとおり訂正するものであります。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容です。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。また、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」には原届出書の「1 財務諸表」に追加される「中間財務諸表」の内容および更新後の「2 ファンドの現況」の内容を記載しています。

第一部【証券情報】

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

<訂正前>

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」と称することがあります。）です。

当ファンドの当初1口当たりの元本は、3,112円とします。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)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(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社であるDIAマセットマネジメント株式会社(平成28年10月1日より、アセットマネジメントOne株式会社となります(予定)。以下、新会社名を記載します。)は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付けまたは信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

<訂正後>

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」と称することがあります。）です。

当ファンドの当初1口当たりの元本は、3,112円とします。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)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(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付けまたは信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

(4) 発行(売出)価格

<訂正前>

取得申込日の基準価額とします。

なお、取得申込日の午後1時までには委託会社に追加設定の連絡をして受理されたものを当日分のお申込みとします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額(純資産総額)を、計算日における受

益権口数で除した価額をいいます。

基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会
は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

注：委託会社に対する照会先の情報は、平成28年10月1日現在（予定）のものであります。なお、電話番号はコールセンター
のものであります（以下同じ）。

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

<訂正後>

取得申込日の基準価額とします。

なお、取得申込日の午後1時まで委託会社に追加設定の連絡をして受理されたものを当日分のお申
込みとします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額(純資産総額)を、計算日における受
益権口数で除した価額をいいます。

基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会
は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのものであります（以下同じ）。

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(2) ファンドの沿革

<訂正前>

平成22年2月12日	信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
平成22年2月15日	受益権を大阪証券取引所へ上場
平成25年7月16日	受益権の上場先を大阪証券取引所から東京証券取引所へ変更
平成28年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継(予定)

<訂正後>

平成22年2月12日	信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
平成22年2月15日	受益権を大阪証券取引所へ上場
平成25年7月16日	受益権の上場先を大阪証券取引所から東京証券取引所へ変更
平成28年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

(3) ファンドの仕組み

<訂正前>

当ファンドの運営の仕組み
(略)

委託会社の概況

1. 資本金の額 20億円(平成28年10月1日現在(予定))

2. 会社の沿革

(中略)

平成28年10月1日 DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更(予定)

3. 大株主の状況(平成28年10月1日現在(予定))

(略)

<訂正後>

当ファンドの運営の仕組み
(略)

委託会社の概況

1．資本金の額 20億円（平成28年10月1日現在）

2．会社の沿革

(中略)

平成28年10月1日 DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

3．大株主の状況（平成28年10月1日現在）

(略)

2 投資方針

(3) 運用体制

<訂正前>

委託会社（平成28年10月1日現在（予定））におけるファンドの運用体制については、以下のとおりです。

a．ファンドの運用体制

(略)

b．ファンドの関係法人に関する管理

(略)

c．運用体制に関する社内規則

(略)

運用体制は、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

a．ファンドの運用体制

(略)

b．ファンドの関係法人に関する管理

(略)

c．運用体制に関する社内規則

（略）

運用体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3 投資リスク

<訂正前>

(1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

（略）

(2) リスク管理体制

委託会社（平成28年10月1日現在（予定））におけるファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下のとおりです。

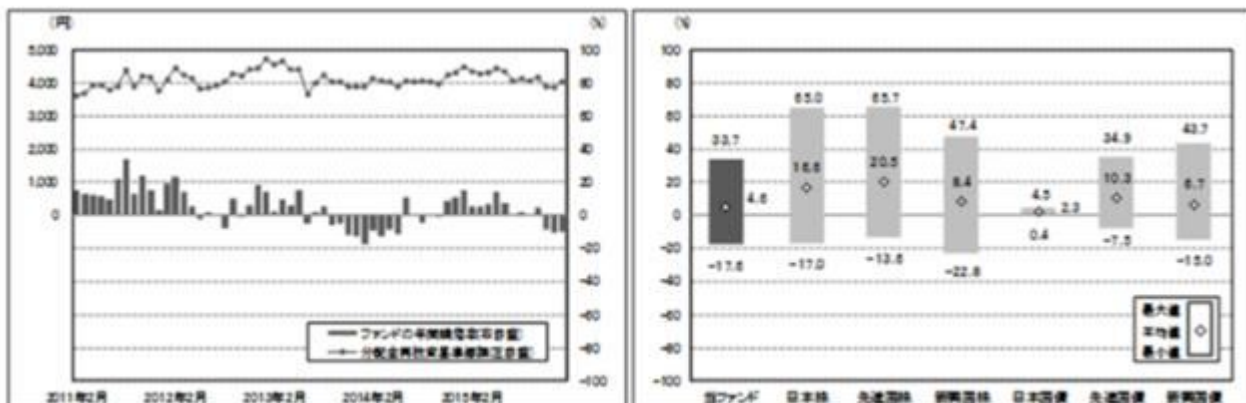
（中略）

リスク管理体制は、今後変更になることがあります。

（参考情報）ファンドの値動き・代表的資産クラスとの年間騰落率の比較（2011年2月～2016年1月）

当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

当ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率
の比較



分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を再投資したものと計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。（以下同じ。）

年間騰落率（各月末時点について1年前と比較したもの）は、分配金再投資基準価額をもとに計算していますので、基準価額をもとに計算した騰落率とは異なる場合があります。

上記は、当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、2011年2月～2016年1月の5年間における年間騰落率（各月末時点について1年前と比較したもの）の平均・最大・最小を表示したものです。当ファンドの年間騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算していますので、基準価額をもとに計算した騰落率とは異なる場合があります。代表的な資産クラスは比較対象として記載しているため、当ファンドの投資対象とは限りません。

（後略）

<訂正後>

(1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

（略）

(2) リスク管理体制

委託会社におけるファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下のとおりです。

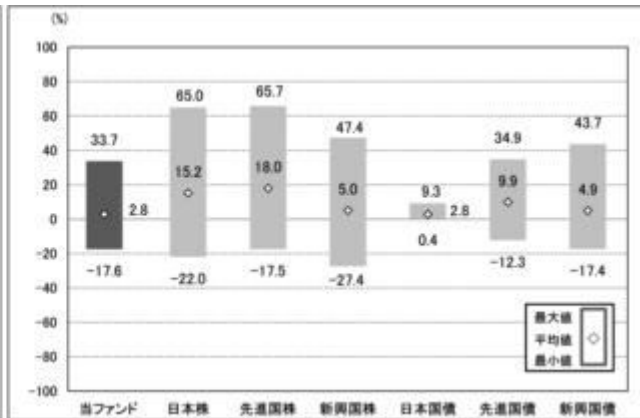
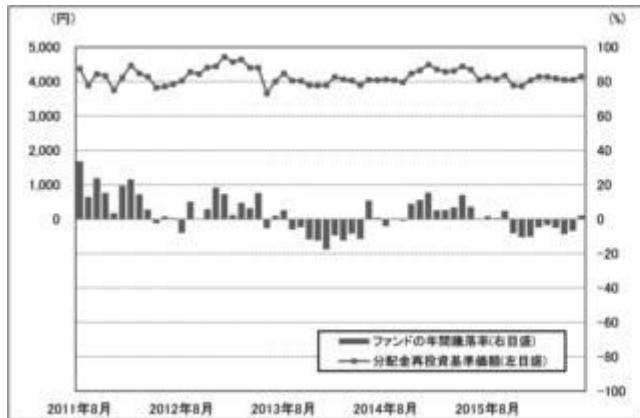
（中略）

リスク管理体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更になることがあります。

(参考情報)ファンドの値動き・代表的資産クラスとの年間騰落率の比較（2011年8月～2016年7月）

当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

当ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率
の比較



分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を再投資したものと計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。（以下同じ。）

年間騰落率（各月末時点について1年前と比較したものは、分配金再投資基準価額をもとに計算していますので、基準価額をもとに計算した騰落率とは異なる場合があります。）

上記は、当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、2011年8月～2016年7月の5年間における年間騰落率（各月末時点について1年前と比較したもの）の平均・最大・最小を表示したものです。

当ファンドの年間騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算していますので、基準価額をもとに計算した騰落率とは異なる場合があります。代表的な資産クラスは比較対象として記載しているため、当ファンドの投資対象とは限りません。

(後略)

4 手数料等及び税金

(3) 信託報酬等

< 訂正前 >

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、次の1.により計算した額に、2.により計算した額を加算して得た額とします。

1. 信託財産の純資産総額に年0.486%(税抜 0.45%)以内（平成28年 9月15日現在における信託報酬率は年率0.486%(税抜 0.45%)）の率を乗じて得た額。

信託報酬の配分（税抜）は以下の通りとします。

委託会社	受託会社
0.40%	0.05%

2. 公社債の貸付を行った場合は、その品貸料の54%（税抜 50%）以内の額。

(略)

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

(略)

< 訂正後 >

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、次の1.により計算した額に、2.により計算した額を加算して得た額とします。

1. 信託財産の純資産総額に年0.486%（税抜 0.45%）以内（平成28年10月17日現在における信託報酬率は年率0.486%（税抜 0.45%））の率を乗じて得た額。

信託報酬の配分（税抜）は以下の通りとします。

委託会社	受託会社
0.40%	0.05%

2. 公社債の貸付を行った場合は、その品貸料の54%（税抜 50%）以内の額。

（略）

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

（略）

（4）その他の手数料等

< 訂正前 >

～ （略）

受益権の上場にかかる費用および対象指標についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（以下「商標利用料」といいます。）ならびに当該上場にかかる費用および当該商標利用料にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。なお、平成28年9月15日現在において商標利用料を信託財産中から支弁する予定はありません。

平成28年1月末日現在、受益権の上場にかかる費用は以下の通りです。

- ・ 上場手数料

新規上場時の純資産総額に対して、および追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時及び新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して、0.0081%（税抜0.0075%）

- ・ 上場の年賦課金

毎年末または上場日の純資産総額に対して、最大0.0081%（税抜0.0075%）

- ・ 上場審査料

新規上場に際して54万円（税抜50万円）

< 主要なその他の手数料等を対価とする役務の内容 >

（略）

< 訂正後 >

～ （略）

受益権の上場にかかる費用および対象指標についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（以下「商標利用料」といいます。）ならびに当該上場にかかる費用および当該商標利用料にかかる

消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。なお、平成28年10月17日現在において商標利用料を信託財産中から支弁する予定はありません。

平成28年7月末日現在、受益権の上場にかかる費用は以下の通りです。

・ 上場手数料

新規上場時の純資産総額に対して、および追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時及び新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して、0.0081%（税抜0.0075%）

・ 上場の年賦課金

毎年末または上場日の純資産総額に対して、最大0.0081%（税抜0.0075%）

・ 上場審査料

新規上場に際して54万円（税抜50万円）

< 主要なその他の手数料等を対価とする役務の内容 >

（略）

（5）課税上の取扱い

< 訂正前 >

当ファンドは、課税上は上場証券投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税の取扱いについて

1．個人の受益者に対する課税

（略）

2．法人の受益者に対する課税

（略）

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

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

< 訂正後 >

当ファンドは、課税上は上場証券投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税の取扱いについて

1．個人の受益者に対する課税

（略）

2．法人の受益者に対する課税

（略）

上記の内容は平成28年7月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

5 運用状況

以下の運用状況は平成28年 7月29日現在です。

投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。なお、小数点第3位を切捨てており、端数調整は行っておりません。

(1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		59,149,627	100.00
合計(純資産総額)		59,149,627	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
商品先物取引	買建	日本	59,295,000	100.24

(注) 商品先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の帳入値段(清算値)により評価しておりません。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	建別	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
商品先物取引	東京商品取引所	金(TOCOM標準取引)2017年6月限	買建	13,000	日本・円	56,186,000	57,525,000	97.25

東京商品取引所	金(TOCOMミニ取引)20 17年6月限	買建	400	日本・円	1,729,200	1,770,000	2.99
---------	--------------------------	----	-----	------	-----------	-----------	------

(注) 時価の算定方法

取引所の発表する計算日の帳入値段(清算値)により評価しております。

(3) 運用実績

純資産の推移

平成28年7月末日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産及び金融商品取引所の取引価格の推移は次の通りです。

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)		金融商品取引所 取引価格(円)
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)	
第1計算期間末 (平成23年 1月17日)	619	619	3,553	3,553	3,560
第2計算期間末 (平成24年 1月17日)	372	372	3,956	3,956	3,945
第3計算期間末 (平成25年 1月17日)	157	157	4,598	4,598	4,405
第4計算期間末 (平成26年 1月17日)	135	135	3,969	3,969	
第5計算期間末 (平成27年 1月17日)	63	63	4,433	4,433	
第6計算期間末 (平成28年 1月17日)	54	54	3,826	3,826	
平成27年 7月末日	57		4,057		4,000
8月末日	58		4,135		4,000
9月末日	57		4,067		
10月末日	59		4,174		
11月末日	55		3,887		3,800
12月末日	55		3,869		3,800
平成28年 1月末日	57		4,035		3,880
2月末日	59		4,145		4,010
3月末日	59		4,139		4,080
4月末日	58		4,094		
5月末日	57		4,053		
6月末日	57		4,052		3,945
7月末日	59		4,148		

(注1) 表中の末日とは当該月の最終営業日を指します。

(注2) 金融商品取引所取引価格は、終値・1口当たりで表示しています。

(注3) 金融商品取引所取引価格は、3期以前は大阪証券取引所、4期以降は東京証券取引所における取引価格です。

分配の推移

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	平成22年 2月12日～平成23年 1月17日	0.00
第2計算期間	平成23年 1月18日～平成24年 1月17日	0.00
第3計算期間	平成24年 1月18日～平成25年 1月17日	0.00
第4計算期間	平成25年 1月18日～平成26年 1月17日	0.00
第5計算期間	平成26年 1月18日～平成27年 1月17日	0.00
第6計算期間	平成27年 1月18日～平成28年 1月17日	0.00

収益率の推移

期	計算期間	収益率(%)
第1計算期間	平成22年 2月12日～平成23年 1月17日	14.17
第2計算期間	平成23年 1月18日～平成24年 1月17日	11.34
第3計算期間	平成24年 1月18日～平成25年 1月17日	16.23
第4計算期間	平成25年 1月18日～平成26年 1月17日	13.68
第5計算期間	平成26年 1月18日～平成27年 1月17日	11.69
第6計算期間	平成27年 1月18日～平成28年 1月17日	13.69
第7中間計算期間	平成28年 1月18日～平成28年 7月17日	10.25

(注1) 収益率は期間騰落率。

(注2) 小数点第3位四捨五入。

(4) 設定及び解約の実績

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	平成22年 2月12日～平成23年 1月17日	174,260		174,260
第2計算期間	平成23年 1月18日～平成24年 1月17日		80,000	94,260
第3計算期間	平成24年 1月18日～平成25年 1月17日		60,000	34,260
第4計算期間	平成25年 1月18日～平成26年 1月17日			34,260
第5計算期間	平成26年 1月18日～平成27年 1月17日	30,000	50,000	14,260
第6計算期間	平成27年 1月18日～平成28年 1月17日			14,260
第7中間計算期間	平成28年 1月18日～平成28年 7月17日			14,260

(注) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

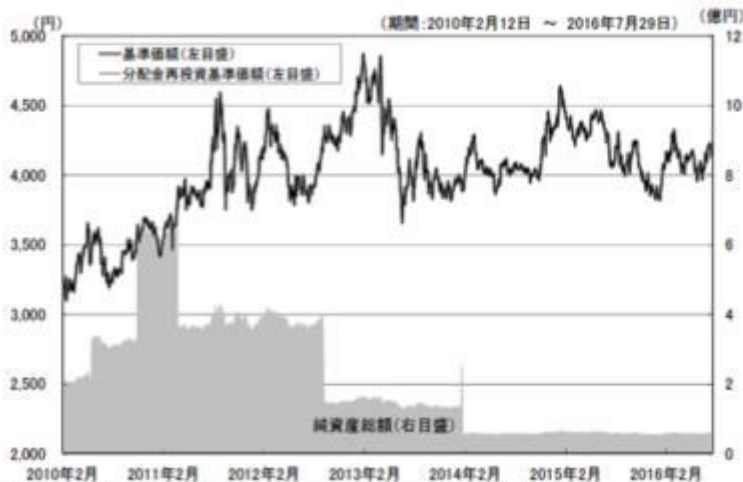
(2016年7月29日現在)

基準価額・純資産の推移

(1口当たり)

基準価額 4,148円

純資産総額 0.59億円



※基準価額および分配金再投資基準価額は、信託報酬控除後の値です。(以下同じ。)

※分配金再投資基準価額は、決算時に収益分配があった場合にその分配金(税引前)を再投資したものと計算しています。(以下同じ。)

なお、当ファンドは分配実績がないため、基準価額と分配金再投資基準価額の線が重なっております。

分配の推移

(1口当たり、税引前)

2016年1月	0円
2015年1月	0円
2014年1月	0円
2013年1月	0円
2012年1月	0円
設定来累計	0円
設定来: 2010年2月12日以降	

主要な資産の状況

※各比率は純資産総額に対する比率を表示(小数点第二位四捨五入)しています。

<資産の組入比率>

資産の種類	比率(%)
現金・預金・その他の資産	100.0
合計	100.0

(その他の資産の投資状況)

商品先物取引(買建) 100.2%

順位	銘柄名	限月	建別	比率(%)
1	金(TOCOM標準取引)	2017年6月	買建	97.3
2	金(TOCOMミニ取引)	2017年6月	買建	3.0

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。

※2009年以前は対象指標を過去に遡って算出した場合の収益率を表示しています。なお、対象指標の収益率はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

※2010年は設定日(2月12日)から年末までの収益率、2016年は1月から7月末までの収益率を表示しています。

当該実績は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

運用実績については、別途開示している場合があります。この場合、委託会社のホームページにおいて閲覧することができます。

第2【管理及び運営】

3 資産管理等の概要

(5) その他

<訂正前>

～ （略）

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.am-one.co.jp/>（平成28年10月1日現在（予定））

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

金融商品取引所への上場

委託会社は、この信託の受益権について、別に定める金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所に上場されるものとしします。

平成28年 9月15日現在、「別に定める金融商品取引所」は次の通りです。

東京証券取引所

委託会社は、この信託の受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとしします。

（略）

<訂正後>

～ （略）

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.am-one.co.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

金融商品取引所への上場

委託会社は、この信託の受益権について、別に定める金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所に上場されるものとしします。

平成28年10月17日現在、「別に定める金融商品取引所」は次の通りです。

東京証券取引所

委託会社は、この信託の受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとしします。

（略）

第3【ファンドの経理状況】

国内金先物価格連動型上場投信

(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）ならびに同規則第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、第7期中間計算期間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。

中間財務諸表

国内金先物価格連動型上場投信

(1) 中間貸借対照表

(単位：円)

第7期中間計算期間 (平成28年 7月17日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,852,162
派生商品評価勘定	2,371,400
現先取引勘定	40,000,000
前払金	4,866,908
差入委託証拠金	1,206,000
流動資産合計	60,296,470
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	15,704
未払委託者報酬	125,556
未払利息	197
その他未払費用	3,008
流動負債合計	144,465
負債合計	
144,465	
純資産の部	
元本等	
元本	44,377,120
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	15,774,885
(分配準備積立金)	6,027,371
元本等合計	60,152,005
純資産合計	
60,152,005	
負債純資産合計	
60,296,470	

(2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

第7期中間計算期間 (自 平成28年 1月18日 至 平成28年 7月17日)	
営業収益	

第7期中間計算期間 (自 平成28年 1月18日 至 平成28年 7月17日)	
有価証券売買等損益	1,780
派生商品取引等損益	5,749,164
その他収益	19
営業収益合計	5,747,403
営業費用	
支払利息	10,218
受託者報酬	15,704
委託者報酬	125,556
その他費用	3,544
営業費用合計	155,022
営業利益又は営業損失（ ）	5,592,381
経常利益又は経常損失（ ）	5,592,381
中間純利益又は中間純損失（ ）	5,592,381
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（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	10,182,504
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	15,774,885

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第7期中間計算期間 (自 平成28年 1月18日 至 平成28年 7月17日)
1 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引 原則として時価で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第7期中間計算期間 (平成28年 7月17日現在)	
1 中間計算期間末日における受益権の総数	14,260口
2 中間計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額	4,218円

(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7期中間計算期間 (平成28年 7月17日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	中間貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	(1)デリバティブ取引 先物取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。

(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)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(商品関連)

第7期中間計算期間(平成28年7月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	商品先物取引 買建	57,915,200	-	60,286,600	2,371,400
	合計	57,915,200	-	60,286,600	2,371,400

(注)時価の算定方法

商品先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の帳入値段(清算値)により評価しております。

(その他の注記)

項目	期別 第7期中間計算期間 (平成28年7月17日現在)
期首元本額	44,377,120円
期中追加設定元本額	-円
期中一部解約元本額	-円

2 ファンドの現況

以下のファンドの現況は平成28年7月29日現在です。

純資産額計算書

資産総額	59,161,150円
負債総額	11,523円
純資産総額(-)	59,149,627円
発行済口数	14,260口
1口当たり純資産額(/)	4,148円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

<訂正前>

(1) 資本金の額

平成28年10月1日現在（予定）

資本金	20億円
発行する株式の総数	100,000株（普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株）
発行済株式の総数	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	

過去5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 会社の機構(平成28年10月1日現在（予定）)

会社の意思決定機構

(略)

投資運用の意思決定機構

(略)

<訂正後>

(1) 資本金の額(平成28年10月1日現在)

資本金	20億円
発行する株式の総数	100,000株（普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株）
発行済株式の総数	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	

過去5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 会社の機構(平成28年10月1日現在)

会社の意思決定機構

(略)

投資運用の意思決定機構

(略)

2 事業の内容及び営業の概況

< 更新後 >

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

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。

平成28年7月29日現在、D I A Mアセットマネジメント株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。
（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	389	5,918,600,293,964
単位型公社債投資信託	48	353,027,465,726
単位型株式投資信託	7	79,600,055,072
合計	444	6,351,227,814,762

（ご参考）

平成28年7月29日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

・みずほ投信投資顧問株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	13	250,148,557,515
追加型株式投資信託	234	2,260,638,584,910
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,491,433,486
合計	250	2,512,278,575,911

・新光投信株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	25	622,747,870,142
追加型株式投資信託	244	3,210,390,488,192
単位型公社債投資信託	6	40,614,819,596
単位型株式投資信託	75	269,539,047,169

合計	350	4,143,292,225,099
----	-----	-------------------

3 委託会社等の経理状況

<訂正前>

1. ~3. (略)

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株式会社に変更する予定です。

委託会社の財務諸表に引き続き、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新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表を参考として添付しております。

(後略)

<訂正後>

1. ~3. (略)

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、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新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表を参考として添付しております。

(後略)

5 その他

<訂正前>

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更する予定です（関係当局の認可等を前提とします）。

<訂正後>

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

平成28年10月1日に、DIAMアセットマネジメント株式会社は、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に变更しました。なお、当該統合に伴い、監査等委員会設置会社に移行しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

3 資本関係

<訂正前>

該当事項はありません（平成28年10月1日現在（予定））。

（持株比率5%以上を記載します。）

<訂正後>

該当事項はありません。

（持株比率5%以上を記載します。）

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9月9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	亀井 純子 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、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内金先物価格連動型上場投信の平成28年1月18日から平成28年7月17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、国内金先物価格連動型上場投信の平成28年7月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年1月18日から平成28年7月17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

みずほ投信投資顧問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

(注)1.上記は、当社が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。

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

