

【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11月22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】 | ディーパリュウ株オープン |
| 【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5月19日まで) 3兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、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。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するため提出するものです。

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が更新されます。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、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「中間財務諸表」の記載事項が追加され、2 ファンドの現況が更新されます。

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>

(イ) 追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

(ロ) 当初元本は1口当たり1円です。

(ハ) D I A Mア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。）（以下「委託者」または「委託会社」といいます。）の依頼により信用格付業者から提供されも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もしくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

(略)

<訂正後>

(イ) 追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

(ロ) 当初元本は1口当たり1円です。

(ハ) アセットマネジメントOne株式会社（以下「委託者」または「委託会社」といいます。）の依頼により信用格付業者から提供されも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もしくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

(略)

(4)【発行（売出）価格】

<訂正前>

(イ) 発行価格は、取得申込受付日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を公表します。

「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た金額（純資産総額）をそのときの受益権口数で除した1口当たりの純資産価額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより日々変動します。

(ロ) 基準価額は毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(注) 委託者に対する照会先の情報は、平成28年10月1日現在（予定）のものです。（以下同じ）。

基準価額は、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額は、前日以前のものとなります。

<訂正後>

(イ) 発行価格は、取得申込受付日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を公表します。

「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た金額（純資産総額）をそ

のときの受益権口数で除した1口当たりの純資産価額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより日々変動します。

(口) 基準価額は毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

基準価額は、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額は、前日以前のものとなります。

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】

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

| | |
|------------|--|
| 平成12年9月1日 | 関東財務局長に対して有価証券届出書提出 |
| 平成12年9月28日 | 投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始 |
| 平成14年8月30日 | 新たな投資対象として「ディープバリュー株オープン マ ザーファンド」を加える旨の約款変更の届出 |
| 平成28年10月1日 | ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からア セットマネジメントOne株式会社に承継（予定） |

<訂正後>

| | |
|------------|--|
| 平成12年9月1日 | 関東財務局長に対して有価証券届出書提出 |
| 平成12年9月28日 | 投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始 |
| 平成14年8月30日 | 新たな投資対象として「ディープバリュー株オープン マ ザーファンド」を加える旨の約款変更の届出 |
| 平成28年10月1日 | ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からア 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】

b. 委託会社の概況

<訂正前>

(イ) 資本金の額 20億円（平成28年10月1日現在（予定））

(ロ) 委託会社の沿革

(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株式会社に更
更（予定）

(ハ) 大株主の状況

(平成28年10月1日現在（予定）)

(略)

<訂正後>

(イ) 資本金の額 20億円(平成28年10月1日現在)

(ロ) 委託会社の沿革

(略)

平成28年10月1日

D I A M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

(ハ) 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))における当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)

運用体制は、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>

a. ファンドの運用体制

(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。

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。

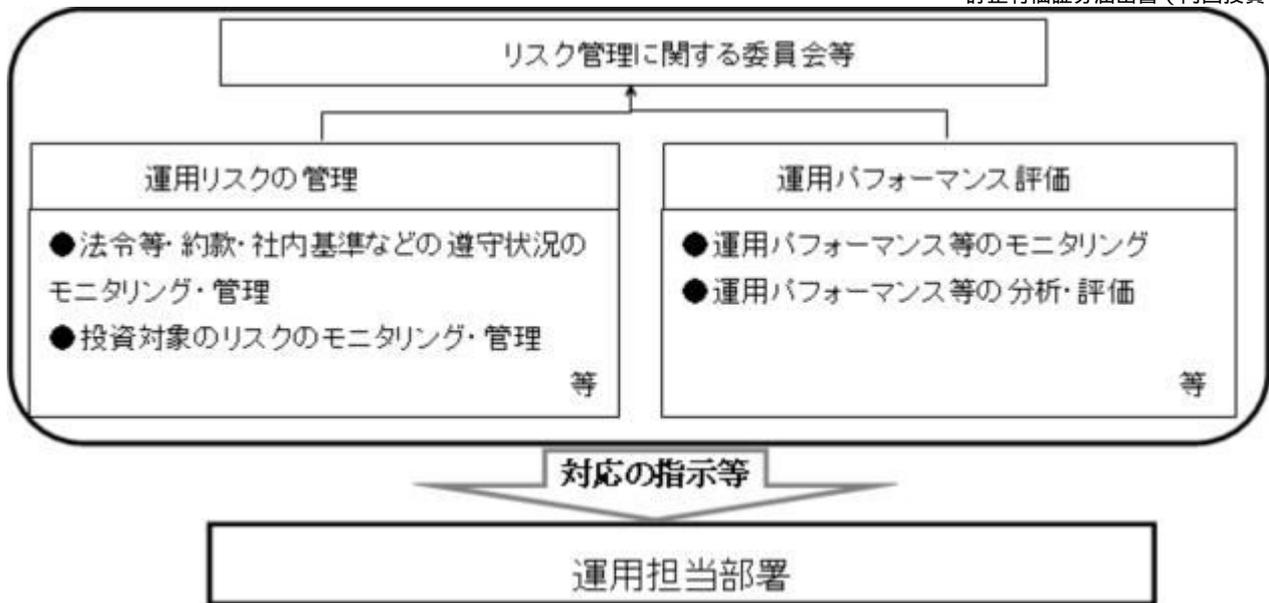
3【投資リスク】

(2) リスク管理体制

<更新後>

委託会社における当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。

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

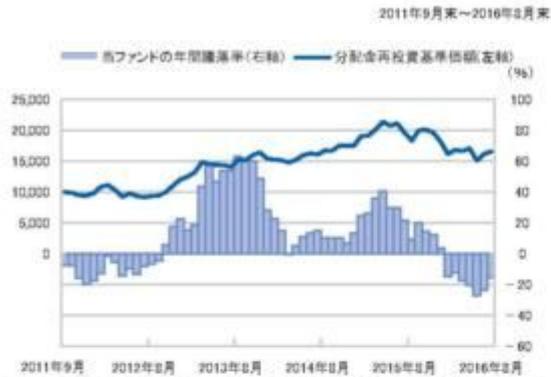


リスク管理体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更になることがあります。

投資リスク

＜参考情報＞

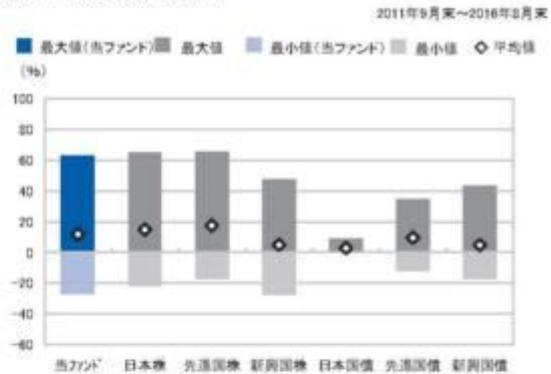
ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



※分配金再投資基準価額は、2011年9月末の基準価額を10,000として指数化しております。
※年間騰落率は、2011年9月から2016年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

グラフは、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。



| | 当ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|-----|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|
| 最大値 | 62.9 | 65.0 | 65.7 | 47.4 | 9.3 | 34.9 | 43.7 |
| 最小値 | △27.2 | △22.0 | △17.5 | △27.4 | 0.5 | △12.3 | △17.4 |
| 平均値 | 12.0 | 15.0 | 17.7 | 5.0 | 2.9 | 9.7 | 4.8 |

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※2011年9月から2016年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

※決算日に対応した数値とは異なります。

※当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を当ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のものであり、実際の基準価額とは異なります。

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-KOKUSAI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)
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・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

各資産クラスの騰落率について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Index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。

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)

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)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Index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。

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、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。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。

なお、シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)は、JP Morgan Securities LLCが開発している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、JP Morgan Securities LLCに帰属します。本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、JP Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。JP Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, JP Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は平成28年4月1日現在のものです。税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

(略)

上記は平成28年8月末現在のものです。税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ディープバリュー株オープン

(平成28年 8月31日現在)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 761,195,818 | 98.90 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 8,405,454 | 1.09 |
| 純資産総額 | | 769,601,272 | 100.00 |

(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。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考)ディープバリュー株オープン マザーファンド

(平成28年 8月31日現在)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-------------|---------|
| 株式 | 日本 | 865,646,320 | 96.70 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 29,494,583 | 3.29 |
| 純資産総額 | | 895,140,903 | 100.00 |

(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。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ディープバリューストックオープン

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成28年 8月31日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量又は 額面総額 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|---------------|-----------------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | ディープバリューストックオープン マザーファンド | 357,368,929 | 2.0527 | 733,594,717 | 2.1300 | 761,195,818 | 98.90 |

(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。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

ロ. 種類別投資比率

(平成28年 8月31日現在)

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.90 |
| 合計 | 98.90 |

(参考)ディープバリューストックオープン マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成28年 8月31日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量又は 額面総額 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|----|-------------------|--------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 78,200 | 638.90 | 49,962,043 | 564.10 | 44,112,620 | 4.92 |
| 2 | 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 5,700 | 6,988.64 | 39,835,248 | 6,238.00 | 35,556,600 | 3.97 |
| 3 | 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 7,200 | 4,442.02 | 31,982,544 | 4,546.00 | 32,731,200 | 3.65 |
| 4 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 8,100 | 4,196.76 | 33,993,818 | 3,621.00 | 29,330,100 | 3.27 |
| 5 | 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 6,200 | 3,820.96 | 23,689,952 | 3,170.00 | 19,654,000 | 2.19 |
| 6 | 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 17,100 | 1,147.74 | 19,626,474 | 1,015.00 | 17,356,500 | 1.93 |
| 7 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 83,900 | 234.15 | 19,645,739 | 179.70 | 15,076,830 | 1.68 |
| 8 | 日本 | 株式 | 小松製作所 | 機械 | 5,800 | 2,159.82 | 12,526,975 | 2,261.50 | 13,116,700 | 1.46 |
| 9 | 日本 | 株式 | 大塚ホールディングス | 医薬品 | 2,900 | 4,350.66 | 12,616,917 | 4,483.00 | 13,000,700 | 1.45 |
| 10 | 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 9,000 | 1,273.15 | 11,458,396 | 1,350.50 | 12,154,500 | 1.35 |
| 11 | 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 3,600 | 3,228.42 | 11,622,332 | 3,325.00 | 11,970,000 | 1.33 |
| 12 | 日本 | 株式 | オリックス | その他金融業 | 7,800 | 1,628.81 | 12,704,718 | 1,487.50 | 11,602,500 | 1.29 |
| 13 | 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 5,100 | 2,125.33 | 10,839,232 | 2,155.50 | 10,993,050 | 1.22 |
| 14 | 日本 | 株式 | 第一生命保険 | 保険業 | 7,500 | 1,795.83 | 13,468,798 | 1,439.50 | 10,796,250 | 1.20 |
| 15 | 日本 | 株式 | SCREENホールディングス | 電気機器 | 8,000 | 915.66 | 7,325,280 | 1,341.00 | 10,728,000 | 1.19 |
| 16 | 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 1,400 | 6,933.75 | 9,707,252 | 7,594.00 | 10,631,600 | 1.18 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----|----|-------------------|------------|--------|----------|------------|----------|------------|------|
| 17 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 2,600 | 4,424.78 | 11,504,450 | 4,064.00 | 10,566,400 | 1.18 |
| 18 | 日本 | 株式 | 旭硝子 | ガラス・土石製品 | 16,000 | 751.27 | 12,020,432 | 658.00 | 10,528,000 | 1.17 |
| 19 | 日本 | 株式 | 日立ハイテクノロジーズ | 卸売業 | 2,700 | 3,494.79 | 9,435,944 | 3,835.00 | 10,354,500 | 1.15 |
| 20 | 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 6,900 | 1,513.26 | 10,441,496 | 1,377.00 | 9,501,300 | 1.06 |
| 21 | 日本 | 株式 | 富士電機 | 電気機器 | 20,000 | 478.94 | 9,578,916 | 472.00 | 9,440,000 | 1.05 |
| 22 | 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 19,000 | 701.45 | 13,327,721 | 496.00 | 9,424,000 | 1.05 |
| 23 | 日本 | 株式 | 野村ホールディングス | 証券、商品先物取引業 | 18,100 | 662.02 | 11,982,671 | 487.30 | 8,820,130 | 0.98 |
| 24 | 日本 | 株式 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 銀行業 | 23,000 | 375.40 | 8,634,409 | 370.30 | 8,516,900 | 0.95 |
| 25 | 日本 | 株式 | 日油 | 化学 | 8,000 | 952.65 | 7,621,200 | 1,045.00 | 8,360,000 | 0.93 |
| 26 | 日本 | 株式 | ブリヂストン | ゴム製品 | 2,300 | 4,268.05 | 9,816,537 | 3,555.00 | 8,176,500 | 0.91 |
| 27 | 日本 | 株式 | 住友林業 | 建設業 | 5,800 | 1,566.67 | 9,086,713 | 1,400.00 | 8,120,000 | 0.90 |
| 28 | 日本 | 株式 | いすゞ自動車 | 輸送用機器 | 6,700 | 1,343.85 | 9,003,856 | 1,190.50 | 7,976,350 | 0.89 |
| 29 | 日本 | 株式 | 住友金属鉱山 | 非鉄金属 | 6,000 | 1,357.00 | 8,142,001 | 1,312.00 | 7,872,000 | 0.87 |
| 30 | 日本 | 株式 | 大陽日酸 | 化学 | 7,300 | 952.44 | 6,952,842 | 1,050.00 | 7,665,000 | 0.85 |

(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。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成28年 8月31日現在)

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|-----|---------|----------|----------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.76 |
| | | 鉱業 | 0.51 |
| | | 建設業 | 3.33 |
| | | 食料品 | 1.59 |
| | | 繊維製品 | 0.61 |
| | | パルプ・紙 | 0.41 |
| | | 化学 | 8.06 |
| | | 医薬品 | 2.88 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.47 |
| | | ゴム製品 | 1.34 |
| | | ガラス・土石製品 | 1.83 |
| | | 鉄鋼 | 1.39 |
| | | 非鉄金属 | 1.92 |
| | | 金属製品 | 0.58 |
| | | 機械 | 4.48 |
| | | 電気機器 | 10.55 |
| | | 輸送用機器 | 11.34 |
| | | 精密機器 | 0.43 |
| | | その他製品 | 2.04 |
| | | 電気・ガス業 | 2.73 |
| 陸運業 | 0.76 | | |

| | | |
|----|------------|-------|
| | 海運業 | 0.38 |
| | 空運業 | 0.34 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 0.37 |
| | 情報・通信業 | 5.35 |
| | 卸売業 | 6.69 |
| | 小売業 | 2.05 |
| | 銀行業 | 15.25 |
| | 証券、商品先物取引業 | 1.67 |
| | 保険業 | 3.82 |
| | その他金融業 | 1.78 |
| | 不動産業 | 0.83 |
| 合計 | | 96.70 |

【投資不動産物件】

ディープバリュー株オープン

該当事項はありません。

(参考)ディープバリュー株オープン マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ディープバリュー株オープン

該当事項はありません。

(参考)ディープバリュー株オープン マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

ディープバリュー株オープン

| 期別 | 純資産総額(円) | | 1口当たり純資産額(円) | |
|-----------------------|---------------|---------------|--------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第7計算期間末 (平成19年 2月20日) | 2,437,330,496 | 2,468,404,469 | 1.5687 | 1.5887 |
| 第8計算期間末 (平成20年 2月20日) | 1,804,079,443 | 1,835,873,302 | 1.1349 | 1.1549 |
| 第9計算期間末 (平成21年 2月20日) | 853,413,040 | 865,491,293 | 0.7066 | 0.7166 |

| | | | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第10計算期間末 | (平成22年 2月22日) | 1,061,390,036 | 1,073,413,874 | 0.8827 | 0.8927 |
| 第11計算期間末 | (平成23年 2月21日) | 758,607,926 | 766,677,243 | 0.9401 | 0.9501 |
| 第12計算期間末 | (平成24年 2月20日) | 560,697,715 | 564,281,765 | 0.7822 | 0.7872 |
| 第13計算期間末 | (平成25年 2月20日) | 617,190,853 | 627,415,383 | 0.9055 | 0.9205 |
| 第14計算期間末 | (平成26年 2月20日) | 682,945,204 | 692,423,153 | 1.0808 | 1.0958 |
| 第15計算期間末 | (平成27年 2月20日) | 774,397,680 | 786,176,407 | 1.3149 | 1.3349 |
| 第16計算期間末 | (平成28年 2月22日) | 701,408,925 | 710,842,615 | 1.1153 | 1.1303 |
| | 平成27年 8月末日 | 807,756,892 | | 1.3777 | |
| | 9月末日 | 761,624,552 | | 1.2875 | |
| | 10月末日 | 851,873,969 | | 1.4087 | |
| | 11月末日 | 857,711,654 | | 1.4125 | |
| | 12月末日 | 863,390,101 | | 1.3795 | |
| | 平成28年 1月末日 | 809,689,484 | | 1.2766 | |
| | 2月末日 | 716,026,671 | | 1.1196 | |
| | 3月末日 | 752,706,975 | | 1.1661 | |
| | 4月末日 | 743,911,180 | | 1.1537 | |
| | 5月末日 | 763,445,981 | | 1.1831 | |
| | 6月末日 | 683,626,147 | | 1.0479 | |
| | 7月末日 | 734,295,177 | | 1.1217 | |
| | 8月末日 | 769,601,272 | | 1.1496 | |

【分配の推移】

ディープバリューストックオープン

| 期 | 計算期間 | 1口当たりの分配金(円) |
|---------|-------------------------|--------------|
| 第7計算期間 | 平成18年 2月21日～平成19年 2月20日 | 0.0200 |
| 第8計算期間 | 平成19年 2月21日～平成20年 2月20日 | 0.0200 |
| 第9計算期間 | 平成20年 2月21日～平成21年 2月20日 | 0.0100 |
| 第10計算期間 | 平成21年 2月21日～平成22年 2月22日 | 0.0100 |
| 第11計算期間 | 平成22年 2月23日～平成23年 2月21日 | 0.0100 |
| 第12計算期間 | 平成23年 2月22日～平成24年 2月20日 | 0.0050 |
| 第13計算期間 | 平成24年 2月21日～平成25年 2月20日 | 0.0150 |
| 第14計算期間 | 平成25年 2月21日～平成26年 2月20日 | 0.0150 |
| 第15計算期間 | 平成26年 2月21日～平成27年 2月20日 | 0.0200 |
| 第16計算期間 | 平成27年 2月21日～平成28年 2月22日 | 0.0150 |

【収益率の推移】

ディープバリューストックオープン

| 期 | 計算期間 | 収益率(%) |
|-----------|-------------------------|--------|
| 第7計算期間 | 平成18年 2月21日～平成19年 2月20日 | 13.9 |
| 第8計算期間 | 平成19年 2月21日～平成20年 2月20日 | 26.4 |
| 第9計算期間 | 平成20年 2月21日～平成21年 2月20日 | 36.9 |
| 第10計算期間 | 平成21年 2月21日～平成22年 2月22日 | 26.3 |
| 第11計算期間 | 平成22年 2月23日～平成23年 2月21日 | 7.6 |
| 第12計算期間 | 平成23年 2月22日～平成24年 2月20日 | 16.3 |
| 第13計算期間 | 平成24年 2月21日～平成25年 2月20日 | 17.7 |
| 第14計算期間 | 平成25年 2月21日～平成26年 2月20日 | 21.0 |
| 第15計算期間 | 平成26年 2月21日～平成27年 2月20日 | 23.5 |
| 第16計算期間 | 平成27年 2月21日～平成28年 2月22日 | 14.0 |
| 第17中間計算期間 | 平成28年 2月23日～平成28年 8月22日 | 0.3 |

(注)収益率は各計算期間における騰落率を表示しており、当該計算期間の分配金額を加算して計算しています。

(4)【設定及び解約の実績】

ディープバリュー株オープン

| 期 | 計算期間 | 設定口数(口) | 解約口数(口) |
|-----------|-------------------------|-------------|-------------|
| 第7計算期間 | 平成18年 2月21日～平成19年 2月20日 | 154,177,070 | 115,452,966 |
| 第8計算期間 | 平成19年 2月21日～平成20年 2月20日 | 165,730,495 | 129,736,169 |
| 第9計算期間 | 平成20年 2月21日～平成21年 2月20日 | 210,421,808 | 592,289,453 |
| 第10計算期間 | 平成21年 2月21日～平成22年 2月22日 | 227,602,528 | 233,044,030 |
| 第11計算期間 | 平成22年 2月23日～平成23年 2月21日 | 87,518,289 | 482,970,397 |
| 第12計算期間 | 平成23年 2月22日～平成24年 2月20日 | 115,492,796 | 205,614,505 |
| 第13計算期間 | 平成24年 2月21日～平成25年 2月20日 | 124,818,663 | 159,993,288 |
| 第14計算期間 | 平成25年 2月21日～平成26年 2月20日 | 210,465,812 | 260,237,889 |
| 第15計算期間 | 平成26年 2月21日～平成27年 2月20日 | 146,161,934 | 189,088,893 |
| 第16計算期間 | 平成27年 2月21日～平成28年 2月22日 | 261,199,565 | 221,223,196 |
| 第17中間計算期間 | 平成28年 2月23日～平成28年 8月22日 | 97,168,755 | 64,899,084 |

参考情報

運用実績

ディープバリュー株オープン

2016年8月31日現在

<基準価額・純資産の推移> (2006年9月1日～2016年8月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。換金時の費用・税金などは考慮していません。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を当ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のものであり、実際の基準価額とは異なります。
 ※ベンチマークはRussell/Nomura Total Market Value インデックスです。当ファンドの設定時を10,000として指数化しています。
 ※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>

| | |
|---------|--------|
| 2016年2月 | 150円 |
| 2015年2月 | 200円 |
| 2014年2月 | 150円 |
| 2013年2月 | 150円 |
| 2012年2月 | 50円 |
| 設定来累計 | 1,650円 |

※分配は1万口当たり・税引前の金額です。
 ※分配の推移は、将来の分配の水準を示唆・保証するものではありません。分配が行われない場合もあります。

<主要な資産の状況>

資産配分

| 資産 | 純資産比率 |
|-------|---------|
| 株式現物 | 95.64% |
| その他資産 | 4.36% |
| 合計 | 100.00% |

※マザーファンドの保有口数に基づき計算した実質組入比率を記載しています。

業種別配分(ディープバリュー株オープン マザーファンド)

| 業種 | 純資産比率 |
|-------|--------|
| 銀行業 | 15.25% |
| 輸送用機器 | 11.34% |
| 電気機器 | 10.55% |
| 化学 | 8.06% |
| 卸売業 | 6.69% |
| その他 | 44.77% |
| 合計 | 96.70% |

※東証33業種分類にしたがって記載しています。
 ※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

組入上位10銘柄(ディープバリュー株オープン マザーファンド)

| 銘柄名 | 業種 | 純資産比率 |
|------------------|--------|-------|
| 三菱UFJフィナンシャルグループ | 銀行業 | 4.92% |
| トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3.97% |
| 日本電信電話 | 情報・通信業 | 3.65% |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 3.27% |
| 本田技研工業 | 輸送用機器 | 2.19% |
| 日産自動車 | 輸送用機器 | 1.93% |
| みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 1.68% |
| 小松製作所 | 機械 | 1.46% |
| 大塚ホールディングス | 医薬品 | 1.45% |
| 三菱電機 | 電気機器 | 1.35% |

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

組入銘柄数:207銘柄

<年間収益率の推移>

暦年ベース



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を単純に合算して計算しています。
 ※ベンチマークはRussell/Nomura Total Market Value インデックスです。
 ※2016年については、年初から8月末までの収益率を記載しています。

-当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。
 -ベンチマーク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。
 -表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。
 -最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認ください。

7

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)

e. 公告

委託者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。

(略)

<訂正後>

(略)

e. 公告

委託者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。

(略)

第3【ファンドの経理状況】

(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）（以下「投資信託財産計算規則」という。）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17期中間計算期間（平成28年2月23日から平成28年8月22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る中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【ディーパリュウ株オープン】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| 第17期中間計算期間末 平成28年8月22日現在 | |
|-----------------------------|--------------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 14,142,191 |
| 親投資信託受益証券 | 715,478,613 |
| 未収入金 | 15,000,000 |
| 流動資産合計 | 744,620,804 |
| 資産合計 | 744,620,804 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 260,773 |
| 未払受託者報酬 | 392,064 |
| 未払委託者報酬 | 4,508,579 |
| 未払利息 | 21 |
| その他未払費用 | 30,107 |
| 流動負債合計 | 5,191,544 |
| 負債合計 | 5,191,544 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 661,182,395 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 78,246,865 |
| （分配準備積立金） | 100,642,383 |
| 元本等合計 | 739,429,260 |
| 純資産合計 | 739,429,260 |
| 負債純資産合計 | 744,620,804 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| 第17期中間計算期間 自 平成28年2月23日 至 平成28年8月22日 | |
|--|----|
| 営業収益 | |
| 受取利息 | 10 |

| 第17期中間計算期間 自 平成28年 2月23日 至 平成28年 8月22日 | |
|--|------------|
| 有価証券売買等損益 | 6,725,306 |
| 営業収益合計 | 6,725,316 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 2,157 |
| 受託者報酬 | 392,064 |
| 委託者報酬 | 4,508,579 |
| その他費用 | 30,226 |
| 営業費用合計 | 4,933,026 |
| 営業利益 | 1,792,290 |
| 経常利益 | 1,792,290 |
| 中間純利益 | 1,792,290 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 285,888 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 72,496,201 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 11,612,968 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 11,612,968 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 7,368,706 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 7,368,706 |
| 分配金 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 78,246,865 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 第17期中間計算期間 自 平成28年 2月23日 至 平成28年 8月22日 |
|------------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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。 |
| 2. 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 | 計算期間に関する事項 前計算期間終了日に該当する日が休業日のため、当中間計算期間は平成28年 2月23日から平成28年 8月22日までとなっております。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 第17期中間計算期間末 平成28年 8月22日現在 | |
|------------------------------|--------------|
| 1. 中間計算期間末日における受益権の総数 | 661,182,395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口当たり純資産額 | 1.1183円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,183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

| 第17期中間計算期間末 平成28年 8月22日現在 |
|--|
| <p>1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> |

（その他の注記）

1 元本の移動

| 区分 | 第17期中間計算期間末 平成28年 8月22日現在 |
|-----------|------------------------------|
| 期首元本額 | 628,912,724円 |
| 期中追加設定元本額 | 97,168,755円 |
| 期中一部解約元本額 | 64,899,084円 |

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ディープバリューストックオープン 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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

ディーパリュウ株オープン マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成28年 8月22日現在

| | |
|-------------|-------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 33,768,556 |
| 株式 | 819,439,300 |
| 未収入金 | 12,140,543 |
| 未収配当金 | 920,800 |
| 流動資産合計 | 866,269,199 |
| 資産合計 | 866,269,199 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 5,364,306 |
| 未払解約金 | 15,500,000 |
| 未払利息 | 51 |
| 流動負債合計 | 20,864,357 |
| 負債合計 | 20,864,357 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 408,304,764 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 437,100,078 |
| 元本等合計 | 845,404,842 |
| 純資産合計 | 845,404,842 |
| 負債純資産合計 | 866,269,199 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 平成28年 2月23日 至 平成28年 8月22日 |
|--------------------|--|
| 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、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。 |
| 2. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、株式の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)

| 平成28年 8月22日現在 | |
|------------------|--------------|
| 1. 計算日における受益権の総数 | 408,304,764口 |

| | |
|------------------------|-----------|
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 2.0705円 |
| (1万口当たり純資産額) | (20,705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

| 平成28年 8月22日現在 |
|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 |
| 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 |
| 2. 時価の算定方法 |
| 株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 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 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合に は、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合が あります。 |

（その他の注記）

1 元本の移動

| 区分 | 平成28年 8月22日現在 |
|--|---------------|
| 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 | 400,163,105円 |
| 期中追加設定元本額 | 49,858,334円 |
| 期中一部解約元本額 | 41,716,675円 |
| 同期末における元本の内訳 | |
| ディープバリューストックオープン | 345,558,374円 |
| ディープバリューストックオープン（変額年金） | 62,746,390円 |
| 合計 | 408,304,764円 |

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ディープバリューストックオープン

(平成28年 8月31日現在)

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 772,019,574円 |
| 負債総額 | 2,418,302円 |
| 純資産総額(-) | 769,601,272円 |
| 発行済口数 | 669,455,951口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.1496円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,496円) |

(参考)ディープバリューストックオープン マザーファンド

(平成28年 8月31日現在)

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 905,596,308円 |
| 負債総額 | 10,455,405円 |
| 純資産総額(-) | 895,140,903円 |
| 発行済口数 | 420,260,514口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.1300円 |
| (1万口当たり純資産額) | (21,300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>

a．資本金の額（平成28年10月1日現在（予定））

（略）

b．会社の機構（平成28年10月1日現在（予定））

（略）

<訂正後>

a．資本金の額（平成28年10月1日現在）

（略）

b．会社の機構（平成28年10月1日現在）

（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8月31日現在における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（円） |
|------------|-----|-------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 追加型株式投資信託 | 392 | 5,889,391,856,643 |
| 単位型公社債投資信託 | 49 | 344,511,981,244 |
| 単位型株式投資信託 | 7 | 79,197,511,703 |
| 合計 | 448 | 6,313,101,349,590 |

（ご参考）

平成28年8月31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 | 263,953,485,574 |
| 追加型株式投資信託 | 232 | 2,245,140,638,646 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 3 | 1,483,762,979 |
| 合計 | 248 | 2,510,577,887,199 |

・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 | 645,515,628,611 |
| 追加型株式投資信託 | 243 | 3,151,408,584,879 |
| 単位型公社債投資信託 | 6 | 40,509,834,945 |
| 単位型株式投資信託 | 78 | 282,536,779,714 |
| 合計 | 352 | 4,119,970,828,149 |

3【委託会社等の経理状況】

<訂正前>

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

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。

（略）

<訂正後>

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財

務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第31期事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

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。

(略)

5【その他】

<更新後>

a. 定款の変更等

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、D I A M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株式会社に変更しました。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。

b. 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。)

<再信託受託会社の概要>

名称 : 資産管理サービス信託銀行株式会社

業務の概要 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託事務の一部(投資信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(資産管理サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

<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。)

<再信託受託会社の概要>

名称 : 資産管理サービス信託銀行株式会社

業務の概要 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託事務の一部(投資信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(資産管理サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月6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 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 山野浩 |

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」に掲げられているディープバリュース株オープンの平成28年2月23日から平成28年8月22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、ディープバリュース株オープンの平成28年8月22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2月23日から平成28年8月22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

- () 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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。