

【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9月20日提出
【発行者名】	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（予定））
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正（平成28年10月1日より、取締役社長 西 惠正（予定））
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号（平成28年10月1日より、東京都千代田区丸の内一丁目8番2号（予定））
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110（平成28年10月1日より、03-6774-5100（予定））
【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】	日本実力株ファンド（DC年金）
【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9月20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】

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、有価証券報告書の提出等に伴ない、訂正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】

<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」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

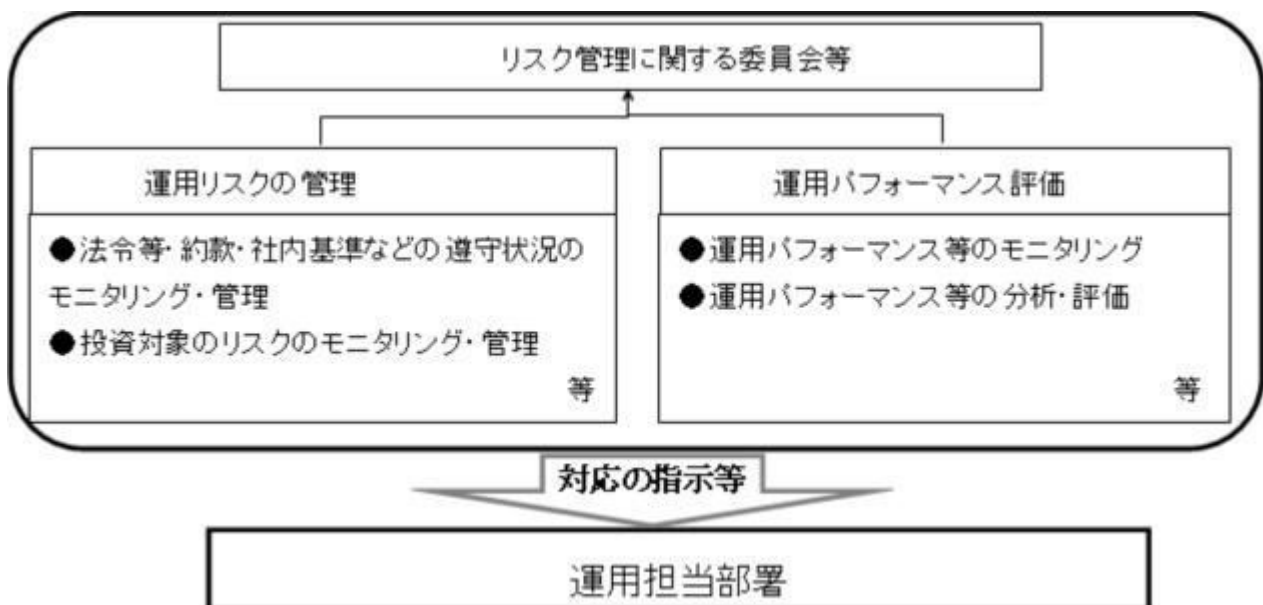
3【投資リスク】

（2）リスク管理体制

<更新後>

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、今後変更になることがあります。

＜参考情報＞

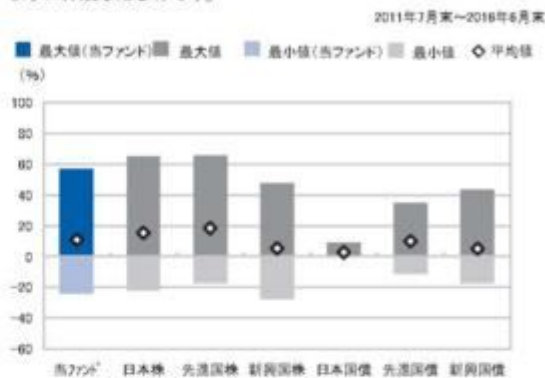
ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



※分配金再投資基準価額は、2011年7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7月から2016年6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	57.0	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△24.0	△22.0	△17.5	△27.4	0.4	△11.2	△17.4
平均値	11.0	15.5	18.4	5.4	2.7	10.0	5.2

※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7月から2016年6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・ディバースファイド(円ベース)
 (注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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、信頼性、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責について、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・ディバースファイド(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・ディバースファイド(円ベース)は、JP Morgan Securities LLCが算出、公表している、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・ディバース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.

5【運用状況】

(1)【投資状況】

日本実力株ファンド（DC年金）

（平成28年 6月30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	71,702,212	98.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		731,036	1.00
純資産総額		72,433,248	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）リアルエコノミー マザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	660,878,980	95.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		32,878,075	4.73
純資産総額		693,757,055	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】

日本実力株ファンド（DC年金）

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成28年 6月30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	リアルエコノミー マザーファン ド	53,073,436	1.4020	74,448,472	1.3510	71,702,212	98.99

(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。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 6月30日現在）

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.99
合計	98.99

（参考）リアルエコノミー マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成28年 6月30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	日本電信電話	情報・通 信業	7,500	4,447.00	33,352,500	4,800.00	36,000,000	5.18
2	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	72,700	499.80	36,335,460	455.90	33,143,930	4.77
3	日本	株式	三井住友フィナンシャル グループ	銀行業	8,000	3,185.00	25,480,000	2,926.00	23,408,000	3.37
4	日本	株式	三菱商事	卸売業	8,800	1,800.50	15,844,400	1,788.00	15,734,400	2.26
5	日本	株式	富士フイルムホール ディングス	化学	3,900	4,143.00	16,157,700	3,944.00	15,381,600	2.21
6	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機 器	3,000	5,568.00	16,704,000	5,052.00	15,156,000	2.18
7	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	12,000	1,271.00	15,252,000	1,239.50	14,874,000	2.14
8	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	2,800	4,678.55	13,099,964	4,719.00	13,213,200	1.90
9	日本	株式	JXホールディングス	石油・石 炭製品	32,000	410.00	13,120,000	398.70	12,758,400	1.83
10	日本	株式	日産自動車	輸送用機 器	13,000	1,010.50	13,136,500	917.90	11,932,700	1.72
11	日本	株式	大和ハウス工業	建設業	4,000	2,980.50	11,922,000	2,982.00	11,928,000	1.71
12	日本	株式	フジッコ	食料品	4,000	2,878.00	11,512,000	2,956.00	11,824,000	1.70
13	日本	株式	東京海上ホールディン グス	保険業	3,500	3,499.00	12,246,500	3,367.00	11,784,500	1.69
14	日本	株式	飯田グループホール ディングス	不動産業	5,500	2,159.00	11,874,500	2,083.00	11,456,500	1.65
15	日本	株式	雪印メグミルク	食料品	3,200	3,405.00	10,896,000	3,575.00	11,440,000	1.64
16	日本	株式	いすゞ自動車	輸送用機 器	9,000	1,293.50	11,641,500	1,248.50	11,236,500	1.61
17	日本	株式	S C R E E Nホール ディングス	電気機器	10,000	1,095.00	10,950,000	1,106.00	11,060,000	1.59
18	日本	株式	ヤマハ	その他製 品	4,000	3,105.00	12,420,000	2,737.00	10,948,000	1.57
19	日本	株式	大林組	建設業	10,000	1,066.00	10,660,000	1,085.00	10,850,000	1.56
20	日本	株式	みずほフィナンシャル グループ	銀行業	70,000	160.70	11,249,000	148.30	10,381,000	1.49
21	日本	株式	日油	化学	12,000	868.00	10,416,000	845.00	10,140,000	1.46
22	日本	株式	九電工	建設業	3,300	3,085.00	10,180,500	3,030.00	9,999,000	1.44
23	日本	株式	ヤマダ電機	小売業	18,000	523.00	9,414,000	540.00	9,720,000	1.40
24	日本	株式	三菱電機	電気機器	8,000	1,317.50	10,540,000	1,208.00	9,664,000	1.39
25	日本	株式	サカタのタネ	水産・農 林業	4,200	2,281.00	9,580,200	2,217.00	9,311,400	1.34
26	日本	株式	損保ジャパン日本興亜 ホールディングス	保険業	3,400	2,813.50	9,565,900	2,698.50	9,174,900	1.32
27	日本	株式	協和発酵キリン	医薬品	5,100	1,801.00	9,185,100	1,736.00	8,853,600	1.27
28	日本	株式	小松製作所	機械	5,000	1,897.00	9,485,000	1,769.50	8,847,500	1.27
29	日本	株式	東レ	繊維製品	10,000	907.20	9,072,000	869.40	8,694,000	1.25
30	日本	株式	スタンレー電気	電気機器	4,000	2,397.00	9,588,000	2,167.00	8,668,000	1.24

(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 6月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	1.34
		建設業	6.96
		食料品	5.48
		繊維製品	1.25
		パルプ・紙	1.13
		化学	7.55
		医薬品	3.69
		石油・石炭製品	1.83
		ガラス・土石製品	1.19
		鉄鋼	1.21
		非鉄金属	0.94
		機械	1.27
		電気機器	8.40
		輸送用機器	7.79
		精密機器	1.19
		その他製品	2.62
		電気・ガス業	0.93
		倉庫・運輸関連業	1.14
		情報・通信業	7.91
		卸売業	6.52
小売業	3.78		
銀行業	12.39		
保険業	4.07		
その他金融業	1.97		
不動産業	1.65		
サービス業	0.94		
合計			95.26

【投資不動産物件】

日本実力株ファンド（DC年金）

該当事項はありません。

（参考）リアルエコノミー 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】

日本実力株ファンド（DC年金）

該当事項はありません。

（参考）リアルエコノミー 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】

日本実力株ファンド（DC年金）

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6計算期間末（平成19年 6月20日）	54,695,157	54,721,709	2.0599	2.0609
第7計算期間末（平成20年 6月20日）	48,960,613	48,991,334	1.5937	1.5947
第8計算期間末（平成21年 6月22日）	38,635,217	38,669,183	1.1375	1.1385
第9計算期間末（平成22年 6月21日）	42,811,002	42,848,946	1.1283	1.1293
第10計算期間末（平成23年 6月20日）	41,283,208	41,323,698	1.0196	1.0206
第11計算期間末（平成24年 6月20日）	43,259,629	43,305,230	0.9486	0.9496
第12計算期間末（平成25年 6月20日）	66,725,195	66,773,653	1.3770	1.3780
第13計算期間末（平成26年 6月20日）	63,905,447	63,948,580	1.4816	1.4826
第14計算期間末（平成27年 6月22日）	101,534,144	101,588,198	1.8784	1.8794
第15計算期間末（平成28年 6月20日）	74,757,246	74,808,284	1.4647	1.4657
平成27年 6月末日	100,313,662		1.8570	
7月末日	95,607,397		1.9113	
8月末日	89,556,591		1.7849	
9月末日	82,620,143		1.6511	
10月末日	90,852,375		1.8067	
11月末日	90,352,812		1.8045	
12月末日	89,013,797		1.7697	
平成28年 1月末日	82,752,306		1.6371	
2月末日	75,032,012		1.4758	
3月末日	79,110,553		1.5475	
4月末日	78,455,294		1.5270	
5月末日	81,476,856		1.5775	
6月末日	72,433,248		1.4102	

【分配の推移】

日本実力株ファンド（DC年金）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第6計算期間	平成18年 6月21日～平成19年 6月20日	0.0010
第7計算期間	平成19年 6月21日～平成20年 6月20日	0.0010
第8計算期間	平成20年 6月21日～平成21年 6月22日	0.0010
第9計算期間	平成21年 6月23日～平成22年 6月21日	0.0010
第10計算期間	平成22年 6月22日～平成23年 6月20日	0.0010
第11計算期間	平成23年 6月21日～平成24年 6月20日	0.0010
第12計算期間	平成24年 6月21日～平成25年 6月20日	0.0010
第13計算期間	平成25年 6月21日～平成26年 6月20日	0.0010
第14計算期間	平成26年 6月21日～平成27年 6月22日	0.0010
第15計算期間	平成27年 6月23日～平成28年 6月20日	0.0010

【収益率の推移】

日本実力株ファンド（DC年金）

期	計算期間	収益率（％）
第6計算期間	平成18年 6月21日～平成19年 6月20日	14.7
第7計算期間	平成19年 6月21日～平成20年 6月20日	22.6
第8計算期間	平成20年 6月21日～平成21年 6月22日	28.6
第9計算期間	平成21年 6月23日～平成22年 6月21日	0.7
第10計算期間	平成22年 6月22日～平成23年 6月20日	9.5
第11計算期間	平成23年 6月21日～平成24年 6月20日	6.9
第12計算期間	平成24年 6月21日～平成25年 6月20日	45.3
第13計算期間	平成25年 6月21日～平成26年 6月20日	7.7
第14計算期間	平成26年 6月21日～平成27年 6月22日	26.8
第15計算期間	平成27年 6月23日～平成28年 6月20日	22.0

(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】

日本実力株ファンド（DC年金）

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第6計算期間	平成18年 6月21日～平成19年 6月20日	5,688,983	3,314,075
第7計算期間	平成19年 6月21日～平成20年 6月20日	6,065,089	1,895,632
第8計算期間	平成20年 6月21日～平成21年 6月22日	8,654,162	5,409,882
第9計算期間	平成21年 6月23日～平成22年 6月21日	6,419,340	2,440,888
第10計算期間	平成22年 6月22日～平成23年 6月20日	7,141,827	4,595,849
第11計算期間	平成23年 6月21日～平成24年 6月20日	8,174,576	3,063,400

第12計算期間	平成24年 6月21日 ~ 平成25年 6月20日	7,836,814	4,979,845
第13計算期間	平成25年 6月21日 ~ 平成26年 6月20日	5,457,367	10,782,543
第14計算期間	平成26年 6月21日 ~ 平成27年 6月22日	13,468,703	2,547,403
第15計算期間	平成27年 6月23日 ~ 平成28年 6月20日	3,684,326	6,700,599

参考情報

運用実績

2016年6月30日 現在

<基準価額・純資産の推移> (2006年7月3日～2016年6月30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、取引時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。
 ※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6月	10円
2015年6月	10円
2014年6月	10円
2013年6月	10円
2012年6月	10円
設定来累計	120円

※分配は1万口当たり・取引時の金額です。
 ※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	94.32%
その他資産	5.68%
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。

組入上位10銘柄 (リアルエコノミー マザーファンド)

銘柄名	業種	純資産比率
日本電信電話	情報・通信業	5.18%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	4.77%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3.37%
三菱商事	卸売業	2.26%
富士フイルムホールディングス	化学	2.21%
トヨタ自動車	輸送用機器	2.18%
伊藤忠商事	卸売業	2.14%
大塚ホールディングス	医薬品	1.90%
JXホールディングス	石油・石炭製品	1.83%
日産自動車	輸送用機器	1.72%

※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:67銘柄

業種別配分 (リアルエコノミー マザーファンド)

業種	純資産比率
銀行業	12.39%
電気機器	8.40%
情報・通信業	7.91%
輸送用機器	7.79%
化学	7.55%
その他	51.19%
合計	95.26%

※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。

<年間収益率の推移>

暦年ベース



※取引時の分配金を単純に合算して計算しています。
 ※当ファンドにはベンチマークがありません。
 ※2016年については、年初から6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。
 ・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。

第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「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、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15期計算期間（平成27年6月23日から平成28年6月20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る監査を受けております。

1【財務諸表】

【日本実力株ファンド（DC年金）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 平成27年 6月22日現在	第15期 平成28年 6月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,731,986	1,353,702
親投資信託受益証券	100,588,580	74,398,472
未収利息	2	-
流動資産合計	102,320,568	75,752,174
資産合計		
	102,320,568	75,752,174
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	54,054	51,038
未払解約金	-	308,405
未払受託者報酬	48,621	42,161
未払委託者報酬	680,626	590,175
未払利息	-	2
その他未払費用	3,123	3,147
流動負債合計	786,424	994,928
負債合計		
	786,424	994,928
純資産の部		
元本等		
元本	54,054,744	51,038,471
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	47,479,400	23,718,775
（分配準備積立金）	27,402,111	24,052,024
元本等合計	101,534,144	74,757,246
純資産合計		
	101,534,144	74,757,246
負債純資産合計		
	102,320,568	75,752,174

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期 自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	第15期 自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
営業収益		

	第14期 自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	第15期 自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
受取利息	381	287
有価証券売買等損益	20,682,503	19,510,108
営業収益合計	20,682,884	19,509,821
営業費用		
支払利息	-	102
受託者報酬	84,465	91,348
委託者報酬	1,182,370	1,278,781
その他費用	4,770	6,617
営業費用合計	1,271,605	1,376,848
営業利益	19,411,279	20,886,669
経常利益	19,411,279	20,886,669
当期純利益	19,411,279	20,886,669
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	332,228	437,580
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	20,772,003	47,479,400
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,933,158	2,578,411
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,933,158	2,578,411
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,250,758	5,838,909
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,250,758	5,838,909
分配金	54,054	51,038
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	47,479,400	23,718,775

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第15期 自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20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、当計算期間は平成27年 6月23日から平成28年 6月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第14期 平成27年 6月22日現在	第15期 平成28年 6月20日現在
1. 計算期間末日における受益権の総数 54,054,744口	1. 計算期間末日における受益権の総数 51,038,471口
2. 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 1.8784円 (1万口当たり純資産額) (18,784円)	2. 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 1.4647円 (1万口当たり純資産額) (14,647円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第14期	第15期
	自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（381円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（19,078,670円）、信託約款に定める収益調整金（42,616,994円）及び分配準備積立金（8,377,114円）より分配対象収益は70,073,159円（1万口当たり12,963.35円）であり、うち54,054円（1万口当たり10円）を分配しております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（42,045,354円）及び分配準備積立金（24,103,062円）より分配対象収益は66,148,416円（1万口当たり12,960.49円）であり、うち51,038円（1万口当たり10円）を分配しております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	第14期	第15期
	自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左

区分	第14期 自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	第15期 自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4.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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

第14期 平成27年 6月22日現在	第15期 平成28年 6月20日現在
<p>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。</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。 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>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	第14期 自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	第15期 自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第14期 平成27年 6月22日現在	第15期 平成28年 6月20日現在
期首元本額	43,133,444円	54,054,744円
期中追加設定元本額	13,468,703円	3,684,326円
期中一部解約元本額	2,547,403円	6,700,599円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第14期 平成27年 6月22日現在	第15期 平成28年 6月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
親投資信託受益証券	20,482,391	18,931,044
合計	20,482,391	18,931,044

3 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。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	リアルエコノミー マザーファンド	53,028,134	74,398,472	
	合計	53,028,134	74,398,472	

（注）券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「リアルエコノミー マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

リアルエコノミー マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	平成27年 6月22日現在	平成28年 6月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	37,902,727	32,964,821
株式	1,016,365,850	687,454,060
未収入金	10,265,402	-
未収配当金	3,560,000	6,836,050
未収利息	51	-
流動資産合計	1,068,094,030	727,254,931
資産合計	1,068,094,030	727,254,931
負債の部		
流動負債		
未払金	10,371,188	-
未払解約金	16,300,000	-
未払利息	-	55
その他未払費用	-	83
流動負債合計	26,671,188	138
負債合計	26,671,188	138
純資産の部		
元本等		
元本	586,342,950	518,360,537
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	455,079,892	208,894,256
元本等合計	1,041,422,842	727,254,793
純資産合計	1,041,422,842	727,254,793
負債純資産合計	1,068,094,030	727,254,931

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27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

区分	自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
2. 収益及び費用の計上基準	<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。</p> <p>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。</p> <p>受取配当金</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 6月22日現在		平成28年 6月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数	586,342,950口	1. 計算日における受益権の総数	518,360,537口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額		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	1.776円	1口当たり純資産額	1.403円
(1000口当たり純資産額)	(1,776円)	(1000口当たり純資産額)	(1,403円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左

区分	自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成27年 6月22日現在	平成28年 6月20日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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ぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>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。</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>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成26年 6月21日 至 平成27年 6月22日	自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成27年 6月22日現在	平成28年 6月20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	802,418,979円	586,342,950円
期中追加設定元本額	21,223,473円	7,652,052円
期中一部解約元本額	237,299,502円	75,634,465円
同期末における元本の内訳		
日本実力株ファンド	529,705,236円	465,332,403円
日本実力株ファンド（DC年金）	56,637,714円	53,028,134円
合計	586,342,950円	518,360,537円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成27年 6月22日現在	平成28年 6月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	11,323,762	118,316,760
合計	11,323,762	118,316,760

（注）「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

3 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。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
サカタのタネ	4,200	2,281.00	9,580,200	
大林組	10,000	1,066.00	10,660,000	
住友林業	6,000	1,504.00	9,024,000	
パナホーム	9,000	804.00	7,236,000	
大和ハウス工業	4,000	2,980.50	11,922,000	

九電工	3,300	3,085.00	10,180,500
雪印メグミルク	3,200	3,405.00	10,896,000
フジッコ	4,000	2,878.00	11,512,000
東レ	10,000	907.20	9,072,000
王子ホールディングス	20,000	415.00	8,300,000
住友化学	18,000	459.00	8,262,000
東ソー	14,000	545.00	7,630,000
日油	12,000	868.00	10,416,000
富士フイルムホールディングス	3,900	4,143.00	16,157,700
ファンケル	5,000	1,432.00	7,160,000
ポーラ・オルビスホールディングス	600	9,080.00	5,448,000
協和発酵キリン	5,100	1,801.00	9,185,100
小野薬品工業	800	4,321.00	3,456,800
大塚ホールディングス	2,500	4,665.00	11,662,500
J Xホールディングス	32,000	410.00	13,120,000
旭硝子	15,000	600.00	9,000,000
新日鐵住金	4,300	2,027.00	8,716,100
フジクラ	14,000	509.00	7,126,000
小松製作所	5,000	1,897.00	9,485,000
T H K	3,800	1,933.00	7,345,400
日立製作所	15,000	470.80	7,062,000
三菱電機	8,000	1,317.50	10,540,000
富士電機	20,000	434.00	8,680,000
T D K	1,200	6,260.00	7,512,000
スタンレー電気	4,000	2,397.00	9,588,000
S C R E E Nホールディングス	10,000	1,095.00	10,950,000
キャノン	2,500	3,041.00	7,602,500
豊田自動織機	2,000	4,360.00	8,720,000
日産自動車	13,000	1,010.50	13,136,500
いすゞ自動車	9,000	1,293.50	11,641,500
トヨタ自動車	3,000	5,568.00	16,704,000
マツダ	6,000	1,683.50	10,101,000
ヤマハ発動機	5,000	1,727.00	8,635,000
ニコン	6,000	1,429.00	8,574,000
ヤマハ	4,000	3,105.00	12,420,000
コクヨ	5,000	1,424.00	7,120,000
中国電力	5,000	1,310.00	6,550,000
キューソー流通システム	3,000	2,602.00	7,806,000
テレビ東京ホールディングス	3,000	1,973.00	5,919,000
日本電信電話	7,500	4,447.00	33,352,500
カブコン	3,000	2,350.00	7,050,000
コナミホールディングス	1,500	3,930.00	5,895,000
伊藤忠商事	12,000	1,271.00	15,252,000

丸紅	16,000	475.80	7,612,800	
三井物産	6,000	1,230.00	7,380,000	
三菱商事	8,800	1,800.50	15,844,400	
エディオン	10,000	839.00	8,390,000	
あさひ	5,500	1,527.00	8,398,500	
ヤマダ電機	18,000	523.00	9,414,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	15,000	437.10	6,556,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	72,700	499.80	36,335,460	
三井住友トラスト・ホールディングス	25,000	356.60	8,915,000	
三井住友フィナンシャルグループ	8,000	3,185.00	25,480,000	
千葉銀行	10,000	514.00	5,140,000	
みずほフィナンシャルグループ	70,000	160.70	11,249,000	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	3,400	2,813.50	9,565,900	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	2,800	2,836.50	7,942,200	
東京海上ホールディングス	3,500	3,499.00	12,246,500	
日立キャピタル	2,900	2,390.00	6,931,000	
オリックス	6,000	1,409.50	8,457,000	
飯田グループホールディングス	5,500	2,159.00	11,874,500	
総合警備保障	1,300	4,890.00	6,357,000	
合 計	648,800		687,454,060	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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】

日本実力株ファンド（DC年金）

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	72,465,671円
負債総額	32,423円

純資産総額（ - ）	72,433,248円
発行済口数	51,364,274口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4102円
（1万口当たり純資産額）	（14,102円）

（参考）リアルエコノミー マザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	702,323,437円
負債総額	8,566,382円
純資産総額（ - ）	693,757,055円
発行済口数	513,394,352口
1口当たり純資産額（ / ）	1.351円
（1000口当たり純資産額）	（1,351円）

独立監査人の監査報告書

平成28年7月26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 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」に掲げられている日本実力株ファンド（DC年金）の平成27年6月23日から平成28年6月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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、日本実力株ファンド（DC年金）の平成28年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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

新光投信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、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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。