

【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12月20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】	海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）
【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6月21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、有価証券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」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) DIAM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、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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発表します。

「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/>

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。

(7) 【申込期間】

< 訂正前 >

平成28年10月 1日から平成29年 6月21日までです。

なお、申込期間は原則として更新されます。

< 訂正後 >

平成28年10月 1日から平成29年 6月21日までです。

申込期間は終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

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】

<訂正前>

a. ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、追加型投信／海外／債券に属し、主として日本を除く世界主要先進国の公社債に実質的に投資し、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。

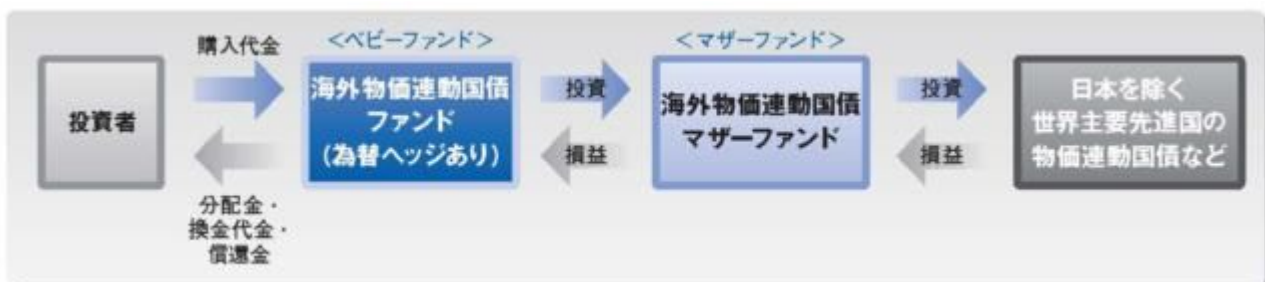
当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において、以下のように分類・区分されます。

（略）

ファンドの仕組み

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（当ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。



ベビーファンド（当ファンド）で日本を除く世界主要先進国の物価連動国債などを直接組み入れる場合があります。

b. ファンドの特色

（略）

国別配分は、原則として各国の物価連動国債の時価総額比率に準じた構成とすることを基本とします。また、投資対象国の経済ファンダメンタルズ分析などに基づいて一定の範囲内で投資比率を調整する場合があります。

公社債の実質組入比率については、原則として高位を保ちます。

運用にあたっては、パークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（G7 除く日本、円ベース）をベンチマークとします。

パークレイズ世界インフレ連動国債インデックス(G7除く日本)

日本を除くG7構成国の物価連動国債市場のパフォーマンスを表す指標として、パークレイズ(本社:イギリス)が時価総額加重方式にて算出している指数です。

採用銘柄は、クーポン種類、発行規模、信用格付け、非居住者の投資可否などの観点からパークレイズが決定します。

採用国は、アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダです。

(2016年3月末現在)

※採用国は今後変更になる場合があります。

(略)

上図は物価連動国債の価格変動特性を示したのですが、債券価格は発行体の信用状態の変化など上記以外の要因によっても変動する場合があります。当ファンドの基準価額は為替変動や利子・配当等収益、運用管理費用（信託報酬）などの影響も受けるため、上図と異なる動きをする場合があります。また、上図は当ファンドの将来の投資成果を保証するものではありません。

主な投資制限

株式への投資割合	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、 <u>転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限り</u> ます。
外貨建資産への投資割合	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

分配方針

(略)

c. 信託金限度額

委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

<訂正後>

a. ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、追加型投信/海外/債券に属し、主として日本を除く世界主要先進国の公社債に実質的に投資し、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。

委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において、以下のように分類・区分されます。

(略)

b. ファンドの特色

(略)

国別配分は、原則として各国の物価連動国債の時価総額比率に準じた構成とすることを基本とします。また、投資対象国の経済ファンダメンタルズ分析などに基づいて一定の範囲内で投資比率を調整する場合があります。

公社債の実質組入比率については、原則として高位を保ちます。

運用にあたっては、ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（G7除く日本、円ベース）をベンチマークとします。

ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス(G7除く日本)

日本を除くG7構成国の物価連動国債市場のパフォーマンスを表す指標として、時価総額加重方式にて算出されている指数です。

採用国は、アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダです。

(2016年9月末現在)

※採用国は今後変更になる場合があります。

(略)

上図は物価連動国債の価格変動特性を示したものです。債券価格は発行体の信用状態の変化など上記以外の要因によっても変動する場合があります。当ファンドの基準価額は為替変動や利子・配当等収益、運用管理費用（信託報酬）などの影響も受けるため、上図と異なる動きをする場合があります。また、上図は当ファンドの将来の投資成果を保証するものではありません。

分配方針

(略)

(2) 【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成17年3月11日	関東財務局長に対して有価証券届出書提出
平成17年3月31日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
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17年3月11日	関東財務局長に対して有価証券届出書提出
平成17年3月31日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
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】

a. ファンドの仕組み

<訂正前>

(略)

2 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

<訂正後>

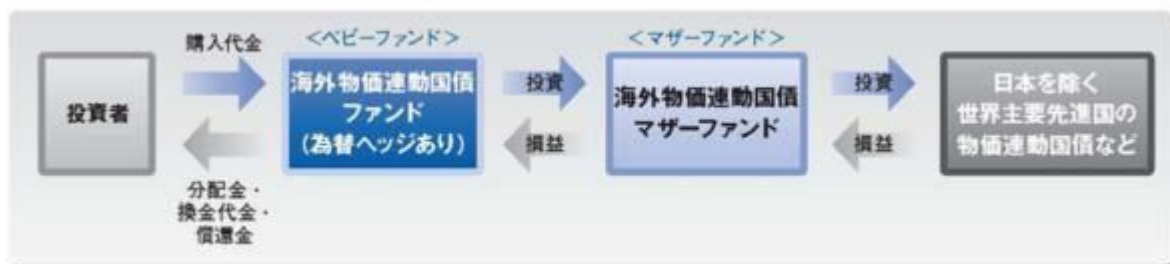
(略)

2 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（当ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。



ベビーファンド（当ファンド）で日本を除く世界主要先進国の物価連動国債などを直接組み入れる場合があります。

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

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（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

(八) 大株主の状況

(平成28年10月1日現在)

(略)

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

a. 基本方針

当ファンドは、海外物価連動国債マザーファンド受益証券ならびに日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

海外物価連動国債マザーファンド受益証券ならびに日本を除くG7構成国(アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国)が発行する物価連動国債を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

海外物価連動国債マザーファンド受益証券ならびに日本を除くG7構成国が発行する物価連動国債に主として投資します。

原則として、実質外貨建資産については為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ります。

公社債の実質組入比率については原則として高位を保ちます。

ただし、ファンドの資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(八) 主な投資制限

株式への実質投資割合は、転換社債の転換および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。)の新株予約権に限り、)の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券(マザーファンドを除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の

純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合には特に制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

マザーファンドの運用方針

海外物価連動国債マザーファンド

(略)

(3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

(略)

<訂正後>

a. 基本方針

当ファンドは、海外物価連動国債マザーファンド受益証券ならびに日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

海外物価連動国債マザーファンド受益証券ならびに日本を除くG7構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国）が発行する物価連動国債を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

海外物価連動国債マザーファンド受益証券ならびに日本を除くG7構成国が発行する物価連動国債に主として投資します。

原則として、実質外貨建資産については為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ります。

公社債の実質組入比率については原則として高位を保ちます。

ただし、ファンドの資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

マザーファンドの運用方針

海外物価連動国債マザーファンド

(略)

(3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法

第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。)の新株予約権に限ります。)の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

(略)

(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。

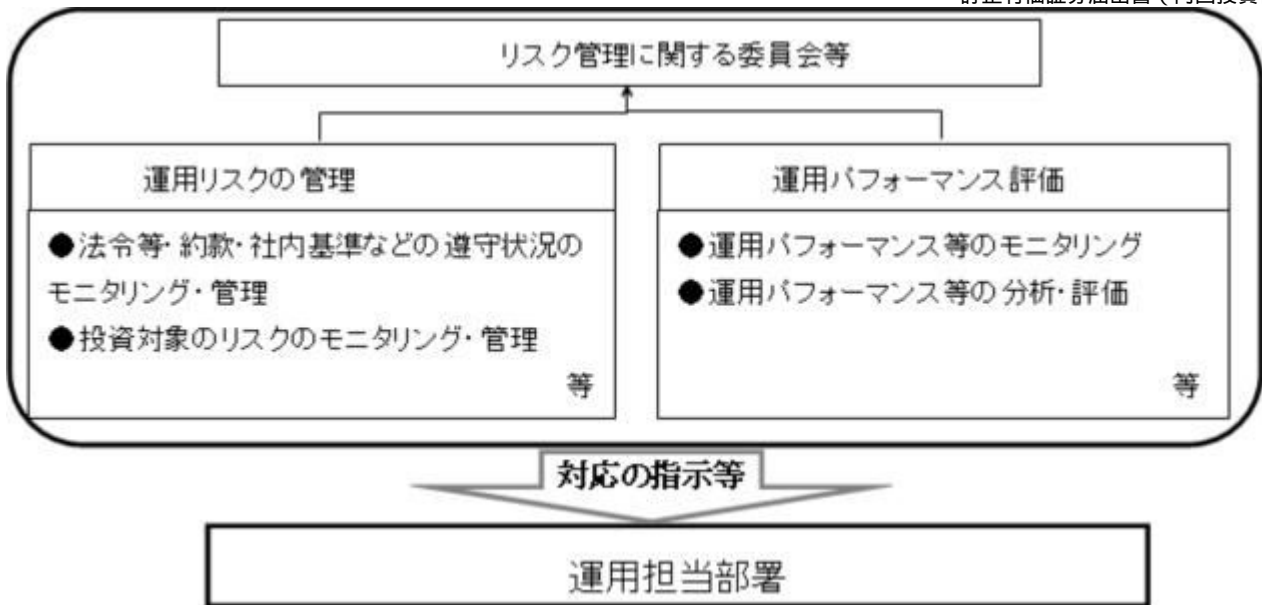
3【投資リスク】

(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。

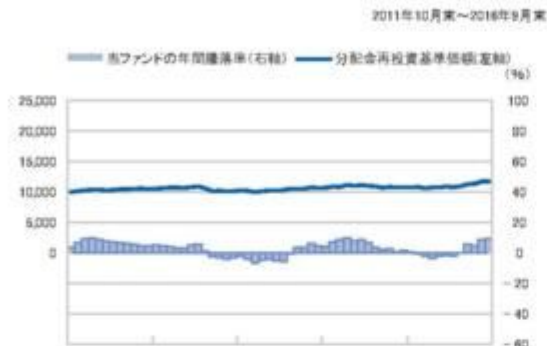
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



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。

＜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

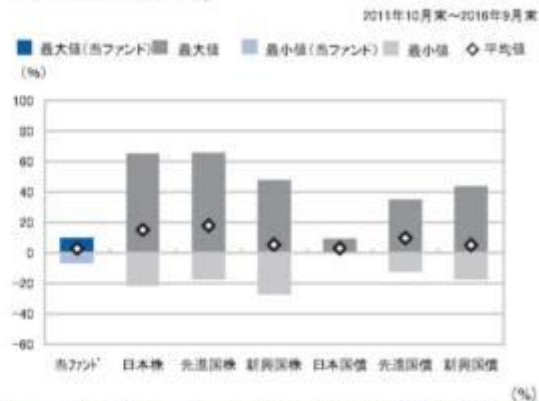


* 分配金再投資基準価額は、2011年10月末の基準価額を10,000として指数化しております。
* 年間騰落率は、2011年10月から2016年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※ 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。

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	9.8	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9
最小値	△6.6	△22.0	△17.5	△27.4	0.5	△12.3
平均値	2.7	15.0	17.8	5.3	3.0	9.6

* 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10月から2016年9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。

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、信頼性、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全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。本指数は特許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9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】

海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）

(平成28年 9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	71,409,668	97.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,648,440	2.25
純資産総額		73,058,108	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) 海外物価連動国債マザーファンド

(平成28年 9月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	397,796,121	47.24
	カナダ	20,875,228	2.47
	ドイツ	14,401,981	1.71
	イタリア	90,661,636	10.76
	フランス	52,960,667	6.29
	イギリス	259,239,898	30.78
	小計	835,935,531	99.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,029,525	0.71
純資産総額		841,965,056	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】

海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成28年 9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	海外物価連動国債マザーファンド	47,382,170	1.4879	70,499,931	1.5071	71,409,668	97.74

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。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 9月30日現在）

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.74
合計	97.74

（参考）海外物価連動国債マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成28年 9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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	460,000	10,554.90	54,875,081	10,424.4450	55,088,730	1.6250	2018.01.15	6.54
2	イギリス	国債証券	TSY I/L GILT	90,000	27,255.86	33,111,944	35,680.6010	44,005,098	1.2500	2055.11.22	5.22
3	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	200,000	14,267.02	41,100,096	14,606.3100	42,767,568	3.8750	2029.04.15	5.07
4	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	250,000	11,935.19	37,482,113	12,064.4850	38,509,835	2.3750	2025.01.15	4.57
5	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000	14,272.02	37,162,580	14,646.1120	38,482,394	2.3500	2035.09.15	4.57
6	イギリス	国債証券	TSY I/L GILT	100,000	23,914.05	26,308,950	33,618.5300	37,546,182	0.3750	2062.03.22	4.45
7	イギリス	国債証券	TSY I/L STOC	70,000	44,923.83	31,446,681	48,694.4685	34,086,128	6.7088	2024.07.17	4.04
8	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	300,000	10,112.00	31,118,669	10,287.3800	32,179,336	0.1250	2023.01.15	3.82
9	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	300,000	9,225.17	28,504,510	10,212.7250	32,072,347	0.6250	2043.02.15	3.80
10	イギリス	国債証券	TSY I/L GILT	100,000	19,589.74	25,131,090	23,355.2040	30,415,482	1.1250	2037.11.22	3.61
11	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000	14,260.68	29,946,874	14,318.5016	30,340,904	3.1000	2026.09.15	3.60
12	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	200,000	12,709.77	27,485,283	13,665.4200	30,036,866	2.1250	2041.02.15	3.56
13	イギリス	国債証券	TSY I/L GILT	90,000	20,645.60	22,589,713	26,881.2000	29,859,341	0.5000	2050.03.22	3.54
14	イギリス	国債証券	TSY I/L GILT	100,000	19,294.99	23,562,039	23,954.6600	29,695,155	0.6250	2042.11.22	3.52
15	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	180,000	11,726.88	25,183,106	11,890.6850	25,953,559	2.0000	2026.01.15	3.08

16	イギリス	国債証券	TSY I/L STOC	50,000	47,297.55	23,648,775	48,573.3600	24,286,680	7.8344	2020.04.16	2.88
17	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	200,000	10,804.67	23,461,823	10,810.7549	23,860,849	1.2500	2020.07.15	2.83
18	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	200,000	10,734.89	23,238,943	10,769.2800	23,696,939	1.1250	2021.01.15	2.81
19	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	200,000	10,532.65	22,131,862	10,625.5000	22,692,668	0.6250	2021.07.15	2.69
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000	12,419.72	21,779,223	12,341.5032	21,838,338	2.3500	2019.09.15	2.59
21	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	100,000	13,739.17	20,113,488	13,992.4800	20,821,089	3.6250	2028.04.15	2.47
22	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	120,000	14,317.36	18,184,031	14,878.5000	19,068,107	1.8500	2027.07.25	2.26
23	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	130,000	12,780.66	17,883,766	12,962.8293	18,262,836	1.1000	2022.07.25	2.16
24	イギリス	国債証券	TSY I/L GILT	70,000	18,248.30	15,262,658	21,183.4860	17,986,749	1.2500	2032.11.22	2.13
25	カナダ	国債証券	CANADA-GOV'T REAL RETURN	100,000	12,189.19	17,132,193	12,307.4967	17,362,184	4.0000	2031.12.01	2.06
26	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	120,000	12,230.41	15,558,842	12,179.3984	15,629,724	1.3000	2019.07.25	1.85
27	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	100,000	12,628.87	13,834,751	13,536.6500	15,073,195	2.1250	2040.02.15	1.79
28	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	100,000	10,942.19	12,134,671	10,861.7100	12,243,102	1.8750	2019.07.15	1.45
29	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	100,000	10,765.23	11,788,255	10,742.0250	11,955,444	1.3750	2020.01.15	1.41
30	イギリス	国債証券	TSY I/L GILT	60,000	14,961.51	9,809,424	17,065.8285	11,359,083	0.1250	2029.03.22	1.34

(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。

外貨建資産の単価及び金額は、平成28年9月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

物価連動国債の単価は、連動係数を考慮しております。また、利金調整方式を採用している銘柄については、物価連動指数を考慮した利率を表示しております。

ロ.種類別投資比率

(平成28年9月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	99.28
合計	99.28

【投資不動産物件】

海外物価連動国債ファンド(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

(参考)海外物価連動国債マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

海外物価連動国債ファンド(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

（参考）海外物価連動国債マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）

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4特定期間末（平成19年 3月20日）	635,272,481	636,915,140	0.9282	0.9306
第5特定期間末（平成19年 9月20日）	384,198,265	386,174,555	0.9137	0.9184
第6特定期間末（平成20年 3月21日）	332,105,209	333,774,941	0.9547	0.9595
第7特定期間末（平成20年 9月22日）	271,733,443	272,497,756	0.9244	0.9270
第8特定期間末（平成21年 3月23日）	215,286,215	215,839,259	0.8953	0.8976
第9特定期間末（平成21年 9月24日）	190,205,127	191,096,802	0.9172	0.9215
第10特定期間末（平成22年 3月23日）	207,065,439	207,509,949	0.9317	0.9337
第11特定期間末（平成22年 9月21日）	199,453,645	200,246,143	0.9564	0.9602
第12特定期間末（平成23年 3月22日）	189,913,917	190,627,200	0.9585	0.9621
第13特定期間末（平成23年 9月20日）	98,113,140	99,549,560	0.9904	1.0049
第14特定期間末（平成24年 3月21日）	135,861,938	135,999,174	0.9900	0.9910
第15特定期間末（平成24年 9月20日）	118,843,874	120,012,472	0.9966	1.0064
第16特定期間末（平成25年 3月21日）	80,021,847	81,075,114	0.9953	1.0084
第17特定期間末（平成25年 9月20日）	74,737,490	74,809,559	0.9333	0.9342
第18特定期間末（平成26年 3月20日）	66,281,307	66,484,927	0.9440	0.9469
第19特定期間末（平成26年 9月22日）	69,973,500	70,168,919	0.9668	0.9695
第20特定期間末（平成27年 3月20日）	73,425,448	74,928,586	0.9965	1.0169
第21特定期間末（平成27年 9月24日）	71,481,878	71,533,833	0.9631	0.9638
第22特定期間末（平成28年 3月22日）	70,642,380	70,845,760	0.9726	0.9754
第23特定期間末（平成28年 9月20日）	71,455,388	72,613,084	1.0061	1.0224
平成27年 9月末日	71,317,406		0.9607	
10月末日	70,366,128		0.9611	
11月末日	70,380,024		0.9678	
12月末日	68,795,950		0.9483	
平成28年 1月末日	69,809,422		0.9619	
2月末日	69,881,545		0.9625	
3月末日	70,743,071		0.9740	
4月末日	69,868,162		0.9621	
5月末日	70,668,990		0.9725	

6月末日	73,315,108		1.0056
7月末日	72,146,534		1.0093
8月末日	74,649,946		1.0440
9月末日	73,058,108		1.0269

【分配の推移】

海外物価連動国債ファンド(為替ヘッジあり)

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第4特定期間	平成18年 9月21日～平成19年 3月20日	0.0048
第5特定期間	平成19年 3月21日～平成19年 9月20日	0.0067
第6特定期間	平成19年 9月21日～平成20年 3月21日	0.0093
第7特定期間	平成20年 3月22日～平成20年 9月22日	0.0053
第8特定期間	平成20年 9月23日～平成21年 3月23日	0.0046
第9特定期間	平成21年 3月24日～平成21年 9月24日	0.0068
第10特定期間	平成21年 9月25日～平成22年 3月23日	0.0061
第11特定期間	平成22年 3月24日～平成22年 9月21日	0.0078
第12特定期間	平成22年 9月22日～平成23年 3月22日	0.0056
第13特定期間	平成23年 3月23日～平成23年 9月20日	0.0181
第14特定期間	平成23年 9月21日～平成24年 3月21日	0.0077
第15特定期間	平成24年 3月22日～平成24年 9月20日	0.0256
第16特定期間	平成24年 9月21日～平成25年 3月21日	0.0216
第17特定期間	平成25年 3月22日～平成25年 9月20日	0.0017
第18特定期間	平成25年 9月21日～平成26年 3月20日	0.0037
第19特定期間	平成26年 3月21日～平成26年 9月22日	0.0058
第20特定期間	平成26年 9月23日～平成27年 3月20日	0.0235
第21特定期間	平成27年 3月21日～平成27年 9月24日	0.0015
第22特定期間	平成27年 9月25日～平成28年 3月22日	0.0035
第23特定期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月20日	0.0190

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

【収益率の推移】

海外物価連動国債ファンド(為替ヘッジあり)

期	計算期間	収益率(%)
第4特定期間	平成18年 9月21日～平成19年 3月20日	2.1
第5特定期間	平成19年 3月21日～平成19年 9月20日	0.8
第6特定期間	平成19年 9月21日～平成20年 3月21日	5.5
第7特定期間	平成20年 3月22日～平成20年 9月22日	2.6

第8特定期間	平成20年 9月23日～平成21年 3月23日	2.7
第9特定期間	平成21年 3月24日～平成21年 9月24日	3.2
第10特定期間	平成21年 9月25日～平成22年 3月23日	2.2
第11特定期間	平成22年 3月24日～平成22年 9月21日	3.5
第12特定期間	平成22年 9月22日～平成23年 3月22日	0.8
第13特定期間	平成23年 3月23日～平成23年 9月20日	5.2
第14特定期間	平成23年 9月21日～平成24年 3月21日	0.7
第15特定期間	平成24年 3月22日～平成24年 9月20日	3.3
第16特定期間	平成24年 9月21日～平成25年 3月21日	2.0
第17特定期間	平成25年 3月22日～平成25年 9月20日	6.1
第18特定期間	平成25年 9月21日～平成26年 3月20日	1.5
第19特定期間	平成26年 3月21日～平成26年 9月22日	3.0
第20特定期間	平成26年 9月23日～平成27年 3月20日	5.5
第21特定期間	平成27年 3月21日～平成27年 9月24日	3.2
第22特定期間	平成27年 9月25日～平成28年 3月22日	1.3
第23特定期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月20日	5.4

(注)収益率は各特定期間における騰落率を表示しており、当該特定期間中の分配金合計額を加算して計算しています。

(4)【設定及び解約の実績】

海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第4特定期間	平成18年 9月21日～平成19年 3月20日	1,708,755	356,630,000
第5特定期間	平成19年 3月21日～平成19年 9月20日	160,000	264,114,053
第6特定期間	平成19年 9月21日～平成20年 3月21日	1,233,589	73,860,000
第7特定期間	平成20年 3月22日～平成20年 9月22日	12,069,077	65,963,234
第8特定期間	平成20年 9月23日～平成21年 3月23日	678,469	54,191,155
第9特定期間	平成21年 3月24日～平成21年 9月24日	787,219	33,874,941
第10特定期間	平成21年 9月25日～平成22年 3月23日	24,933,660	10,044,704
第11特定期間	平成22年 3月24日～平成22年 9月21日	2,690,239	16,393,363
第12特定期間	平成22年 9月22日～平成23年 3月22日	3,990,669	14,408,411
第13特定期間	平成23年 3月23日～平成23年 9月20日	5,124,808	104,195,737
第14特定期間	平成23年 9月21日～平成24年 3月21日	51,574,727	13,401,607
第15特定期間	平成24年 3月22日～平成24年 9月20日	55,017,273	73,009,100
第16特定期間	平成24年 9月21日～平成25年 3月21日	6,854,841	45,697,515
第17特定期間	平成25年 3月22日～平成25年 9月20日	5,311,943	5,636,989
第18特定期間	平成25年 9月21日～平成26年 3月20日	1,995,548	11,858,755
第19特定期間	平成26年 3月21日～平成26年 9月22日	2,886,480	722,855
第20特定期間	平成26年 9月23日～平成27年 3月20日	5,758,771	4,452,979
第21特定期間	平成27年 3月21日～平成27年 9月24日	3,789,165	3,249,941
第22特定期間	平成27年 9月25日～平成28年 3月22日	236,972	1,823,692

第23特定期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月20日	2,201,375	3,812,799
---------	-------------------------	-----------	-----------

参考情報

運用実績

2016年9月30日現在

<基準価額・純資産の推移> (2006年10月2日～2016年9月30日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控後の価額です。税金等の費用・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す。実際の基準価額とは異なります。
 ※ベンチマークはブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス(G7除く日本、円ヘッジベース)です。当ファンドの設定時を10,000として増数化しています。
 ※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9月	163円
2016年6月	27円
2016年3月	28円
2015年12月	7円
2015年9月	7円
設定来累計	2,207円

※分配は1万円当たり・税引前の金額です。
 ※分配の推移は、前回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
債券現物	97.04%
その他資産	2.96%
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。

外貨建て有価証券の通貨別配分(海外物価連動国債マザーファンド)

通貨	純資産比率
米ドル	47.24%
英ポンド	30.78%
ユーロ	18.76%
カナダドル	2.47%
-	-
合計	99.28%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

組入上位10銘柄(海外物価連動国債マザーファンド)

銘柄名	借入日	利率	通貨	純資産比率
TSY INFL IX N/B	2018/01/15	1.625%	米ドル	6.54%
TSY I/L GILT	2055/11/22	1.250%	英ポンド	5.22%
TSY INFL IX N/B	2029/04/15	3.875%	米ドル	5.07%
TSY INFL IX N/B	2025/01/15	2.375%	米ドル	4.57%
BUONI POLIENNALI DEL TES	2035/09/15	2.350%	ユーロ	4.57%
TSY I/L GILT	2062/03/22	0.375%	英ポンド	4.45%
TSY I/L STOC	2024/07/17	6.709%	英ポンド	4.04%
TSY INFL IX N/B	2023/01/15	0.125%	米ドル	3.82%
TSY INFL IX N/B	2043/02/15	0.625%	米ドル	3.80%
TSY I/L GILT	2037/11/22	1.125%	英ポンド	3.61%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

組入銘柄数:34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。
 ※ベンチマークはブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス(G7除く日本、円ヘッジベース)です。
 ※2016年については、年初から9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額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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 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23期特定期間（平成28年3月23日から平成28年9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】

【海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）】

(1)【貸借対照表】

	第22期特定期間末 平成28年 3月22日現在	第23期特定期間末 平成28年 9月20日現在
（単位：円）		
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,308,661	-
コール・ローン	-	2,469,856
親投資信託受益証券	68,969,291	69,903,664
派生商品評価勘定	758,468	514,538
流動資産合計	71,036,420	72,888,058
資産合計	71,036,420	72,888,058
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14	73,563
未払収益分配金	203,380	1,157,696
未払受託者報酬	7,570	7,996
未払委託者報酬	181,670	191,844
未払利息	-	4
その他未払費用	1,406	1,567
流動負債合計	394,040	1,432,670
負債合計	394,040	1,432,670
純資産の部		
元本等		
元本	72,635,750	71,024,326
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,993,370	431,062
（分配準備積立金）	388,134	1,037,192
元本等合計	70,642,380	71,455,388
純資産合計	70,642,380	71,455,388
負債純資産合計	71,036,420	72,888,058

(2)【損益及び剰余金計算書】

	第22期特定期間 自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月22日	第23期特定期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9月20日
営業収益		
受取利息	54	-
有価証券売買等損益	4,299,660	3,735,627
為替差損益	5,610,884	7,928,966
営業収益合計	1,311,278	4,193,339
営業費用		
支払利息	-	173
受託者報酬	14,892	15,526
委託者報酬	357,381	372,545
その他費用	2,711	13,786
営業費用合計	374,984	402,030
営業利益	936,294	3,791,309
経常利益	936,294	3,791,309
当期純利益	936,294	3,791,309
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	6,100	99,982
期首剰余金又は期首欠損金()	2,740,592	1,993,370
剰余金増加額又は欠損金減少額	68,097	98,988
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	68,097	63,630
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	35,358
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,119	10,994
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,119	10,994
分配金	254,150	1,354,889
期末剰余金又は期末欠損金()	1,993,370	431,062

(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23期特定期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 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 前特定期間終了日に該当する日が休業日のため、当特定期間は平成28年 3月23日から平成28年 9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22期特定期間末 平成28年 3月22日現在	第23期特定期間末 平成28年 9月20日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 72,635,750口	1. 特定期間末日における受益権の総数 71,024,326口

2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,993,370円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 -
3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9726円 (1万口当たり純資産額) (9,726円)	3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0061円 (1万口当たり純資産額) (10,061円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第22期特定期間 自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月22日	第23期特定期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9月20日
分配金の計算過程	<p>第43期(自 平成27年 9月25日 至 平成27年12月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(51,368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(1,269,516円)及び分配準備積立金(380,418円)より分配対象収益は1,701,302円(1万口当たり234.55円)であり、うち50,770円(1万口当たり7円)を分配しております。</p> <p>第44期(自 平成27年12月22日 至 平成28年 3月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(210,508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(1,272,040円)及び分配準備積立金(381,006円)より分配対象収益は1,863,554円(1万口当たり256.54円)であり、うち203,380円(1万口当たり28円)を分配しております。</p>	<p>第45期(自 平成28年 3月23日 至 平成28年 6月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(199,158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(1,282,070円)及び分配準備積立金(387,634円)より分配対象収益は1,868,862円(1万口当たり255.86円)であり、うち197,193円(1万口当たり27円)を分配しております。</p> <p>第46期(自 平成28年 6月21日 至 平成28年 9月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(218,752円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,605,299円)、信託約款に定める収益調整金(1,257,321円)及び分配準備積立金(370,837円)より分配対象収益は3,452,209円(1万口当たり486.04円)であり、うち1,157,696円(1万口当たり163円)を分配しております。</p>

(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22期特定期間 自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月22日	第23期特定期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p> <p>また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左

2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>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、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。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
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> <p>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又は計算上の想定元本であり、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。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

第22期特定期間末 平成28年 3月22日現在	第23期特定期間末 平成28年 9月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	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 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。 派生商品評価勘定 「(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。	同左 2.時価の算定方法 同左
---	-------------------------------

(関連当事者との取引に関する注記)

	第22期特定期間 自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月22日	第23期特定期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9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22期特定期間末 平成28年 3月22日現在	第23期特定期間末 平成28年 9月20日現在
期首元本額	74,222,470円	72,635,750円
期中追加設定元本額	236,972円	2,201,375円
期中一部解約元本額	1,823,692円	3,812,799円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第22期特定期間末 平成28年 3月22日現在	第23期特定期間末 平成28年 9月20日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	3,876,226	1,047,616
合計	3,876,226	1,047,616

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

種類	第22期特定期間末 平成28年 3月22日現在				第23期特定期間末 平成28年 9月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	67,537,315	-	66,778,861	758,454	69,565,202	-	69,124,227	440,975
米ドル	31,130,181	-	30,638,680	491,501	33,055,827	-	33,129,390	73,563
カナダドル	260,547	-	260,561	14	1,730,154	-	1,711,842	18,312
ユーロ	14,404,082	-	14,337,780	66,302	13,027,395	-	12,976,620	50,775
英ポンド	21,742,505	-	21,541,840	200,665	21,751,826	-	21,306,375	445,451
合計	67,537,315	-	66,778,861	758,454	69,565,202	-	69,124,227	440,975

時価の算定方法

為替予約取引

1) 期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。

期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、当該仲値で評価しております。

期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。

- ・ 期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売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期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、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2) 期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、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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。

(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	海外物価連動国債マザーファンド	46,978,269	69,903,664	
合計		46,978,269	69,903,664	

(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

「注記表(デリバティブ取引等関係)」に記載しております。

(参考)

当ファンドは、「海外物価連動国債マザーファンド」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。

海外物価連動国債マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成28年 3月22日現在	平成28年 9月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	17,209,043	-
コール・ローン	-	4,598,425
国債証券	933,594,360	821,341,583
未収入金	-	3,158,634
未収利息	2,674,444	2,264,602
前払費用	404,350	70,200
流動資産合計	953,882,197	831,433,444
資産合計	953,882,197	831,433,444
負債の部		
流動負債		
前受金	-	2,132,012
未払利息	-	9
流動負債合計	-	2,132,021
負債合計	-	2,132,021
純資産の部		
元本等		
元本	606,854,625	557,333,465
剰余金		
剰余金又は欠損金()	347,027,572	271,967,958
元本等合計	953,882,197	829,301,423
純資産合計	953,882,197	829,301,423
負債純資産合計	953,882,197	831,433,444

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 3月23日 至 平成28年 9月20日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）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	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。	
3. 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 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。	

（貸借対照表に関する注記）

平成28年 3月22日現在		平成28年 9月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数	606,854,625口	1. 計算日における受益権の総数	557,333,465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	1.5718円	1口当たり純資産額	1.4880円
(1万口当たり純資産額)	(15,718円)	(1万口当たり純資産額)	(14,880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27年 9月25日 至 平成28年 3月22日	自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9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。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。

区分	自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月22日	自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9月20日
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、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。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
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> <p>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又は計算上の想定元本であり、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。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成28年 3月22日現在	平成28年 9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</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>国債証券</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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27年 9月25日 至 平成28年 3月22日	自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9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28年 3月22日現在	平成28年 9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	619,186,849円	606,854,625円
期中追加設定元本額	20,410,079円	10,658,844円
期中一部解約元本額	32,742,303円	60,180,004円
同期末における元本の内訳		
海外物価連動国債ファンド(為替ヘッジなし)	562,975,447円	510,355,196円
海外物価連動国債ファンド(為替ヘッジあり)	43,879,178円	46,978,269円
合計	606,854,625円	557,333,465円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成28年 3月22日現在	平成28年 9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)
国債証券	10,518,141	49,643,542
合計	10,518,141	49,643,542

(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

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	TSY INFL IX N/B-1.625%-18/01/15	460,000.00	543,778.51	
		TSY INFL IX N/B-1.875%-19/07/15	100,000.00	120,567.79	
		TSY INFL IX N/B-1.375%-20/01/15	100,000.00	117,602.37	
		TSY INFL IX N/B-1.25%-20/07/15	200,000.00	234,515.35	
		TSY INFL IX N/B-1.125%-21/01/15	200,000.00	232,673.00	
		TSY INFL IX N/B-0.625%-21/07/15	200,000.00	222,571.50	
		TSY INFL IX N/B-0.125%-22/07/15	100,000.00	106,133.36	
		TSY INFL IX N/B-0.125%-23/01/15	300,000.00	314,622.43	
		TSY INFL IX N/B-2.375%-25/01/15	250,000.00	375,923.88	
		TSY INFL IX N/B-2.0%-26/01/15	180,000.00	252,908.59	
		TSY INFL IX N/B-3.625%-28/04/15	100,000.00	202,486.69	
		TSY INFL IX N/B-3.875%-29/04/15	200,000.00	415,293.68	
		TSY INFL IX N/B-2.125%-40/02/15	100,000.00	144,564.47	
		TSY INFL IX N/B-2.125%-41/02/15	200,000.00	287,777.34	
		TSY INFL IX N/B-0.625%-43/02/15	300,000.00	305,106.69	
米ドル建小計			2,990,000.00	3,876,525.65 (395,211,790)	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T REAL RETURN-4.0%-31/12/01	100,000.00	221,666.48	
		CANADA-GOV'T REAL RETURN-1.5%-44/12/01	30,000.00	43,915.86	
カナダドル建小計			130,000.00	265,582.34 (20,508,268)	
ユーロ	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES-2.35%-19/09/15	160,000.00	192,533.02	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-26/09/15	200,000.00	266,332.84	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.35%-35/09/15	220,000.00	333,795.16	
		DEUTSCHLAND I/L BOND-1.75%-20/04/15	30,000.00	36,393.07	
		DEUTSCHLAND I/L BOND-0.1%-23/04/15	80,000.00	89,977.83	
		FRANCE (GOVT OF)-1.3%-19/07/25	120,000.00	137,626.92	
		FRANCE (GOVT OF)-1.1%-22/07/25	100,000.00	123,413.11	
		FRANCE (GOVT OF)-1.85%-27/07/25	120,000.00	165,894.35	
ユーロ建小計			1,030,000.00	1,345,966.30	(153,265,182)
英ポンド	国債証券	TSY I/L GILT-0.125%-29/03/22	60,000.00	84,575.22	
		TSY I/L GILT-1.25%-32/11/22	70,000.00	133,335.13	
		TSY I/L GILT-1.125%-37/11/22	100,000.00	223,714.33	
		TSY I/L GILT-0.625%-42/11/22	100,000.00	215,875.80	
		TSY I/L GILT-0.5%-50/03/22	90,000.00	215,512.04	
		TSY I/L GILT-1.25%-55/11/22	90,000.00	318,582.59	
		TSY I/L GILT-0.375%-62/03/22	100,000.00	266,814.01	
		TSY I/L STOC-7.8344%-20/04/16	50,000.00	184,310.50	
		TSY I/L STOC-6.7088%-24/07/17	70,000.00	256,410.00	
英ポンド建小計			730,000.00	1,899,129.62	(252,356,343)
合計				821,341,583	(821,341,583)

有価証券明細表注記

- 小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	債券 15銘柄	47.7%	48.1%
カナダドル	債券 2銘柄	2.5%	2.5%
ユーロ	債券 8銘柄	18.5%	18.7%
英ポンド	債券 9銘柄	30.4%	30.7%

（注1）組入債券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

（注2）有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）

（平成28年 9月30日現在）

資産総額	73,080,057円
負債総額	21,949円
純資産総額（ - ）	73,058,108円
発行済口数	71,143,767口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0269円
（1万口当たり純資産額）	（10,269円）

（参考）海外物価連動国債マザーファンド

（平成28年 9月30日現在）

資産総額	841,965,062円
負債総額	6円
純資産総額（ - ）	841,965,056円
発行済口数	558,681,481口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5071円
（1万口当たり純資産額）	（15,071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9月30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	393	5,864,442,125,905
単位型公社債投資信託	49	337,748,656,746
単位型株式投資信託	9	88,382,773,408
合計	451	6,290,573,556,059

（ご参考）

平成28年9月30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	275,632,843,628
追加型株式投資信託	229	2,280,959,186,831
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,454,591,074
合計	245	2,558,046,621,533

・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	651,056,923,166
追加型株式投資信託	240	3,084,756,237,399
単位型公社債投資信託	7	42,284,286,781
単位型株式投資信託	79	290,858,982,767
合計	351	4,068,956,430,113

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>

委託者は、三津井証券株式会社の株式の5.7%を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託者の株式または委託者が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が5.0%以上のものを記載しています。(平成28年10月1日現在(予定))

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
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(日本マスタートラスト信託銀行株式会社)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>

委託者は、三津井証券株式会社の株式の5.7%を所有しています。

(注)関係法人が所有する委託者の株式または委託者が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が5.0%以上のものを記載しています。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

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(日本マスタートラスト信託銀行株式会社)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。

独立監査人の監査報告書

平成28年11月1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」に掲げられている海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）の平成28年3月23日から平成28年9月20日までの特定期間の財務諸表、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、海外物価連動国債ファンド（為替ヘッジあり）の平成28年9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特定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

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、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。