

## 【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 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	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】	みずほラップファンド（堅実型コース） みずほラップファンド（安定成長型コース） みずほラップファンド（成長型コース）
【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) みずほラップファンド（堅実型コース） 3兆円を上限とします。 みずほラップファンド（安定成長型コース） 3兆円を上限とします。 みずほラップファンド（成長型コース） 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】

&lt;訂正前&gt;

(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)

&lt;訂正後&gt;

(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】

&lt;訂正前&gt;

(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。

&lt;訂正後&gt;

(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/>

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

各コースは、追加型投信／内外／資産複合に属し、主としてマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」という場合があります。）に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

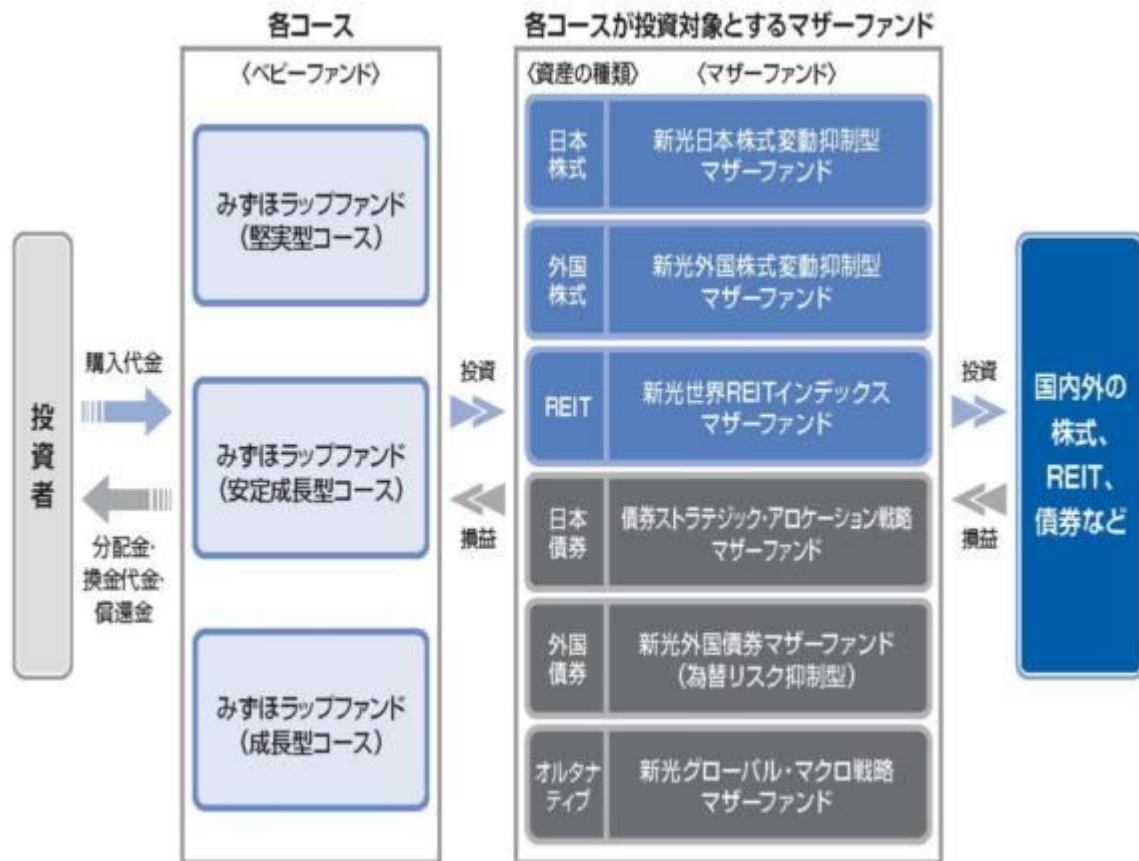
各コースは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において、以下のように分類・区分されます。

（略）

## ファンドの仕組み

各コースの運用は「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（各コース）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。



債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンドの投資対象には為替ヘッジ付外国債券を含みません。

## b. ファンドの特色

(略)

### (参考)各コースが投資するマザーファンドの運用方針

(略)

上記の各マザーファンドの運用方針は、各マザーファンドの内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、記載内容は平成28年10月1日現在（予定）のものであり、今後変更になる場合があります。

## 主な投資制限

株式などへの投資割合	株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。
同一銘柄の株式などへの投資割合	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10%以下とします。 同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
デリバティブの利用	デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
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、各コースにつき金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

各コースは、追加型投信／内外／資産複合に属し、主としてマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」という場合があります。）に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

委託者は、受託者と合意のうえ、各コースにつき金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。

各コースは、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）

## （参考）各コースが投資するマザーファンドの運用方針

（略）

上記の各マザーファンドの運用方針は、各マザーファンドの内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、記載内容は平成28年12月22日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

## 分配方針

（略）

### （2）【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成27年3月6日

平成27年3月31日

関東財務局長に対して有価証券届出書提出

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)

&lt;訂正後&gt;

平成27年3月6日

関東財務局長に対して有価証券届出書提出

平成27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

&lt;訂正前&gt;

(略)

## 3 投資顧問契約

委託者と投資顧問会社との間において「投資顧問契約」を締結しており、投資顧問会社が提供する役務、委託者への報告、投資顧問会社に対する報酬、契約の期間等を規定しています。

&lt;訂正後&gt;

(略)

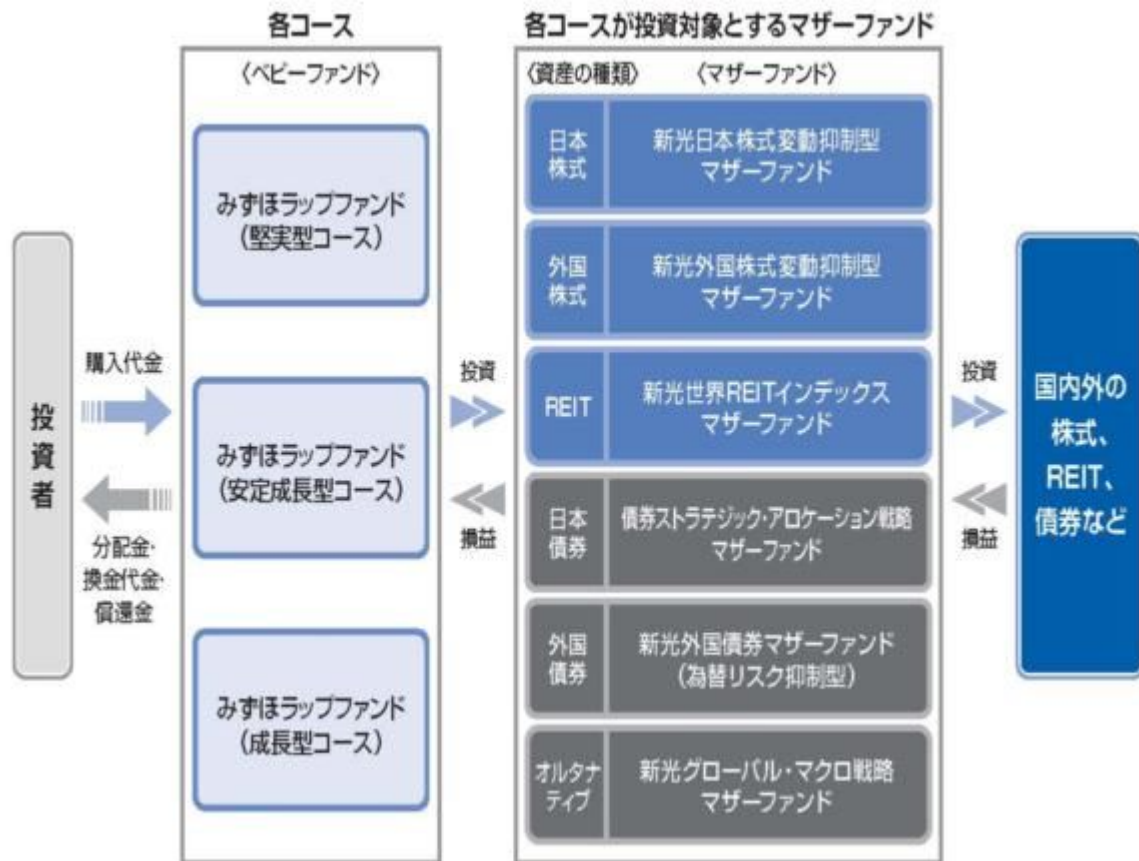
## 3 投資顧問契約

委託者と投資顧問会社との間において「投資顧問契約」を締結しており、投資顧問会社が提供する役務、委託者への報告、投資顧問会社に対する報酬、契約の期間等を規定しています。

各コースの運用は「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(各コース)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。





債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンドの投資対象には為替ヘッジ付外国債券を含みません。

## 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】

&lt;訂正前&gt;

## a．基本方針

各コースは、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

## b．運用の方法

## （イ）主要投資対象

新光日本株式変動抑制型マザーファンド受益証券、新光外国株式変動抑制型マザーファンド受益証券、債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド受益証券、新光外国債券マザーファンド（為替リスク抑制型）受益証券、新光世界REITインデックスマザーファンド受益証券、新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

## （ロ）投資態度

## &lt;堅実型コース&gt;

主としてマザーファンド受益証券への投資を通じ、わが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券等に実質的に分散投資を行い、投資信託財産の安定的な成長を重視した運用を行います。

## &lt;安定成長型コース&gt;

主としてマザーファンド受益証券への投資を通じ、わが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券等に実質的に分散投資を行い、投資信託財産の着実な成長を重視した運用を行います。

## &lt;成長型コース&gt;

主としてマザーファンド受益証券への投資を通じ、わが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券等に実質的に分散投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を重視した運用を行います。

## &lt;各コース共通&gt;

投資対象のマザーファンドは以下の通りとします。

内国証券投資信託（親投資信託）	新光日本株式変動抑制型マザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光外国株式変動抑制型マザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光外国債券マザーファンド（為替リスク抑制型）受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光世界REITインデックスマザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド受益証券

各マザーファンド受益証券への投資比率は、各コース全体のリスク水準と各マザーファンドのリスク特性等を勘案して決定します。

各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、債券先物取引等を利用す

ることがあります。

各マザーファンド受益証券への投資比率の決定にあたっては、みずほ証券株式会社から投資助言および情報提供を受けます。

各コースの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、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

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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10%以下とします。

同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券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。

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。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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。

（略）

#### <訂正後>

##### a．基本方針

各コースは、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

##### b．運用の方法

##### （イ）主要投資対象

新光日本株式変動抑制型マザーファンド受益証券、新光外国株式変動抑制型マザーファンド受益証券、債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド受益証券、新光外国債券マザーファンド（為替リスク抑制型）受益証券、新光世界REITインデックスマザーファンド受益証券、新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

##### （ロ）投資態度

##### <堅実型コース>

主としてマザーファンド受益証券への投資を通じ、わが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券等に実質的に分散投資を行い、投資信託財産の安定的な成長を重視した運用を行います。

##### <安定成長型コース>

主としてマザーファンド受益証券への投資を通じ、わが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券等に実質的に分散投資を行い、投資信託財産の着実な成長を重視した運用を行います。

<成長型コース>

主としてマザーファンド受益証券への投資を通じ、わが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券等に実質的に分散投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を重視した運用を行います。

<各コース共通>

投資対象のマザーファンドは以下の通りとします。

内国証券投資信託(親投資信託)	新光日本株式変動抑制型マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光外国株式変動抑制型マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光世界REITインデックスマザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド受益証券

各マザーファンド受益証券への投資比率は、各コース全体のリスク水準と各マザーファンドのリスク特性等を勘案して決定します。

各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

各マザーファンド受益証券への投資比率の決定にあたっては、みずほ証券株式会社から投資助言および情報提供を受けます。

各コースの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(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。

## (5)【投資制限】

<訂正前>

投資信託約款に定める投資制限

(略)

### p. 信用リスク集中回避のための投資制限

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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

法令に定める投資制限

### a. 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

<訂正後>

投資信託約款に定める投資制限

(略)

### p. 信用リスク集中回避のための投資制限

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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

### q. デリバティブの利用

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

法令に定める投資制限

### a. 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

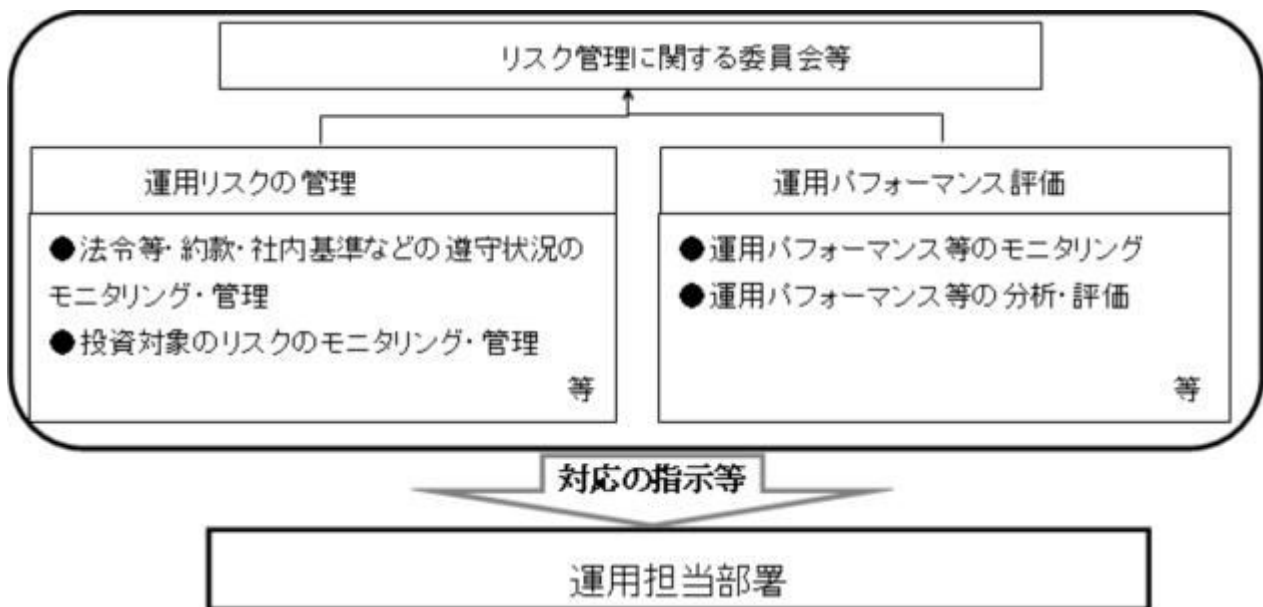
## 3【投資リスク】

### (2) リスク管理体制

## &lt;更新後&gt;

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

## &lt;参考情報&gt;

## 堅実型コース

## 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、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

※ 年間騰落率は、2016年3月から2016年9月の各月末における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。

## 安定成長型コース

## 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



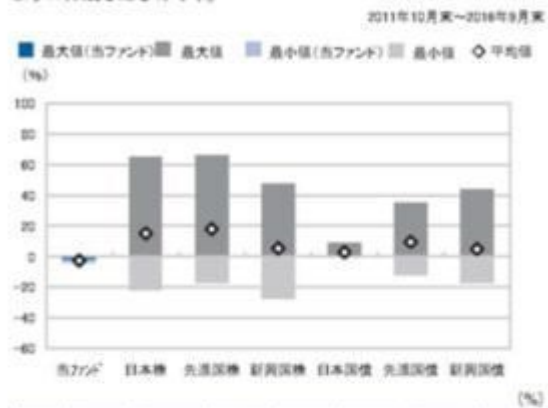
※ 分配金再投資基準価額は、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

※ 年間騰落率は、2016年3月から2016年9月の各月末における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	△1.2	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△3.9	△22.0	△17.5	△27.4	0.5	△12.3	△17.4
平均値	△2.7	15.0	17.8	5.3	3.0	9.6	4.9

※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。

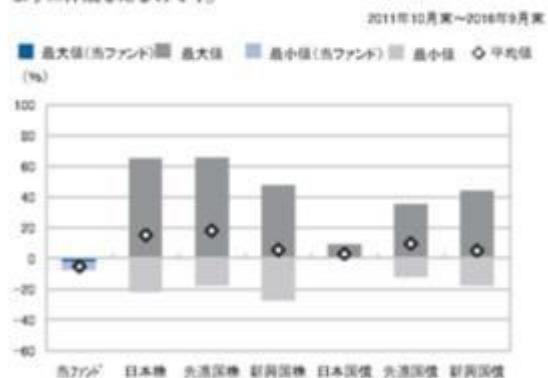
※2011年10月から2016年9月の5年間の当ファンドは2016年3月から2016年9月の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

※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。

## 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	△1.6	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△7.7	△22.0	△17.5	△27.4	0.5	△12.3	△17.4
平均値	△5.2	15.0	17.8	5.3	3.0	9.6	4.9

※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年間の当ファンドは2016年3月から2016年9月の各月末における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。



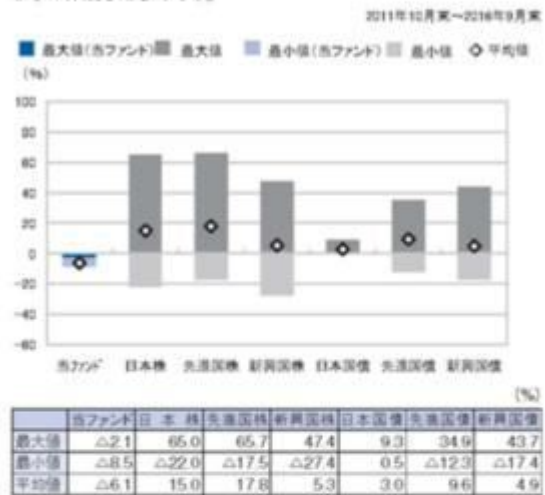
## 成長型コース

## 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



## 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。



分配金再投資基準価額は、算出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。

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いたしません。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、当該騰落率に關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債務について、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に關する著作権、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に關する著作権、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に關する著作権、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国債に關する著作権、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關する著作権、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・ディバーシファイドに關する著作権、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】



&lt;訂正前&gt;

(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。

&lt;訂正後&gt;

(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】

## みずほラップファンド(堅実型コース)

(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	3,257,572,018	99.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,094,197	0.58
純資産総額		3,276,666,215	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。

## みずほラップファンド(安定成長型コース)

(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	5,309,207,302	98.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		90,375,454	1.67
純資産総額		5,399,582,756	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。

## みずほラップファンド(成長型コース)

(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	2,171,682,122	98.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		30,691,502	1.39
純資産総額		2,202,373,624	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) 新光日本株式変動抑制型マザーファンド

(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(%)
株式	日本	1,385,556,590	98.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23,880,543	1.69
純資産総額		1,409,437,133	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) 新光外国株式変動抑制型マザーファンド

(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(%)
株式	アメリカ	822,942,691	43.76
	カナダ	147,903,185	7.86
	ドイツ	46,103,670	2.45
	オランダ	13,317,830	0.70
	スペイン	4,879,207	0.25
	ベルギー	14,050,745	0.74
	イギリス	8,030,719	0.42
	スイス	111,678,711	5.93
	オーストラリア	67,599,425	3.59
	バミューダ諸島	9,640,146	0.51
	ニュージーランド	17,658,847	0.93
	香港	127,844,486	6.79
	シンガポール	105,212,690	5.59
	イスラエル	34,225,288	1.82
	小計	1,531,087,640	81.42
投資証券	アメリカ	156,778,662	8.33
	オーストラリア	30,986,813	1.64
	香港	18,226,334	0.96
	シンガポール	36,433,642	1.93
	小計	242,425,451	12.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		106,952,116	5.68

純資産総額	1,880,465,207	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)債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド

(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	日本	30,454,817,200	52.49
社債券	日本	11,335,485,454	19.53
	アメリカ	201,220,000	0.34
	フランス	511,385,356	0.88
	オランダ	100,590,000	0.17
	小計	12,148,680,810	20.94
投資信託受益証券	アメリカ	4,297,987,289	7.40
	アイルランド	1,435,011,487	2.47
	小計	5,732,998,776	9.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,677,537,693	16.68
純資産総額		58,014,034,479	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)新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)

(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	1,297,463,824	42.75
	カナダ	62,046,756	2.04
	メキシコ	25,455,569	0.83
	ドイツ	225,132,984	7.41
	イタリア	291,407,411	9.60
	フランス	305,205,115	10.05
	オランダ	70,721,449	2.33
	スペイン	168,127,502	5.54
	ベルギー	78,180,084	2.57
	オーストリア	47,678,195	1.57
	フィンランド	19,559,247	0.64
	アイルランド	25,616,356	0.84
	イギリス	227,413,647	7.49
	スウェーデン	14,080,835	0.46
	ノルウェー	7,903,096	0.26
	デンマーク	21,686,326	0.71

	ポーランド	17,767,036	0.58
	オーストラリア	59,211,711	1.95
	シンガポール	11,324,159	0.37
	南アフリカ	15,197,442	0.50
	小計	2,991,178,744	98.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		43,265,275	1.42
	純資産総額	3,034,444,019	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) 新光世界REITインデックスマザーファンド

(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(%)
株式	オランダ	2,272,301	0.16
	ニュージーランド	4,669,481	0.34
	小計	6,941,782	0.51
投資証券	日本	117,755,080	8.66
	アメリカ	875,474,005	64.41
	カナダ	22,121,126	1.62
	ドイツ	2,374,382	0.17
	イタリア	920,710	0.06
	フランス	55,932,616	4.11
	オランダ	3,475,447	0.25
	スペイン	7,134,992	0.52
	ベルギー	7,694,232	0.56
	アイルランド	2,866,818	0.21
	イギリス	59,589,358	4.38
	オーストラリア	98,785,984	7.26
	ニュージーランド	1,616,898	0.11
	香港	21,802,880	1.60
	シンガポール	38,761,991	2.85
	イスラエル	624,237	0.04
	ガンジー	683,820	0.05
	マン島	742,864	0.05
	小計	1,318,357,440	97.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		33,808,015	2.48
	純資産総額	1,359,107,237	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) 新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

(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(%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,272,384,584	100.00
純資産総額		3,272,384,584	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】

## みずほラップファンド(堅実型コース)

## 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	債券ストラテジック・アロケー ション戦略マザーファンド	1,203,000,876	1.1038	1,327,872,367	1.1129	1,338,819,674	40.85
2	日本	親投資信託 受益証券	新光グローバル・マクロ戦略マ ザーファンド	781,487,469	0.9834	768,514,778	0.9758	762,575,472	23.27
3	日本	親投資信託 受益証券	新光外国債券マザーファンド(為 替リスク抑制型)	793,715,094	0.9637	764,903,237	0.9569	759,505,973	23.17
4	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式変動抑制型マザー ファンド	166,945,850	0.9612	160,468,352	0.9096	151,853,945	4.63
5	日本	親投資信託 受益証券	新光世界REITインデックスマ ザーファンド	143,545,253	0.9462	135,822,519	0.9123	130,956,334	3.99
6	日本	親投資信託 受益証券	新光日本株式変動抑制型マザー ファンド	118,530,731	0.9582	113,576,147	0.9606	113,860,620	3.47

(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	99.41
合計	99.41

## みずほラップファンド(安定成長型コース)

## 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	債券ストラテジック・アロケー ション戦略マザーファンド	1,358,197,054	1.1044	1,499,992,827	1.1129	1,511,537,501	27.99

2	日本	親投資信託 受益証券	新光外国債券マザーファンド(為 替リスク抑制型)	899,110,389	0.9623	865,213,928	0.9569	860,358,731	15.93
3	日本	親投資信託 受益証券	新光グローバル・マクロ戦略マ ザーファンド	881,310,806	0.9829	866,240,392	0.9758	859,983,084	15.92
4	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式変動抑制型マザー ファンド	871,910,627	0.9612	838,080,495	0.9096	793,089,906	14.68
5	日本	親投資信託 受益証券	新光世界REITインデックスマ ザーファンド	769,132,006	0.9462	727,752,705	0.9123	701,679,129	12.99
6	日本	親投資信託 受益証券	新光日本株式変動抑制型マザー ファンド	606,453,208	0.9582	581,103,464	0.9606	582,558,951	10.78

(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	98.32
合計	98.32

#### みずほラップファンド(成長型コース)

##### 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	債券ストラテジック・アロケー ション戦略マザーファンド	431,290,922	1.1054	476,748,986	1.1129	479,983,667	21.79
2	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式変動抑制型マザー ファンド	478,176,193	0.9612	459,622,957	0.9096	434,949,065	19.74
3	日本	親投資信託 受益証券	新光世界REITインデックスマ ザーファンド	420,613,951	0.9462	397,984,921	0.9123	383,726,107	17.42
4	日本	親投資信託 受益証券	新光日本株式変動抑制型マザー ファンド	341,205,348	0.9582	326,942,965	0.9606	327,761,857	14.88
5	日本	親投資信託 受益証券	新光グローバル・マクロ戦略マ ザーファンド	279,696,895	0.9823	274,746,260	0.9758	272,928,230	12.39
6	日本	親投資信託 受益証券	新光外国債券マザーファンド(為 替リスク抑制型)	284,599,432	0.9603	273,300,835	0.9569	272,333,196	12.36

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。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	98.60
合計	98.60

(参考)新光日本株式変動抑制型マザーファンド

##### 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	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	森永乳業	食料品	20,000	591.00	11,820,000	807.00	16,140,000	1.14
2	日本	株式	久光製薬	医薬品	2,800	5,053.94	14,151,032	5,430.00	15,204,000	1.07
3	日本	株式	ローソン	小売業	1,900	9,218.42	17,515,000	7,970.00	15,143,000	1.07
4	日本	株式	雪印メグミルク	食料品	4,100	2,739.21	11,230,761	3,685.00	15,108,500	1.07
5	日本	株式	田辺三菱製薬	医薬品	7,000	2,056.00	14,392,000	2,155.00	15,085,000	1.07
6	日本	株式	岩谷産業	卸売業	24,000	614.00	14,736,000	622.00	14,928,000	1.05
7	日本	株式	シーズ・ホールディングス	化学	5,100	2,333.89	11,902,839	2,898.00	14,779,800	1.04
8	日本	株式	日本ハム	食料品	6,000	2,520.00	15,120,000	2,436.00	14,616,000	1.03
9	日本	株式	大東建託	建設業	900	16,280.00	14,652,000	16,175.00	14,557,500	1.03
10	日本	株式	アサツー ディ・ケイ	サービス業	5,400	2,566.00	13,856,400	2,680.00	14,472,000	1.02
11	日本	株式	イオンディライト	サービス業	4,700	2,905.00	13,653,500	3,075.00	14,452,500	1.02
12	日本	株式	D C Mホールディングス	小売業	16,600	836.00	13,877,600	867.00	14,392,200	1.02
13	日本	株式	沢井製薬	医薬品	2,000	7,264.72	14,529,444	7,180.00	14,360,000	1.01
14	日本	株式	キョーリン製薬ホールディングス	医薬品	6,300	2,156.02	13,582,926	2,279.00	14,357,700	1.01
15	日本	株式	チヨダ	小売業	5,800	2,384.00	13,827,200	2,474.00	14,349,200	1.01
16	日本	株式	ツムラ	医薬品	5,000	2,728.97	13,644,850	2,865.00	14,325,000	1.01
17	日本	株式	あい ホールディングス	卸売業	5,900	2,913.16	17,187,698	2,425.00	14,307,500	1.01
18	日本	株式	マンダム	化学	3,100	4,572.49	14,174,748	4,615.00	14,306,500	1.01
19	日本	株式	イズミ	小売業	3,300	4,794.22	15,820,944	4,335.00	14,305,500	1.01
20	日本	株式	鳥忠	小売業	5,700	2,659.70	15,160,305	2,506.00	14,284,200	1.01
21	日本	株式	T O K A Iホールディングス	卸売業	22,000	599.95	13,198,900	648.00	14,256,000	1.01
22	日本	株式	科研製薬	医薬品	2,300	5,994.00	13,786,200	6,180.00	14,214,000	1.00
23	日本	株式	大気社	建設業	5,700	2,816.43	16,053,684	2,492.00	14,204,400	1.00
24	日本	株式	コクヨ	その他製品	9,700	1,259.24	12,214,628	1,464.00	14,200,800	1.00
25	日本	株式	メイテック	サービス業	4,000	3,470.00	13,880,000	3,545.00	14,180,000	1.00
26	日本	株式	すかいらーく	小売業	10,400	1,301.00	13,530,400	1,360.00	14,144,000	1.00
27	日本	株式	ホギメディカル	繊維製品	2,000	6,187.35	12,374,700	7,070.00	14,140,000	1.00
28	日本	株式	沖縄電力	電気・ガス業	6,200	1,904.04	11,805,048	2,276.00	14,111,200	1.00
29	日本	株式	パラマウントベッドホールディングス	その他製品	3,700	4,289.84	15,872,415	3,810.00	14,097,000	1.00
30	日本	株式	ビー・エム・エル	サービス業	5,300	2,323.89	12,316,617	2,653.00	14,060,900	0.99

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

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	12.78

	食料品	8.18
	繊維製品	1.97
	パルプ・紙	0.96
	化学	3.05
	医薬品	10.10
	石油・石炭製品	0.99
	ゴム製品	0.98
	ガラス・土石製品	1.24
	非鉄金属	0.94
	機械	1.88
	電気機器	1.90
	その他製品	3.16
	電気・ガス業	5.70
	陸運業	4.66
	空運業	0.94
	情報・通信業	10.42
	卸売業	5.38
	小売業	14.64
	銀行業	0.47
	サービス業	7.87
合計		98.30

（参考）新光外国株式変動抑制型マザーファンド

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	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	アメリカ	株式	F5 NETWORKS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,570	10,416.37	16,353,703	12,478.2082	19,590,787	1.04
2	スイス	株式	SIKA AG-BR	素材	40	389,709.50	15,588,380	485,541.4250	19,421,657	1.03
3	カナダ	株式	DOLLARAMA INC	小売	2,400	7,612.93	18,271,048	8,015.8916	19,238,140	1.02
4	アメリカ	株式	WESTAR ENERGY INC	公益事業	3,300	5,544.17	18,295,776	5,736.5375	18,930,574	1.00
5	カナダ	株式	SAPUTO INC	食品・飲料・タバコ	5,400	3,080.84	16,636,585	3,501.7679	18,909,547	1.00
6	香港	株式	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	公益事業	97,000	192.96	18,717,682	194.8175	18,897,307	1.00
7	オーストラリア	株式	COCA-COLA AMATIL LIMITED	食品・飲料・タバコ	24,120	669.47	16,147,799	781.9559	18,860,778	1.00
8	イスラエル	株式	BANK HAPAOALIM BM	銀行	32,870	527.82	17,349,706	572.5317	18,819,120	1.00
9	アメリカ	株式	KIMBERLY-CLARK CORP	家庭用品・パーソナル用品	1,480	13,593.57	20,118,484	12,662.2466	18,740,125	0.99
10	スイス	株式	SONOVA HOLDING AG-REG	ヘルスケア機器・サービス	1,300	12,575.32	16,347,921	14,374.7876	18,687,224	0.99



11	スイス	株式	ACTELION LTD-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,060	17,170.54	18,200,777	17,618.0075	18,675,088	0.99
12	アメリカ	株式	IMS HEALTH HOLDINGS INC	ヘルスケア機器・サービス	6,080	2,649.34	16,108,011	3,068.9919	18,659,471	0.99
13	アメリカ	株式	CLOROX COMPANY	家庭用品・パーソナル用品	1,480	12,887.74	19,073,861	12,605.6189	18,656,316	0.99
14	香港	株式	HANG SENG BANK LTD	銀行	10,200	1,830.97	18,675,909	1,825.6000	18,621,120	0.99
15	ドイツ	株式	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	家庭用品・パーソナル用品	1,360	13,338.67	18,140,593	13,648.5441	18,562,020	0.98
16	アメリカ	株式	AMEREN CORPORATION	公益事業	3,700	4,860.50	17,983,878	5,015.5518	18,557,542	0.98
17	香港	株式	MTR CORPORATION	運輸	33,000	493.56	16,287,612	562.0240	18,546,792	0.98
18	アメリカ	株式	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	ヘルスケア機器・サービス	1,860	7,964.21	14,813,432	9,964.3645	18,533,718	0.98
19	香港	株式	NEW WORLD DEVELOPMENT	不動産	139,000	99.23	13,793,582	133.2687	18,524,363	0.98
20	カナダ	株式	FORTIS INC	公益事業	5,700	3,154.62	17,981,374	3,249.8310	18,524,037	0.98
21	スイス	株式	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	運輸	1,260	14,176.01	17,861,773	14,699.1103	18,520,879	0.98
22	カナダ	株式	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	電気通信サービス	4,300	3,912.70	16,824,616	4,305.2004	18,512,362	0.98
23	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	730	25,112.31	18,331,991	25,297.1164	18,466,895	0.98
24	オーストラリア	投資証券	GPT GROUP		47,340	377.49	17,870,660	389.8223	18,454,192	0.98
25	香港	株式	HKT TRUST AND HKT LIMITED	電気通信サービス	129,000	142.65	18,402,831	142.9184	18,436,474	0.98
26	アメリカ	株式	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	食品・飲料・タバコ	1,870	9,530.54	17,822,112	9,848.0770	18,415,904	0.97
27	アメリカ	株式	ARAMARK	消費者サービス	4,800	3,771.29	18,102,205	3,832.4479	18,395,750	0.97
28	シンガポール	株式	UNITED OVERSEAS BANK LTD	銀行	13,100	1,386.85	18,167,760	1,403.2296	18,382,308	0.97
29	シンガポール	投資証券	CAPITALAND MALL TRUST		114,400	157.64	18,034,164	160.6016	18,372,834	0.97
30	アメリカ	株式	NISOURCE INC	公益事業	7,500	2,363.50	17,726,289	2,448.1152	18,360,864	0.97

(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。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成28年9月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	素材	2.94
		資本財	3.10
		運輸	4.86
		耐久消費財・アパレル	0.23
		消費者サービス	0.97
		小売	3.48

		食品・生活必需品小売り	3.92
		食品・飲料・タバコ	11.54
		家庭用品・パーソナル用品	4.42
		ヘルスケア機器・サービス	11.14
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.41
		銀行	4.49
		不動産	1.86
		ソフトウェア・サービス	2.79
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.91
		電気通信サービス	4.05
		公益事業	13.22
	投資証券		12.89
	合計		94.31

## (参考) 債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド

## 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	投資信託 受益証券	ISHARES IBOXX INVESTMENT GRA ETF	232,000	12,446.44	2,887,575,076	12,478.2080	2,894,944,256			4.99
2	日本	国債証券	第1回利付国債 (30年)	1,420,000,000	137.84	1,957,351,200	135.67	1,926,613,400	2.8000	2029.09.20	3.32
3	日本	国債証券	第344回利付 国債(10年)	1,500,000,000	101.24	1,518,630,000	101.85	1,527,870,000	0.1000	2026.09.20	2.63
4	日本	国債証券	第305回利付 国債(10年)	1,400,000,000	105.59	1,478,330,000	105.10	1,471,428,000	1.3000	2019.12.20	2.53
5	アイルラ ンド	投資信託 受益証券	ISHARES EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF	99,500	14,321.64	1,425,003,647	14,422.2260	1,435,011,487			2.47
6	アメリカ	投資信託 受益証券	ISHARES US TREASURY BOND ETF	531,000	2,642.26	1,403,043,033	2,642.2655	1,403,043,033			2.41
7	日本	国債証券	第309回利付 国債(10年)	1,100,000,000	105.62	1,161,919,000	105.11	1,156,243,000	1.1000	2020.06.20	1.99
8	日本	国債証券	第4回利付国債 (30年)	800,000,000	139.78	1,118,247,000	139.59	1,116,736,000	2.9000	2030.11.20	1.92
9	日本	国債証券	第342回利付 国債(10年)	1,000,000,000	101.50	1,015,040,000	102.05	1,020,550,000	0.1000	2026.03.20	1.75
10	日本	国債証券	第343回利付 国債(10年)	1,000,000,000	101.40	1,014,040,000	101.96	1,019,600,000	0.1000	2026.06.20	1.75
11	日本	国債証券	第113回利付 国債(20年)	800,000,000	125.91	1,007,354,400	126.72	1,013,808,000	2.1000	2029.09.20	1.74
12	日本	国債証券	第121回利付 国債(20年)	800,000,000	124.36	994,943,500	125.38	1,003,112,000	1.9000	2030.09.20	1.72
13	日本	国債証券	第105回利付 国債(20年)	800,000,000	124.51	996,148,500	125.26	1,002,152,000	2.1000	2028.09.20	1.72
14	日本	国債証券	第130回利付 国債(20年)	800,000,000	123.89	991,175,900	124.96	999,736,000	1.8000	2031.09.20	1.72
15	日本	国債証券	第146回利付 国債(20年)	800,000,000	123.36	986,956,500	124.70	997,672,000	1.7000	2033.09.20	1.71

16	日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	800,000,000	123.07	984,614,100	124.16	993,296,000	1.7000	2032.09.20	1.71
17	日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	800,000,000	118.48	947,917,200	119.87	958,968,000	1.4000	2034.09.20	1.65
18	日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	900,000,000	106.78	961,065,000	106.21	955,944,000	1.2000	2020.12.20	1.64
19	日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	800,000,000	114.84	918,738,100	116.35	930,840,000	1.2000	2035.09.20	1.60
20	日本	国債証券	第3回利付国債(30年)	700,000,000	130.15	911,051,000	130.44	913,136,000	2.3000	2030.05.20	1.57
21	日本	国債証券	第158回利付国債(20年)	800,000,000	102.41	819,344,000	102.70	821,616,000	0.5000	2036.09.20	1.41
22	日本	国債証券	第10回利付国債(30年)	700,000,000	118.13	826,924,000	114.70	802,935,000	1.1000	2033.03.20	1.38
23	日本	国債証券	第42回利付国債(30年)	600,000,000	140.79	844,770,000	132.81	796,914,000	1.7000	2044.03.20	1.37
24	日本	国債証券	第5回利付国債(30年)	600,000,000	130.33	782,025,000	130.45	782,742,000	2.2000	2031.05.20	1.34
25	日本	国債証券	第18回利付国債(30年)	560,000,000	140.82	788,603,200	136.16	762,540,800	2.3000	2035.03.20	1.31
26	日本	国債証券	第48回利付国債(30年)	600,000,000	134.18	805,080,000	125.95	755,724,000	1.4000	2045.09.20	1.30
27	日本	国債証券	第2回利付国債(30年)	500,000,000	132.78	663,924,000	131.32	656,615,000	2.4000	2030.02.20	1.13
28	日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	600,000,000	104.35	626,106,000	103.93	623,610,000	1.3000	2019.03.20	1.07
29	日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	600,000,000	101.43	608,622,000	101.22	607,350,000	0.2000	2019.03.20	1.04
30	日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	500,000,000	101.57	507,875,000	101.30	506,545,000	0.1000	2020.03.20	0.87

(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。

#### 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	52.49
社債券	20.94
投資信託受益証券	9.88
合計	83.31

(参考)新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)

#### 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	US TREASURY N/B	1,000,000	10,313.44	103,134,453	10,527.5398	105,275,398	2.0000	2023.02.15	3.46
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	10,485.05	76,540,881	10,414.5698	76,026,360	2.6250	2018.04.30	2.50
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	10,570.19	75,048,421	10,656.3098	75,659,800	2.3750	2020.12.31	2.49
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	10,950.18	71,176,233	10,909.1095	70,909,212	3.6250	2019.08.15	2.33

5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	660,000	10,361.42	68,385,408	10,529.1200	69,492,192	2.0000	2021.11.15	2.29
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	600,000	10,086.72	60,520,320	10,118.3200	60,709,920	0.7500	2018.02.28	2.00
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	550,000	10,814.31	59,478,706	10,716.3500	58,939,925	3.1250	2019.05.15	1.94
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	570,000	10,208.66	58,189,403	10,222.5998	58,268,819	1.2500	2019.04.30	1.92
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	530,000	10,744.96	56,948,297	10,751.8998	56,985,069	2.6250	2020.11.15	1.87
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	550,000	10,106.93	55,588,152	10,117.5300	55,646,415	0.7500	2018.03.31	1.83
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	500,000	10,873.16	54,365,825	10,882.2500	54,411,250	3.3750	2019.11.15	1.79
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	500,000	10,820.23	54,101,175	10,745.5800	53,727,900	3.7500	2018.11.15	1.77
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	470,000	11,040.25	51,889,175	11,011.0197	51,751,793	3.6250	2020.02.15	1.70
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	460,000	10,198.10	46,911,302	10,393.2395	47,808,902	1.7500	2022.02.28	1.57
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	340,000	12,025.37	40,886,288	13,022.3594	44,276,022	3.6250	2044.02.15	1.45
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	390,000	10,320.60	40,250,343	10,507.7897	40,980,380	2.0000	2025.02.15	1.35
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	300,000	10,439.85	31,319,550	11,387.8500	34,163,550	2.8750	2043.05.15	1.12
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	300,000	10,394.82	31,184,460	10,714.7700	32,144,310	2.2500	2025.11.15	1.05
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	300,000	10,289.46	30,868,383	10,596.2700	31,788,810	2.5000	2046.05.15	1.04
20	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	240,000	12,887.75	30,930,617	12,760.9354	30,626,245	4.2500	2019.04.25	1.00
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	260,000	11,262.36	29,282,138	11,665.9292	30,331,416	3.0000	2045.05.15	0.99
22	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	240,000	11,666.23	27,998,956	11,715.7562	28,117,815	0.5000	2019.11.25	0.92
23	イギリス	国債証券	TSY	110,000	19,859.07	21,844,983	24,594.2018	27,053,622	4.0000	2060.01.22	0.89
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	250,000	10,527.35	26,318,376	10,807.2000	27,018,000	2.3750	2024.08.15	0.89
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000	17,554.92	26,332,394	17,885.9406	26,828,911	6.0000	2031.05.01	0.88
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	240,000	10,832.98	25,999,165	11,051.3100	26,523,144	2.7500	2023.11.15	0.87
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	240,000	10,138.46	24,332,317	10,251.0400	24,602,496	1.3750	2020.05.31	0.81
28	イギリス	国債証券	TSY	130,000	17,148.42	22,292,951	18,892.8200	24,560,666	4.2500	2032.06.07	0.80
29	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	160,000	13,709.75	21,935,613	14,502.1443	23,203,431	2.5000	2030.05.25	0.76
30	イギリス	国債証券	TSY	110,000	18,080.95	19,889,049	20,703.3709	22,773,708	4.2500	2040.12.07	0.75

(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。

#### 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	98.57
合計	98.57

(参考)新光世界REITインデックスマザーファンド

#### 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)	投資 比率 (%)
----	------	----	-----	--------------	-------------------	-------------------	------------------	------------------	-----------------

1	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	3,340	20,534.43	68,585,024	20,990.4895	70,108,235	5.15
2	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	1,600	26,663.32	42,661,314	22,750.9887	36,401,582	2.67
3	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	5,600	4,308.72	24,128,850	5,439.2448	30,459,771	2.24
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3,800	6,772.00	25,733,624	7,665.9071	29,130,447	2.14
5	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,060	28,264.04	29,959,892	27,223.4037	28,856,808	2.12
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,500	18,710.23	28,065,350	18,140.9280	27,211,392	2.00
7	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	3,700	6,269.44	23,196,928	7,271.5391	26,904,695	1.97
8	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	3,900	7,383.78	28,796,751	6,515.1615	25,409,130	1.86
9	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1,600	12,736.06	20,377,703	13,783.6675	22,053,868	1.62
10	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	56,600	334.35	18,924,413	365.1695	20,668,599	1.52
11	アメリカ	投資証券	HCP INC	5,000	3,283.36	16,416,832	3,897.1648	19,485,824	1.43
12	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2,800	6,153.15	17,228,826	6,835.7121	19,139,994	1.40
13	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1,800	9,370.79	16,867,422	10,266.7133	18,480,084	1.35
14	香港	投資証券	LINK REIT	24,000	611.83	14,684,083	743.9320	17,854,368	1.31
15	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	6,200	2,942.59	18,244,070	2,787.8783	17,284,846	1.27
16	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	700	22,878.40	16,014,880	22,815.7057	15,970,994	1.17
17	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,600	8,851.03	14,161,654	9,909.7600	15,855,616	1.16
18	オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORPORATION	20,300	757.30	15,373,255	755.7624	15,341,977	1.12
19	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	4,500	2,826.30	12,718,368	2,963.8271	13,337,222	0.98
20	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	800	15,580.57	12,464,456	15,705.9587	12,564,767	0.92
21	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	7,900	1,698.81	13,420,646	1,582.5279	12,501,971	0.91
22	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	1,100	9,717.63	10,689,395	10,911.8590	12,003,045	0.88
23	イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	8,500	1,435.76	12,203,960	1,368.9500	11,636,075	0.85
24	アメリカ	投資証券	VEREIT INC	10,300	876.71	9,030,117	1,035.4688	10,665,329	0.78
25	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,300	8,943.05	11,625,969	8,182.6307	10,637,420	0.78
26	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	1,300	8,054.20	10,470,470	8,140.1600	10,582,208	0.77
27	アメリカ	投資証券	UDR INC	2,800	3,777.84	10,577,960	3,683.8014	10,314,644	0.75
28	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	3,700	2,209.47	8,175,047	2,782.8224	10,296,443	0.75
29	フランス	投資証券	KLEPIERRE	2,200	4,745.93	10,441,048	4,606.3836	10,134,044	0.74
30	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	2,600	3,308.64	8,602,481	3,817.2800	9,924,928	0.73

(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。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成28年9月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	不動産	0.51
投資証券			97.00
合計			97.51

(参考)新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

#### 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】

みずほラップファンド(堅実型コース)

該当事項はありません。

みずほラップファンド(安定成長型コース)

該当事項はありません。

みずほラップファンド(成長型コース)

該当事項はありません。

(参考)新光日本株式変動抑制型マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光外国株式変動抑制型マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)

該当事項はありません。

(参考)新光世界REITインデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

みずほラップファンド(堅実型コース)

該当事項はありません。

みずほラップファンド(安定成長型コース)

該当事項はありません。

## みずほラップファンド（成長型コース）

該当事項はありません。

## （参考）新光日本株式変動抑制型マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新光外国株式変動抑制型マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド

（平成28年 9月30日現在）

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資比率 （％）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債標準物先物	売建	19	日本円	2,884,929,220	2,894,460,000	4.98

（注）時価評価にあたっては、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

## （参考）新光外国債券マザーファンド（為替リスク抑制型）

該当事項はありません。

## （参考）新光世界REITインデックスマザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

（平成28年 9月30日現在）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	日経平均株価指数先物	売建	4	日本円	66,275,680	66,275,680	65,800,000	65,800,000	2.01
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	売建	6	米ドル	638,952	64,610,826	644,550	65,176,896	1.99
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO ST50	売建	19	ユーロ	560,918	63,585,664	566,010	64,162,893	1.96

債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	38米ドル	4,961,179.12	501,674,432	4,998,781.44	505,476,779	15.44
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND FU	買建	56ユーロ	9,208,796	1,043,909,114	9,281,440	1,052,144,038	32.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	売建	72ユーロ	9,474,768	1,074,059,701	9,514,080	1,078,516,109	32.95
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	買建	9英ポンド	1,183,806	155,078,586	1,176,300	154,095,300	4.70

(注)時価評価にあたっては、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外貨建先物取引については、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。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

#### みずほラップファンド(堅実型コース)

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1計算期間末 (平成28年 3月22日)	5,062,108,551	5,062,108,551	0.9769	0.9769
平成27年 9月末日	6,490,656,314		0.9732	
10月末日	6,264,596,525		0.9928	
11月末日	6,182,033,749		0.9927	
12月末日	6,013,886,487		0.9859	
平成28年 1月末日	5,581,100,866		0.9755	
2月末日	5,186,788,289		0.9642	
3月末日	4,940,145,519		0.9804	
4月末日	4,348,512,560		0.9699	
5月末日	4,051,077,400		0.9732	
6月末日	3,698,041,768		0.9685	
7月末日	3,559,986,059		0.9728	
8月末日	3,389,402,458		0.9654	
9月末日	3,276,666,215		0.9617	

#### みずほラップファンド(安定成長型コース)

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1計算期間末 (平成28年 3月22日)	9,026,169,970	9,026,169,970	0.9535	0.9535
平成27年 9月末日	11,057,272,069		0.9461	



10月末日	11,403,665,217		0.9909
11月末日	11,345,389,782		0.9944
12月末日	10,993,393,059		0.9873
平成28年 1月末日	9,872,246,048		0.9565
2月末日	9,242,770,729		0.9294
3月末日	8,681,836,841		0.9605
4月末日	7,517,465,199		0.9460
5月末日	7,040,285,521		0.9535
6月末日	6,496,051,759		0.9345
7月末日	6,104,931,663		0.9508
8月末日	5,767,001,453		0.9364
9月末日	5,399,582,756		0.9308

## みずほラップファンド（成長型コース）

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1計算期間末（平成28年 3月22日）	3,566,874,793	3,566,874,793	0.9454	0.9454
平成27年 9月末日	4,734,289,261		0.9384	
10月末日	4,978,619,729		0.9957	
11月末日	4,905,741,877		1.0008	
12月末日	4,663,161,217		0.9931	
平成28年 1月末日	4,082,630,057		0.9506	
2月末日	3,662,471,092		0.9153	
3月末日	3,450,640,610		0.9541	
4月末日	3,004,748,020		0.9376	
5月末日	2,790,664,384		0.9476	
6月末日	2,562,134,523		0.9217	
7月末日	2,518,721,139		0.9437	
8月末日	2,370,484,921		0.9255	
9月末日	2,202,373,624		0.9188	

## 【分配の推移】

## みずほラップファンド（堅実型コース）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	0.0000

## みずほラップファンド（安定成長型コース）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	0.0000

## みずほラップファンド（成長型コース）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	0.0000

## 【収益率の推移】

## みずほラップファンド（堅実型コース）

期	計算期間	収益率（％）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	2.3
第2中間計算期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月22日	2.0

(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。

## みずほラップファンド（安定成長型コース）

期	計算期間	収益率（％）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	4.7
第2中間計算期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月22日	2.7

(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。

## みずほラップファンド（成長型コース）

期	計算期間	収益率（％）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	5.5
第2中間計算期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月22日	3.2

(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】

## みずほラップファンド（堅実型コース）

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	7,182,844,597	2,001,106,922
第2中間計算期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月22日	54,678,344	1,804,872,450

(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。

#### みずほラップファンド（安定成長型コース）

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	12,270,074,788	2,803,701,644
第2中間計算期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月22日	73,431,099	3,613,795,540

(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。

#### みずほラップファンド（成長型コース）

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1計算期間	平成27年 3月31日～平成28年 3月22日	5,365,539,376	1,592,758,873
第2中間計算期間	平成28年 3月23日～平成28年 9月22日	20,112,882	1,375,462,751

(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。

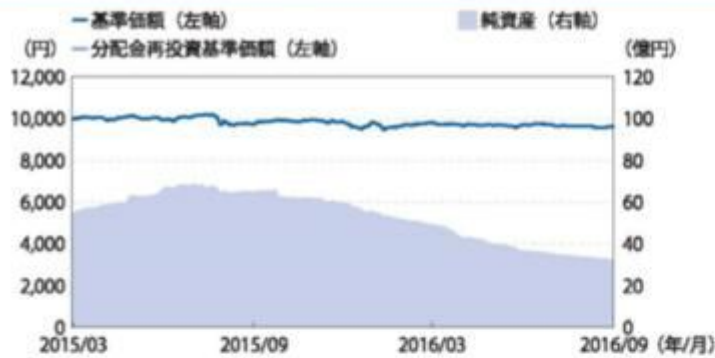
#### 参考情報

## 運用実績

2016年9月30日現在

## 堅実型コース

## &lt;基準価額・純資産の推移&gt; (2015年3月31日～2016年9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。徴金時の費用・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。  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、最近10年分を記載しています。

## &lt;分配の推移&gt;

2016年3月	0円
-	-
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

※分配は1万口当たり・取引前の金額です。  
 ※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。

## &lt;主要な資産の状況&gt;

## 組入状況

ファンド名	純資産比率
債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド	40.85%
新光グローバルマクロ戦略マザーファンド	23.27%
新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)	23.17%
新光外国株式変動抑制型マザーファンド	4.63%
新光世界REITインデックスマザーファンド	3.99%
新光日本株式変動抑制型マザーファンド	3.47%
合計	99.41%

※計理処理の関係上、純資産比率が一時的に100%を超える場合があります。

## &lt;年間収益率の推移&gt;

暦年ベース



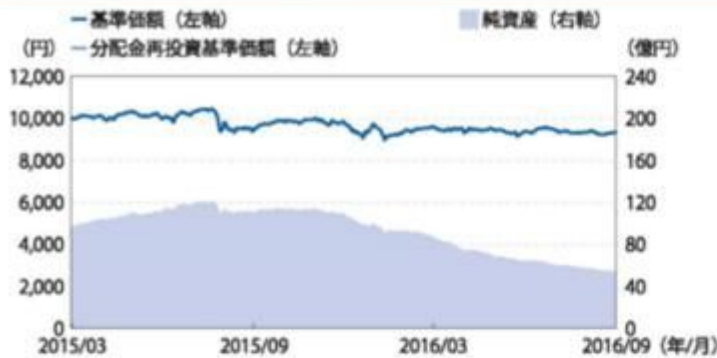
※取引前の分配金を単純に合算して計算しています。  
 ※当ファンドにはベンチマークがありません。  
 ※2015年については、設定時から12月末までの収益率を記載しています。  
 ※2016年については、年初から9月末までの収益率を記載しています。

・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。  
 ・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。

2016年9月30日現在

## 安定成長型コース

## &lt;基準価額・純資産の推移&gt; (2015年3月31日～2016年9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、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。  
 ※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。

## &lt;分配の推移&gt;

年月	分配額 (円)
2016年3月	0円
-	-
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0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。

## &lt;主要な資産の状況&gt;

## 組入状況

ファンド名	純資産比率
債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド	27.99%
新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)	15.93%
新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド	15.92%
新光外国株式変動抑制型マザーファンド	14.68%
新光世界REITインデックスマザーファンド	12.99%
新光日本株式変動抑制型マザーファンド	10.78%
合計	98.32%

※計理処理の関係上、純資産比率が一時的に100%を超える場合があります。

## &lt;年間収益率の推移&gt;

暦年ベース



※税引前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。  
 ※2015年については、設定時から12月末までの収益率を記載しています。  
 ※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。  
 ・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。

## 運用実績

2016年9月30日現在

## 成長型コース

## &lt;基準価額・純資産の推移&gt; (2015年3月31日～2016年9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。償還時の費用・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。  
 ※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。

## &lt;分配の推移&gt;

年月	分配額 (円)
2016年3月	0円
-	-
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

※分配は1万口当たり・取引前の金額です。  
 ※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。

## &lt;主要な資産の状況&gt;

## 組入状況

ファンド名	純資産比率
債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド	21.79%
新光外国株式変動抑制型マザーファンド	19.74%
新光世界REITインデックスマザーファンド	17.42%
新光日本株式変動抑制型マザーファンド	14.88%
新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド	12.39%
新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)	12.36%
合計	98.60%

※計理処理の関係上、純資産比率が一時的に100%を超える場合があります。

## &lt;年間収益率の推移&gt;

暦年ベース



※取引前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。  
 ※2015年については、設定時から12月末までの収益率を記載しています。  
 ※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。  
 ・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。



2016年9月30日現在

## 新光日本株式変動抑制型マザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	種別	業種	純資産比率
森永乳業	株式	食料品	1.14%
久光製薬	株式	医薬品	1.07%
ローソン	株式	小売業	1.07%
雪印メグミルク	株式	食料品	1.07%
HLAニッセイ	株式	医薬品	1.07%

※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、新光日本株式変動抑制型マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光外国株式変動抑制型マザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	種別	国・地域	業種	純資産比率
F5 NETWORKS INC	株式	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.04%
SIKA AG-BR	株式	スイス	素材	1.03%
DOLLARAMA INC	株式	カナダ	小売	1.02%
WESTAR ENERGY INC	株式	アメリカ	公共事業	1.00%
SAPUTO INC	株式	カナダ	食品・飲料・タバコ	1.00%

※世界産業分類基準(GICS)にしたがって記載しています。純資産比率は、新光外国株式変動抑制型マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光世界REITインデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	種別	国・地域	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	投資証券	アメリカ	5.15%
PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.67%
PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	2.24%
WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.14%
UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券	フランス	2.12%

※純資産比率は、新光世界REITインデックスマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンドの組入上位5銘柄/債券先物取引

銘柄名	種別	償還日	利率	通貨	純資産比率
ISHARES IBOXX INVESTMENT GRA ETF	投資信託受益証券	-	-	米ドル	4.99%
国債10年(30年)	国債証券	2029/09/20	2.800%	日本円	3.32%
国債344(10年)	国債証券	2026/09/20	0.100%	日本円	2.63%
国債305(10年)	国債証券	2019/12/20	1.300%	日本円	2.53%
ISHARES EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF	投資信託受益証券	-	-	ユーロ	2.47%

銘柄名	種別	国・地域	買建/売建	純資産比率
長期国債先物	債券先物取引	日本	売建	-4.98%

※純資産比率は、債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)の組入上位5銘柄

銘柄名	種別	償還日	利率	通貨	純資産比率
US TREASURY N/B	国債証券	2023/02/15	2.000%	米ドル	3.46%
US TREASURY N/B	国債証券	2018/04/30	2.625%	米ドル	2.50%
US TREASURY N/B	国債証券	2020/12/31	2.375%	米ドル	2.49%
US TREASURY N/B	国債証券	2019/08/15	3.625%	米ドル	2.33%
US TREASURY N/B	国債証券	2021/11/15	2.000%	米ドル	2.29%

※純資産比率は、新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)の純資産総額に対する比率です。

## 新光グローバル・マクロ戦略マザーファンドの組入上位5銘柄/株価指数先物取引/債券先物取引

銘柄名	償還日	利率	純資産比率
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

銘柄名	種別	国・地域	買建/売建	純資産比率
日経平均株価先物	株価指数先物取引	日本	売建	-2.01
S&P500 EMINI	株価指数先物取引	アメリカ	売建	-1.99
DJ EURO ST50	株価指数先物取引	ドイツ	売建	-1.95
US 10YR NOTE	債券先物取引	アメリカ	買建	15.44
EURO-BUND FU	債券先物取引	ドイツ	買建	32.15
EURO-BOBL FU	債券先物取引	ドイツ	売建	-32.95
LONG GILT FU	債券先物取引	イギリス	買建	4.70
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

※純資産比率は、新光グローバル・マクロ戦略マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

-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】

&lt;訂正前&gt;

(略)

## f. 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)

&lt;訂正後&gt;

(略)

## f. 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】

- みずほラップファンド（堅実型コース）  
みずほラップファンド（安定成長型コース）  
みずほラップファンド（成長型コース）

(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2期中間計算期間（平成28年3月23日から平成28年9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】

## 【みずほラップファンド（堅実型コース）】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期中間計算期間末 平成28年9月22日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	136,004
コール・ローン	104,911,453
親投資信託受益証券	3,246,513,780
流動資産合計	3,351,561,237
<b>資産合計</b>	<b>3,351,561,237</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	23,800,825
未払受託者報酬	1,079,428
未払委託者報酬	39,938,840
未払利息	430
その他未払費用	167,910
流動負債合計	64,987,433
<b>負債合計</b>	<b>64,987,433</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	3,431,543,569
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	144,969,765
元本等合計	3,286,573,804
<b>純資産合計</b>	<b>3,286,573,804</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>3,351,561,237</b>

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第2期中間計算期間	
自 平成28年 3月23日	
至 平成28年 9月22日	
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	41,670,129
<b>営業収益合計</b>	<b>41,670,129</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	20,815
受託者報酬	1,079,428
委託者報酬	39,938,840
その他費用	168,975
<b>営業費用合計</b>	<b>41,208,058</b>
営業利益	82,878,187
経常利益	82,878,187
中間純利益	82,878,187
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	17,222,271
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	119,629,124
剰余金増加額又は欠損金減少額	41,658,406
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	41,658,406
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,343,131
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,343,131
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	144,969,765

## (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2期中間計算期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9月22日
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。

(中間貸借対照表に関する注記)

第2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在	
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	3,431,543,569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	144,969,765円
3. 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	0.9578円
(1万口当たり純資産額)	(9,578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2期中間計算期間末 平成28年 9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2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在
期首元本額	5,181,737,675円
期中追加設定元本額	54,678,344円
期中一部解約元本額	1,804,872,450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。

【みずほラップファンド（安定成長型コース）】

（1）【中間貸借対照表】

(単位：円)

第2期中間計算期間末  
平成28年 9月22日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	82,001
コール・ローン	206,425,368
親投資信託受益証券	5,410,602,636
流動資産合計	5,617,110,005
資産合計	
5,617,110,005	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	51,206,836
未払受託者報酬	1,860,827
未払委託者報酬	68,850,395
未払利息	848
その他未払費用	289,423
流動負債合計	122,208,329
負債合計	
122,208,329	
純資産の部	
元本等	
元本	5,926,008,703
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	431,107,027
元本等合計	5,494,901,676
純資産合計	
5,494,901,676	
負債純資産合計	
5,617,110,005	

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第2期中間計算期間  
自 平成28年 3月23日  
至 平成28年 9月22日

営業収益	
有価証券売買等損益	122,007,841
営業収益合計	122,007,841
営業費用	
支払利息	38,470
受託者報酬	1,860,827
委託者報酬	68,850,395
その他費用	291,554
営業費用合計	71,041,246
営業利益	193,049,087
経常利益	193,049,087
中間純利益	193,049,087
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	38,236,956
期首剰余金又は期首欠損金( )	440,203,174
剰余金増加額又は欠損金減少額	168,101,836
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	168,101,836
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,193,558
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,193,558
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	431,107,027

## (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2期中間計算期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9月22日
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。

（中間貸借対照表に関する注記）

第2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在	
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,926,008,703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	431,107,027円
3. 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	0.9273円
(1万口当たり純資産額)	(9,273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2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在	
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。
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。
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	第2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在
期首元本額	9,466,373,144円
期中追加設定元本額	73,431,099円
期中一部解約元本額	3,613,795,540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。

【みずほラップファンド（成長型コース）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	182,003
コール・ローン	83,529,506
親投資信託受益証券	2,162,751,821
流動資産合計	2,246,463,330
資産合計	2,246,463,330
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	4,757,026
未払受託者報酬	745,840
未払委託者報酬	27,595,922
未払利息	342
その他未払費用	116,015
流動負債合計	33,215,145
負債合計	33,215,145
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	2,417,430,634
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	204,182,449
元本等合計	2,213,248,185
純資産合計	2,213,248,185
負債純資産合計	2,246,463,330

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

第2期中間計算期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9月22日	
営業収益	
有価証券売買等損益	60,375,867
営業収益合計	60,375,867
営業費用	
支払利息	16,281
受託者報酬	745,840
委託者報酬	27,595,922
その他費用	116,956
営業費用合計	28,474,999
営業利益	88,850,866
経常利益	88,850,866
中間純利益	88,850,866
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	16,802,471
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	205,905,710
剰余金増加額又は欠損金減少額	75,095,813
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	75,095,813
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,324,157
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,324,157
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	204,182,449

## （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2期中間計算期間 自 平成28年 3月23日 至 平成28年 9月22日
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。

（中間貸借対照表に関する注記）

第2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在	
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,417,430,634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	204,182,449円
3. 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	0.9155円

(1万口当たり純資産額)

(9,155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2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在
<p>1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>親投資信託受益証券</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</p> <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>

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	第2期中間計算期間末 平成28年 9月22日現在
期首元本額	3,772,780,503円
期中追加設定元本額	20,112,882円
期中一部解約元本額	1,375,462,751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、「新光日本株式変動抑制型マザーファンド」、「新光外国株式変動抑制型マザーファンド」、「債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド」、「新光外国債券マザーファンド(為替リスク抑制型)」、「新光世界REITインデックスマザーファンド」及び「新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド」各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、これら同ファンドの受益証券であります。

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 新光日本株式変動抑制型マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

平成28年 9月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	38,270,550
株式	1,394,054,720
未収配当金	2,611,750
流動資産合計	1,434,937,020
資産合計	1,434,937,020
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,600,000
未払利息	78
流動負債合計	2,600,078
負債合計	2,600,078
純資産の部	
元本等	
元本	1,492,912,436
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	60,575,494
元本等合計	1,432,336,942
純資産合計	1,432,336,942
負債純資産合計	1,434,937,020

### 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 9月22日現在	
1. 計算日における受益権の総数	1,492,912,436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	60,575,494円
3. 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	0.9594円
(1万口当たり純資産額)	(9,594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 9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 9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	2,597,665,613円
期中追加設定元本額	113,502,449円
期中一部解約元本額	1,218,255,626円
同期末における元本の内訳	
新光スマート・アロケーション・ファンド(安定型)	8,476,784円
新光スマート・アロケーション・ファンド(安定成長型)	56,566,507円
新光スマート・アロケーション・ファンド(成長型)	64,511,537円

みずほラップファンド（堅実型コース）	118,530,731円
みずほラップファンド（安定成長型コース）	632,176,019円
みずほラップファンド（成長型コース）	341,205,348円
新光日本株式変動抑制型ファンド（ファンドラップ）	271,445,510円
合計	1,492,912,436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。

## 新光外国株式変動抑制型マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成28年 9月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	41,137,000
コール・ローン	61,841,932
株式	1,557,502,649
投資証券	239,586,930
未収配当金	3,522,150
流動資産合計	1,903,590,661
資産合計	1,903,590,661
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,400,000
未払利息	127
流動負債合計	2,400,127
負債合計	2,400,127
純資産の部	
元本等	
元本	2,086,488,679
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	185,298,145
元本等合計	1,901,190,534
純資産合計	1,901,190,534
負債純資産合計	1,903,590,661

### 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22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<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>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として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。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券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>
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成28年 9月22日現在	
1. 計算日における受益権の総数	2,086,488,679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	185,298,145円
3. 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	0.9112円
(1万口当たり純資産額)	(9,112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 9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。

## 投資証券

「（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。

## 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 9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	3,557,430,426円
期中追加設定元本額	105,769,940円
期中一部解約元本額	1,576,711,687円
同期末における元本の内訳	
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定型）	10,176,437円
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定成長型）	69,235,681円
新光スマート・アロケーション・ファンド（成長型）	78,848,513円
みずほラップファンド（堅実型コース）	166,945,850円
みずほラップファンド（安定成長型コース）	893,893,481円
みずほラップファンド（成長型コース）	478,176,193円
新光外国株式変動抑制型ファンド（ファンドラップ）	389,212,524円
合計	2,086,488,679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。

## 債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

平成28年 9月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	12,209,402
コール・ローン	12,879,137,120
国債証券	27,378,924,700
社債券	12,122,669,929
投資信託受益証券	5,710,996,608
未収入金	101,635,000
未収利息	36,229,322
前払費用	18,712,325
差入委託証拠金	126,320,339
流動資産合計	58,386,834,745
資産合計	58,386,834,745
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,693,325
未払金	400,000,000
未払解約金	1,200,000
未払利息	26,502
流動負債合計	473,919,827
負債合計	473,919,827
純資産の部	
元本等	
元本	52,273,814,301
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,639,100,617
元本等合計	57,912,914,918
純資産合計	57,912,914,918
負債純資産合計	58,386,834,745

## 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22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として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。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。
4. 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 9月22日現在	
1. 計算日における受益権の総数	52,273,814,301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 (1万口当たり純資産額)	1.1079円 (11,079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 9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	
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。	
国債証券 「(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。	
社債券 「(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。	
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。

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。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成28年 9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	45,062,731,254円
期中追加設定元本額	10,121,327,134円
期中一部解約元本額	2,910,244,087円
同期末における元本の内訳	
債券ストラテジック・アロケーション戦略ファンド（適格機関投資家私募/年金信託専用）	28,945,076,608円
債券アロケーション戦略ファンド（適格機関投資家私募）	18,177,737,525円
絶対収益追求型為替ヘッジ内外債券アロケーションファンド（適格機関投資家私募）	9,185,534円
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定型）	188,947,606円
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定成長型）	174,976,756円
新光スマート・アロケーション・ファンド（成長型）	59,642,214円
みずほラップファンド（堅実型コース）	1,203,000,876円
みずほラップファンド（安定成長型コース）	1,385,139,129円
みずほラップファンド（成長型コース）	431,290,922円
新光債券ストラテジック・アロケーション戦略ファンド（ファンドラップ）	1,698,817,131円
合計	52,273,814,301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

（通貨関連）

種類	平成28年 9月22日現在		
	契約額等（円）	時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超		



市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	5,778,358,275	-	5,851,051,600	72,693,325
米ドル	4,351,408,875	-	4,422,341,000	70,932,125
ユーロ	1,426,949,400	-	1,428,710,600	1,761,200
合計	5,778,358,275	-	5,851,051,600	72,693,325

## 時価の算定方法

### 為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算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。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算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。
- ・ 計算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) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算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。

## 新光外国債券マザーファンド（為替リスク抑制型）

### 貸借対照表

（単位：円）

平成28年 9月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,883,520
国債証券	2,969,743,580
派生商品評価勘定	4,846,342
未収入金	20,543,745
未収利息	21,543,053
前払費用	4,499,486
流動資産合計	3,040,059,726
資産合計	3,040,059,726
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	903,129
前受金	19,751,288
未払解約金	1,000,000
未払利息	38
流動負債合計	21,654,455
負債合計	21,654,455
純資産の部	
元本等	

平成28年 9月22日現在

元本	3,173,221,788
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,816,517
元本等合計	3,018,405,271
純資産合計	3,018,405,271
負債純資産合計	3,040,059,726

## 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22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 9月22日現在	
1. 計算日における受益権の総数	3,173,221,788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	154,816,517円
3. 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	0.9512円
(1万口当たり純資産額)	(9,512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 9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	

<p>国債証券 「（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>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。</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> <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>
---

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成28年 9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	3,437,094,073円
期中追加設定元本額	810,617,622円
期中一部解約元本額	1,074,489,907円
同期末における元本の内訳	
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定型）	87,956,219円
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定成長型）	81,508,246円
新光スマート・アロケーション・ファンド（成長型）	28,010,899円
みずほラップファンド（堅実型コース）	793,715,094円
みずほラップファンド（安定成長型コース）	914,784,371円
みずほラップファンド（成長型コース）	284,599,432円
新光外国債券ファンド（為替リスク抑制型）（ファンドラップ）	982,647,527円
合計	3,173,221,788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

## （通貨関連）

平成28年 9月22日現在	
契約額等（円）	

種類		うち1年 超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	2,203,186,013	-	2,199,242,800	3,943,213
米ドル	1,037,772,973	-	1,038,154,960	381,987
ユーロ	978,532,708	-	975,707,520	2,825,188
英ポンド	186,880,332	-	185,380,320	1,500,012
合計	2,203,186,013	-	2,199,242,800	3,943,213

## 時価の算定方法

### 為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算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。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算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。
- ・ 計算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) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算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。

## 新光世界REITインデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成28年 9月22日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	14,605,145
株式	7,025,042
投資証券	1,326,783,831
未収入金	26,485,770
未収配当金	3,245,877
流動資産合計	1,378,145,665
資産合計	1,378,145,665
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	3,424,321
未払金	12,369,219
未払解約金	200,000
未払利息	30
流動負債合計	15,993,570

平成28年 9月22日現在

負債合計	15,993,570
純資産の部	
元本等	
元本	1,510,455,750
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	148,303,655
元本等合計	1,362,152,095
純資産合計	1,362,152,095
負債純資産合計	1,378,145,665

## 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。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所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. 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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券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。
4. 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 9月22日現在	
1. 計算日における受益権の総数	1,510,455,750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	148,303,655円
3. 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	0.9018円
(1万口当たり純資産額)	(9,018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 9月22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ん。</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>投資証券 「（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	平成28年 9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	2,857,640,941円
期中追加設定元本額	12,906,098円
期中一部解約元本額	1,360,091,289円
同期末における元本の内訳	
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定型）	9,963,194円
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定成長型）	68,273,605円
新光スマート・アロケーション・ファンド（成長型）	78,206,267円
みずほラップファンド（堅実型コース）	147,882,237円
みずほラップファンド（安定成長型コース）	785,516,496円
みずほラップファンド（成長型コース）	420,613,951円
合計	1,510,455,750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。

## 新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

平成28年 9月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,229,249,054
派生商品評価勘定	2,964,030
現先取引勘定	2,000,000,000
未収入金	70,550
前払金	1,000,000
差入委託証拠金	43,579,837
流動資産合計	3,276,863,471
資産合計	3,276,863,471
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,299,236
未払金	86,144
未払解約金	1,000,000
未払利息	2,529
流動負債合計	9,387,909
負債合計	9,387,909
純資産の部	
元本等	
元本	3,361,791,541
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	94,315,979
元本等合計	3,267,475,562
純資産合計	3,267,475,562
負債純資産合計	3,276,863,471

## 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22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として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。</p>

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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 9月22日現在	
1. 計算日における受益権の総数	3,361,791,541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	94,315,979円
3. 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	0.9719円
(1万口当たり純資産額)	(9,719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 9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 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。
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。 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。

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

区分	平成28年 9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	3,682,352,329円



期中追加設定元本額	672,883,919円
期中一部解約元本額	993,444,707円
同期末における元本の内訳	
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定型）	109,842,733円
新光スマート・アロケーション・ファンド（安定成長型）	116,353,289円
新光スマート・アロケーション・ファンド（成長型）	53,652,049円
みずほラップファンド（堅実型コース）	781,487,469円
みずほラップファンド（安定成長型コース）	901,800,510円
みずほラップファンド（成長型コース）	279,696,895円
新光グローバル・マクロ戦略ファンド（ファン ドラップ）	1,118,958,596円
合計	3,361,791,541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

(株式関連)

種類	平成28年 9月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	66,284,320	-	66,920,000	635,680
日経平均株価指数 先物	66,284,320	-	66,920,000	635,680
売建	128,767,158	-	128,844,491	77,333
S&P500 EMINI	65,058,092	-	65,096,580	38,488
DJ EURO ST50	63,709,066	-	63,747,911	38,845
合計	195,051,478	-	195,764,491	558,347

### 時価の算定方法

#### 先物取引

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

契約額等及び時価の邦貨換算額は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

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。

(債券関連)

種類	平成28年 9月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超		
市場取引				
債券先物取引				
買建	1,948,385,109	-	1,942,974,503	5,410,606
US 10YR NOTE	745,725,984	-	744,100,560	1,625,424
EURO-BUND FU	1,045,935,049	-	1,044,263,606	1,671,443
LONG GILT FU	156,724,076	-	154,610,337	2,113,739
売建	1,076,144,149	-	1,077,092,769	948,620
EURO-BOBL FU	1,076,144,149	-	1,077,092,769	948,620
合計	3,024,529,258	-	3,020,067,272	6,359,226

## 時価の算定方法

## 先物取引

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

契約額等及び時価の邦貨換算額は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (通貨関連)

種類	平成28年 9月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	66,126,840	-	64,734,900	1,391,940
ユーロ	66,126,840	-	64,734,900	1,391,940
売建	132,734,250	-	131,036,400	1,697,850
英ポンド	132,734,250	-	131,036,400	1,697,850
合計	198,861,090	-	195,771,300	305,910

## 時価の算定方法

## 為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算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。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算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。
- ・ 計算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) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## みずほラップファンド（堅実型コース）

（平成28年 9月30日現在）

資産総額	3,284,685,546円
負債総額	8,019,331円
純資産総額（ - ）	3,276,666,215円
発行済口数	3,407,053,010口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9617円
（1万口当たり純資産額）	（9,617円）

## みずほラップファンド（安定成長型コース）

（平成28年 9月30日現在）

資産総額	5,444,862,533円
負債総額	45,279,777円
純資産総額（ - ）	5,399,582,756円
発行済口数	5,800,793,397口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9308円
（1万口当たり純資産額）	（9,308円）

## みずほラップファンド（成長型コース）

（平成28年 9月30日現在）

資産総額	2,209,983,734円
負債総額	7,610,110円
純資産総額（ - ）	2,202,373,624円
発行済口数	2,396,949,106口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9188円
（1万口当たり純資産額）	（9,188円）

## （参考）新光日本株式変動抑制型マザーファンド

（平成28年 9月30日現在）

資産総額	1,409,437,161円
負債総額	28円
純資産総額（ - ）	1,409,437,133円
発行済口数	1,467,189,625口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9606円
（1万口当たり純資産額）	（9,606円）

## （参考）新光外国株式変動抑制型マザーファンド

（平成28年 9月30日現在）

資産総額	1,880,465,316円
負債総額	109円
純資産総額（ - ）	1,880,465,207円
発行済口数	2,067,254,286口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9096円
（1万口当たり純資産額）	（9,096円）

## （参考）債券ストラテジック・アロケーション戦略マザーファンド

（平成28年 9月30日現在）

資産総額	58,028,128,616円
負債総額	14,094,137円
純資産総額（ - ）	58,014,034,479円
発行済口数	52,127,600,617口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1129円
（1万口当たり純資産額）	（11,129円）

## （参考）新光外国債券マザーファンド（為替リスク抑制型）

(平成28年 9月30日現在)

資産総額	3,082,831,171円
負債総額	48,387,152円
純資産総額( - )	3,034,444,019円
発行済口数	3,171,112,589口
1口当たり純資産額( / )	0.9569円
(1万口当たり純資産額)	(9,569円)

(参考) 新光世界REITインデックスマザーファンド

(平成28年 9月30日現在)

資産総額	1,363,982,666円
負債総額	4,875,429円
純資産総額( - )	1,359,107,237円
発行済口数	1,489,734,276口
1口当たり純資産額( / )	0.9123円
(1万口当たり純資産額)	(9,123円)

(参考) 新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

(平成28年 9月30日現在)

資産総額	3,279,116,836円
負債総額	6,732,252円
純資産総額( - )	3,272,384,584円
発行済口数	3,353,599,439口
1口当たり純資産額( / )	0.9758円
(1万口当たり純資産額)	(9,758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>

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」に掲げられているみずほラップファンド（堅実型コース）の平成28年3月23日から平成28年9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、みずほラップファンド（堅実型コース）の平成28年9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3月23日から平成28年9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。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

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 公認会計士 湯原 尚  
業務執行社員  
指定有限責任社員 公認会計士 山野 浩  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているみずほラップファンド（安定成長型コース）の平成28年3月23日から平成28年9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、みずほラップファンド（安定成長型コース）の平成28年9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3月23日から平成28年9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。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

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」に掲げられているみずほラップファンド（成長型コース）の平成28年3月23日から平成28年9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、みずほラップファンド（成長型コース）の平成28年9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3月23日から平成28年9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。