

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年7月18日
【発行者名】	朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 種邑 満
【本店の所在の場所】	東京都杉並区和泉一丁目22番19号
【事務連絡者氏名】	宮崎 恭介
【電話番号】	03 - 3323 - 6201
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	朝日ライフ リサーチ 日本株オープン
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限1,000億円
【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】

半期報告書の提出に伴い、平成24年1月18日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項のうち、訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書により原届出書の該当情報を以下の内容に訂正いたします。

2【訂正の内容】

以下の内容の下線部分__は、訂正個所を示します。

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 >

（略）

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はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

< 訂正後 >

（略）

委託会社の依頼により、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はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

（4）【発行（売出）価格】

< 訂正前 >

取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、便宜上1万口当たりで表示されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、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。

（略）

< 訂正後 >

取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額とは、純資産総額（信託財産の資産総額から負債総額を控除した額）を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。当ファンドにおいては、1万口当たりの価額として表示されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、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。

（略）

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】

（3）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

（略）

委託会社の概況

1）資本金の額（平成23年11月末現在）

（略）

3）大株主の状況（平成23年11月末現在）

（略）

< 訂正後 >

（略）

委託会社の概況

1）資本金の額（平成24年5月末現在）

（略）

3）大株主の状況（平成24年5月末現在）

（略）

3【投資リスク】

<訂正前>

リスクに関する留意点

1）ファンドは値動きのある有価証券等を投資対象としますので、組入有価証券等の値動きなどの影響により、基準価額が下落することがあります。したがって、投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、これを割り込むことがあります。ファンドは預貯金と異なります。

信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（略）

3）ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

（略）

<訂正後>

リスクに関する留意点

1）ファンドは値動きのある有価証券等を投資対象としますので、組入有価証券等の値動きなどの影響により、基準価額が下落することがあります。したがって、投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、これを割り込むことがあります。ファンドは預貯金と異なります。

信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

（略）

3）ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

4）分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

（略）

4【手数料等及び税金】

（4）【その他の手数料等】

<訂正前>

（略）

当該手数料等の合計額については、受益者がファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

<訂正後>

（略）

当該手数料等の合計額については、投資者がファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示する

ことができません。

（５）【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

（略）

個人、法人別の課税の取扱いについて

１）個人の受益者に対する課税

a. 収益分配金に対する課税

個人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、平成25年12月31日までは10%（所得税7%、地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、原則として確定申告の必要はありません。

なお、確定申告を行い、総合課税または申告分離課税を選択することもできます。

b. ご換金（解約）時および償還時における課税

解約時の解約価額^注および償還時の償還価額から取得費（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額を含みます。）を控除した差益（譲渡益）は、譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます。特定口座（源泉徴収あり）の利用も可能です。

その税率は、平成25年12月31日までは10%（所得税7%、地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%、地方税5%）です。

注：解約価額とは、基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額です。

（略）

２）法人の受益者に対する課税

a. 収益分配金に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、7%（所得税）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。

なお、上記7%の税率は、平成26年1月1日から15%（所得税）となります。

b. ご換金（解約）時および償還時における課税

解約時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。

なお、上記7%の税率は、平成26年1月1日から15%（所得税）となります。

c. 益金不算入制度が適用されます。

（略）

上記は、平成23年11月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

< 訂正後 >

（略）

個人、法人別の課税の取扱いについて

１）個人の受益者に対する課税

a. 収益分配金に対する課税

個人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、平成24年12月31日までは10%（所得税7%、地方税3%）、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）、平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、原則として確定申告の必要はありません。

なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用が可能です。）または申告分離課税を選択することもできます。

b. ご換金（解約）時および償還時における課税

解約時の解約価額^注および償還時の償還価額から取得費（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額を含みます。）を控除した差益（譲渡益）は、譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます。特定口座（源泉徴収あり）の利用も可能です。

その税率は、平成24年12月31日までは10%（所得税7%、地方税3%）、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）、平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）です。

注：解約価額とは、基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額です。

（略）

2）法人の受益者に対する課税

a. 収益分配金に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、7%（所得税）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。

なお、上記7%の税率は、平成25年1月1日から7.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%）、平成26年1月1日から15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）となります。

b. ご換金（解約）時および償還時における課税

解約時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。

なお、上記7%の税率は、平成25年1月1日から7.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%）、平成26年1月1日から15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）となります。

c. 益金不算入制度の適用が可能です。

（略）

上記は、平成24年5月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

（1）【投資状況】

平成24年5月31日現在の資産別および地域別の投資状況は次のとおりです。

資産の種類	投資国 または地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券 （朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド受益証券）	日本	2,340,156,294	99.17
コール・ローン、その他（負債控除後）		19,560,288	0.83
合計（純資産総額）		2,359,716,582	100.00

（注1）投資比率とは、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率をいいます。

（注2）投資比率は、小数点第3位を四捨五入しています。

<参考> マザーファンドの投資状況

朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド

平成24年5月31日現在の資産別および地域別の投資状況は次のとおりです。

資産の種類	投資国または 地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	2,274,373,200	97.19
コール・ローン、その他（負債控除後）		65,744,488	2.81
合計（純資産総額）		2,340,117,688	100.00

（注1）投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率をいいます。

（注2）投資比率は、小数点第3位を四捨五入しています。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

1) 主要銘柄の明細（平成24年5月31日現在）

種類	銘柄	国/地域	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資信託 受益証券 朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド	日本	3,451,557,957	7,017	2,421,958,219	6,780	2,340,156,294	99.17

(注1) 投資銘柄は上記の1銘柄です。

(注2) 投資比率とは、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

(注3) 投資比率は、小数点第3位を四捨五入しています。

2) 種類別投資比率（平成24年5月31日現在）

国内/外国	種類	投資比率(%)
国内	親投資信託受益証券	99.17
	合計	99.17

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<参考> マザーファンドの投資資産

朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

1) 主要銘柄の明細（評価金額上位30銘柄）

平成24年5月31日現在

種類	銘柄名	国/地域	業種	数量 (株)	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	株式 本田技研工業	日本	輸送用機器	31,900	2,390 76,242,280	2,512 80,132,800	3.42
2	三井住友フィナンシャルグループ		銀行業	33,200	2,167 71,943,404	2,289 75,994,800	3.25
3	オリックス		その他金融業	9,810	6,706 65,781,837	6,780 66,511,800	2.84
4	三井物産		卸売業	60,200	1,127 67,846,002	1,104 66,460,800	2.84
5	三菱商事		卸売業	42,800	1,576 67,459,220	1,535 65,698,000	2.81
6	キヤノン		電気機器	17,900	3,746 67,060,199	3,150 56,385,000	2.41
7	アイシン精機		輸送用機器	22,800	2,744 62,566,349	2,455 55,974,000	2.39
8	J S R		化学	40,600	1,393 56,562,522	1,355 55,013,000	2.35
9	住友金属鉱山		非鉄金属	62,000	1,043 64,667,129	885 54,870,000	2.34
10	信越化学工業		化学	13,600	3,928 53,417,808	4,030 54,808,000	2.34
11	小松製作所		機械	26,600	1,874 49,858,508	1,878 49,954,800	2.13
12	日信工業		輸送用機器	45,700	1,194 54,582,709	1,059 48,396,300	2.07
13	三井住友トラスト・ホールディングス		銀行業	243,000	253 61,379,370	198 48,114,000	2.06

14	東芝機械	機械	122,000	418	386	2.01
				50,978,407	47,092,000	
15	京セラ	電気機器	7,000	7,165	6,490	1.94
				50,155,140	45,430,000	
16	S M C	機械	3,500	12,292	12,880	1.93
				43,022,945	45,080,000	
17	コムシスホールディングス	建設業	52,500	808	831	1.86
				42,428,865	43,627,500	
18	マキタ	機械	16,200	2,887	2,667	1.85
				46,772,640	43,205,400	
19	東京海上ホールディングス	保険業	24,600	1,973	1,707	1.79
				48,537,522	41,992,200	
20	東海理化電機製作所	輸送用機器	31,900	1,308	1,290	1.76
				41,723,381	41,151,000	
21	ヒロセ電機	電気機器	5,700	7,409	7,190	1.75
				42,234,036	40,983,000	
22	住友不動産販売	不動産業	11,770	3,239	3,470	1.75
				38,128,080	40,841,900	
23	H O Y A	精密機器	24,100	1,785	1,681	1.73
				43,013,159	40,512,100	
24	日東電工	化学	12,400	3,355	3,180	1.69
				41,602,000	39,432,000	
25	デンソー	輸送用機器	15,600	2,371	2,369	1.58
				36,994,620	36,956,400	
26	日立化成工業	化学	29,500	1,376	1,241	1.56
				40,583,740	36,609,500	
27	オイレス工業	機械	21,800	1,487	1,638	1.53
				32,426,628	35,708,400	
28	ロート製薬	医薬品	38,000	900	926	1.50
				34,200,000	35,188,000	
29	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	272	136,700	125,100	1.45
				37,182,400	34,027,200	
30	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	14,400	2,188	2,359	1.45
				31,507,200	33,969,600	

(注1) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

(注2) 投資比率は、小数点第3位を四捨五入しています。

2) 業種別投資比率

平成24年5月31日現在

国内/外国	業種	投資比率(%)
-------	----	---------

国内	化学	12.96
	輸送用機器	12.65
	機械	9.81
	電気機器	8.90
	卸売業	6.15
	情報・通信業	5.79
	小売業	5.68
	銀行業	5.30
	その他金融業	3.99
	建設業	3.98
	不動産業	3.94
	サービス業	3.11
	医薬品	2.63
	非鉄金属	2.34
	精密機器	2.25
	食料品	2.02
	保険業	1.79
	その他製品	1.44
	陸運業	1.37
	繊維製品	0.93
鉄鋼	0.08	
電気・ガス業	0.06	
合計	97.19	

(注1) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する各業種の評価額比率をいいます。

(注2) 投資比率は、小数点第3位を四捨五入しています。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		基準価額（円） （1万口当たりの純資産額）	
第3計算期間末 （平成14年10月21日）	（分配付）	4,310,523,131	（分配付）	6,059
	（分配落）	4,310,523,131	（分配落）	6,059
第4計算期間末 （平成15年10月20日）	（分配付）	5,263,264,236	（分配付）	7,134
	（分配落）	5,263,264,236	（分配落）	7,134
第5計算期間末 （平成16年10月19日）	（分配付）	6,218,372,365	（分配付）	7,936
	（分配落）	6,218,372,365	（分配落）	7,936
第6計算期間末 （平成17年10月19日）	（分配付）	7,005,435,875	（分配付）	9,321
	（分配落）	7,005,435,875	（分配落）	9,321
第7計算期間末 （平成18年10月19日）	（分配付）	5,965,128,015	（分配付）	10,831
	（分配落）	5,524,518,917	（分配落）	10,031
第8計算期間末 （平成19年10月19日）	（分配付）	4,555,559,710	（分配付）	9,474
	（分配落）	4,555,559,710	（分配落）	9,474

第 9計算期間末 (平成20年10月20日)	(分配付)	2,598,946,232	(分配付)	5,451
	(分配落)	2,598,946,232	(分配落)	5,451
第10計算期間末 (平成21年10月19日)	(分配付)	2,895,754,598	(分配付)	6,025
	(分配落)	2,895,754,598	(分配落)	6,025
第11計算期間末 (平成22年10月19日)	(分配付)	2,564,218,832	(分配付)	5,535
	(分配落)	2,564,218,832	(分配落)	5,535
第12計算期間末 (平成23年10月19日)	(分配付)	2,474,578,334	(分配付)	5,345
	(分配落)	2,474,578,334	(分配落)	5,345
平成23年 5月末		2,662,037,144		5,705
6月末		2,688,962,909		5,774
7月末		2,671,217,867		5,745
8月末		2,497,831,327		5,379
9月末		2,515,805,238		5,416
10月末		2,500,044,260		5,399
11月末		2,373,000,805		5,134
12月末		2,359,773,519		5,118
平成24年 1月末		2,442,379,994		5,300
2月末		2,686,641,608		5,825
3月末		2,759,694,311		5,975
4月末		2,640,436,998		5,718
平成24年5月31日		2,359,716,582		5,114

【分配の推移】

		1万口当たりの分配額（円）
第 3計算期間末	平成14年10月21日	0
第 4計算期間末	平成15年10月20日	0
第 5計算期間末	平成16年10月19日	0
第 6計算期間末	平成17年10月19日	0
第 7計算期間末	平成18年10月19日	800
第 8計算期間末	平成19年10月19日	0
第 9計算期間末	平成20年10月20日	0
第10計算期間末	平成21年10月19日	0
第11計算期間末	平成22年10月19日	0
第12計算期間末	平成23年10月19日	0

【収益率の推移】

期 間		収益率（％）
第 3計算期間	自 平成13年10月20日 至 平成14年10月21日	13.15
第 4計算期間	自 平成14年10月22日 至 平成15年10月20日	17.74
第 5計算期間	自 平成15年10月21日 至 平成16年10月19日	11.24
第 6計算期間	自 平成16年10月20日 至 平成17年10月19日	17.45

第 7 計算期間	自 平成17年10月20日 至 平成18年10月19日	16.20
第 8 計算期間	自 平成18年10月20日 至 平成19年10月19日	5.55
第 9 計算期間	自 平成19年10月20日 至 平成20年10月20日	42.46
第10計算期間	自 平成20年10月21日 至 平成21年10月19日	10.53
第11計算期間	自 平成21年10月20日 至 平成22年10月19日	8.13
第12計算期間	自 平成22年10月20日 至 平成23年10月19日	3.43
第13計算期間 中間期	自 平成23年10月20日 至 平成24年 4月19日	7.46

(注) 収益率は、計算期間末日の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末日の基準価額(分配落の額、以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して計算し、小数点第3位を四捨五入しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

期 間	設定数量(口)	解約数量(口)	
第 3 計算期間	自 平成13年10月20日 至 平成14年10月21日	212,740,369	563,690,257
第 4 計算期間	自 平成14年10月22日 至 平成15年10月20日	1,439,723,690	1,176,018,918
第 5 計算期間	自 平成15年10月21日 至 平成16年10月19日	1,301,477,321	843,846,527
第 6 計算期間	自 平成16年10月20日 至 平成17年10月19日	2,052,387,007	2,372,061,974
第 7 計算期間	自 平成17年10月20日 至 平成18年10月19日	970,428,719	2,978,775,591
第 8 計算期間	自 平成18年10月20日 至 平成19年10月19日	573,345,764	1,272,653,468
第 9 計算期間	自 平成19年10月20日 至 平成20年10月20日	132,214,425	172,966,110
第10計算期間	自 平成20年10月21日 至 平成21年10月19日	179,808,800	140,761,393
第11計算期間	自 平成21年10月20日 至 平成22年10月19日	140,515,688	314,034,907
第12計算期間	自 平成22年10月20日 至 平成23年10月19日	176,123,445	179,113,825
第13計算期間 中間期	自 平成23年10月20日 至 平成24年 4月19日	65,286,641	76,291,342

(注) 日本国外における設定および解約はありません。

(参考情報)

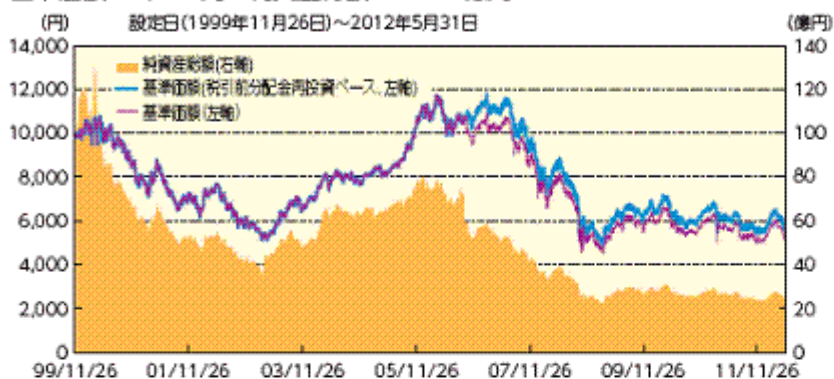


運用実績

(2012年5月31日現在)

● 基準価額・純資産の推移

基準価額 5,114円 純資産総額 23.59億円



※基準価額(税引前分配金再投資ベース)は信託報酬控除後であり、税引前分配金を再投資した
ものとして計算しています。

※基準価額は信託報酬控除後です。

● 分配の推移

決算期	分配金
2007年10月	0円
2008年10月	0円
2009年10月	0円
2010年10月	0円
2011年10月	0円
設定来累計	800円

※分配金は1万口当たり、税引前の金額
です。

● 主要な資産の状況

マザーファンドの資産の状況を記載しています。

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する投資比率です。

資産別構成

	比率
株式	97.2%
その他資産	2.8%
合計	100.0%

組入上位10業種

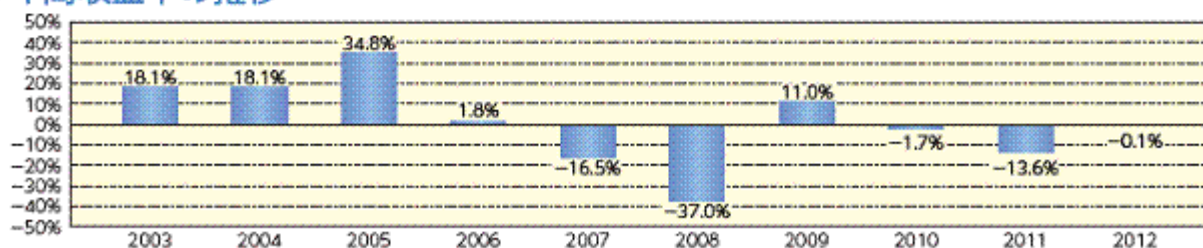
順位	業種名	比率
1	化学	13.0%
2	輸送用機器	12.7%
3	機械	9.8%
4	電気機器	8.9%
5	卸売業	6.1%
6	情報・通信業	5.8%
7	小売業	5.7%
8	銀行業	5.3%
9	その他金融業	4.0%
10	建設業	4.0%

※業種は東証33業種分類によります。

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	比率
1	本田技研工業	3.4%
2	三井住友フィナンシャルグループ	3.2%
3	オリックス	2.8%
4	三井物産	2.8%
5	三菱商事	2.8%
6	キヤノン	2.4%
7	アイシン精機	2.4%
8	JSR	2.4%
9	住友金属鉱山	2.3%
10	信越化学工業	2.3%

● 年間収益率の推移



※年間収益率は、税引前分配金を再投資したものと計算しています。

※2012年は5月31日までの収益率を表示しています。

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・最新の運用状況は、委託会社のホームページで確認することができます。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」の末尾に以下の内容が追加されます。

<追加>

当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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13期中間計算期間（平成23年10月20日から平成24年4月19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。

1【財務諸表】

原届出書「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」の末尾に以下の内容が追加されま
す。

<追加>

中間財務諸表

朝日ライフ リサーチ 日本株オープン

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

第13期中間計算期間 (平成24年 4月19日現在)	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	500,538
コール・ローン	28,269,354
親投資信託受益証券	2,644,388,314
未収利息	46
流動資産合計	2,673,158,252
資産合計	2,673,158,252
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4
未払受託者報酬	1,315,919
未払委託者報酬	18,422,830
その他未払費用	65,730
流動負債合計	19,804,483
負債合計	19,804,483
純資産の部	
元本等	
元本	4,619,087,445
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	1,965,733,676
(分配準備積立金)	446,805,189
元本等合計	2,653,353,769
純資産合計	2,653,353,769
負債純資産合計	2,673,158,252

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期中間計算期間 自平成23年10月20日 至平成24年 4月19日
営業収益	
受取利息	10,223
有価証券売買等損益	203,354,990
営業収益合計	203,365,213
営業費用	
受託者報酬	1,315,919
委託者報酬	18,422,830
その他費用	65,730
営業費用合計	19,804,479
営業利益	183,560,734
経常利益	183,560,734
中間純利益	183,560,734
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	357,974
期首剰余金又は期首欠損金()	2,155,513,812
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,628,152
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,628,152
剰余金減少額又は欠損金増加額	29,766,724
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	29,766,724
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,965,733,676

（ 3 ）【中間注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

項目	第13期中間計算期間 自 平成23年10月20日 至 平成24年 4月19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、基準価額により評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 追加情報	当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（ 中間貸借対照表に関する注記 ）

項目	第13期中間計算期間 (平成24年 4月19日現在)
1. 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額	
期首元本額	4,630,092,146円
期中追加設定元本額	65,286,641円
期中一部解約元本額	76,291,342円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,619,087,445口
3. 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その金額は1,965,733,676円であります。
4. 1単位（1万口）当たりの純資産額 （1口当たりの純資産額）	5,744円 (0.5744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

第13期中間計算期間 (平成24年4月19日現在)
<p>1. 中間貸借対照表計上額、時価および差額</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で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>(1) 親投資信託受益証券</p> <p>「注記表(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>(2) コール・ローン等の金銭債権および金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</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>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

第13期中間計算期間 (平成24年4月19日現在)
デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（参考情報）

当ファンドは、「朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて「朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド」の受益証券です。

なお、「朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド」の状況は以下のとおりです。

「朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（１）貸借対照表

(単位：円)

		(平成24年4月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		24,938,971
株式		2,568,454,250
未収入金		51,779,486
未収配当金		30,960,950
未収利息		40
流動資産合計		2,676,133,697
資産合計		2,676,133,697
負債の部		
流動負債		
未払金		31,908,270
流動負債合計		31,908,270
負債合計		31,908,270
純資産の部		
元本等		
元本		3,478,085,380
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		833,859,953
元本等合計		2,644,225,427
純資産合計		2,644,225,427
負債純資産合計		2,676,133,697

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成23年10月20日 至 平成24年 4月19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、半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場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、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 追加情報	当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年 4月19日現在)
1. 半期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、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額	
期首元本額	3,514,369,851円
期中追加設定元本額	-
期中一部解約元本額	36,284,471円
2. 元本の内訳	
朝日ライフ リサーチ 日本株オープン	3,478,085,380円
3. 半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	3,478,085,380口
4. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その金額は833,859,953円であります。
5. 1単位（1万口）当たりの純資産額 （1口当たりの純資産額）	7,603円 (0.7603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24年 4月19日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価および差額	

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、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

(1)株式

「注記表(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。

(2)コール・ローン等の金銭債権および金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(3)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年4月19日現在)

デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」は以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

平成24年5月31日

資産総額	2,364,765,322 円
負債総額	5,048,740 円
純資産総額（ - ）	2,359,716,582 円
発行済数量	4,613,949,247 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5114 円
（1万口当たり純資産額）	（5,114 円）

<参考>マザーファンドの現況

朝日ライフ リサーチ 日本株マザーファンド

平成24年5月31日

資産総額	2,354,005,116 円
負債総額	13,887,428 円
純資産総額（ - ）	2,340,117,688 円
発行済数量	3,451,557,957 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6780 円
（1万口当たり純資産額）	（6,780 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】

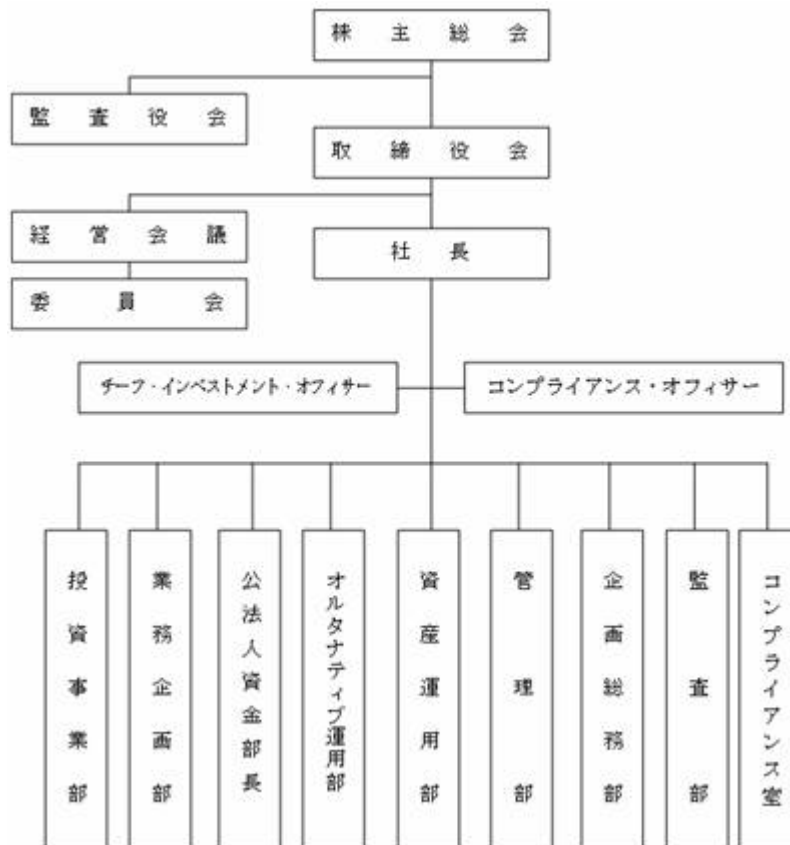
<訂正前>

資本金の額等（平成23年11月末現在）

（略）

委託会社の機構

・会社の意思決定機構



（略）

<訂正後>

資本金の額等（平成24年5月末現在）

（略）

委託会社の機構

・会社の意思決定機構

委託会社の経営にあたる取締役は、株主総会によって選任されます。その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。

取締役全員で構成される取締役会は、委託会社の経営の基本方針を決定するとともに、代表取締役を選任します。代表取締役は会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、常勤取締役および役付執行役員によって構成される経営会議が、取締役会から委任を受けた事項を決定します。

（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」は以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

「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当社は、証券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）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務の一部および投資助言業務を行っています。平成24年5月31日現在、当社の証券投資信託のうち、公募により勧誘が行われたものについての種類別の本数および純資産総額は以下のとおりです。なお、下記の他に私募により勧誘が行われた証券投資信託（純資産総額合計1,593億円）の運用を行っています。

種 類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	8	38,932
合 計	8	38,932

3【委託会社等の経理状況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」は以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

1. 財務諸表の作成方法について

当社の財務諸表は、「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条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成23年4月1日から平成24年3月31日まで)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。

財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期別		第26期 (平成23年3月31日)		第27期 (平成24年3月31日)	
科目	注記 番号	内訳	金額	内訳	金額
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			1,878,783		2,072,612
有価証券			-		199,975
前払費用	2		43,490		41,536
未収委託者報酬			140,954		147,060
未収運用受託報酬	2		405,408		439,269
未収収益			11,816		11,501
繰延税金資産			59,407		64,145
その他			33,271		11,182
流動資産計			2,573,132		2,987,284
固定資産					
有形固定資産					
建物	1	20,586		18,456	
器具備品	1	20,900	41,486	26,078	44,534
無形固定資産					
電話加入権		2,776		2,776	
ソフトウェア		7,957	10,733	4,849	7,625
投資その他の資産					
投資有価証券		1,310,501		1,107,646	
関係会社株式		39,857		38,574	
長期差入保証金	2	29,820		28,234	
繰延税金資産		50,119	1,430,298	34,513	1,208,967
固定資産計			1,482,518		1,261,128
資産合計			4,055,650		4,248,412

(単位：千円)

期別		第26期 (平成23年3月31日)		第27期 (平成24年3月31日)	
科目	注記 番号	内訳	金額	内訳	金額
(負債の部)					
流動負債					
預り金			6,337		32,156
未払金					
未払手数料	2	39,103		38,362	
その他未払金		12,063	51,167	14,580	52,942
未払費用	2		267,058		335,518
未払法人税等			264		716
未払消費税等			18,383		23,350
賞与引当金			82,020		104,118
流動負債計			425,230		548,803
負債合計			425,230		548,803
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			3,000,000		3,000,000
資本剰余金					
資本準備金		524,000	524,000	524,000	524,000
利益剰余金					
利益準備金		216,800		216,800	
その他利益剰余金					
繰越利益剰余金		110,869	105,930	41,710	175,089
株主資本合計			3,629,930		3,699,089
評価・換算差額等					
その他有価証券評価差額金			489		519
評価・換算差額等合計			489		519
純資産合計			3,630,419		3,699,609
負債・純資産合計			4,055,650		4,248,412

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

期別		第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）		第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	
科目	注記 番号	内訳	金額	内訳	金額
営業収益					
委託者報酬		1,474,346		1,612,285	
運用受託報酬		1,329,383		1,453,066	
その他営業収益		67,967	2,871,697	71,692	3,137,044
営業費用	1				
支払手数料			365,358		392,860
広告宣伝費			15,862		6,141
公告費			1,140		1,140
調査費					
調査費		396,780		396,480	
委託調査費		1,014,938		1,137,841	
図書費		2,390	1,414,109	1,804	1,536,126
営業雑経費					
通信費		3,611		2,994	
印刷費		8,764		6,222	
協会費		3,743		3,839	
諸会費		1,253		1,343	
その他営業雑経費		825	18,197	438	14,837
営業費用計			1,814,668		1,951,106
一般管理費	1				
給料					
役員報酬		77,984		75,464	
給料・手当		746,694		630,854	
賞与		8,445	833,124	6,775	699,543
交際費			6,192		3,908
寄付金			2,970		2,787
旅費交通費			25,577		20,270
租税公課			14,571		15,037
不動産賃借料			89,537		86,990
退職給付費用			39,677		37,782
福利厚生費			92,550		90,570
賞与引当金繰入			73,387		92,169
固定資産減価償却費			15,371		16,074
諸経費			93,563		86,018
一般管理費計			1,286,523		1,151,153
営業利益又は営業損失()			229,493		34,783
営業外収益					
受取配当金	1		18,360		19,541
有価証券利息			17,927		16,579
受取利息			239		105
受取賃借料			14,870		13,531
雑収入	1		1,765		849
営業外収益計			53,162		50,607
営業外費用					
為替差損			-		720
雑損			14		98
営業外費用計			14		818

経常利益又は経常損失()			176,346		84,572
特別損失					
固定資産除却損	2		269		831
関係会社株式評価損			-		1,282
勤労対策特別費用			40,884		-
資産除去債務会計基準 の適用に伴う影響額			3,316		-
その他特別損失			229		92
特別損失計			44,699		2,207
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失()			221,045		82,365
法人税、住民税及び事業税		2,290		2,290	
法人税等調整額		34,715	37,005	10,916	13,206
当期純利益又は当期純損失()			258,051		69,158

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

		第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	
株主資本				
資本金	当期首残高	3,000,000	3,000,000	
	当期変動額	-	-	
	当期末残高	3,000,000	3,000,000	
資本剰余金				
資本準備金	当期首残高	524,000	524,000	
	当期変動額	-	-	
	当期末残高	524,000	524,000	
資本剰余金合計	当期首残高	524,000	524,000	
	当期変動額	-	-	
	当期末残高	524,000	524,000	
利益剰余金				
利益準備金	当期首残高	216,800	216,800	
	当期変動額	-	-	
	当期末残高	216,800	216,800	
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金	当期首残高	147,181	110,869	
	当期変動額	当期純利益又は 当期純損失（ ）	258,051	69,158
	当期末残高	110,869	41,710	
利益剰余金合計	当期首残高	363,981	105,930	
	当期変動額	258,051	69,158	
	当期末残高	105,930	175,089	
株主資本合計	当期首残高	3,887,981	3,629,930	
	当期変動額	258,051	69,158	
	当期末残高	3,629,930	3,699,089	
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金	当期首残高	202	489	
	当期変動額	株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	287	30
	当期末残高	489	519	
評価・換算差額等合計	当期首残高	202	489	
	当期変動額	287	30	
	当期末残高	489	519	
純資産合計	当期首残高	3,888,184	3,630,419	
	当期変動額	257,764	69,189	
	当期末残高	3,630,419	3,699,609	

重要な会計方針

項目	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)満期保有目的の債券 償却原価法（定額法） (2)子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (3)その他有価証券 時価のあるもの 期末日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの 移動平均法による原価法
2. 固定資産の減価償却方法	(1)有形固定資産 定率法（ただし平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。 なお、主な耐用年数は、建物6年～24年、器具備品3年～15年であります。 (2)無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。
3. 引当金の計上基準	賞与引当金 従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち、当期の負担額を計上しております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の処理方法 消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

追加情報

（会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用）
当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

（単位：千円）

項目	第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額		
建物	28,770	31,100
器具備品	95,717	88,435
2 関係会社に対する資産及び負債		
前払費用	4,579	4,579
未収運用受託報酬	2,852	3,399
長期差入保証金	27,755	27,755
未払手数料	18,046	16,475
未払費用	4,802	5,394

（損益計算書関係）

（単位：千円）

項目	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1 関係会社との取引に係るもの		

営業費用	214,927	228,237
一般管理費	258,006	219,543
受取配当金	18,360	19,380
雑収入	312	308
2 固定資産除却損の内訳		
器具備品	269	831

（株主資本等変動計算書関係）

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

（単位：株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
発行済株式				
普通株式	32,000	-	-	32,000
合計	32,000	-	-	32,000

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

第27期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

（単位：株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
発行済株式				
普通株式	32,000	-	-	32,000
合計	32,000	-	-	32,000

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、第二種金融商品取引業（委託者指図型投資信託の受益権の私募に係る業務）、投資助言・代理業（投資顧問契約に係る業務）及び投資運用業（投資一任契約に係る業務及び投資信託に係る業務）を営んでおります。

当社の金融商品に対する取組方針に関しましては、資産運用を行うに当たっては、会社経営の社会性・公共性の観点から問題を生ぜしめないように十分な配慮を行い、財務健全性の見地からリスク分散を図るとともに、経営体力に見合ったものとするよう定めております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

当社が保有する金融商品には、関係会社株式、投資信託、及び満期保有目的の債券が含まれております。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び金利の変動リスク、市場価格の変動リスクに晒されております。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

当社の金融商品に係るリスク管理体制に関しましては、対象となる運用資産、取引、コンプライアンスチェック等を定めるとともに、実際に保有する金融商品については、定期的に発行体の財務状況、時価等を

把握し、保有状況を見直すよう努めております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）参照）。

第26期（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	1,878,783	1,878,783	-
(2) 未収委託者報酬	140,954	140,954	-
(3) 未収運用受託報酬	405,408	405,408	-
(4) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	1,306,676	1,342,550	35,873
その他有価証券	3,824	3,824	-
(5) 未払費用	267,058	267,058	-

第27期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	2,072,612	2,072,612	-
(2) 未収委託者報酬	147,060	147,060	-
(3) 未収運用受託報酬	439,269	439,269	-
(4) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	1,304,814	1,338,420	33,605
その他有価証券	2,807	2,807	-
(5) 未払費用	335,518	335,518	-

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、並びに(5) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価については、債券は取引金融機関から提示された価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	平成23年3月31日	平成24年3月31日
非上場株式	39,857	38,574

上記については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	1,878,783	-	-	-

未収委託者報酬	140,954	-	-	-
未収運用受託報酬	405,408	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券				
（1）国債・地方債等	-	606,097	-	-
（2）社債	-	99,829	-	-
（3）その他	-	396,887	203,861	-
合計	2,425,146	1,102,814	203,861	-

第27期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	2,072,612	-	-	-
未収委託者報酬	147,060	-	-	-
未収運用受託報酬	439,269	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券				
（1）国債・地方債等	99,998	503,914	-	-
（2）社債	99,977	-	-	-
（3）その他	-	397,563	203,361	-
合計	2,858,918	901,477	203,361	-

（有価証券関係）

1. 満期保有目的の債券

第26期（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	時価	差額
時価が貸借対照表計上額を 超えるもの	（1）国債・地方債等	606,097	614,990	8,892
	（2）社債	99,829	101,170	1,340
	（3）その他	496,887	523,250	26,362
	小計	1,202,814	1,239,410	36,595
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	（1）国債・地方債等	-	-	-
	（2）社債	-	-	-
	（3）その他	103,861	103,140	721
	小計	103,861	103,140	721
合計		1,306,676	1,342,550	35,873

第27期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	時価	差額
時価が貸借対照表計上額を 超えるもの	（1）国債・地方債等	603,912	610,390	6,477
	（2）社債	99,977	100,170	192
	（3）その他	600,924	627,860	26,935
	小計	1,304,814	1,338,420	33,605
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	（1）国債・地方債等	-	-	-
	（2）社債	-	-	-
	（3）その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		1,304,814	1,338,420	33,605

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式26,074千円、関連会社株式12,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式27,357千円、関連会社株式12,500千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,000	3,824	824
	小計	3,000	3,824	824
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		3,000	3,824	824

第27期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	2,000	2,807	807
	小計	2,000	2,807	807
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		2,000	2,807	807

4. 事業年度中に売却したその他有価証券

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

第27期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く利用しておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出年金法の施行に伴い、平成19年3月より確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付費用の内訳

（単位：千円）

	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
確定拠出掛金	39,677	37,782

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の主な発生原因別の内訳

（単位：千円）

	第26期 （平成23年3月31日）	第27期 （平成24年3月31日）
繰延税金資産 （流動）		
未払事業税	2,250	2,294
未払事業所税	1,287	1,111
賞与引当金	29,861	36,189
未払役員報酬	308	303

未払法定福利費	3,512	4,717
未払寄付金	634	536
コンサルティング費用	203	190
インデックス使用料	152	142
未払確定拠出掛金	1,295	1,174
未返還投資顧問料	2,610	2,946
未払監査費用	3,355	3,061
未払アセスメント費用	1,395	-
未払調査費	-	2,508
繰越欠損金	12,537	8,970
繰延税金資産合計	59,407	64,145
(固定)		
関係会社株式評価損	4,265	4,192
インデックス使用料	356	190
敷金	1,571	1,570
繰越欠損金	169,479	113,949
小計	175,672	119,903
評価性引当金	125,216	85,102
繰延税金資産合計	50,455	34,800
繰延税金負債		
(固定)		
其他有価証券評価差額金	335	287
繰延税金負債合計	335	287
繰延税金資産の純額	109,527	98,658

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった項目別の内訳

(単位：%)

	第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
法定実効税率	-	40.69
(調整)		
永久に損金に算入されない項目	-	6.31
永久に益金に算入されない項目	-	9.60
住民税均等割	-	2.78
評価性引当金の増減	-	34.06
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	9.92
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	16.03

(注) 前事業年度は、税引前当期純損失が計上されているため、記載しておりません。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」(平成23年法律第114号)及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」(平成23年法律第117号)が平成23年12月2日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算(ただし、平成24年4月1日以降解消されるものに限る)に使用した法定実効税率は、前事業年度の40.69%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成24年4月1日から平成27年3月31日までのものは38.01%、平成27年4月1日以降のものについては35.64%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が8,133千円減少し、法人税等調整額8,174千円、其他有価証券評価差額金が40千円それぞれ増加しております。

(持分法損益等)

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
関連会社等に対する投資の金額	38,000	38,000
持分法を適用した場合の投資の金額	127,764	129,310
持分法を適用した場合の投資利益の金額	20,981	20,925

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち、貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

当社はオフィスの不動産貸借契約に基づき、オフィスの退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しております。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該資産除去債務については、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産貸借契約に関連する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積もり、そのうち当期の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

この見積もりにあたり、使用見込期間は当該オフィスビルの耐用年数である50年を採用しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
期首残高(注)	23,943	23,398
増減額(は減少)	545	545
期末残高	23,398	22,853

(注) 前事業年度の「期首残高」は「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用したことによる残高であります。

(セグメント情報等)

〔セグメント情報〕

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

〔関連情報〕

第26期(自平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

製品・サービスの区分の外部顧客への売上高については、損益計算書に記載しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客への売上高が損益計算書の売上高の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が、貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

対象となる外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載

はありません。

なお、制度上顧客情報を知りえない、または顧客との守秘義務契約により開示できない売上については、判定対象から除いております。

第27期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

製品・サービスの区分の外部顧客への売上高については、損益計算書に記載しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客への売上高が損益計算書の売上高の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が、貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

対象となる外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

なお、制度上顧客情報を知りえない、または顧客との守秘義務契約により開示できない売上については、判定対象から除いております。

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれん償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

親会社及び法人主要株主等

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等の 被所有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	朝日生命保険相互会社	千代田区	166,000	生命保険業	(被所有) 直接100%	投資顧問契約に基づく資産運用 受託、及び証券投資信託受益証券の募集販売	運用受託報酬	35,115	未収運用受託報酬	2,852
							出向者人件費の 支払、代行手数料 支払、賃借料 ・共益費支払他	386,179	未払金	18,046
									前払費用	4,579

第27期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等の 被所有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	------------	-----	-------------------	---------------	----------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

親会社	朝日生命保険相互会社	千代田区	166,000	生命保険業	(被所有) 直接100%	投資顧問契約に基づく資産運用 受託、及び証券投資信託受益証券 の募集販売	運用受託報酬	37,437	未収運用 受託報酬	3,399
							出向者人件費の 支払、代 hands 手数料 支払、賃借料 ・共益費支払他	361,886	未払金	16,475
									前払費用	4,579

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投資顧問契約については、一般の顧客と同様の取扱いをしております。
証券投資信託受益証券の募集販売の取引条件については、一般の販売会社と同様の取扱いをしております。
3. 営業費用のうち、賃借料・共益費については、朝日不動産管理株式会社が収納事務の代理を行っており、同社を経由した取引となっております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

朝日生命保険相互会社(相互会社であるため上場しておりません)

(1株当たり情報)

(単位: 円)

項目	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	113,450.62	115,612.78
1株当たり当期純利益又は当期純損失()	8,064.09	2,161.21

なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、前事業年度は1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。当事業年度は、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たりの当期純利益又は当期純損失()金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
損益計算書上の当期純利益又は当期純損失()	258,051千円	69,158千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益又は当期純損失()	258,051千円	69,158千円
普通株式の期中平均株式数	32,000株	32,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限」は以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。);

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。);

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。) または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。) と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1 名称、資本金の額及び事業の内容」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

<受託会社>

名称

みずほ信託銀行株式会社

資本金の額(平成24年3月末現在)

247,369百万円

事業の内容

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等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

(参考) 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

資本金の額: 50,000百万円(平成24年3月末現在)

事業の内容: 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等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<販売会社>

	名称	資本金の額 (単位: 百万円)	事業の内容
1)	藍澤證券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2)	安藤証券株式会社	2,280	同上
3)	SMBc日興証券株式会社	10,000	同上
4)	株式会社SBI証券	47,937	同上
5)	岡三証券株式会社	5,000	同上
6)	カブドットコム証券株式会社	7,196	同上
7)	極東証券株式会社	5,251	同上
8)	三栄証券株式会社	621	同上
9)	高木証券株式会社	11,069	同上
10)	東海東京証券株式会社	6,000	同上
11)	西日本シティIT証券株式会社	1,575	同上
12)	日産センチュリー証券株式会社	1,500	同上
13)	浜銀IT証券株式会社	3,307	同上
14)	日の出証券株式会社	4,650	同上
15)	廣田証券株式会社	600	同上
16)	フィリップ証券株式会社	800	同上
17)	マネックス証券株式会社	7,425	同上
18)	丸八証券株式会社	3,676	同上
19)	みずほインベスターズ証券株式会社(1)	80,288	同上
20)	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	同上
21)	むさし証券株式会社	5,000	同上
22)	八幡証券株式会社	1,260	同上
23)	楽天証券株式会社	7,495	同上
24)	リテラ・クレア証券株式会社	3,794	同上
25)	株式会社トマト銀行(1)	14,310	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
26)	株式会社みずほ銀行	700,000	同上
27)	株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065	同上
28)	楽天銀行株式会社	25,954	同上
29)	三井住友信託銀行株式会社(2)	342,037	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等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
30)	株式会社りそな銀行	279,928	同上
31)	日本興亜損害保険株式会社	91,249	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
32)	朝日生命保険相互会社	(3) 166,000	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注) 資本金の額は、平成24年3月末現在を記載しています。

- (1) みずほインベスターズ証券株式会社および株式会社トマト銀行は、現在新規の募集の取扱いを行っていません。
- (2) 三井住友信託銀行株式会社の資本金額は、平成24年4月1日現在を記載しています。
- (3) 朝日生命保険相互会社の資本金の額は、「基金」の額を記載しています。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年6月22日

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
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 杉山 正治
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 窪寺 信
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」に掲げられている朝日ライフ リサーチ 日本株オープンの平成23年10月20日から平成24年4月19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、朝日ライフ リサーチ 日本株オープンの平成24年4月19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23年10月20日から平成24年4月19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

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

-
- (注) 1. 上記は、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. 中間財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月21日

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
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

杉山 正治

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士

窪寺 信

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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている朝日ライフ アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記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、朝日ライフ アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績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

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）上記は、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。

