

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成23年4月8日提出
【発行者名】	ニッセイ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 皆川 卓士
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6 号
【事務連絡者氏名】	投資信託業務部 澤田 昌彦
【電話番号】	03 - 5533 - 4605
【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】	TAA株50ポートフォリオ TAA株100ポートフォリオ
【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 各ファンドにつき上限 3,000億円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

T A A株50ポートフォリオ

T A A株100ポートフォリオ

上記2ファンドの愛称として「マイポート」ということがあります。

（以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」ということがあります）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）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、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はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき3,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額です。基準価額は日々変動します。なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示されます。

基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、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。

なお、委託会社へは後記「（8）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

なお、販売会社につきましては、後記「（8）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成23年4月9日（土）～平成24年4月10日（火）

なお、継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター 0120-762-506
(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)
ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

(9) 【払込期日】

取得申込者は、各販売会社が定める期日(詳しくは販売会社にお問合せください)までに、申込代金を各販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に各々の販売会社より、委託会社の指定する口座を経由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座(受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座)に払込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター 0120-762-506
(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)
ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

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】

基本方針

T A A株50ポートフォリオは、主に国内の株式、公社債および短期金融資産への投資により、信託財産の長期的かつ着実な成長を図ることを目標として運用を行います。

T A A株100ポートフォリオは、主に国内の株式、公社債および短期金融資産への投資により、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

ファンドの特色

国内の株式、公社債、短期金融資産を主な投資対象とします。

- ・各ファンドにおいて以下のベンチマーク¹を中長期的観点から上回ることを目標とします。

T A A株50ポートフォリオ：東証株価指数（TOPIX）²50%、無担保コール翌日物50%を合成し、委託会社で独自に指数化したもの

T A A株100ポートフォリオ：東証株価指数（TOPIX）

- 1 ベンチマークとは、あくまでも運用上の目標であって利回りを保証するものではありません。
- 2 東証株価指数（TOPIX）とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。東証株価指数は、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、東証株価指数の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数の算出もしくは公表の停止または東証株価指数の商標もしくは使用の停止を行うことができます。

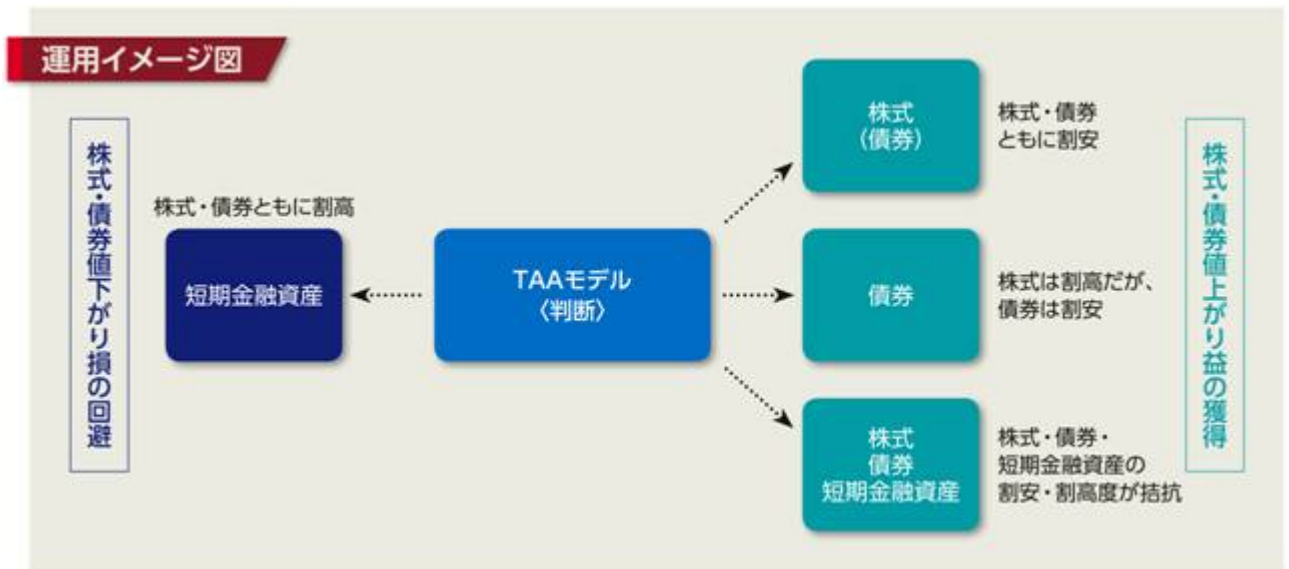
株式、公社債および短期金融資産の組入比率の変更は、ニッセイ基礎研究所が開発したT A Aモデルを原則として利用します。

- ・ファンドでは、T A Aモデルを利用し、企業業績・金利・株価水準等のファンダメンタルズ・データから株式・債券の投資価値とその相対的な割安・割高度を分析し、これに基づく適切な資産配分（株式、公社債、短期金融資産の組入比率の変更）を行うことでパフォーマンスの向上をめざします。
- ・T A Aとは、タクティカル・アセット・アロケーション（戦術的資産配分）の略称で、価格変動のリスクを抑えつつ、3資産（株式、公社債、短期金融資産）の最適な組入比率を一定の運用ルールのもとで機動的に変更していくことにより、運用成果の向上をめざす運用手法です。なお、T A Aモデルについては継続的に評価、分析を行い、必要と判断した場合には見直しを行うことがあります。
- ・資産の組入比率の変更にあたっては、運用の効率化を図るため株価指数先物および債券先物

等をヘッジ目的に限定せず活用することがあります。

< 株式会社ニッセイ基礎研究所について >

ニッセイ基礎研究所は、日本生命の創業100周年記念事業として1988年7月に設立されたニッセイグループのシンクタンクです。生命保険分野にとどまらず、国内外の経済・金融、資産運用、年金・福祉・雇用に至るまで幅広い分野で、中立公正な立場から基礎的かつ問題解決型の調査・研究を実施しています。



投資者の皆様のご判断により、各ファンド間のスイッチング ができます。

- ・スイッチングには手数料はかかりません。

スイッチングとは、保有しているファンドの換金と同時に乗換えるファンドを購入する取引です。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

各ファンドにつき、3,000億円とします。ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの分類

追加型投信 / 国内 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

ファンドの商品分類表・属性区分表は以下の通りです（該当区分を網掛け表示しています）。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
---------	--------	-------------------

単位型 追加型	国内	株式 債券
	海外	不動産投信 その他資産
	内外	() 資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル 日本
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回 年4回 年6回 (隔月)	北米 欧州 アジア オセアニア
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米
その他資産 ()	日々	アフリカ
資産複合 (株式・債券・短期金融資産)	その他 ()	中近東 (中東)
資産配分固定型 資産配分変更型		エマー ジング

商品分類表

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

属性区分表

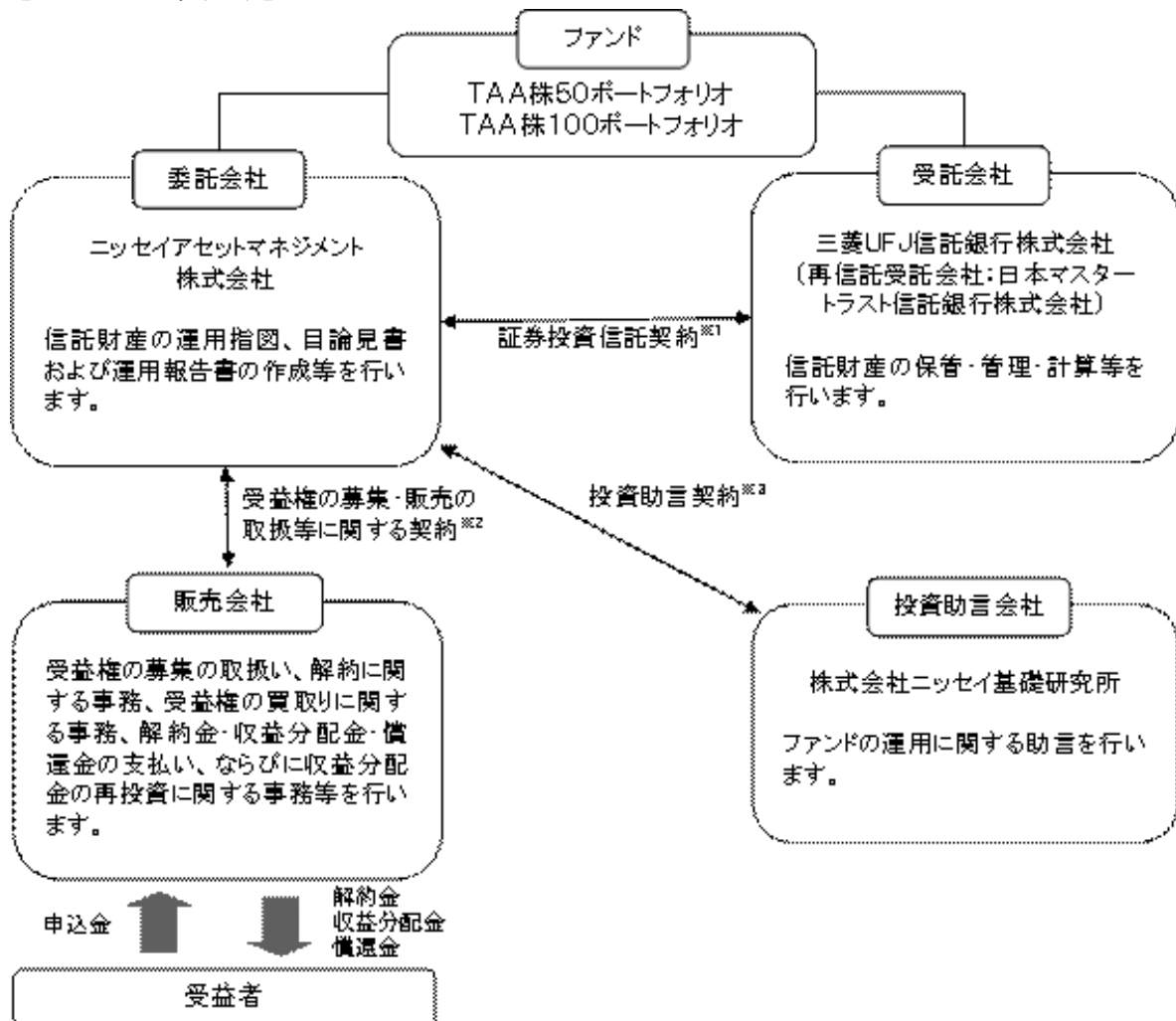
資産複合（株式・債券・短期金融資産）	目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
資産配分変更型	目論見書または約款において、主として株式、公社債等および短期金融資産に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、
社団法人 投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

（２）【ファンドの沿革】

平成8年12月11日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（平成23年2月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 皆川 卓士
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号

6. 設立年月日 : 平成7年4月4日

7. 沿革

昭和60年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。

平成7年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。

平成10年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。

平成12年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

8. 大株主の状況

名 称	住 所	保有株数	比 率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号	97,604株	90.00%
パトナム・ユーエス・ホールディングス・エルエルシー	アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市ワン・ポスト・オフィス・スクエア	10,844株	10.00%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

T A A株50ポートフォリオ

株式、公社債および短期金融資産の組入比率の変更は、ニッセイ基礎研究所が開発したT A Aモデルを原則として利用して行います。

なお、T A Aモデルにつきましては、継続的に評価、分析を行い、必要と判断した場合には、見直しを行うことがあります。

資産の組入比率の変更にあたっては、運用の効率化をはかるために、ヘッジ目的に限定せず、株価指数先物および債券先物等を活用することがあります。ただし、株価指数先物および債券先物等を考慮した株式および債券の合計の実質組入比率は純資産総額の範囲内とします。

また、株価指数先物を考慮した株式の実質組入比率は純資産総額の50%以下とします。

株式については、東証株価指数（TOPIX）に連動することを目的とした銘柄選択を行い、運用します。

公社債については、流動性を考慮のうえ、国内の公社債を中心に運用を行います。

短期金融資産については、C D、C P、コール・ローン等を中心に運用を行います。

資金の50%を株式（東証株価指数（TOPIX））、50%を短期金融資産（コール）で常に運用したと仮定した基準ポートフォリオをベンチマークとし、中長期的観点からこれを上回ることを目標とした運用を行います。

T A A株100ポートフォリオ

株式、公社債および短期金融資産の組入比率の変更は、ニッセイ基礎研究所が開発したT A Aモデルを原則として利用して行います。

なお、T A Aモデルにつきましては、継続的に評価、分析を行い、必要と判断した場合には、見直しを行うことがあります。

資産の組入比率の変更にあたっては、運用の効率化をはかるために、ヘッジ目的に限定せず、株価指数先物および債券先物等を活用することがあります。ただし、株価指数先物および債券先物等を考慮した株式および債券の合計の実質組入比率は純資産総額の範囲内とします。

また、株価指数先物を考慮した株式の実質組入比率は純資産総額の範囲内とします。
株式については、東証株価指数（TOPIX）に連動することを目的とした銘柄選択を行い、運用しま

す。
公社債については、流動性を考慮のうえ、国内の公社債を中心に運用を行います。
短期金融資産については、CD、CP、コール・ローン等を中心に運用を行います。
東証株価指数（TOPIX）をベンチマークとし、中長期的観点からこれを上回ることを目標とした運用を行います。

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

国内の株式、公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。

b 約款に定める投資対象

有価証券

ファンドは、主に次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます）を投資対象とします。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます）の新株引受権証券を除きます）
6. コマーシャル・ペーパー
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.から6.の証券または証書の性質を有するもの
8. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
9. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます）
10. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます）
12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
13. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
14. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で15.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書および7.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から5.までの証券および7.の証券のうち2.から5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、9.および10.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品

ファンドは前記 に掲げる有価証券のほかに、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きま

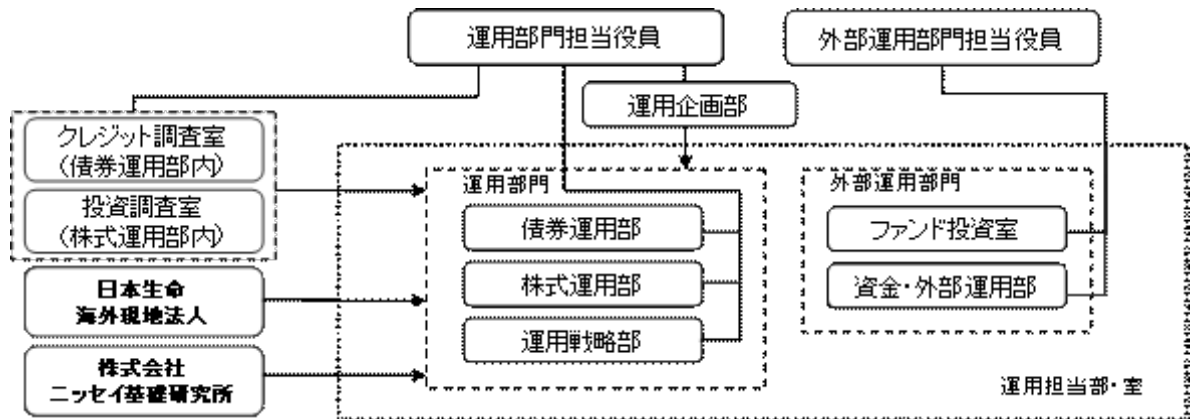
す)

- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で5．の権利の性質を有するもの

前記にかかわらず、ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記の1．から4．までに掲げる金融商品により運用することができます。

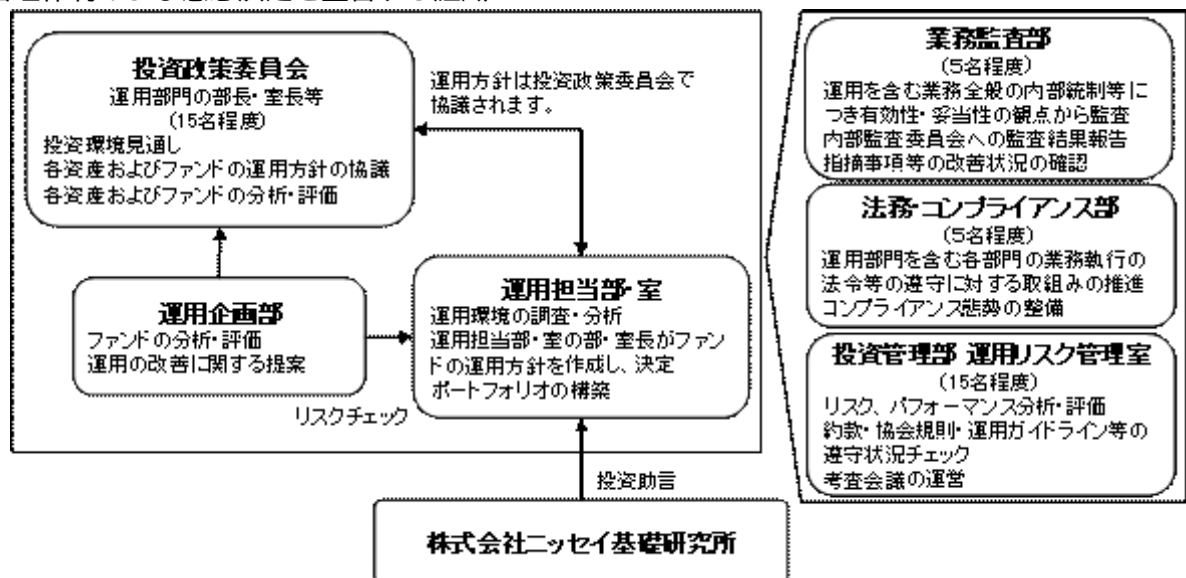
(3) 【運用体制】

委託会社の組織体制



社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネジャー・サービス規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、S A S 70（受託業務にかかわる内部統制について評価する監査人の業務に関する基準）に基づく受託業務の内部統制の有効性についての監査報告書を、定期的に受託会社より受取っています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

配当・利子等を中心とする収益等の全額とします。

2. 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

3. 留保益の運用方針

留保益(収益分配に充てず信託財産に留保した収益)については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

分配時期

毎決算日とし、決算日は1月10日(年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日)です。

支払方法

再投資専用のファンドであり、収益分配金は税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券ならびに投資信託証券(公社債投資信託証券を除きます)への投資割合

T A A株50ポートフォリオ : 信託財産の純資産総額の50%以下とします。

T A A株100ポートフォリオ : 信託財産の純資産総額の範囲内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%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投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

私募により発行された有価証券(短期社債等を除く)および上場予定・登録予定株式への投資割合は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、国内の証券取引所に上場(上場予定を含みます)されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。

信用取引の範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことができます。
2. 前記1.の信用取引は、次の . から . に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の . から . に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - . 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - . 株式分割により取得する株券
 - . 有償増資により取得する株券
 - . 売出しにより取得する株券
 - . 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（なお、ここでいう新株予約権とは、転換社債型新株予約権付社債の新株予約権をいいます）の行使により取得可能な株券
 - . 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ . に定めるものを除きます）の行使により取得可能な株券

先物取引等

1. 国内の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、選択権取引はオプション取引に含め（以下同じ）、外国の取引所における現物オプション取引は公社債に限ります。
2. 国内の取引所における通貨に関する先物取引ならびに外国の取引所における通貨に関する先物取引および先物オプション取引を行うことができます。
3. 国内の取引所における金利に関する先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、現物オプション取引は預金に限ります。

スワップ取引

1. 信託財産に属する資産を効率的に運用するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産に関するスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えた場合には、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部を解約します。
4. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価します。
5. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行います。

有価証券の貸付けおよび範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の . および . の範囲内で貸付けることができます。
 - . 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - . 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有

する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

- 2．前記1．に定める限度額を超えた場合には、速やかに、その超える額に相当する契約の一部を解約します。
- 3．有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行います。

外国為替予約等

- 1．信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を行うことができます。
- 2．前記1．の予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
- 3．信託財産に属する外貨建資産の時価総額が信託財産の純資産総額の30%を超えることとなる投資を行いません。ただし、有価証券の値上がり等により30%を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。
- 4．外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

資金の借入れ

- 1．信託財産を効率的に運用するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資に関する収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行いません。
- 2．一部解約に伴う支払資金の手当てに関する借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- 3．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c 法令に定める投資制限

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

ファンドは、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。

ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

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

（１）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

株式は国内および国際的な景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、また業績悪化（倒産に至る場合も含む）等により、価格が下落することがあります。

・債券投資リスク

金利変動リスク

金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。

信用リスク

債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。

・短期金融資産の運用に関するリスク

コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。

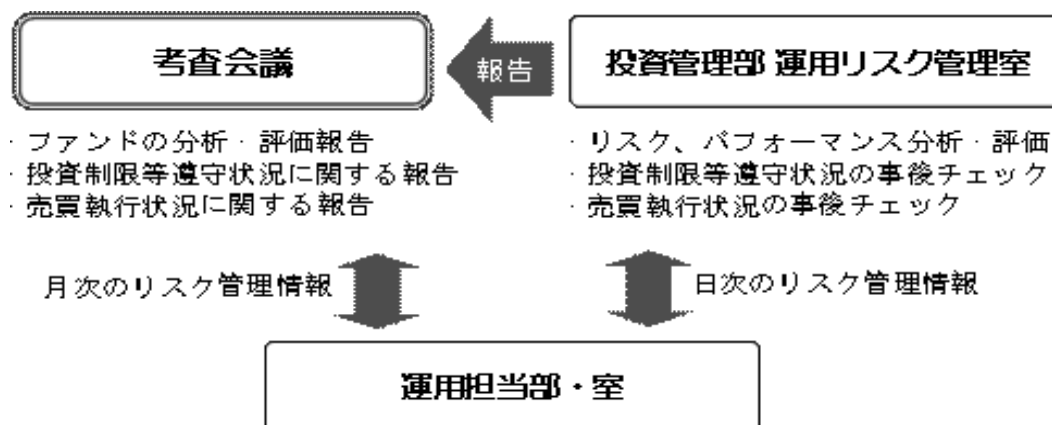
・資産配分リスク

ファンドは、投資対象資産の配分比率を機動的に変更する運用を行います。この資産配分がファンドの収益の源泉となる場合もありますが、投資対象資産が予想しない値動きをした場合、損失を被る可能性があります。

・流動性リスク

市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予想される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

（２）投資リスク管理体制



1. 投資管理部 運用リスク管理室が、以下の通り管理を行います。

- ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵

守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。

・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。

2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

上記投資リスク管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.26%（税抜1.2%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分		
委託会社	年0.3675%	（税抜0.35%）
販売会社	年0.7875%	（税抜0.75%）
受託会社	年0.1050%	（税抜0.10%）

前記の信託報酬については、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払います。

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および税金等は、信託財産中から支払います。この他に、先物取引・オプション取引等に要する費用についても信託財産中から支払います。
監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に下記の監査報酬率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.00210% （税抜0.002%）
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00315% （税抜0.003%）
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00525% （税抜0.005%）
10億円以下 の部分	年 0.03150% （税抜0.030%）

信託事務の諸費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支払います。

借入金の利息

信託財産において一部解約金の支払資金の手当て、または再投資に関する収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入を行った場合、当該借入金の利息は、借入れのつど信託財産中

から支払います。
信託財産留保額
ありません。

上記の、およびの費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「4 手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

- 分配時 : 分配時の「普通分配金」に対して課税されます。
「特別分配金」は非課税です。
- 解約請求・償還時 : 個人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額と取得価額の差益に対して課税されます。
法人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して課税されます。
- 買取請求時 : 買取請求時の買取価額と取得価額の差益に対して課税されます。
申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

- 分配時 : 分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、原則として20%（所得税15%・地方税5%）の税率により源泉徴収され申告不要制度が適用されます。確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）または20%（所得税15%・地方税5%）の申告分離課税を選択することもできます。
ただし、平成23年12月31日までは、
・軽減税率が適用され、源泉徴収税率は10%（所得税7%・地方税3%）となります。
・確定申告を行い、申告分離課税を選択する場合、10%（所得税7%・地方税3%）の軽減税率が適用されます。

- 解約請求・償還・買取請求時 : 解約請求、償還および買取請求時の差益は、上場株式等の譲渡所得として、原則として20%（所得税15%・地方税5%）の申告分離課税の対象となり確定申告を行う必要があります。
ただし、平成23年12月31日までは、10%（所得税7%・地方税3%）の軽減税率が適用されます。
解約請求、償還および買取請求時の損益については、確定申告を行い、上場株式等の譲渡損益と通算することができます。

源泉徴収選択口座（特定口座）を選択した場合、上場株式等の譲渡所得等について申告不要制度が適用されます。

確定申告を行い、上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した場合に限ります）から上場株式等の譲渡損失を控除することができます。

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

分配時の普通分配金、解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して

15%（所得税のみ）の税率により源泉徴収されます。ただし、平成23年12月31日までは7%（所得税のみ）の軽減税率が適用されます。

益金不算入制度の適用はありません。

個別元本

- ・追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（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は含まれません）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ・受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ・受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から特別分配金を差引いた額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

普通分配金と特別分配金

収益分配金は分配前の受益者の個別元本と基準価額の関係により、課税扱いの普通分配金と、個別元本の一部払戻しに相当する非課税扱いの特別分配金に区分されます。

普通分配金	特別分配金
<p>収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額以上の場合、収益分配金の全額が普通分配金となります。</p>	<p>収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回っている場合、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を差引いた額が普通分配金となります。</p>

投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

上記は平成23年2月末現在のものであり、税法が改正された場合等には、内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

「TAA株50ポートフォリオ」

(平成23年1月31日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	101,909,220	52.05
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		93,875,347	47.95
純資産総額		195,784,567	100.00

(注1) 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合計の比率であります。

(注2) その他資産として、下記のとおり株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

資産の名称	取引所	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
東証株価指数先物 (買建)(2011年3月限)	東京証券取引所	83,430,000	81,810,000	41.79
ミニ東証株価指数先物 (買建)(2011年3月限)	東京証券取引所	11,124,000	10,908,000	5.57

「TAA株100ポートフォリオ」

(平成23年1月31日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	727,094,230	65.50
国債証券	日本	32,970,630	2.97
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		350,015,701	31.53
純資産総額		1,110,080,561	100.00

(注1) 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合計の比率であります。

(注2) その他資産として、下記のとおり株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

資産の名称	取引所	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
東証株価指数先物 (買建)(2011年3月限)	東京証券取引所	352,260,000	345,420,000	31.12

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

「TAA株50ポートフォリオ」

(平成23年1月31日現在)

順位	国名	銘柄名	利率(%)	償還日	種類	額面	上段:帳簿価額(円) 下段:評価額(円)		投資比率(%)
							単価	金額	
1	日本	第312回利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	国債証券	102,000,000	100.13 99.91	102,135,660 101,909,220	52.05

投資比率：合計 52.05

「TAA株100ポートフォリオ」

(平成23年1月31日現在)

順位	国名	銘柄名	利率(%) 償還日	種類 業種	株数又は 額面	上段：帳簿価額(円)		投資 比率 (%)
						下段：評価額(円)		
						単価	金額	
1	日本	第312回利付国債(10年)	1.200 2020/12/20	国債証券 -	33,000,000	100.13 99.91	33,043,890 32,970,630	2.97
2	日本	トヨタ自動車	- -	株式 輸送用機器	8,200	3,455 3,400	28,331,000 27,880,000	2.51
3	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	- -	株式 銀行業	44,000	442 426	19,448,000 18,744,000	1.69
4	日本	ホンダ	- -	株式 輸送用機器	5,100	3,265 3,475	16,651,500 17,722,500	1.60
5	日本	キヤノン	- -	株式 電気機器	3,600	4,155 4,025	14,958,000 14,490,000	1.31
6	日本	三井住友フィナンシャルグループ	- -	株式 銀行業	4,300	2,922 2,792	12,564,600 12,005,600	1.08
7	日本	三菱商事	- -	株式 卸売業	4,700	2,382 2,285	11,195,400 10,739,500	0.97
8	日本	日本電信電話	- -	株式 情報・通信業	2,500	3,715 3,810	9,287,500 9,525,000	0.86
9	日本	ソニー	- -	株式 電気機器	3,200	3,010 2,829	9,632,000 9,052,800	0.82
10	日本	武田薬品工業	- -	株式 医薬品	2,200	3,975 3,950	8,745,000 8,690,000	0.78
11	日本	みずほフィナンシャルグループ	- -	株式 銀行業	49,900	163 158	8,133,700 7,884,200	0.71
12	日本	ファナック	- -	株式 電気機器	600	12,980 12,960	7,788,000 7,776,000	0.70
13	日本	ソフトバンク	- -	株式 情報・通信業	2,600	2,857 2,823	7,428,200 7,339,800	0.66
14	日本	NTTドコモ	- -	株式 情報・通信業	50	143,000 146,500	7,150,000 7,325,000	0.66
15	日本	東京電力	- -	株式 電気・ガス業	3,600	1,975 1,995	7,110,000 7,182,000	0.65
16	日本	三井物産	- -	株式 卸売業	5,100	1,430 1,380	7,293,000 7,038,000	0.63
17	日本	任天堂	- -	株式 その他製品	300	24,040 22,180	7,212,000 6,654,000	0.60
18	日本	パナソニック	- -	株式 電気機器	5,900	1,182 1,124	6,973,800 6,631,600	0.60
19	日本	東芝	- -	株式 電気機器	13,000	480 485	6,240,000 6,305,000	0.57
20	日本	三菱地所	- -	株式 不動産業	4,000	1,505 1,550	6,020,000 6,200,000	0.56
21	日本	コマツ	- -	株式 機械	2,500	2,583 2,444	6,457,500 6,110,000	0.55

22	日本	東日本旅客鉄道	-	株式 陸運業	1,100	5,300 5,420	5,830,000 5,962,000	0.54
23	日本	日立製作所	-	株式 電気機器	13,000	457 448	5,941,000 5,824,000	0.52
24	日本	日産自動車	-	株式 輸送用機器	7,000	855 830	5,985,000 5,810,000	0.52
25	日本	東京海上ホールディングス	-	株式 保険業	2,300	2,502 2,446	5,754,600 5,625,800	0.51
26	日本	野村ホールディングス	-	株式 証券、商品先物取引業	11,100	536 499	5,949,600 5,538,900	0.50

順位	国名	銘柄名	利率(%) 償還日	種類 業種	株数又は 額面	上段：帳簿価額(円) 下段：評価額(円)		投資 比率 (%)
						単価	金額	
27	日本	三菱電機	-	株式 電気機器	6,000	897 905	5,382,000 5,430,000	0.49
28	日本	セブン&アイ・ホールディングス	-	株式 小売業	2,500	2,155 2,124	5,387,500 5,310,000	0.48
29	日本	三井不動産	-	株式 不動産業	3,000	1,681 1,668	5,043,000 5,004,000	0.45
30	日本	新日本製鐵	-	株式 鉄鋼	17,000	303 280	5,151,000 4,760,000	0.43
投資比率：合計								25.92

(注1) 投資有価証券の評価金額の上位30銘柄について記載しております。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

「TAA株50ポートフォリオ」

種類	業種	投資比率(%)
国債証券	-	52.05
合計		52.05

「TAA株100ポートフォリオ」

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	電気機器	9.51
	輸送用機器	6.93
	銀行業	6.04
	化学	4.12
	情報・通信業	3.89
	卸売業	3.36
	機械	3.13
	電気・ガス業	3.12
	医薬品	2.81
	陸運業	2.42
	小売業	2.18
	食料品	2.15
	不動産業	1.66
	鉄鋼	1.60
	建設業	1.47
	保険業	1.30
	その他製品	1.22
	非鉄金属	1.00
	証券、商品先物取引業	0.96
	サービス業	0.92
	精密機器	0.88
	ガラス・土石製品	0.85
	繊維製品	0.70
	石油・石炭製品	0.62
	その他金融業	0.54
	金属製品	0.45
ゴム製品	0.35	
海運業	0.34	

種類	業種	投資比率 (%)
株式	鉱業	0.25
	倉庫・運輸関連業	0.24
	パルプ・紙	0.23
	空運業	0.22
	水産・農林業	0.04
合計		65.50

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

【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】

「TAA株50ポートフォリオ」

(平成23年1月31日現在)

種類	取引所	資産の名称	買建 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	東京証券 取引所	東証株価指数先物 (2011年3月限)	買建	9	83,430,000	81,810,000	41.79
	東京証券 取引所	ミ二東証株価指数先 物 (2011年3月限)	買建	12	11,124,000	10,908,000	5.57

「TAA株100ポートフォリオ」

(平成23年1月31日現在)

種類	取引所	資産の名称	買建 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	東京証券 取引所	東証株価指数先物 (2011年3月限)	買建	38	352,260,000	345,420,000	31.12

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率であります。

(注2) 時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
2. 先物取引の評価においては、取引所の発表する清算値段によっております。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成23年1月31日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

「TAA株50ポートフォリオ」

		純資産総額(円)		1万口当たり純資産総額(円)	
第1期末	(平成9年1月10日)	分配付:	17,667,547	分配付:	9,459
		分配落:	17,667,547	分配落:	9,459
第2期末	(平成10年1月12日)	分配付:	97,521,276	分配付:	8,965
		分配落:	97,521,276	分配落:	8,965
第3期末	(平成11年1月11日)	分配付:	153,282,259	分配付:	8,831
		分配落:	153,282,259	分配落:	8,831
第4期末	(平成12年1月11日)	分配付:	235,028,943	分配付:	10,901
		分配落:	235,028,943	分配落:	10,901

		純資産総額(円)		1万口当たり純資産総額(円)	
第5期末	(平成13年1月10日)	分配付:	227,108,466	分配付:	9,515
		分配落:	227,108,466	分配落:	9,515

第6期末	(平成14年1月10日)	分配付：244,424,788 分配落：244,424,788	分配付：8,528 分配落：8,528
第7期末	(平成15年1月10日)	分配付：250,996,003 分配落：250,996,003	分配付：7,966 分配落：7,966
第8期末	(平成16年1月13日)	分配付：256,087,476 分配落：256,087,476	分配付：8,847 分配落：8,847
第9期末	(平成17年1月11日)	分配付：255,078,088 分配落：255,078,088	分配付：9,070 分配落：9,070
第10期末	(平成18年1月10日)	分配付：299,477,976 分配落：299,477,976	分配付：10,871 分配落：10,871
第11期末	(平成19年1月10日)	分配付：288,240,124 分配落：288,240,124	分配付：10,631 分配落：10,631
第12期末	(平成20年1月10日)	分配付：270,812,714 分配落：270,812,714	分配付：10,017 分配落：10,017
第13期末	(平成21年1月13日)	分配付：226,545,639 分配落：226,545,639	分配付：8,190 分配落：8,190
第14期末	(平成22年1月12日)	分配付：203,945,484 分配落：203,945,484	分配付：8,869 分配落：8,869
第15期末	(平成23年1月11日)	分配付：199,085,407 分配落：199,085,407	分配付：8,844 分配落：8,844
	平成22年1月末日	197,183,001	8,583
	2月末日	194,760,646	8,557
	3月末日	201,846,465	8,974
	4月末日	202,090,996	8,996
	5月末日	191,593,120	8,518
	6月末日	189,941,835	8,442
	7月末日	190,926,362	8,488
	8月末日	186,570,192	8,316
	9月末日	189,994,875	8,486
	10月末日	187,640,763	8,388
	11月末日	190,343,991	8,505
	12月末日	195,706,297	8,709
	平成23年1月31日	195,784,567	8,748

「TAA株100ポートフォリオ」

		純資産総額(円)	1万口当たり純資産総額(円)
第1期末	(平成9年1月10日)	分配付：22,573,969 分配落：22,573,969	分配付：8,824 分配落：8,824
第2期末	(平成10年1月12日)	分配付：120,831,853 分配落：120,831,853	分配付：7,644 分配落：7,644
第3期末	(平成11年1月11日)	分配付：964,432,487 分配落：964,432,487	分配付：7,136 分配落：7,136

第4期末	(平成12年1月11日)	分配付： 1,695,655,626 分配落： 1,695,655,626	分配付： 11,195 分配落： 11,195
第5期末	(平成13年1月10日)	分配付： 1,320,905,577 分配落： 1,320,905,577	分配付： 8,289 分配落： 8,289
第6期末	(平成14年1月10日)	分配付： 1,145,320,033 分配落： 1,145,320,033	分配付： 6,617 分配落： 6,617
第7期末	(平成15年1月10日)	分配付： 1,051,411,883 分配落： 1,051,411,883	分配付： 5,676 分配落： 5,676
第8期末	(平成16年1月13日)	分配付： 1,295,800,213 分配落： 1,295,800,213	分配付： 7,104 分配落： 7,104
第9期末	(平成17年1月11日)	分配付： 1,373,174,440 分配落： 1,373,174,440	分配付： 7,627 分配落： 7,627
第10期末	(平成18年1月10日)	分配付： 1,854,329,409 分配落： 1,854,329,409	分配付： 10,850 分配落： 10,850
第11期末	(平成19年1月10日)	分配付： 1,822,621,945 分配落： 1,822,621,945	分配付： 10,863 分配落： 10,863
第12期末	(平成20年1月10日)	分配付： 1,569,568,148 分配落： 1,569,568,148	分配付： 9,432 分配落： 9,432
第13期末	(平成21年1月13日)	分配付： 1,022,789,894 分配落： 1,022,789,894	分配付： 6,028 分配落： 6,028
第14期末	(平成22年1月12日)	分配付： 1,164,035,220 分配落： 1,164,035,220	分配付： 7,136 分配落： 7,136
第15期末	(平成23年1月11日)	分配付： 1,129,607,634 分配落： 1,129,607,634	分配付： 7,002 分配落： 7,002
	平成22年1月末日	1,096,784,666	6,718
	2月末日	1,090,361,436	6,677
	3月末日	1,198,798,812	7,362
	4月末日	1,204,867,172	7,412
	5月末日	1,077,784,682	6,626
	6月末日	1,037,067,599	6,388
	7月末日	1,046,134,475	6,435
	8月末日	998,710,288	6,138
	9月末日	1,032,348,060	6,353
	10月末日	1,011,587,511	6,225

	純資産総額（円）	1万口当たり純資産総額（円）
11月末日	1,057,876,225	6,519
12月末日	1,095,493,945	6,794
平成23年1月31日	1,110,080,561	6,874

【分配の推移】

「TAA株50ポートフォリオ」

		1万口当たり分配金
第1期	（平成9年1月10日）	0円
第2期	（平成10年1月12日）	0円
第3期	（平成11年1月11日）	0円
第4期	（平成12年1月11日）	0円
第5期	（平成13年1月10日）	0円
第6期	（平成14年1月10日）	0円
第7期	（平成15年1月10日）	0円
第8期	（平成16年1月13日）	0円
第9期	（平成17年1月11日）	0円
第10期	（平成18年1月10日）	0円
第11期	（平成19年1月10日）	0円
第12期	（平成20年1月10日）	0円
第13期	（平成21年1月13日）	0円
第14期	（平成22年1月12日）	0円
第15期	（平成23年1月11日）	0円

「TAA株100ポートフォリオ」

		1万口当たり分配金
第1期	（平成9年1月10日）	0円
第2期	（平成10年1月12日）	0円
第3期	（平成11年1月11日）	0円
第4期	（平成12年1月11日）	0円
第5期	（平成13年1月10日）	0円
第6期	（平成14年1月10日）	0円
第7期	（平成15年1月10日）	0円
第8期	（平成16年1月13日）	0円
第9期	（平成17年1月11日）	0円
第10期	（平成18年1月10日）	0円

		1万口当たり分配金
第11期	（平成19年1月10日）	0円
第12期	（平成20年1月10日）	0円
第13期	（平成21年1月13日）	0円
第14期	（平成22年1月12日）	0円
第15期	（平成23年1月11日）	0円

【収益率の推移】

「TAA株50ポートフォリオ」

		収益率

第1期	自平成8年12月11日 至平成9年1月10日	5.41%
第2期	自平成9年1月11日 至平成10年1月12日	5.22%
第3期	自平成10年1月13日 至平成11年1月11日	1.49%
第4期	自平成11年1月12日 至平成12年1月11日	23.44%
第5期	自平成12年1月12日 至平成13年1月10日	12.71%
第6期	自平成13年1月11日 至平成14年1月10日	10.37%
第7期	自平成14年1月11日 至平成15年1月10日	6.59%
第8期	自平成15年1月11日 至平成16年1月13日	11.06%
第9期	自平成16年1月14日 至平成17年1月11日	2.52%
第10期	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	19.86%
第11期	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日	2.21%
第12期	自平成19年1月11日 至平成20年1月10日	5.78%
第13期	自平成20年1月11日 至平成21年1月13日	18.24%
第14期	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	8.29%
第15期	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	0.28%

「TAA株100ポートフォリオ」

		収益率
第1期	自平成8年12月11日 至平成9年1月10日	11.76%
第2期	自平成9年1月11日 至平成10年1月12日	13.37%
第3期	自平成10年1月13日 至平成11年1月11日	6.65%
第4期	自平成11年1月12日 至平成12年1月11日	56.88%
第5期	自平成12年1月12日 至平成13年1月10日	25.96%

第6期	自平成13年1月11日 至平成14年1月10日	20.17%
第7期	自平成14年1月11日 至平成15年1月10日	14.22%
第8期	自平成15年1月11日 至平成16年1月13日	25.16%
第9期	自平成16年1月14日 至平成17年1月11日	7.36%
第10期	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	42.26%
第11期	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日	0.12%
第12期	自平成19年1月11日 至平成20年1月10日	13.17%
第13期	自平成20年1月11日 至平成21年1月13日	36.09%
第14期	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	18.38%
第15期	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	1.88%

(注) 収益率は、以下の計算式により算出しております。ただし、第1期については、前期末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額（10,000円）を用いております。

$$\text{収益率} = (\text{当期末分配付基準価額} - \text{前期末分配落基準価額}) \div \text{前期末分配落基準価額} \times 100$$

(4) 【設定及び解約の実績】

「TAA株50ポートフォリオ」

		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	自平成8年12月11日 至平成9年1月10日	18,697,198	20,114	18,677,084
第2期	自平成9年1月11日 至平成10年1月12日	113,830,308	23,732,347	108,775,045
第3期	自平成10年1月13日 至平成11年1月11日	112,732,633	47,926,018	173,581,660
第4期	自平成11年1月12日 至平成12年1月11日	95,301,327	53,272,142	215,610,845
第5期	自平成12年1月12日 至平成13年1月10日	89,127,426	66,043,638	238,694,633
第6期	自平成13年1月11日 至平成14年1月10日	89,961,289	42,049,276	286,606,646
第7期	自平成14年1月11日 至平成15年1月10日	84,467,354	55,987,097	315,086,903
第8期	自平成15年1月11日 至平成16年1月13日	57,947,504	83,557,207	289,477,200

第9期	自平成16年1月14日 至平成17年1月11日	42,468,365	50,721,735	281,223,830
第10期	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	35,500,352	41,234,368	275,489,814
第11期	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日	29,666,327	34,033,850	271,122,291
第12期	自平成19年1月11日 至平成20年1月10日	27,969,033	28,744,779	270,346,545
第13期	自平成20年1月11日 至平成21年1月13日	28,573,352	22,309,789	276,610,108
第14期	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	12,695,261	59,359,737	229,945,632
第15期	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	5,361,996	10,211,029	225,096,599

「TAA株100ポートフォリオ」

		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	自平成8年12月11日 至平成9年1月10日	25,583,244	-	25,583,244
第2期	自平成9年1月11日 至平成10年1月12日	153,891,093	21,399,310	158,075,027
第3期	自平成10年1月13日 至平成11年1月11日	1,234,657,242	41,176,791	1,351,555,478

		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第4期	自平成11年1月12日 至平成12年1月11日	240,406,191	77,350,262	1,514,611,407
第5期	自平成12年1月12日 至平成13年1月10日	145,264,787	66,344,222	1,593,531,972
第6期	自平成13年1月11日 至平成14年1月10日	191,056,657	53,754,290	1,730,834,339
第7期	自平成14年1月11日 至平成15年1月10日	188,114,870	66,586,546	1,852,362,663
第8期	自平成15年1月11日 至平成16年1月13日	127,291,952	155,696,538	1,823,958,077
第9期	自平成16年1月14日 至平成17年1月11日	85,366,788	108,963,307	1,800,361,558
第10期	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	73,154,200	164,467,484	1,709,048,274
第11期	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日	58,427,446	89,719,281	1,677,756,439
第12期	自平成19年1月11日 至平成20年1月10日	55,589,555	69,257,126	1,664,088,868

第13期	自平成20年1月11日 至平成21年1月13日	65,319,569	32,659,923	1,696,748,514
第14期	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	40,227,548	105,730,455	1,631,245,607
第15期	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	16,568,653	34,552,358	1,613,261,902

(注) 本邦外における販売又は解約の実績はありません。

〈参考情報〉

2011年1月末現在

TAA株50ポートフォリオ

● 基準価額・純資産の推移



- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 基準価額および純資産総額

基準価額	8,748円
純資産総額	195百万円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

第11期	2007年1月10日	0円
第12期	2008年1月10日	0円
第13期	2009年1月13日	0円
第14期	2010年1月12日	0円
第15期	2011年1月11日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

● 資産構成比率

株式	47.4%
債券	52.1%

- ・比率は対純資産総額比です。
- ・各資産は先物を含みます。

● 組入銘柄

銘柄	種類	比率
第312回 10年国債	国債証券	52.1%

- ・比率は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2011年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

1 ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

2 最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2011年1月末現在

TAA株100ポートフォリオ

●基準価額・純資産の推移



- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

●基準価額および純資産総額

基準価額	6,874円
純資産総額	11億円

●分配の推移 1万円当たり(税引前)

期	日付	金額
第11期	2007年1月10日	0円
第12期	2008年1月10日	0円
第13期	2009年1月13日	0円
第14期	2010年1月12日	0円
第15期	2011年1月11日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

●資産構成比率

株式	96.6%
債券	3.0%

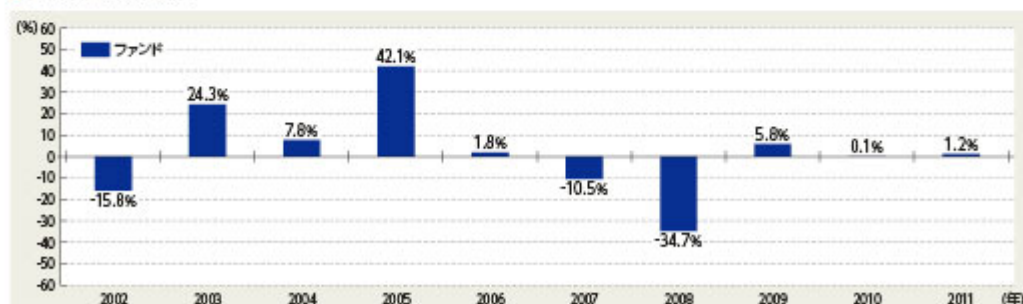
- ・比率は対純資産総額比です。
- ・各資産は先物を含まず。

●組入上位銘柄

順位	銘柄	種類	比率
1	第312回 10年国債	国債証券	3.0%
2	トヨタ自動車	株式	2.5%
3	三菱UFJフィナンシャルG	株式	1.7%
4	本田技研	株式	1.6%
5	キャノン	株式	1.3%
6	三井住友フィナンシャルG	株式	1.1%
7	三菱商事	株式	1.0%
8	日本電信電話	株式	0.9%
9	ソニー	株式	0.8%
10	武田薬品	株式	0.8%

- ・比率は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。
- ・2011年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

- ① ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。
- ② 最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受け付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。

証券取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、申込みの受け付けを中止することおよび既に受け付けた申込みの受け付けを取消すことがあります。

取扱コース

分配金再投資専用のファンドです。

販売会社と「自動けいぞく（累積）投資契約」（同様の権利義務を規定する名称の異なる契約または規定も含まれます）を締結します。なお、販売会社によっては、定期引出契約を締結できる場合があります。

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

1. ファンドの取得申込者は、販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。
2. 定期引出契約とは、分配金を再投資せず、定期的に分配金を受取るための契約です。
3. 各ファンド間のスイッチングができます。スイッチングとは、保有しているファンドの換金と同時に乗換えるファンドを購入する取引です。
保有しているファンドの換金の際に税金が差引かれます。税金についての詳細は「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご確認ください。
4. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

2【換金（解約）手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。

証券取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することがあります。

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

1口単位とします。

換金価額

<解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

<買取請求の場合>

買取価額：買取請求受付日の基準価額とします（税法上の一定の要件を満たしている場合）。
それ以外の場合は、買取請求受付日の基準価額から、当該買取りに関して当該買取りを行う販売会社にかかる源泉徴収税額に相当する金額を差引いた額とします。

換金方法および受益者によって課税上の取扱いが異なります。詳細は「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご確認ください。

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

解約請求受付日または買取請求受付日から起算して、原則として4営業日目からお支払いします。

その他

1. 受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
2. 換金請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記の規定に準じて算出した価額とします。
3. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金

額をいいます。

ファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

主な投資資産	評価方法の概要
国内株式	証券取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。
国内債券先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます）の円換算については、原則として国内における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。

基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、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。

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限です。

（4）【計算期間】

毎年1月11日から翌年1月10日までとします。

上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（5）【その他】

繰上償還

1．委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

．この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

．やむを得ない事情が発生したとき

2．委託会社は、前記1．により解約するときには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

3．前記2．の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。

4. 前記3. の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1. の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前記3. から5. までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記3. の一定の期間を1ヵ月以上設けることが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更 4. 」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社の間において存続します。
9. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「 約款の変更 」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
10. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目(償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目)までにお支払いします。

約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することができます。この場合、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、前記1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
3. 前記2. の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3. の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1. の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記1. から5. の規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前記「 繰上償還 」に規定する信託契約の解約または前記「 約款の変更 」に規定する約款の変更を行う場合において、「 繰上償還 3. 」または「 約款の変更 3. 」の一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権の買取りを請求することができます。ただし、当該買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社および販売会社の協議により決定します。

公告

電子公告により行い、委託会社のホームページ（<http://www.nam.co.jp/>）に掲載します。

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。

運用報告書の作成

委託会社は、ファンドの計算期間の末日毎および償還時に期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、これを販売会社を通じてファンドの知られたる受益者に交付します。

信託事務処理の再信託

受託会社は、ファンドにかかる信託事務の処理の一部について、日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

関係法人との契約の更改等に関する手続き

委託会社と販売会社との間で締結された「受益権の募集・販売の取扱等に関する契約」は、契約期間満了の3ヵ月前までに委託会社、販売会社いずれかにより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。

委託会社と投資助言会社との間で締結された「投資助言契約」は、契約期間満了の1ヵ月前までに委託会社、投資助言会社いずれかにより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（1）収益分配金に対する請求権

受益者には、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利があります。

収益分配金は、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（2）償還金に対する請求権

受益者には、持分に応じて償還金を請求する権利があります。原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までに販売会社において支払いを開始します。ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

（3）解約請求権

受益者には、持分に応じて解約請求する権利があります。権利行使の方法等については、前記「2 換金（解約）手続等」の項をご参照ください。

（4）帳簿閲覧権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する法令で定められた帳簿書類の閲覧を請求することができます。

（5）反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要（5）その他 反対者の買取請求権」の項をご参照ください。

第3【ファンドの経理状況】

- 1) 各ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。ただし、第14期計算期間（平成21年1月14日から平成22年1月12日まで）の財務諸表については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」並びに「投資信託財産の計算に関する規則」に基づき、第15期計算期間（平成22年1月13日から平成23年1月11日まで）の財務諸表については、改正後の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」並びに「投資信託財産の計算に関する規則」に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2) 各ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間（平成21年1月14日から平成22年1月12日まで）及び第15期計算期間（平成22年1月13日から平成23年1月11日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【TAA株50ポートフォリオ】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (平成22年1月12日現在)	第15期 (平成23年1月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	162,578,545	95,998,949
国債証券	37,950,980	102,135,660
派生商品評価勘定	7,743,175	5,369,345
未収利息	51,734	13,412
前払費用	102,503	60,361
差入委託証拠金	3,210,000	2,184,000
流動資産合計	211,636,937	205,761,727
資産合計	211,636,937	205,761,727
負債の部		
流動負債		
前受金	6,371,600	5,437,200
未払受託者報酬	107,274	100,711
未払委託者報酬	1,180,482	1,108,281
その他未払費用	32,097	30,128
流動負債合計	7,691,453	6,676,320
負債合計	7,691,453	6,676,320
純資産の部		
元本等		
元本	229,945,632	225,096,599
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	26,000,148	26,011,192
純資産合計	203,945,484	199,085,407
負債純資産合計	211,636,937	205,761,727

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第14期 （自平成21年1月14日 至平成22年1月12日）	第15期 （自平成22年1月13日 至平成23年1月11日）
営業収益		
受取利息	949,643	1,053,873
有価証券売買等損益	1,866,510	1,513,750
派生商品取引等損益	20,451,405	757,500
営業収益合計	19,534,538	1,810,123
営業費用		
受託者報酬	218,595	203,353
委託者報酬	2,405,443	2,237,757
その他費用	65,418	60,846
営業費用合計	2,689,456	2,501,956
営業利益又は営業損失（ ）	16,845,082	691,833
経常利益又は経常損失（ ）	16,845,082	691,833
当期純利益又は当期純損失（ ）	16,845,082	691,833
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,333,878	265,644
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	50,064,469	26,000,148
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,756,684	1,155,930
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,756,684	1,155,930
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,203,567	740,785
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,203,567	740,785
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,000,148	26,011,192

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)	第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>	<p>国債証券</p> <p>同左</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、証券取引所の発表する計算期間末日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>	<p>株価指数先物取引</p> <p>同左</p> <p>同左</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>	<p>派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>同左</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>ファンドの計算期間</p> <p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとしておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成21年1月14日から平成22年1月12日までとなっております。</p>	<p>ファンドの計算期間</p> <p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとしておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成22年1月13日から平成23年1月11日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 (平成22年1月12日現在)	第15期 (平成23年1月11日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	229,945,632口	225,096,599口

2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額		
元本の欠損	26,000,148円	26,011,192円
3. 1口当たり純資産額	0.8869円	0.8844円
(1万口当たり純資産額)	(8,869円)	(8,844円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)	第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)
<p>分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(787,537円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(33,292,820円)、及び分配準備積立金(26,313,969円)より、分配対象収益は60,394,326円(1口当たり0.262646円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。</p>	<p>分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(33,214,895円)、及び分配準備積立金(25,905,837円)より、分配対象収益は59,120,732円(1口当たり0.262646円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)	第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)

	<p>1．金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2．金融商品の内容及びそのリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> <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ることもあります。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> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額また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>
--	---

金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (平成22年1月12日現在)	第15期 (平成23年1月11日現在)

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		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	-	<p>1. 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>2. デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「（その他の注記）」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>3. 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、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。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第14期 （自平成21年1月14日 至平成22年1月12日）	第15期 （自平成22年1月13日 至平成23年1月11日）
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

第14期 （自平成21年1月14日 至平成22年1月12日）	第15期 （自平成22年1月13日 至平成23年1月11日）
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第14期 （平成22年1月12日現在）	第15期 （平成23年1月11日現在）
期首元本額	276,610,108円	229,945,632円
期中追加設定元本額	12,695,261円	5,361,996円

期中一部解約元本額	59,359,737円	10,211,029円
-----------	-------------	-------------

2 有価証券関係

第14期(平成22年1月12日現在)

売買目的有価証券

種類	貸借対照表計上額(円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	37,950,980	318,140
合計	37,950,980	318,140

第15期(平成23年1月11日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	182,580
合計	182,580

3 デリバティブ取引関係

取引の状況に関する事項

第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)	第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)
--------------------------------------	--------------------------------------

<p>1．取引の内容 利用している取引は、株式関連で国内の株価指数先物取引であります。</p> <p>2．取引に対する取組方針 国内の株価指数先物取引は、ファンドの運用の効率化を図るため、将来の価格変動リスクの回避目的に限定せずに利用する場合があります。但し、投機目的の取引は行わない方針であります。</p> <p>3．取引の利用目的 国内の株価指数先物取引は、ファンド資金の流入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用します。</p> <p>4．取引に係るリスクの内容 利用している取引については、市場リスクすなわち株価指数の変動リスクがあります。</p> <p>5．取引に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>6．取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項における契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体が取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	-
--	---

取引の時価等に関する事項

第14期（平成22年1月12日現在）

株式関連

区分	種類	契約額等（円）	契約額等のうち1年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	94,709,325	-	102,452,500	7,743,175

合計	94,709,325	-	102,452,500	7,743,175
----	------------	---	-------------	-----------

(注) 時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
2. 先物取引の評価においては、証券取引所の発表する計算期間末日の清算値段によっております。

第15期(平成23年1月11日現在)

株式関連

区分	種類	契約額等(円)	契約額等のうち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	91,038,655	-	96,408,000	5,369,345
合計		91,038,655	-	96,408,000	5,369,345

(注1) 時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
2. 先物取引の評価においては、証券取引所の発表する計算期間末日の清算値段によっております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	利率(%)	償還日	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第312回利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	102,000,000	102,135,660	
合計				102,000,000	102,135,660	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

デリバティブ取引関係注記に記載したとおりであります。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

【TAA株100ポートフォリオ】
 (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (平成22年1月12日現在)	第15期 (平成23年1月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	400,140,694	362,879,285
株式	762,591,540	740,104,340
国債証券	-	33,043,890
派生商品評価勘定	30,111,425	19,610,090
未収配当金	639,000	669,950
未収利息	-	4,336
前払費用	-	19,528
差入委託証拠金	2,727,500	-
流動資産合計	1,196,210,159	1,156,331,419
資産合計	1,196,210,159	1,156,331,419
負債の部		
流動負債		
前受金	24,846,000	19,836,000
未払解約金	49,999	79,334
未払受託者報酬	592,934	554,059
未払委託者報酬	6,522,697	6,095,170
その他未払費用	163,309	159,222
流動負債合計	32,174,939	26,723,785
負債合計	32,174,939	26,723,785
純資産の部		
元本等		
元本	1,631,245,607	1,613,261,902
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	467,210,387	483,654,268
純資産合計	1,164,035,220	1,129,607,634
負債純資産合計	1,196,210,159	1,156,331,419

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)	第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)
営業収益		
受取配当金	12,912,710	14,116,513
受取利息	291,078	1,107,415
有価証券売買等損益	112,934,058	18,105,651
派生商品取引等損益	71,395,750	5,103,555
その他収益	20,965	17,192
営業収益合計	197,554,561	7,968,086
営業費用		
受託者報酬	1,126,243	1,139,737
委託者報酬	12,389,510	12,538,000
その他費用	316,020	318,587
営業費用合計	13,831,773	13,996,324
営業利益又は営業損失()	183,722,788	21,964,410
経常利益又は経常損失()	183,722,788	21,964,410
当期純利益又は当期純損失()	183,722,788	21,964,410
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	3,407,633	1,126,430
期首剰余金又は期首欠損金()	673,958,620	467,210,387
剰余金増加額又は欠損金減少額	42,017,997	9,904,952
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	42,017,997	9,904,952
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,584,919	5,510,853
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,584,919	5,510,853
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	467,210,387	483,654,268

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)	第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 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、証券取引所における計算期間末日の最終相場によっております。</p> <p style="text-align: center;">-</p>	<p>(1) 株式 同左</p> <p>(2) 国債証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、証券取引所の発表する計算期間末日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>	<p>株価指数先物取引 同左</p> <p>同左</p>

項目	第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)	第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)
----	--	--

<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1) 受取配当金 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を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>	<p>(1) 受取配当金 同左</p> <p>(2) 派生商品取引等損益の計上基準 同左</p>
<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>	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとしておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成21年1月14日から平成22年1月12日までとなっております。</p>	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとしておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成22年1月13日から平成23年1月11日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第14期 (平成22年1月12日現在)	第15期 (平成23年1月11日現在)
<p>1. 担保に供している資産 先物取引に係る差入委託証拠金の代用として差し入れている有価証券</p>	株式 13,990,000円	株式 13,842,500円
<p>2. 当該計算期間の末日における受益権総数</p>	1,631,245,607口	1,613,261,902口
<p>3. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損</p>	467,210,387円	483,654,268円
<p>4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)</p>	0.7136円 (7,136円)	0.7002円 (7,002円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

<p>第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)</p>	<p>第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)</p>
---	---

<p>分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益 (12,038,242円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益(0円)、収益調整金 (223,632,813円)、及び分配準備積立金 (404,997,324円)より、分配対象収益は 640,668,379円(1口当たり0.392748円)ですが、基 準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り (0円)としております。</p>	<p>分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益 (1,212,003円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益(0円)、収益調整金 (225,365,285円)、及び分配準備積立金 (408,253,501円)より、分配対象収益は 634,830,789円(1口当たり0.393508円)ですが、基 準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り (0円)としております。</p>
--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

<p>第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)</p>	<p>第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)</p>
---	---

	<p>1．金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2．金融商品の内容及びそのリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは株価変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> <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ることもあります。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> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額また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>
--	---

金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (平成22年1月12日現在)	第15期 (平成23年1月11日現在)

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		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	-	<p>1. 株式、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>2. デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「（その他の注記）」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>3. 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、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。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第14期 （自平成21年1月14日 至平成22年1月12日）	第15期 （自平成22年1月13日 至平成23年1月11日）
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

第14期 （自平成21年1月14日 至平成22年1月12日）	第15期 （自平成22年1月13日 至平成23年1月11日）
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第14期 （平成22年1月12日現在）	第15期 （平成23年1月11日現在）
期首元本額	1,696,748,514円	1,631,245,607円

期中追加設定元本額	40,227,548円	16,568,653円
期中一部解約元本額	105,730,455円	34,552,358円

2 有価証券関係

第14期(平成22年1月12日現在)

売買目的有価証券

種類	貸借対照表計上額(円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	762,564,540	113,227,288
新株予約権証券	27,000	27,000
合計	762,591,540	113,254,288

第15期(平成23年1月11日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	15,222,617
国債証券	59,070
合計	15,281,687

3 デリバティブ取引関係

取引の状況に関する事項

第14期 (自平成21年1月14日 至平成22年1月12日)	第15期 (自平成22年1月13日 至平成23年1月11日)
--------------------------------------	--------------------------------------

<p>1．取引の内容 利用している取引は、株式関連で国内の株価指数先物取引であります。</p> <p>2．取引に対する取組方針 国内の株価指数先物取引は、ファンドの運用の効率化を図るため、将来の価格変動リスクの回避目的に限定せずに利用する場合があります。但し、投機目的の取引は行わない方針であります。</p> <p>3．取引の利用目的 国内の株価指数先物取引は、ファンド資金の流入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用します。</p> <p>4．取引に係るリスクの内容 利用している取引については、市場リスクすなわち株価指数の変動リスクがあります。</p> <p>5．取引に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>6．取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項における契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体が取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	-
--	---

取引の時価等に関する事項

第14期（平成22年1月12日現在）

株式関連

区分	種類	契約額等（円）	契約額等のうち1年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	362,463,575	-	392,575,000	30,111,425

合計	362,463,575	-	392,575,000	30,111,425
----	-------------	---	-------------	------------

(注) 時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
2. 先物取引の評価においては、証券取引所の発表する計算期間末日の清算値段によっております。

第15期(平成23年1月11日現在)

株式関連

区分	種類	契約額等(円)	契約額等のうち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	332,649,910	-	352,260,000	19,610,090
合計		332,649,910	-	352,260,000	19,610,090

(注1) 時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
2. 先物取引の評価においては、証券取引所の発表する計算期間末日の清算値段によっております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本水産	1,500	256	384,000	
国際石油開発帝石	4	486,000	1,944,000	
石油資源開発	200	3,235	647,000	
コムシスホールディングス	500	886	443,000	
大成建設	4,000	204	816,000	
大林組	2,000	399	798,000	
清水建設	3,000	367	1,101,000	
長谷工コーポレーション	5,500	77	423,500	
鹿島	4,000	230	920,000	
奥村組	2,000	322	644,000	
戸田建設	2,000	323	646,000	
大東建託	400	5,650	2,260,000	
住友林業	1,000	745	745,000	
大和ハウス工業	2,000	1,018	2,036,000	
積水ハウス	2,000	839	1,678,000	
きんでん	1,000	775	775,000	
協和エクシオ	800	841	672,800	
日揮	1,000	1,904	1,904,000	
日清製粉グループ本社	500	1,050	525,000	
江崎グリコ	1,000	953	953,000	
山崎製パン	1,000	980	980,000	
森永乳業	2,000	344	688,000	

ヤクルト本社	400	2,432	972,800	
明治ホールディングス	300	3,705	1,111,500	
雪印メグミルク	500	1,518	759,000	
日本ハム	1,000	1,085	1,085,000	
総合警備保障	500	987	493,500	
ディー・エヌ・エー	300	2,957	887,100	
博報堂DYホールディングス	130	4,835	628,550	
サッポロホールディングス	2,000	387	774,000	
アサヒビール	900	1,572	1,414,800	
キリンホールディングス	3,000	1,144	3,432,000	
宝ホールディングス	1,000	485	485,000	
コカ・コーラウエスト	300	1,504	451,200	
伊藤園	500	1,380	690,000	
不二製油	200	1,165	233,000	
ローソン	200	4,030	806,000	
ポイント	120	3,600	432,000	
エディオン	400	748	299,200	
双日	5,900	191	1,126,900	
アルフレッサホールディングス	200	3,685	737,000	
キッコーマン	1,000	927	927,000	
味の素	2,000	870	1,740,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
キューピー	200	1,042	208,400	
カゴメ	300	1,506	451,800	
ニチレイ	2,000	377	754,000	
日清食品ホールディングス	300	2,926	877,800	
JT	15	308,000	4,620,000	
ゲンゼ	1,000	365	365,000	
J・フロントリテイリング	2,000	445	890,000	
マツモトキヨシホールディングス	300	1,764	529,200	
三越伊勢丹ホールディングス	1,100	947	1,041,700	
東洋紡	5,000	156	780,000	
日清紡ホールディングス	1,000	935	935,000	
トヨタ紡織	300	1,509	452,700	
野村不動産ホールディングス	600	1,595	957,000	
セブン&アイホールディングス	2,500	2,155	5,387,500	
帝人	3,000	378	1,134,000	
東レ	4,000	515	2,060,000	
クラレ	1,000	1,208	1,208,000	
旭化成	4,000	548	2,192,000	
SUMCO	400	1,211	484,400	
ワコールホールディングス	1,000	1,158	1,158,000	

ITホールディングス	500	1,102	551,000	
王子製紙	2,000	393	786,000	
大王製紙	1,000	591	591,000	
日本製紙グループ本社	300	2,150	645,000	
レンゴー	1,000	557	557,000	
昭和電工	4,000	193	772,000	
住友化学	5,000	424	2,120,000	
東ソー	2,000	269	538,000	
トクヤマ	1,000	440	440,000	
セントラル硝子	2,000	403	806,000	
東亜合成	3,000	397	1,191,000	
電気化学工業	1,000	392	392,000	
イビデン	400	2,775	1,110,000	
信越化学工業	1,000	4,700	4,700,000	
エア・ウォーター	1,000	1,069	1,069,000	
大陽日酸	1,000	726	726,000	
日本触媒	1,000	866	866,000	
カネカ	1,000	582	582,000	
協和発酵キリン	1,000	845	845,000	
三菱ガス化学	1,000	576	576,000	
三井化学	2,000	304	608,000	
J S R	600	1,650	990,000	
東京応化工業	300	1,835	550,500	
三菱ケミカルホールディングス	4,000	588	2,352,000	
ダイセル化学工業	2,000	626	1,252,000	
住友ベークライト	1,000	511	511,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
積水化学工業	1,000	617	617,000	
日本ゼオン	1,000	723	723,000	
宇部興産	3,000	242	726,000	
日立化成工業	300	1,764	529,200	
野村総合研究所	400	1,883	753,200	
電通	600	2,578	1,546,800	
A D E K A	700	925	647,500	
日油	1,000	423	423,000	
花王	1,700	2,197	3,734,900	
武田薬品工業	2,200	3,975	8,745,000	
アステラス製薬	1,200	3,125	3,750,000	
大日本住友製薬	500	753	376,500	
塩野義製薬	900	1,597	1,437,300	
田辺三菱製薬	1,000	1,379	1,379,000	
中外製薬	700	1,496	1,047,200	
エーザイ	700	2,938	2,056,600	
ロート製薬	1,000	959	959,000	
小野薬品工業	300	3,870	1,161,000	

久光製薬	300	3,370	1,011,000	
持田製薬	1,000	880	880,000	
大正製薬	1,000	1,818	1,818,000	
参天製薬	200	2,924	584,800	
ツムラ	200	2,611	522,200	
テルモ	400	4,610	1,844,000	
みらかホールディングス	100	3,260	326,000	
第一三共	1,900	1,782	3,385,800	
キョーリン製薬ホールディングス	1,000	1,433	1,433,000	
日本ペイント	1,000	650	650,000	
関西ペイント	1,000	828	828,000	
D I C	4,000	182	728,000	
オリエンタルランド	100	7,600	760,000	
パーク24	700	849	594,300	
フジ・メディア・ホールディングス	6	129,400	776,400	
オービック	30	17,770	533,100	
ヤフー	40	30,450	1,218,000	
トレンドマイクロ	400	2,718	1,087,200	
日本オラクル	200	3,995	799,000	
ユー・エス・エス	110	6,620	728,200	
伊藤忠テクノソリューションズ	200	3,125	625,000	
大塚商会	100	5,600	560,000	
富士フイルムホールディングス	1,200	3,030	3,636,000	
コニカミノルタホールディングス	1,500	870	1,305,000	
資生堂	1,000	1,767	1,767,000	
ライオン	3,000	444	1,332,000	
コーセー	200	2,070	414,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
小林製薬	400	3,810	1,524,000	
昭和シェル石油	500	773	386,500	
コスモ石油	3,000	280	840,000	
東燃ゼネラル石油	1,000	933	933,000	
出光興産	100	9,000	900,000	
JXホールディングス	7,200	576	4,147,200	
横浜ゴム	1,000	443	443,000	
ブリヂストン	1,900	1,673	3,178,700	
住友ゴム工業	600	885	531,000	
旭硝子	3,000	964	2,892,000	
日本板硝子	2,000	226	452,000	
日本電気硝子	1,000	1,154	1,154,000	
住友大阪セメント	3,000	192	576,000	
太平洋セメント	4,000	111	444,000	

東海カーボン	1,000	530	530,000	
TOTO	1,000	592	592,000	
日本ガイシ	1,000	1,426	1,426,000	
日本特殊陶業	1,000	1,325	1,325,000	
新日本製鐵	17,000	303	5,151,000	
住友金属工業	11,000	201	2,211,000	
神戸製鋼所	9,000	216	1,944,000	
日新製鋼	5,000	181	905,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	1,300	2,907	3,779,100	
東京製鐵	300	971	291,300	
大和工業	200	2,568	513,600	
淀川製鋼所	1,000	387	387,000	
丸一鋼管	300	1,785	535,500	
大同特殊鋼	2,000	512	1,024,000	
愛知製鋼	2,000	633	1,266,000	
日立金属	1,000	1,005	1,005,000	
日本製鋼所	1,000	904	904,000	
日本軽金属	4,000	161	644,000	
三井金属	2,000	274	548,000	
三菱マテリアル	3,000	271	813,000	
住友金属鉱山	2,000	1,410	2,820,000	
DOWAホールディングス	1,000	545	545,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	3,935	393,500	
東邦チタニウム	200	1,986	397,200	
古河電気工業	2,000	381	762,000	
住友電気工業	1,900	1,190	2,261,000	
フジクラ	1,000	437	437,000	
日立電線	2,000	236	472,000	
アサヒホールディングス	600	1,715	1,029,000	
東洋製罐	400	1,597	638,800	
三和ホールディングス	2,000	273	546,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
住生活グループ	800	1,783	1,426,400	
リンナイ	200	5,110	1,022,000	
ニッパツ	1,000	927	927,000	
アマダ	1,000	690	690,000	
オーエスジー	500	978	489,000	
森精機製作所	200	996	199,200	
ディスコ	100	5,070	507,000	
豊田自動織機	500	2,696	1,348,000	
島精機製作所	300	2,196	658,800	
S M C	200	14,750	2,950,000	
コマツ	2,500	2,583	6,457,500	
住友重機械工業	1,000	549	549,000	

日立建機	300	2,071	621,300	
井関農機	1,000	230	230,000	
クボタ	3,000	815	2,445,000	
小森コーポレーション	300	1,012	303,600	
荏原製作所	2,000	408	816,000	
千代田化工建設	1,000	772	772,000	
ダイキン工業	700	2,958	2,070,600	
栗田工業	400	2,621	1,048,400	
ダイフク	1,000	605	605,000	
タダノ	1,000	471	471,000	
SANKYO	200	4,615	923,000	
ブラザー工業	1,000	1,253	1,253,000	
グローリー	400	2,015	806,000	
セガサミーホールディングス	1,000	1,635	1,635,000	
日本精工	1,000	772	772,000	
NTN	2,000	458	916,000	
ジェイテクト	700	1,062	743,400	
ミネベア	1,000	532	532,000	
THK	400	2,086	834,400	
日立製作所	13,000	457	5,941,000	
東芝	13,000	480	6,240,000	
三菱電機	6,000	897	5,382,000	
富士電機ホールディングス	3,000	266	798,000	
安川電機	1,000	816	816,000	
明電舎	1,000	421	421,000	
日立工機	500	781	390,500	
マキタ	500	3,385	1,692,500	
東芝テック	1,000	421	421,000	
マブチモーター	100	4,285	428,500	
日本電産	300	8,720	2,616,000	
オムロン	700	2,240	1,568,000	
エルピーダメモリ	700	1,001	700,700	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,000	591	591,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
NEC	6,000	254	1,524,000	
富士通	6,000	552	3,312,000	
沖電気工業	6,000	73	438,000	
セイコーエプソン	600	1,528	916,800	
アルバック	200	2,264	452,800	
パナソニック	5,900	1,182	6,973,800	
シャープ	3,000	888	2,664,000	
ソニー	3,200	3,010	9,632,000	
TDK	300	6,080	1,824,000	
ミツミ電機	100	1,556	155,600	

アルプス電気	600	1,001	600,600	
パイオニア	700	382	267,400	
ホシデン	300	1,000	300,000	
ヒロセ電機	100	9,410	941,000	
横河電機	800	674	539,200	
山武	300	2,016	604,800	
日本光電	300	1,759	527,700	
堀場製作所	300	2,382	714,600	
アドバンテスト	400	1,878	751,200	
キーエンス	100	23,800	2,380,000	
シスメックス	100	5,680	568,000	
デンソー	1,400	3,000	4,200,000	
スタンレー電気	500	1,587	793,500	
ウシオ電機	500	1,664	832,000	
カシオ計算機	900	711	639,900	
ファナック	600	12,980	7,788,000	
ローム	300	5,550	1,665,000	
浜松ホトニクス	300	3,070	921,000	
新光電気工業	200	950	190,000	
京セラ	500	8,590	4,295,000	
村田製作所	700	6,140	4,298,000	
双葉電子工業	200	1,702	340,400	
日東電工	500	4,180	2,090,000	
東海理化	300	1,662	498,600	
ニチコン	300	1,233	369,900	
三井造船	2,000	235	470,000	
日立造船	4,000	127	508,000	
三菱重工業	10,000	320	3,200,000	
川崎重工業	5,000	291	1,455,000	
I H I	5,000	188	940,000	
日産自動車	7,000	855	5,985,000	
いすゞ自動車	4,000	409	1,636,000	
トヨタ自動車	8,200	3,455	28,331,000	うち代用有価証券1,000株
日野自動車	2,000	480	960,000	
三菱自動車工業	14,000	121	1,694,000	
トヨタ車体	200	1,583	316,600	
日信工業	300	1,578	473,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
N O K	400	1,805	722,000	
ケーヒン	300	1,945	583,500	
アイシン精機	500	3,060	1,530,000	
マツダ	4,000	255	1,020,000	
ダイハツ工業	1,000	1,287	1,287,000	
ホンダ	5,100	3,265	16,651,500	
スズキ	1,100	2,121	2,333,100	

富士重工業	2,000	695	1,390,000	
ヤマハ発動機	700	1,396	977,200	
豊田合成	300	2,070	621,000	
シマノ	300	4,140	1,242,000	
タカタ	300	2,635	790,500	
良品計画	100	3,790	379,000	
メディopalホールディングス	700	916	641,200	
ネットワンシステムズ	10	126,200	1,262,000	
ドン・キホーテ	300	2,568	770,400	
スギホールディングス	200	1,965	393,000	
島津製作所	1,000	651	651,000	
東京精密	300	1,364	409,200	
ニコン	1,000	1,829	1,829,000	
オリンパス	700	2,519	1,763,300	
大日本スクリーン製造	1,000	636	636,000	
H O Y A	1,400	2,035	2,849,000	
キヤノン	3,600	4,155	14,958,000	うち代用有価証券2,500株
リコー	2,000	1,178	2,356,000	
シチズンホールディングス	1,000	579	579,000	
バンダイナムコホールディングス	800	898	718,400	
凸版印刷	2,000	764	1,528,000	
大日本印刷	2,000	1,142	2,284,000	
日本写真印刷	100	2,251	225,100	
アシックス	1,000	1,045	1,045,000	
ヤマハ	600	1,064	638,400	
リンテック	100	2,224	222,400	
任天堂	300	24,040	7,212,000	
コクヨ	500	709	354,500	
ニフコ	200	2,250	450,000	
伊藤忠商事	4,000	882	3,528,000	
丸紅	5,000	611	3,055,000	
長瀬産業	1,000	1,066	1,066,000	
豊田通商	600	1,521	912,600	
オンワードホールディングス	1,000	748	748,000	
ファミリーマート	200	3,065	613,000	
三井物産	5,100	1,430	7,293,000	
東京エレクトロン	500	5,330	2,665,000	
日立ハイテクノロジーズ	300	1,946	583,800	
住友商事	3,400	1,225	4,165,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
三菱商事	4,700	2,382	11,195,400	
キヤノンマーケティングジャパン	500	1,210	605,000	
阪和興業	1,000	414	414,000	

ニプロ	200	1,684	336,800	
東京スタイル	1,000	655	655,000	
ユニ・チャーム	300	3,270	981,000	
東邦ホールディングス	400	1,167	466,800	
島忠	200	1,901	380,200	
コメリ	200	1,955	391,000	
青山商事	300	1,469	440,700	
しまむら	100	7,600	760,000	
高島屋	1,000	702	702,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,000	604	604,000	
丸井グループ	1,000	696	696,000	
クレディセゾン	500	1,433	716,500	
イオン	2,000	1,051	2,102,000	
ユニー	600	851	510,600	
イズミ	500	1,265	632,500	
ケーズホールディングス	200	2,238	447,600	
新生銀行	5,000	100	500,000	
あおぞら銀行	4,000	170	680,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	44,000	442	19,448,000	
りそなホールディングス	1,800	485	873,000	
中央三井トラスト・ホールディングス	4,000	337	1,348,000	
三井住友フィナンシャルグループ	4,300	2,922	12,564,600	
第四銀行	2,000	269	538,000	
札幌北洋ホールディングス	1,100	404	444,400	
千葉銀行	2,000	530	1,060,000	
横浜銀行	4,000	429	1,716,000	
常陽銀行	2,000	360	720,000	
群馬銀行	2,000	462	924,000	
武蔵野銀行	200	2,348	469,600	
東京都民銀行	500	1,239	619,500	
七十七銀行	1,000	441	441,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	3,000	358	1,074,000	
静岡銀行	2,000	749	1,498,000	
十六銀行	2,000	273	546,000	
スルガ銀行	1,000	766	766,000	
八十二銀行	1,000	465	465,000	
大垣共立銀行	2,000	269	538,000	
北國銀行	1,000	284	284,000	
滋賀銀行	1,000	458	458,000	
南都銀行	1,000	421	421,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

百五銀行	1,000	361	361,000	
京都銀行	1,000	765	765,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	5,000	167	835,000	
広島銀行	2,000	352	704,000	
山陰合同銀行	1,000	618	618,000	
中国銀行	1,000	1,006	1,006,000	
伊予銀行	1,000	659	659,000	
百十四銀行	2,000	308	616,000	
阿波銀行	1,000	493	493,000	
鹿児島銀行	1,000	550	550,000	
肥後銀行	1,000	433	433,000	
住友信託銀行	6,000	508	3,048,000	
みずほ信託銀行	8,000	85	680,000	
みずほフィナンシャルグループ	49,900	163	8,133,700	
山口フィナンシャルグループ	1,000	836	836,000	
SBIホールディングス	53	12,830	679,990	
日本証券金融	500	658	329,000	
名古屋銀行	1,000	268	268,000	
京葉銀行	1,000	410	410,000	
イオンクレジットサービス	500	1,242	621,000	
アコム	260	1,115	289,900	
プロミス	350	554	193,900	
日立キャピタル	400	1,350	540,000	
オリックス	300	8,030	2,409,000	
三菱UFJリース	260	3,290	855,400	
ジャフコ	100	2,435	243,500	
大和証券グループ本社	5,000	440	2,200,000	
野村ホールディングス	11,100	536	5,949,600	
みずほ証券	2,000	247	494,000	
みずほインベスターズ証券	5,000	93	465,000	
岡三証券グループ	1,000	358	358,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2,000	315	630,000	
松井証券	500	592	296,000	
NKSJホールディングス	4,000	598	2,392,000	
カブドットコム証券	800	370	296,000	
MS&ADホールディングス	1,800	2,033	3,659,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	3	315,000	945,000	
東京海上ホールディングス	2,300	2,502	5,754,600	
T&Dホールディングス	1,050	2,136	2,242,800	
三井不動産	3,000	1,681	5,043,000	
三菱地所	4,000	1,505	6,020,000	
東京建物	2,000	390	780,000	
東急不動産	1,000	418	418,000	
住友不動産	1,000	1,973	1,973,000	

イオンモール	500	2,246	1,123,000	
--------	-----	-------	-----------	--

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
NTT都市開発	8	81,700	653,600	
東武鉄道	2,000	456	912,000	
東京急行電鉄	3,000	374	1,122,000	
京浜急行電鉄	2,000	705	1,410,000	
小田急電鉄	2,000	761	1,522,000	
京王電鉄	1,000	555	555,000	
京成電鉄	1,000	570	570,000	
東日本旅客鉄道	1,100	5,300	5,830,000	
西日本旅客鉄道	5	309,000	1,545,000	
東海旅客鉄道	5	686,000	3,430,000	
西日本鉄道	2,000	345	690,000	
近畿日本鉄道	5,000	255	1,275,000	
阪急阪神ホールディングス	5,000	381	1,905,000	
南海電気鉄道	3,000	331	993,000	
京阪電気鉄道	2,000	336	672,000	
名古屋鉄道	3,000	221	663,000	
日本通運	3,000	354	1,062,000	
ヤマトホールディングス	1,000	1,185	1,185,000	
山九	1,000	383	383,000	
福山通運	1,000	447	447,000	
セイノーホールディングス	1,000	576	576,000	
日本郵船	4,000	380	1,520,000	
商船三井	3,000	580	1,740,000	
川崎汽船	2,000	381	762,000	
全日本空輸	8,000	305	2,440,000	
三菱倉庫	1,000	1,090	1,090,000	
住友倉庫	2,000	437	874,000	
上組	1,000	693	693,000	
TBSホールディングス	600	1,175	705,000	
日本テレビ放送網	70	12,830	898,100	
テレビ朝日	3	141,100	423,300	
日本電信電話	2,500	3,715	9,287,500	
KDDI	10	480,500	4,805,000	
光通信	600	1,825	1,095,000	
NTTドコモ	50	143,000	7,150,000	
東京電力	3,600	1,975	7,110,000	
中部電力	1,900	1,996	3,792,400	
関西電力	2,300	2,013	4,629,900	
中国電力	1,000	1,661	1,661,000	
北陸電力	800	2,001	1,600,800	
東北電力	1,500	1,820	2,730,000	
四国電力	700	2,391	1,673,700	
九州電力	1,100	1,830	2,013,000	

北海道電力	700	1,665	1,165,500	
沖縄電力	300	3,920	1,176,000	
J POWER	500	2,558	1,279,000	
東京ガス	7,000	363	2,541,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
大阪ガス	7,000	316	2,212,000	
東邦ガス	2,000	407	814,000	
松竹	1,000	543	543,000	
東宝	500	1,356	678,000	
NTTデータ	4	277,400	1,109,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	300	1,471	441,300	
カブコン	100	1,354	135,400	
日本空港ビルデング	600	1,257	754,200	
セコム	600	3,855	2,313,000	
メイテック	100	1,785	178,500	
アサツー ディ・ケイ	300	2,271	681,300	
コナミ	300	1,775	532,500	
ベネッセホールディングス	400	3,780	1,512,000	
ダイセキ	200	1,656	331,200	
ヤマダ電機	300	5,400	1,620,000	
オートバックスセブン	300	3,350	1,005,000	
ニトリホールディングス	150	7,000	1,050,000	
吉野家ホールディングス	4	106,300	425,200	
ミスミグループ本社	400	2,079	831,600	
ファーストリテイリング	100	12,330	1,233,000	
ソフトバンク	2,600	2,857	7,428,200	
スズケン	300	2,502	750,600	
サンドラッグ	400	2,362	944,800	
合計	849,750	-	740,104,340	

株式以外の有価証券

種類	銘柄	利率（％）	償還日	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第312回利付国債（10年）	1.200	2020/12/20	33,000,000	33,043,890	
合計				33,000,000	33,043,890	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

デリバティブ取引関係注記に記載したとおりであります。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

「TAA株50ポートフォリオ」

（平成23年1月31日現在）

資産総額	200,491,357 円
負債総額	4,706,790 円
純資産総額（ - ）	195,784,567 円
発行済数量	223,803,910 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	8,748 円

「TAA株100ポートフォリオ」

（平成23年1月31日現在）

資産総額	1,127,862,678 円
負債総額	17,782,117 円
純資産総額（ - ）	1,110,080,561 円
発行済数量	1,614,893,453 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	6,874 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であつて、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者に対する特典

ありません。

（3）譲渡制限

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（4）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

前記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

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】

（1）資本金の額

平成23年2月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。

最近5年間における資本金の増減はありません。

（2）委託会社等の機構

会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後2年以内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。ただし、任期満了前に退任した取締役の補欠として選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

取締役会は、取締役の中から代表取締役を選任するとともに、取締役社長1名を選任します。また、取締役会は、取締役会長1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を選任することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集し、その議長を務めます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数をもって決議します。

投資運用の意思決定機構

ファンドの個々の取引の運用指図は、運用基本方針、運用内規および月次運用方針に基づき、委託会社のファンドマネジャーが行います。

ファンド毎の運用基本方針、具体的な運用ルールである運用内規および月次運用方針については、運用部門中心に構成される協議機関において市場動向・ファンダメンタルズ等の投資環境分析を踏まえ協議され、運用担当部（室）の部（室）長が決定します。

ファンドマネジャーは、運用基本方針、運用内規および月次運用方針に基づき、具体的な銘柄選択を行い、組入有価証券等の売買の指図を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

「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、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」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年2月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	145	19,918
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	2	22

単位型公社債投資信託	0	0
合計	147	19,941

純資産総額合計額の金額については、億円未満の端数を切り捨てて記載しておりますので、表中の個々の金額の合計と合計欄の金額とは一致しないことがあります。

3 【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

(1) 委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」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。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「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）に基づき作成しております。

なお、第14期事業年度（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）は改正前の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき、第15期事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）は改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

(2) 当社の中間財務諸表は、「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。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

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項の規定に基づき第14期事業年度（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）の財務諸表について監査法人トーマツによる監査を受けており、第15期事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第16期事業年度に係る中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

なお、監査法人トーマツは、監査法人の種類の変更により、平成21年7月1日をもって有限責任監査法人トーマツとなっております。

財務諸表

(1) 【貸借対照表】

期別	科目	注記 番号	第14期 (平成21年3月31日現在)			第15期 (平成22年3月31日現在)		
			内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)
(資産の部)								
流動資産								
	1. 現金・預金			5,631,332		7,338,891		
	2. 有価証券			5,496,391		7,509,155		
	3. 前払費用	1		152,013		167,143		
	4. 未収委託者報酬			1,531,772		1,639,083		
	5. 未収運用受託報酬	1		610,279		621,865		
	6. 未収投資助言報酬	1		192,707		176,080		
	7. 未収収益			25,200		26,952		
	8. 未収金			543,797		9,402		
	9. 貯蔵品			16,973		13,545		
	10. 繰延税金資産			230,986		253,992		
	11. 未収還付法人税等			205,842		-		
	12. 未収消費税等			54,100		-		
	13. その他			310		68		
	流動資産計			14,691,707	39.6	17,756,180	45.5	

固定資産							
1.有形固定資産							
(1)建物	2		185,669			158,855	
(2)器具備品	2		184,583			163,773	
有形固定資産計			370,252	1.0		322,629	0.8
2.無形固定資産							
(1)電信加入権			325			292	
(2)電話加入権			7,942			7,942	
(3)ソフトウェア			1,462,445			1,516,892	
(4)ソフトウェア仮勘定			186,833			49,810	
無形固定資産計			1,657,547	4.4		1,574,938	4.0

期別	科目	注記 番号	第14期 (平成21年3月31日現在)			第15期 (平成22年3月31日現在)		
			内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)
	3.投資その他の資産							
	(1)投資有価証券			18,597,384			18,457,108	
	(2)長期差入保証金	1		282,453			282,326	
	(3)預託金			9,707			458	
	(4)繰延税金資産			1,512,655			665,854	
	投資その他の資産計			20,402,200	55.0		19,405,748	49.7
	固定資産計			22,429,999	60.4		21,303,315	54.5
	資産合計			37,121,707	100.0		39,059,496	100.0
	(負債の部)							
	流動負債							
	1.預り金			24,606			29,359	
	2.未払金							
	(1)未払収益分配金		5,075			5,024		
	(2)未払償還金		161,779			159,114		
	(3)未払手数料	1	564,092			565,051		
	(4)その他未払金	1	266,514	997,462		170,412	899,602	
	3.未払運用委託報酬			450,155			438,086	
	4.未払投資助言報酬			116,336			100,080	
	5.未払費用	1		59,744			53,471	
	6.未払法人税等			-			71,382	
	7.未払事業所税			12,813			-	
	8.未払消費税等			-			22,816	
	9.前受運用受託報酬			335			-	
	10.賞与引当金			477,967			502,405	
	11.その他			106			12,777	
	流動負債計			2,139,527	5.8		2,129,982	5.5
	固定負債							
	1.長期未払費用	1		5,080			-	
	2.退職給付引当金			428,902			537,616	
	3.役員退職慰労引当金			26,929			12,962	
	固定負債計			460,912	1.2		550,578	1.4
	負債合計			2,600,440	7.0		2,680,560	6.9

期別	科目	注記 番号	第14期 (平成21年3月31日現在)			第15期 (平成22年3月31日現在)		
			内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)

(純資産の部)							
株主資本							
1. 資本金			10,000,000	26.9		10,000,000	25.6
2. 資本剰余金							
資本準備金			8,281,840			8,281,840	
資本剰余金計			8,281,840	22.3		8,281,840	21.2
3. 利益剰余金							
(1) 利益準備金			139,807			139,807	
(2) その他利益剰余金							
配当準備積立金		120,000				120,000	
研究開発積立金		70,000				70,000	
別途積立金		350,000				350,000	
繰越利益剰余金		16,954,532	17,494,532			17,323,750	
利益剰余金計			17,634,339	47.5		18,003,557	46.1
株主資本計			35,916,179			36,285,397	
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金			1,394,911	3.7		93,537	0.2
純資産合計			34,521,267	93.0		36,378,935	93.1
負債・純資産合計			37,121,707	100.0		39,059,496	100.0

(2) 【損益計算書】

期別	注記 番号	第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)			第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
営業収益							
1. 委託者報酬		12,826,491			11,527,251		
2. 運用受託報酬		4,159,731			3,551,530		
3. 投資助言報酬		914,936			780,375		
4. その他営業収益		47,100			47,100		
営業収益計			17,948,258	100.0		15,906,257	100.0
営業費用							
1. 支払手数料			5,372,440			4,836,212	
2. 広告宣伝費			103,044			20,846	
3. 公告費			1,694			-	
4. 受益証券発行費			412			6,873	
5. 調査費							
(1) 調査費		862,306			838,762		
(2) 支払運用委託報酬		2,026,740			1,628,406		
(3) 支払投資助言報酬		460,766	3,349,813		409,100	2,876,269	
6. 委託計算費			106,565			106,973	
7. 営業雑経費							
(1) 通信費		65,515			58,544		
(2) 印刷費		288,824			177,070		
(3) 協会費		20,669			17,981		
(4) 販売事務費		24,827			24,802		
(5) その他営業雑経費		349,317	749,153		176,419	454,818	
営業費用計			9,683,123	54.0		8,301,993	52.2
一般管理費							
1. 給料							
(1) 役員報酬	1	72,379			60,906		
(2) 給料・手当		2,884,490			3,003,448		
(3) 賞与		298,455			240,551		
(4) その他人件費		8,123	3,263,449		6,257	3,311,164	
2. 退職給付負担金			50,690			64,509	
3. 海外派遣関係費			101,217			89,982	
4. 交際費			26,410			17,004	
5. 寄付金			254			-	

6. 旅費交通費		157,027		69,949
----------	--	---------	--	--------

期別	注記 番号	第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)			第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
7. 福利厚生費			515,594			501,440	
8. 租税公課			83,812			79,700	
9. 不動産賃借料			668,993			662,795	
10. 器具備品賃借料			4,309			4,057	
11. 器具備品費			159,935			152,994	
12. 業務委託費			184,831			156,825	
13. 賞与引当金繰入額			477,967			489,537	
14. 退職給付引当金繰入額			95,444			-	
15. 退職給付費用			-			109,004	
16. 役員退職慰労引当金繰入額			8,875			4,600	
17. 固定資産減価償却費			581,209			604,130	
18. 諸経費			218,175			252,151	
一般管理費計			6,598,198	36.8		6,569,846	41.3
営業利益			1,666,937	9.3		1,034,417	6.5
営業外収益							
1. 受取配当金			144,552			88,280	
2. 有価証券利息			141,541			127,716	
3. 受取利息			21,378			7,927	
4. 有価証券償還益			15,898			-	
5. 為替差益			7,230			-	
6. 支払委託金時効免除益	2		17,320			-	
7. 雑収入			7,760			14,354	
営業外収益計			355,680	2.0		238,280	1.5
営業外費用							
1. 為替差損			-			1,142	
2. 雑損失			3,696			6,007	
営業外費用計			3,696	0.0		7,150	0.0
経常利益			2,018,922	11.2		1,265,547	8.0
特別利益							
1. 投資有価証券売却益			106,062			123,026	
2. 投資有価証券償還益			-			32,782	
3. 事故受取保険金	4		9,024			-	
4. 賞与引当金戻入益			3,979			-	
5. 前期支払投資助言報酬戻入益			-			25,605	
6. 前期支払運用委託報酬戻入益			-			31,404	

期別	注記 番号	第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)			第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
7. 役員退職慰労引当金戻入益			-			583	
特別利益計			119,065	0.7		213,401	1.3
特別損失							
1. 固定資産除却損	5		5,640			3,290	
2. 投資有価証券売却損			492,455			424,493	
3. 投資有価証券評価損			1,831,471			118,045	
4. 事故損失賠償金	3		31,629			478	
5. その他特別損失			-			230	
6. 投資有価証券償還損			-			54,263	
特別損失計			2,361,196	13.2		600,801	3.8

税引前当期純利益又は 税引前当期純損失()		223,208	1.2		878,147	5.5
法人税、住民税及び事業税	554,304			337,932		
過年度法人税等	-			27,704		
法人税等還付額	-			35,406		
法人税等調整額	524,168	30,135	0.2	43,138	373,369	2.3
当期純利益又は 当期純損失()		253,344	1.4		504,778	3.2

(3) 【株主資本等変動計算書】

第14期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

（単位：千円）

株主資本		
資本金	前期末残高	10,000,000
	当期変動額	-
	当期末残高	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	前期末残高	8,281,840
	当期変動額	-
	当期末残高	8,281,840
資本剰余金合計	前期末残高	8,281,840
	当期変動額	-
	当期末残高	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金	前期末残高	139,807
	当期変動額	-
	当期末残高	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	前期末残高	120,000
	当期変動額	-
	当期末残高	120,000
研究開発積立金	前期末残高	70,000
	当期変動額	-
	当期末残高	70,000
別途積立金	前期末残高	350,000
	当期変動額	-
	当期末残高	350,000
繰越利益剰余金	前期末残高	17,343,436
	当期変動額	剰余金の配当 当期純損失 135,560 253,344
	当期末残高	16,954,532
利益剰余金合計	前期末残高	18,023,243
	当期変動額	388,904
	当期末残高	17,634,339
株主資本合計	前期末残高	36,305,083
	当期変動額	388,904
	当期末残高	35,916,179
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	前期末残高	602,394
	当期変動額（純額）	792,517
	当期末残高	1,394,911
評価・換算差額等合計	前期末残高	602,394
	当期変動額	792,517
	当期末残高	1,394,911
純資産合計	前期末残高	35,702,689
	当期変動額	1,181,422
	当期末残高	34,521,267

第15期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

（単位：千円）

株主資本		
資本金	前期末残高	10,000,000
	当期変動額	-
	当期末残高	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	前期末残高	8,281,840
	当期変動額	-
	当期末残高	8,281,840
資本剰余金合計	前期末残高	8,281,840
	当期変動額	-
	当期末残高	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金	前期末残高	139,807
	当期変動額	-
	当期末残高	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	前期末残高	120,000
	当期変動額	-
	当期末残高	120,000
研究開発積立金	前期末残高	70,000
	当期変動額	-
	当期末残高	70,000
別途積立金	前期末残高	350,000
	当期変動額	-
	当期末残高	350,000
繰越利益剰余金	前期末残高	16,954,532
	当期変動額	剰余金の配当 当期純利益 135,560 504,778
	当期末残高	17,323,750
利益剰余金合計	前期末残高	17,634,339
	当期変動額	369,218
	当期末残高	18,003,557
株主資本合計	前期末残高	35,916,179
	当期変動額	369,218
	当期末残高	36,285,397
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	前期末残高	1,394,911
	当期変動額（純額）	1,488,449
	当期末残高	93,537
評価・換算差額等合計	前期末残高	1,394,911
	当期変動額	1,488,449
	当期末残高	93,537
純資産合計	前期末残高	34,521,267
	当期変動額	1,857,668
	当期末残高	36,378,935

（重要な会計方針）

第14期 （自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）	第15期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）
1. 有価証券の評価基準及び評価方法 満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。	1. 有価証券の評価基準及び評価方法 満期保有目的の債券 同左

<p> その他有価証券 時価のあるもの ...決算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）によっております。 </p> <p> 時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。 </p> <p> なお、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の財務諸表を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。 </p> <p> 2. 固定資産の減価償却の方法 有形固定資産 定率法によっております。なお主な耐用年数は、建物3～15年、器具備品2～20年であります。 </p> <p> 無形固定資産 定額法によっております。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）に基づく定額法によっております。 </p> <p> 3. 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期末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。 </p>	<p> その他有価証券 時価のあるもの 同左 </p> <p> 時価のないもの 同左 </p> <p> 2. 固定資産の減価償却の方法 有形固定資産 同左 </p> <p> 無形固定資産 同左 </p> <p> 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左 </p>
---	---

第14期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）	第15期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）
<p> 4. 引当金の計上基準 賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当事業年度末在籍者に対する支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。 </p> <p> 退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額（簡便法により自己都合退職による期末要支給額の100%）を計上しております。なお受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。 </p>	<p> 4. 引当金の計上基準 賞与引当金 同左 </p> <p> 退職給付引当金 同左 </p>

<p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>5. リース取引の処理方法 平成19年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>6. 消費税及び地方消費税の会計処理 税抜方式によっております。</p>	<p>役員退職慰労引当金 同左</p> <p>5. リース取引の処理方法 同左</p> <p>6. 消費税及び地方消費税の会計処理 同左</p>
---	--

(会計処理の変更)

第14期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、当期より「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成5年6月17日（企業審議会第一部会）、平成19年3月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成6年1月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年3月30日改正））を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。</p> <p>なお、リース取引会計基準の改正適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。 この変更による影響はありません。</p>	

(表示方法の変更)

第14期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(貸借対照表) 前期において、「役員退任慰労金引当金」として表示していたものは、「役員退職慰労引当金」として表示しております。	(貸借対照表)
(損益計算書)	(損益計算書) 前期において「退職給付引当金繰入額」として表示していたものは、「退職給付費用」として表示しております。

(注記事項)

(貸借対照表関係)

第14期 (平成21年3月31日現在)	第15期 (平成22年3月31日現在)								
1. 関係会社に対する資産及び負債は以下のとおりであり、すべて親会社に対するものであります。	1. 関係会社に対する資産及び負債は以下のとおりであり、すべて親会社に対するものであります。								
<table> <tr> <td>未収運用受託報酬</td> <td>171,771千円</td> </tr> <tr> <td>未収投資助言報酬</td> <td>178,612千円</td> </tr> </table>	未収運用受託報酬	171,771千円	未収投資助言報酬	178,612千円	<table> <tr> <td>未収運用受託報酬</td> <td>229,597千円</td> </tr> <tr> <td>未収投資助言報酬</td> <td>171,926千円</td> </tr> </table>	未収運用受託報酬	229,597千円	未収投資助言報酬	171,926千円
未収運用受託報酬	171,771千円								
未収投資助言報酬	178,612千円								
未収運用受託報酬	229,597千円								
未収投資助言報酬	171,926千円								

長期差入保証金	265,746千円	前払費用	52,971千円
未払手数料	55,046千円	長期差入保証金	265,746千円
未払費用	72,525千円	未払手数料	78,620千円
長期未払費用	5,080千円	未払費用	5,080千円
		その他未払金	15,052千円
2.有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。		2.有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。	
建物	141,871千円	建物	169,123千円
器具備品	549,361千円	器具備品	585,673千円
合計	691,233千円	合計	754,796千円

(損益計算書関係)

第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1.役員報酬の限度額は以下のとおりであります。	1. 同左
取締役 180,000千円 監査役 30,000千円	
2.支払委託金時効免除益は、時効成立のため利益計上した償還金によるものであります。	2.
3.事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。	3. 同左
4.事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。	4.
5.固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。	5.固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。
器具備品 5,640千円 合計 5,640千円	器具備品 2,957千円 ソフトウェア 333千円 合計 3,290千円

(株主資本等変動計算書関係)

第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1.発行済株式の種類及び総数は以下のとおりであります。	1.発行済株式の種類及び総数は以下のとおりであります。
前事業年度末発行済株式総数 普通株式 108,448株 当事業年度末発行済株式総数 普通株式 108,448株 当事業年度に増加または減少した発行済株式数 なし	前事業年度末発行済株式総数 普通株式 108,448株 当事業年度末発行済株式総数 普通株式 108,448株 当事業年度に増加または減少した発行済株式数 なし

2. 配当に関する事項	2. 配当に関する事項
<p>配当金支払額 平成20年6月23日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項</p> <p>株式の種類 普通株式 配当金の総額 135,560千円 1株当たり配当額 1,250円 基準日 平成20年3月31日 効力発生日 平成20年6月23日</p> <p>基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの 平成21年6月26日開催の定時株主総会決議において、次のとおり決議することを予定しております。</p> <p>株式の種類 普通株式 配当金の総額 135,560千円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 1,250円 基準日 平成21年3月31日 効力発生日 平成21年6月26日</p>	<p>配当金支払額 平成21年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項</p> <p>株式の種類 普通株式 配当金の総額 135,560千円 1株当たり配当額 1,250円 基準日 平成21年3月31日 効力発生日 平成21年6月26日</p> <p>基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの 平成22年6月25日開催の定時株主総会決議において、次のとおり決議することを予定しております。</p> <p>株式の種類 普通株式 配当金の総額 135,560千円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 1,250円 基準日 平成22年3月31日 効力発生日 平成22年6月25日</p>

(リース取引関係)

第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)																																				
<p>1. リース取引に関する会計基準適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。その内容は以下のとおりであります。</p> <p>リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>取得価額 相当額</th> <th>減価償却 累計額 相当額</th> <th>期末残高 相当額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>9,538</td> <td>6,386</td> <td>3,151</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <tbody> <tr> <td>1年内</td> <td>1,997千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td>1,340千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>3,337千円</td> </tr> </tbody> </table>		取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	期末残高 相当額		千円	千円	千円	器具備品	9,538	6,386	3,151	1年内	1,997千円	1年超	1,340千円	合計	3,337千円	<p>1. リース取引に関する会計基準適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。その内容は以下のとおりであります。</p> <p>リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>取得価額 相当額</th> <th>減価償却 累計額 相当額</th> <th>期末残高 相当額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>10,400</td> <td>8,365</td> <td>2,035</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <tbody> <tr> <td>1年内</td> <td>1,329千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td>804千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>2,134千円</td> </tr> </tbody> </table>		取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	期末残高 相当額		千円	千円	千円	器具備品	10,400	8,365	2,035	1年内	1,329千円	1年超	804千円	合計	2,134千円
	取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	期末残高 相当額																																		
	千円	千円	千円																																		
器具備品	9,538	6,386	3,151																																		
1年内	1,997千円																																				
1年超	1,340千円																																				
合計	3,337千円																																				
	取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	期末残高 相当額																																		
	千円	千円	千円																																		
器具備品	10,400	8,365	2,035																																		
1年内	1,329千円																																				
1年超	804千円																																				
合計	2,134千円																																				

<p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <p>支払リース料 2,547千円 減価償却費相当額 2,312千円 支払利息相当額 177千円</p> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</p> <p>2. オペレーティング・リース取引 未経過リース料期末残高相当額</p> <table border="1"> <tbody> <tr> <td>1年内</td> <td>1,530千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td>510千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>2,040千円</td> </tr> </tbody> </table>	1年内	1,530千円	1年超	510千円	合計	2,040千円	<p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <p>支払リース料 2,169千円 減価償却費相当額 1,979千円 支払利息相当額 103千円</p> <p>減価償却費相当額の算定方法 同左</p> <p>利息相当額の算定方法 同左</p> <p>2. オペレーティング・リース取引 未経過リース料期末残高相当額</p> <table border="1"> <tbody> <tr> <td>1年内</td> <td>510千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>510千円</td> </tr> </tbody> </table>	1年内	510千円	1年超	-	合計	510千円
1年内	1,530千円												
1年超	510千円												
合計	2,040千円												
1年内	510千円												
1年超	-												
合計	510千円												

(金融商品関係)

当事業年度(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、自己勘定の資金運用にあたっては、資金運用規則に沿って、慎重な資金管理、資本金の保全、投機の回避に十分に留意しております。また、資金の管理にあたっては、投資信託委託会社としての業務により当社が受け入れる投資信託財産に属する金銭等との混同を来たさないよう、分離して行っております。

投資有価証券は主として利付国債と自社設定投資信託であります。これらは金利の変動リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。自己資金運用に係るリスク管理等については、資金運用規則のほか自己資金運用に係るリスク管理規程に従い、適切なリスク管理を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日(当期の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金及び預金	7,338,891	7,338,891	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,009,955	4,026,820	16,864
其他有価証券	3,499,200	3,499,200	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	10,550,685	10,662,050	111,364
其他有価証券	7,773,922	7,773,922	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金及び預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

これらの時価について、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから当該帳簿価額によっており、譲渡性預金以外のものは決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）は、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっており、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資以外のものは、決算日の市場価格等によっております。

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額132,500千円）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等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金及び預金	7,338,891	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	10,400,000	-	-
(1) 国債・地方債等	4,000,000	10,400,000	-	-
(2) 社債	-	-	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの	5,800,000	3,590,445	1,123,345	1,000
その他(注)	5,800,000	3,590,445	1,123,345	1,000
合計	17,138,891	13,990,445	1,123,345	1,000

（注）譲渡性預金と投資信託受益証券であります。

（追加情報）

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

（有価証券関係）

前事業年度（平成21年3月31日現在）

1. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1) 国債・地方債等	14,256,505	14,376,210	119,704
	(2) 社債	-	-	-
	(3) その他	-	-	-
	小計	14,256,505	14,376,210	119,704
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	300,429	300,300	129
	(2) 社債	-	-	-
	(3) その他	-	-	-
	小計	300,429	300,300	129
合計		14,556,935	14,676,510	119,574

2. 其他有価証券で時価のあるもの

	種類	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)	差額 (千円)

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,499,162	1,499,450	287
	国債・地方債等	1,499,162	1,499,450	287
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注）	1,001,000	1,062,688	61,688
	小計	2,500,162	2,562,138	61,975
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注）	10,725,390	6,741,766	3,983,624
	小計	10,725,390	6,741,766	3,983,624
	合計	13,225,553	9,303,904	3,921,649

（注）投資信託受益証券であります。

3．当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
1,063,412	106,062	492,455

4．時価のない主な有価証券の内容及び貸借対照表計上額

	貸借対照表計上額 （千円）	摘要
その他有価証券		
非上場株式	132,500	
匿名組合出資	100,436	

5．その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の今後の償還予定額

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
1．債券	5,496,391	10,559,993	-	-
(1)国債・地方債等	5,496,391	10,559,993	-	-
(2)社債	-	-	-	-
(3)その他	-	-	-	-
2．その他（注）	1,284,732	4,605,475	1,503,447	410,798
合計	6,781,124	15,165,468	1,503,447	410,798

（注）投資信託受益証券であります。

当事業年度（平成22年3月31日現在）

1．満期保有目的の債券

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	12,539,527	12,670,410	130,882
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,539,527	12,670,410	130,882

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	2,021,114	2,018,460	2,654
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,021,114	2,018,460	2,654
合計		14,560,641	14,688,870	128,228

2. その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	999,729	999,800	71
	国債・地方債等	999,729	999,800	71
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	3,410,636	4,408,424	997,787
	小計	4,410,365	5,408,224	997,858
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,999,408	1,999,400	8
	国債・地方債等	1,999,408	1,999,400	8
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	4,083,982	3,274,650	809,331
	小計	6,083,391	5,274,050	809,340
合計		10,493,756	10,682,275	188,518

(注1) 投資信託受益証券であります。

(注2) 非上場株式(貸借対照表計上額132,500千円)については、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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
2,269,047	123,026	424,493

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について118,045千円(その他有価証券の投資信託受益証券118,045千円)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

当社は、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。

当事業年度(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

当社は、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。

(退職給付関係)

前事業年度(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を支払っております。

2．退職給付債務及びその内訳（平成21年3月31日現在）

- (1)退職給付債務 428,902千円
(2)退職給付引当金 428,902千円

(注)当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

3．退職給付費用の内訳

勤務費用 96,193千円

(注)勤務費用には退職金（「諸経費」）748千円を含めております。その他、確定拠出型年金制度への拠出金（「福利厚生費」）38,038千円及び受入出向者にかかる退職給付負担金50,690千円を計上しております。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

当事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を支払っております。

2．退職給付債務及びその内訳（平成22年3月31日現在）

- (1)退職給付債務 537,616千円
(2)退職給付引当金 537,616千円

(注)当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

3．退職給付費用の内訳

勤務費用 110,011千円

(注)勤務費用には退職金（「諸経費」）1,007千円を含めております。その他、確定拠出型年金制度への拠出金（「福利厚生費」）41,273千円及び受入出向者にかかる退職給付負担金64,509千円を計上しております。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

(税効果会計関係)

第14期 (平成21年3月31日現在)	第15期 (平成22年3月31日現在)
1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳	1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳
(流動資産)	(流動資産)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 191,186千円	賞与引当金 200,962千円
その他 113,524千円	未払事業税 21,062千円
繰延税金資産合計 304,710千円	その他 32,093千円

		繰延税金資産合計	254,117千円
繰延税金負債		繰延税金負債	
未収事業税	72,448千円	有価証券評価差額	28千円
その他	1,161千円	その他	97千円
繰延税金負債合計	73,724千円	繰延税金負債合計	125千円
繰延税金資産の純額	230,986千円	繰延税金資産の純額	253,992千円
(固定資産)		(固定資産)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
退職給付引当金	171,561千円	退職給付引当金	215,046千円
役員退職慰労引当金	10,771千円	役員退職慰労引当金	5,185千円
長期未払費用	2,032千円	税務上の繰延資産償却超過額	6,611千円
税務上の繰延資産償却超過額	8,237千円	投資有価証券評価損	695,776千円
投資有価証券評価損	732,588千円	投資有価証券評価差額	327,794千円
投資有価証券評価差額	861,086千円	その他	5,018千円
その他	6,721千円	小計	1,255,430千円
小計	1,792,996千円	評価性引当額	126,659千円
	円	繰延税金資産合計	1,128,770千円
評価性引当額	255,572千円		
	円		
繰延税金資産合計	1,537,424千円		
	円		
繰延税金負債		繰延税金負債	
投資有価証券評価差額	24,675千円	特別分配金否認	63,801千円
その他	96千円	投資有価証券評価差額	399,115千円
繰延税金負債合計	24,772千円	繰延税金負債合計	462,916千円
繰延税金資産の純額	1,512,655千円	繰延税金資産の純額	665,854千円
	円		
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主な項目別の内訳		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主な項目別の内訳	
法定実効税率	40.00%	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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。	
調整)			
交際費等永久に損金に算入されない項目	7.97%		
住民税均等割	2.61%		
過年度法人税等修正	15.07%		
源泉所得税	7.34%		
評価性引当額の増加額	51.68%		
その他	0.90%		
税効果会計適用後の法人税等の負担率	13.63%		

(関連当事者との取引)

前事業年度(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

(追加情報)

当事業年度から平成18年10月17日公表の、「関連当事者の開示に関する会計基準」(企業会計基準委員会 企業会計基準第11号)及び「関連当事者の開示に関する実務指針」(企業会計基準委員会 企業会計基

準第13号)を適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に変更はありません。

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	200,000	生命保険業	(被所有)直接所有 90.00%	兼任5 出向3 転籍5	営業取引	運用受託報酬の受取	927,282	未収運用受託報酬	171,771
								投資助言報酬の受取	840,989	未収投資助言報酬	178,612

(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

取引条件は第三者との取引価格を参考に、一般的取引条件と同様に決定しております。

3. 上記の他に、当社は、日本生命保険相互会社が保有する私募投資信託より委託者報酬を受取っております。

4. 運用受託報酬の受取927,282千円には、日本生命保険相互会社が保有する外国籍投資信託に係る運用受託報酬471,187千円を含んでおります。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(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)
同一の親会社を持つ会社	ニッセイ情報テクノロジー株式会社	東京都大田区蒲田	4,000	システムサービス	なし	ソフトウェアの開発費用	ソフトウェア及びソフトウェア仮勤定等の取得	627,444	その他未払金	169,941

(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

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場であります。）

当事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有)直接所有 90.00%	兼任5 出向3 転籍4	営業取引	運用受託報酬の受取	962,342	未収運用受託報酬	229,597
								投資助言報酬の受取	734,939	未収投資助言報酬	171,926

(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

取引条件は第三者との取引価格を参考に、一般的取引条件と同様に決定しております。

3. 上記の他に、当社は、日本生命保険相互会社が保有する私募投資信託より委託者報酬を受取っております。

4. 運用受託報酬の受取962,342千円には、日本生命保険相互会社が保有する外国籍投資信託に係る運用受託報酬738,747千円を含んでおります。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(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)
同一の親会社を持つ会社	ニッセイ情報テクノロジー株式会社	東京都大田区	4,000	システムサービス	なし	ソフトウェアの開発費用	ソフトウェア及びソフトウェア仮勘定等の取得	307,154	その他未払金	31,915

(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

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場であります。）

(1株当たり情報)

第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)		第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	
1株当たり純資産額	318,320円92銭	1株当たり純資産額	335,450円49銭
1株当たり当期純損失金額	2,336円09銭	1株当たり当期純利益金額	4,654円56銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		同左	

(注) 1株当たり当期純利益金額又は1株当たり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。

	第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
当期純利益又は当期純損失()	253,344千円	504,778千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株主に係る当期純利益又は当期純損失()	253,344千円	504,778千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

前事業年度(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第16期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		6,670,258
有価証券		9,043,990
未収委託者報酬		1,821,224
未収運用受託報酬		895,196
未収投資助言報酬		176,420
繰延税金資産		233,426
その他		295,610
流動資産合計		19,136,126
固定資産		
有形固定資産	1	347,896
無形固定資産		1,496,181
投資その他の資産		
投資有価証券		17,474,754
繰延税金資産		822,898
その他		284,270
投資その他の資産合計		18,581,923
固定資産合計		20,426,001
資産合計		39,562,127
負債の部		
流動負債		
未払金		245,219
未払運用委託報酬		460,124
未払投資助言報酬		124,386
未払費用		106,516
未払法人税等		229,707
前受運用受託報酬		12,030
前受投資助言報酬		70,329
賞与引当金		367,681
その他		959,180
流動負債合計		2,575,177
固定負債		
退職給付引当金		589,436
役員退職慰労引当金		9,425
その他		96,561
固定負債合計		695,423
負債合計		3,270,600
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840

利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	17,455,011
利益剰余金合計	18,134,818
株主資本合計	36,416,658
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	125,131
評価・換算差額等合計	125,131
純資産合計	36,291,527
負債・純資産合計	39,562,127

(2) 中間損益計算書 (単位：千円)

第16期中間会計期間
(自平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	5,604,865
運用受託報酬	1,964,526
投資助言報酬	382,729
その他営業収益	23,550
営業収益合計	7,975,670
営業費用	4,070,829
一般管理費	1 3,374,988
営業利益	529,852
営業外収益	2 130,735
営業外費用	3 8,682
経常利益	651,906
特別利益	8
特別損失	4 185,399
税引前中間純利益	466,515
法人税、住民税及び事業税	199,179
法人税等調整額	514
法人税等合計	199,694
中間純利益	266,821

(3) 中間株主資本等変動計算書 (単位：千円)

第16期中間会計期間
(自平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

株主資本	
資本金	
前期末残高	10,000,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840

資本剰余金合計	
前期末残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	139,807
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
前期末残高	120,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	120,000
研究開発積立金	
前期末残高	70,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	70,000
別途積立金	
前期末残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
繰越利益剰余金	
前期末残高	17,323,750
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	266,821
当中間期変動額合計	131,261
当中間期末残高	17,455,011
利益剰余金合計	
前期末残高	18,003,557
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	266,821
当中間期変動額合計	131,261
当中間期末残高	18,134,818
株主資本合計	
前期末残高	36,285,397
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	266,821
当中間期変動額合計	131,261
当中間期末残高	36,416,658
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	93,537
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	218,668

当中間期変動額合計	218,668
当中間期末残高	125,131
評価・換算差額等合計	
前期末残高	93,537
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	218,668
当中間期変動額合計	218,668
当中間期末残高	125,131
純資産合計	
前期末残高	36,378,935
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	266,821
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	218,668
当中間期変動額合計	87,408
当中間期末残高	36,291,527

（中間財務諸表作成の基本となる重要な事項）

項目	第16期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算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）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>なお、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。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）に基づく定額法によっております。</p>

3. 引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額(簡便法により自己都合退職による中間会計期間末要支給額の100%)を計上しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上していません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
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、中間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. リース取引の処理方法	平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。なお、仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(注記事項)

[中間貸借対照表関係]

第16期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	758,031千円

[中間損益計算書関係]

第16期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	32,580千円
無形固定資産	256,695千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
有価証券利息	56,681千円
受取配当金	54,128千円
受取利息	2,075千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	8,106千円
4. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	10,077千円
投資有価証券償還損	141,865千円
事故損失賠償金	21,827千円
固定資産除却損	
器具備品	3,396千円
建物付属設備	3,878千円
計	7,274千円

[中間株主資本等変動計算書関係]

第16期中間会計期間
（自 平成22年4月1日
至 平成22年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

	前事業年度末 株式数（千 株）	当中間会計期間増加 株式数（千株）	当中間会計期間減少 株式数（千株）	当中間会計期間末 株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成22年6月25日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成22年3月31日	平成22年6月25日

[リース取引関係]

第16期中間会計期間
（自 平成22年4月1日
至 平成22年9月30日）

1. リース取引に関する会計基準適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引
所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。その内容は以下のとおりであります。

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間会計期間末残高相当額

	取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	中間 会計期間末残高 相当額
有形固定資産 （器具備品）	千円 6,440	千円 5,115	千円 1,325

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1年内	839千円
1年超	547千円
合計	1,386千円

当中間会計期間の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料	780千円
減価償却費相当額	710千円
支払利息相当額	33千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

2. オペレーティング・リース取引
該当取引はありません。

[金融商品関係]

第16期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日（中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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、次表には含まれておりません（（注2）を参照下さい。）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金及び預金	6,670,258	6,670,258	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,045,040	4,066,150	21,110
その他有価証券	4,998,950	4,998,950	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	10,509,565	10,613,210	103,644
その他有価証券	6,832,689	6,832,689	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金及び預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

これらの時価について、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから当該帳簿価額によっており、譲渡性預金以外のものは中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）は、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっており、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資以外のものは、中間決算日の市場価格等によっております。

（注2）非上場株式（中間貸借対照表計上額132,500千円）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等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券
その他有価証券」には含めておりません。

[有価証券関係]

第16期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)

時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	14,554,605	14,679,360	124,754
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	14,554,605	14,679,360	124,754
時価が中間貸借 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	14,554,605	14,679,360	124,754	

2. その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	2,999,191	2,999,400	208
	国債・地方債等	2,999,191	2,999,400	208
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,439,136	3,194,435	755,298
	小計	5,438,328	6,193,835	755,506
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,499,587	1,499,550	37
	国債・地方債等	1,499,587	1,499,550	37
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,071,020	4,138,254	932,766
	小計	6,570,607	5,637,804	932,803
合計		12,008,935	11,831,639	177,296

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額132,500千円)については、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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

[デリバティブ取引関係]

第16期中間会計期間(自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)

当社は、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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第16期中間会計期間(自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)

当社は、資産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16期中間会計期間(自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)

1. サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の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

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間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

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
ニッセイ/パトナム・インカムオープン（注）	1,687,291
ニッセイ高金利国債ファンド（注）	1,293,748
日本生命保険相互会社	1,090,074

（注）当社は、投資信託委託会社として、約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ております。そのため、投資信託からの営業収益については当該投資信託を顧客として開示しております。

[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]

第16期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第16期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

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]

第16期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

該当事項はありません。

（追加情報）

当中間会計期間から「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

[1株当たり情報]

	第16期中間会計期間 （自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
1株当たり純資産額	334,644円50銭
1株当たり中間純利益	2,460円35銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

２．1株当たり中間純利益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益	266,821千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	266,821千円
期中平均株式数	108千株

[重要な後発事象]

第16期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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。

自己又はその取締役若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、若しくは取引の公正を害し、又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、若しくは取引の公正を害し、又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）。

通常の見積り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）又は子法人等（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又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等又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、運用財産の額若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又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、若しくは取引の公正を害し、又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。

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成22年9月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

銀行法に基づき監督官庁の免許を受けて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）に基づき監督官庁の認可を受けて信託業務を営んでいます。

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成22年9月末現在、10,000百万円

c. 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に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

(平成22年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
コスモ証券株式会社	13,500百万円	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。
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
西日本シティTT証券株式会社	1,575百万円	
日本アジア証券株式会社	4,000百万円	
丸三証券株式会社	10,000百万円	
みずほインベスターズ証券株式会社	80,288百万円	
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	

1 資本金の額は、平成23年4月1日現在のものです。

(3) 投資助言会社（参考情報）

a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

b. 資本金の額

平成22年9月末現在、450百万円

c. 事業の内容

「有価証券に係る投資顧問業の規制に関する法律」に基づき監督官庁の登録を受け、投資顧問業を営むとともに、内外の経済、産業動向や金融・投資手法等に関する調査研究の受託、コンサルティング業等を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社

信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

（2）販売会社

証券投資信託の募集の取扱いおよび販売を行い、一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を代行します。

（3）投資助言会社（参考情報）

委託会社に対し、ファンドの運用に関する投資助言を行います。

3【資本関係】

委託会社は、株式会社ニッセイ基礎研究所（投資助言会社）の株式を1,350株（持株比率15.0%）保有しています（参考情報）。

委託会社が所有する関係法人の株式または関係法人が所有する委託会社の株式のうち、持株比率が5%以上のものを記しています。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
 - ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せや、資料のご請求などを委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
 - コールセンター 0120-762-506
 - （午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）
 - ホームページ <http://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。

投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成23年2月24日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 吉益裕二 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 岩本 正 印

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TAA株100ポートフォリオの平成22年1月13日から平成23年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、TAA株100ポートフォリオの平成23年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

ニッセイ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

1. 上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 吉益裕二 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大竹 新 印

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」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第15期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成22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。

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

上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年11月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員公認会計士 吉益裕二 印指定有限責任社員
業務執行社員公認会計士 大竹 新 印

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」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第16期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成22年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）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。

独立監査人の監査報告書

平成23年2月24日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 吉益裕二 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 岩本 正 印

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TAA株50ポートフォリオの平成22年1月13日から平成23年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、TAA株50ポートフォリオの平成23年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

ニッセイ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

1. 上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年2月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 吉益裕二 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 岩本 正 印

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TAA株100ポートフォリオの平成21年1月14日から平成22年1月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、TAA株100ポートフォリオの平成22年1月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

ニッセイ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

1. 上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月16日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

指定社員
業務執行社員 公認会計士 吉益裕二 印

指定社員
業務執行社員 公認会計士 白田英生 印

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」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第14期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成21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。

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

上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

平成22年2月26日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員公認会計士 吉益裕二 印指定有限責任社員
業務執行社員公認会計士 岩本 正 印

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TAA株50ポートフォリオの平成21年1月14日から平成22年1月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、TAA株50ポートフォリオの平成22年1月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

ニッセイ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

1. 上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)