

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年10月7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 赤林 富二
【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】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【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1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年4月8日をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、半期報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

## 【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

### 第二部【ファンド情報】

#### 第1【ファンドの状況】

##### 1【ファンドの性格】

###### （3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社の概況（平成28年4月1日現在）

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  
（略）

<訂正後>

（略）

委託会社の概況（平成28年8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  
（略）

##### 3【投資リスク】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「3 投資リスク」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。

（略）

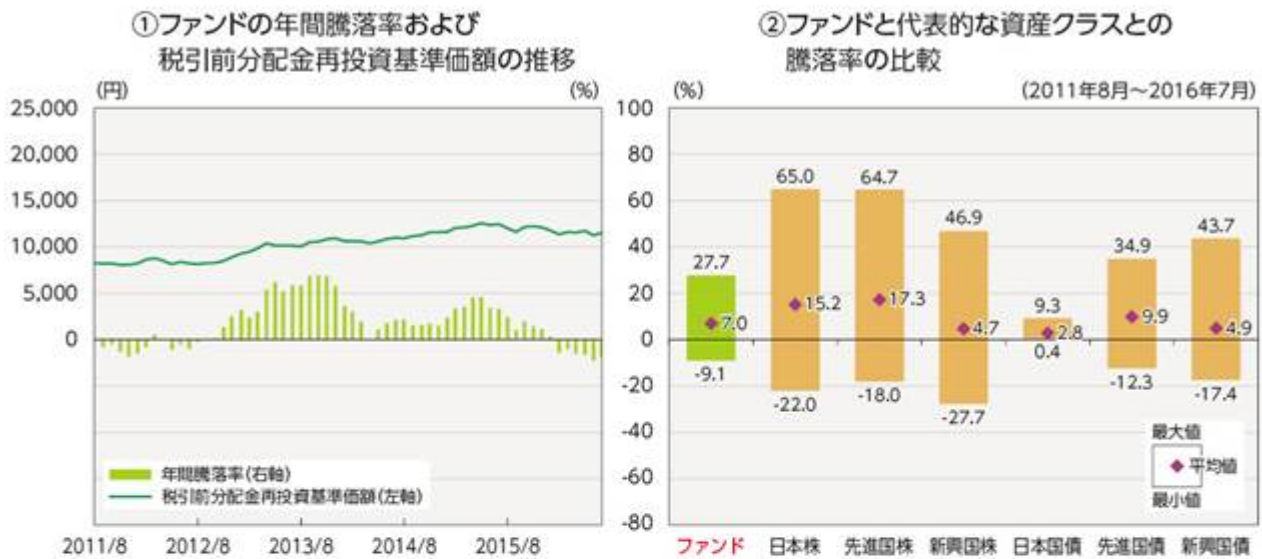
###### （2）投資リスク管理体制

（略）

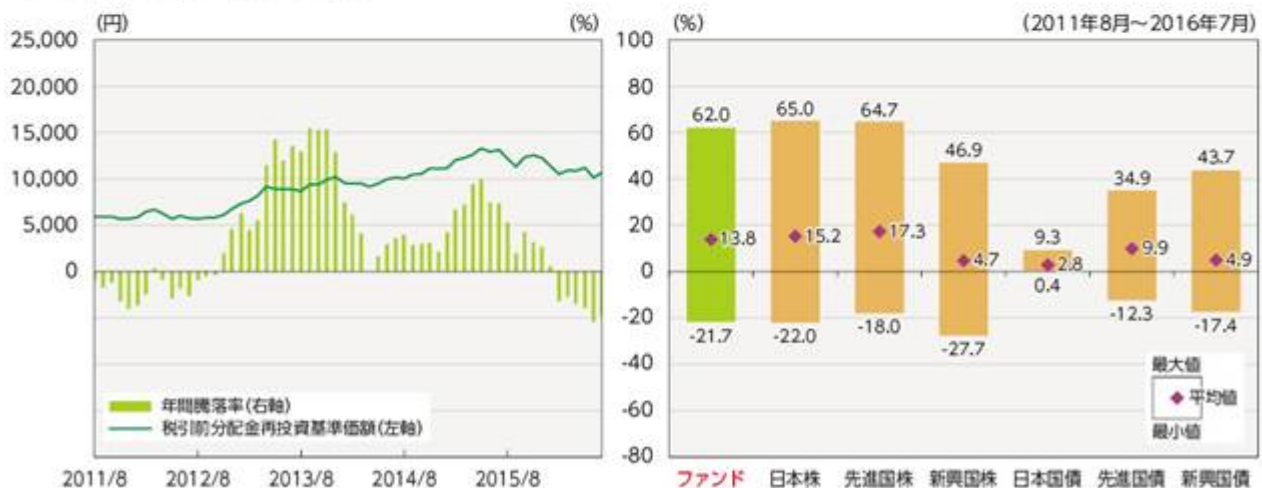
## (参考情報)

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

### TAA株50ポートフォリオ



### TAA株100ポートフォリオ



- ・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります。ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。
- ・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間におけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

## &lt;代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数&gt;

日本株・・・TOPIX(東証株価指数)(配当込み)  
先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)  
新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)  
日本国債・・・NOMURA-BPI 国債  
先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

**■** 前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

## 5【運用状況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。

## (1)【投資状況】

## 「TAA株50ポートフォリオ」

(平成28年7月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	57,084,480	56.35
内 日本	57,084,480	56.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	44,218,019	43.65
純資産総額	101,302,499	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	43,840,500	43.28
内 日本	43,840,500	43.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

その他資産として、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。

## 「TAA株100ポートフォリオ」

(平成28年7月29日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,088,430,140	70.76
内 日本	1,088,430,140	70.76
国債証券	227,225,570	14.77
内 日本	227,225,570	14.77
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	222,550,558	14.47
純資産総額	1,538,206,268	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	212,560,000	13.82
内 日本	212,560,000	13.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

その他資産として、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。

## (2) 【投資資産】

## 「TAA株50ポートフォリオ」

## 【投資有価証券の主要銘柄】

(平成28年7月29日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は 額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	第339回 利付国債(10年) 日本	国債証券	54,000,000	102.82 55,523,430	105.71 57,084,480	0.400000 2025/6/20	56.35%

(注) 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

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	国内	国債証券	56.35
	小計		56.35
合計(対純資産総額比)			56.35

(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】

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2809月	買建	3	40,309,620	39,855,000	39.34%
		ミニTPX 先物 2809月	買建	3	3,843,174	3,985,500	3.93%

(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す。

(注2) 先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

## 「TAA株100ポートフォリオ」

## 投資有価証券の主要銘柄

(平成28年7月29日現在)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は 額面金額	簿価単価 (円) 簿価金額 (円)	評価単価 (円) 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	第343回 利付国債 (10年) 日本	国債証券 -	221,000,000	103.51 228,769,210	102.81 227,225,570	0.100000 2026/6/20	14.77%

2	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,500	6,755.00 50,662,500	5,894.00 44,205,000	- -	2.87%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	5,200	4,689.00 24,382,800	4,881.00 25,381,200	- -	1.65%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	43,500	677.00 29,449,500	522.00 22,707,000	- -	1.48%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	5,400	2,948.50 15,921,900	3,145.00 16,983,000	- -	1.10%
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	2,600	5,528.00 14,372,800	5,703.00 14,827,800	- -	0.96%
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	4,300	4,156.00 17,870,800	3,308.00 14,224,400	- -	0.92%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	4,900	3,503.00 17,164,700	2,841.50 13,923,350	- -	0.91%
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	73,800	221.80 16,368,840	167.10 12,331,980	- -	0.80%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	2,900	4,083.00 11,840,700	4,025.00 11,672,500	- -	0.76%
11	ソニー 日本	株式 電気機器	3,500	2,675.00 9,362,500	3,282.00 11,487,000	- -	0.75%
12	キヤノン 日本	株式 電気機器	3,600	3,285.00 11,826,000	2,935.00 10,566,000	- -	0.69%
13	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	3,800	2,411.50 9,163,700	2,749.50 10,448,100	- -	0.68%
14	ファナック 日本	株式 電気機器	600	18,800.00 11,280,000	17,325.00 10,395,000	- -	0.68%
15	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	6,000	1,606.50 9,639,000	1,721.50 10,329,000	- -	0.67%
16	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	2,300	4,980.00 11,454,000	4,303.00 9,896,900	- -	0.64%
17	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	500	19,765.00 9,882,500	19,220.00 9,610,000	- -	0.62%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	1,000	10,355.00 10,355,000	9,485.00 9,485,000	- -	0.62%
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	2,000	5,625.00 11,250,000	4,588.00 9,176,000	- -	0.60%

20	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	2,100	4,178.00 8,773,800	4,040.00 8,484,000	- -	0.55%
21	花王 日本	株式 化学	1,500	5,643.00 8,464,500	5,553.00 8,329,500	- -	0.54%
22	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	2,000	4,359.00 8,718,000	4,015.00 8,030,000	- -	0.52%
23	信越化学工業 日本	株式 化学	1,100	6,104.00 6,714,400	7,064.00 7,770,400	- -	0.51%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	4,000	2,307.00 9,228,000	1,929.00 7,716,000	- -	0.50%
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	600	14,755.00 8,853,000	12,825.00 7,695,000	- -	0.50%
26	三菱商事 日本	株式 卸売業	4,300	1,861.50 8,004,450	1,778.50 7,647,550	- -	0.50%
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	6,000	1,119.50 6,717,000	1,217.50 7,305,000	- -	0.47%
28	キーエンス 日本	株式 電気機器	100	56,470.00 5,647,000	72,920.00 7,292,000	- -	0.47%
29	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	7,100	1,121.00 7,959,100	1,012.00 7,185,200	- -	0.47%
30	三井不動産 日本	株式 不動産業	3,000	2,817.50 8,452,500	2,253.50 6,760,500	- -	0.44%

（注）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

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	8.77
		輸送用機器	7.02
		情報・通信業	6.20
		銀行業	5.20
		化学	4.96
		医薬品	4.29
		食料品	3.85
		小売業	3.49
		機械	3.40
		陸運業	3.17
		卸売業	2.71
		建設業	2.57
		不動産業	1.73
保険業	1.60		



		サービス業	1.51
		電気・ガス業	1.45
		その他製品	1.26
		精密機器	1.07
		証券、商品先物取引業	0.78
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.67
		非鉄金属	0.66
		その他金融業	0.63
		ゴム製品	0.54
		繊維製品	0.51
		金属製品	0.50
		石油・石炭製品	0.32
		倉庫・運輸関連業	0.22
		パルプ・紙	0.22
		鉱業	0.20
		空運業	0.19
		海運業	0.15
		水産・農林業	0.11
	小計		70.76
公社債券	国内	国債証券	14.77
	小計		14.77
合 計（対純資産総額比）			85.53

（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

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2809月	買建	16	214,984,640	212,560,000	13.82%

（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す。

（注2）先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

## (3) 【運用実績】

## 「TAA株50ポートフォリオ」

## 【純資産の推移】

平成28年7月29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。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第11計算期間末 (平成19年1月10日)	288,240,124	288,240,124	1.0631	1.0631
第12計算期間末 (平成20年1月10日)	270,812,714	270,812,714	1.0017	1.0017
第13計算期間末 (平成21年1月13日)	226,545,639	226,545,639	0.8190	0.8190
第14計算期間末 (平成22年1月12日)	203,945,484	203,945,484	0.8869	0.8869
第15計算期間末 (平成23年1月11日)	199,085,407	199,085,407	0.8844	0.8844
第16計算期間末 (平成24年1月10日)	169,919,280	169,919,280	0.8106	0.8106
第17計算期間末 (平成25年1月10日)	183,782,286	183,782,286	0.9024	0.9024
第18計算期間末 (平成26年1月10日)	144,067,560	144,067,560	1.0941	1.0941
第19計算期間末 (平成27年1月13日)	136,197,824	136,197,824	1.1483	1.1483
第20計算期間末 (平成28年1月12日)	108,798,541	108,798,541	1.1546	1.1546
平成27年7月末日	126,739,181	-	1.2455	-
8月末日	121,853,915	-	1.2009	-
9月末日	116,077,679	-	1.1620	-
10月末日	121,504,843	-	1.2147	-
11月末日	121,819,685	-	1.2234	-
12月末日	113,866,439	-	1.2113	-
平成28年1月末日	110,031,082	-	1.1782	-
2月末日	106,600,722	-	1.1363	-
3月末日	108,165,991	-	1.1608	-
4月末日	104,085,047	-	1.1536	-
5月末日	103,700,293	-	1.1740	-
6月末日	99,209,518	-	1.1251	-

7月末日	101,302,499	-	1.1526	-
------	-------------	---	--------	---

## 「TAA株100ポートフォリオ」

## 純資産の推移

平成28年7月29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。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第11計算期間末 (平成19年1月10日)	1,822,621,945	1,822,621,945	1.0863	1.0863
第12計算期間末 (平成20年1月10日)	1,569,568,148	1,569,568,148	0.9432	0.9432
第13計算期間末 (平成21年1月13日)	1,022,789,894	1,022,789,894	0.6028	0.6028
第14計算期間末 (平成22年1月12日)	1,164,035,220	1,164,035,220	0.7136	0.7136
第15計算期間末 (平成23年1月11日)	1,129,607,634	1,129,607,634	0.7002	0.7002
第16計算期間末 (平成24年1月10日)	919,353,395	919,353,395	0.5716	0.5716
第17計算期間末 (平成25年1月10日)	1,119,571,704	1,119,571,704	0.6964	0.6964
第18計算期間末 (平成26年1月10日)	1,600,033,203	1,600,033,203	1.0185	1.0185
第19計算期間末 (平成27年1月13日)	1,601,091,387	1,601,091,387	1.0832	1.0832
第20計算期間末 (平成28年1月12日)	1,618,659,361	1,618,659,361	1.1127	1.1127
平成27年7月末日	1,924,472,937	-	1.3141	-
8月末日	1,764,928,830	-	1.2164	-
9月末日	1,649,501,624	-	1.1310	-
10月末日	1,789,451,931	-	1.2334	-
11月末日	1,824,808,006	-	1.2543	-
12月末日	1,783,981,687	-	1.2291	-
平成28年1月末日	1,667,447,759	-	1.1412	-
2月末日	1,537,068,863	-	1.0509	-
3月末日	1,589,856,557	-	1.0914	-

4月末日	1,579,482,305	-	1.0866	-
5月末日	1,627,833,071	-	1.1195	-
6月末日	1,472,618,942	-	1.0125	-
7月末日	1,538,206,268	-	1.0660	-

〈参考情報〉

2016年7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	11,526円
純資産総額	101百万円

## ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

第16期	2012年1月	0円
第17期	2013年1月	0円
第18期	2014年1月	0円
第19期	2015年1月	0円
第20期	2016年1月	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	43.3%
債券	56.4%

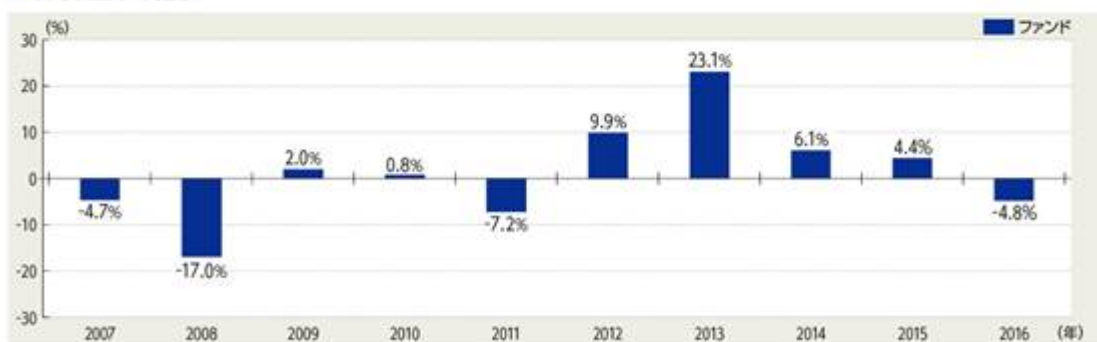
- ・ 比率は対純資産総額比です。
- ・ 各資産は先物を含みます。

## ● 組入銘柄

銘柄	種類	比率
第339回 利付国債(10年)	国債証券	56.4%

- ・ 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して計算しております。
- ・ 2016年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

2016年7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	10,660円
純資産総額	15億円

## ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

第16期	2012年1月	0円
第17期	2013年1月	0円
第18期	2014年1月	0円
第19期	2015年1月	0円
第20期	2016年1月	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	84.6%
債券	14.8%

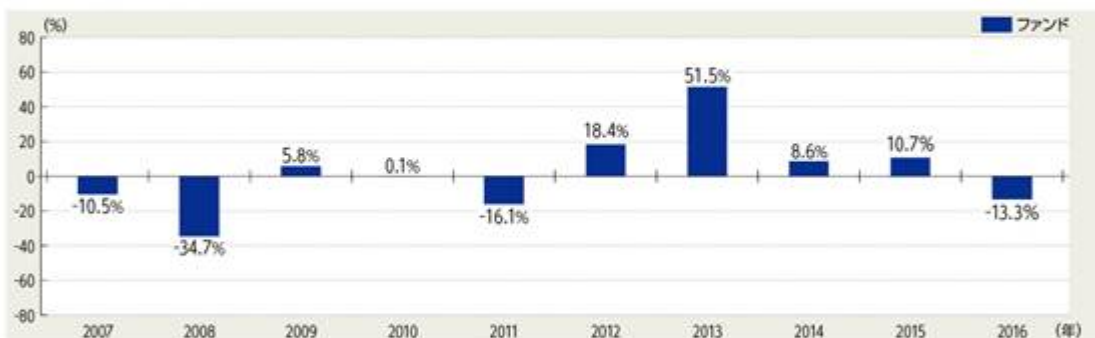
- ・ 比率は対純資産総額比です。
- ・ 各資産は先物を含みます。

## ● 組入上位銘柄

	銘柄	種類	比率
1	第343回 利付国債(10年)	国債証券	14.8%
2	トヨタ自動車	株式	2.9%
3	日本電信電話	株式	1.7%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	1.5%
5	KDDI	株式	1.1%
6	ソフトバンクグループ	株式	1.0%
7	三井住友フィナンシャルグループ	株式	0.9%
8	本田技研工業	株式	0.9%
9	みずほフィナンシャルグループ	株式	0.8%
10	日本たばこ産業	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）を再投資したものと計算しております。
- ・ 2016年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

#### 1【財務諸表】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」に以下の内容が追加されます。

##### 中間財務諸表

###### T A A株50ポートフォリオ

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年1月13日から平成28年7月12日まで）の中間財務諸表について、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。

###### T A A株100ポートフォリオ

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年1月13日から平成28年7月12日まで）の中間財務諸表について、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。



【TAA株50ポートフォリオ】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (平成28年1月12日現在)	第21期中間計算期間 (平成28年7月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	365,527
コール・ローン	51,572,681	40,168,003
国債証券	58,162,800	57,628,800
派生商品評価勘定	-	84,284
未収利息	7,467	11,840
前払金	3,896,000	2,653,350
前払費用	6,893	1,150
差入委託証拠金	1,782,000	1,881,000
流動資産合計	115,427,841	102,793,954
資産合計	115,427,841	102,793,954
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,824,268	1,601,078
未払受託者報酬	66,498	295
未払委託者報酬	731,978	3,246
その他未払費用	6,556	267
流動負債合計	6,629,300	1,604,886
負債合計	6,629,300	1,604,886
純資産の部		
元本等		
元本	94,231,764	88,318,717
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	14,566,777	12,870,351
純資産合計	108,798,541	101,189,068
負債純資産合計	115,427,841	102,793,954

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期中間計算期間 (自平成27年1月14日 至平成27年7月13日)	第21期中間計算期間 (自平成28年1月13日 至平成28年7月12日)
営業収益		
受取利息	250,944	110,946
有価証券売買等損益	1,062,850	2,511,800
派生商品取引等損益	10,980,862	2,647,522
営業収益合計	10,168,956	24,776
営業費用		
支払利息	-	8,596
受託者報酬	69,978	56,443
委託者報酬	770,147	621,248
その他費用	6,910	6,438
営業費用合計	847,035	692,725
営業利益又は営業損失( )	9,321,921	717,501
経常利益又は経常損失( )	9,321,921	717,501
中間純利益又は中間純損失( )	9,321,921	717,501
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	1,211,921	54,105
期首剰余金又は期首欠損金( )	17,589,183	14,566,777
剰余金増加額又は欠損金減少額	329,062	287,265
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	329,062	287,265
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,703,623	1,212,085
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,703,623	1,212,085
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	23,324,622	12,870,351

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>ファンドの中間計算期間</p> <p>当ファンドは、原則として毎年1月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、平成28年1月13日から平成28年7月12日までとなっております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第20期 (平成28年1月12日現在)	第21期中間計算期間 (平成28年7月12日現在)
1. 受益権総口数	94,231,764口	88,318,717口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1546円 (11,546円)	1.1457円 (11,457円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 (平成28年1月12日現在)	第21期中間計算期間 (平成28年7月12日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありせん。</p>	同左

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）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>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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>	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

#### 株式関連

種類	第20期 (平成28年1月12日 現在)				第21期中間計算期間 (平成28年7月12日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	55,988,000	-	50,166,000	5,822,000	44,150,850	-	42,636,000	1,514,850
合計	55,988,000	-	50,166,000	5,822,000	44,150,850	-	42,636,000	1,514,850

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数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。
3. 評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第20期 (平成28年1月12日現在)	第21期中間計算期間 (平成28年7月12日現在)
期首元本額	118,608,641円	94,231,764円
期中追加設定元本額	2,897,601円	1,928,115円
期中一部解約元本額	27,274,478円	7,841,162円

【TAA株100ポートフォリオ】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 （平成28年1月12日現在）	第21期中間計算期間 （平成28年7月12日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,040,271
コール・ローン	472,722,315	224,206,475
株式	1,151,611,520	1,055,497,130
国債証券	17,140,420	223,462,400
未収配当金	1,531,910	1,474,800
未収利息	834	4,116
前払金	34,848,000	15,498,000
前払費用	2,375	8,835
差入委託証拠金	4,979,500	1,819,500
流動資産合計	1,682,836,874	1,524,011,527
資産合計	1,682,836,874	1,524,011,527
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	51,985,280	9,297,720
未払解約金	283,655	-
未払受託者報酬	985,947	4,379
未払委託者報酬	10,845,907	48,175
その他未払費用	76,724	2,578
流動負債合計	64,177,513	9,352,852
負債合計	64,177,513	9,352,852
純資産の部		
元本等		
元本	1,454,658,467	1,454,729,409
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	164,000,894	59,929,266
純資産合計	1,618,659,361	1,514,658,675
負債純資産合計	1,682,836,874	1,524,011,527

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期中間計算期間 （自平成27年1月14日 至平成27年7月13日）	第21期中間計算期間 （自平成28年1月13日 至平成28年7月12日）
営業収益		
受取配当金	12,646,560	12,971,289
受取利息	140,463	176,034
有価証券売買等損益	203,535,231	91,322,252
派生商品取引等損益	85,482,100	15,215,480
その他収益	3,675	4,732
営業収益合計	301,808,029	93,385,677
営業費用		
支払利息	-	74,603
受託者報酬	968,013	839,885
委託者報酬	10,648,473	9,239,278
その他費用	75,089	76,246
営業費用合計	11,691,575	10,230,012
営業利益又は営業損失（ ）	290,116,454	103,615,689
経常利益又は経常損失（ ）	290,116,454	103,615,689
中間純利益又は中間純損失（ ）	290,116,454	103,615,689
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	19,213,727	747,027
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	122,912,951	164,000,894
剰余金増加額又は欠損金減少額	19,469,508	1,706,974
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	19,469,508	1,706,974
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,436,483	2,909,940
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,436,483	2,909,940
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	403,848,703	59,929,266

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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>
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>ファンドの中間計算期間</p> <p>当ファンドは、原則として毎年1月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、平成28年1月13日から平成28年7月12日までとなっております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第20期 (平成28年1月12日現在)	第21期中間計算期間 (平成28年7月12日現在)
1. 担保に供している資産 差入代用有価証券	株式 14,967,500円	株式 12,814,250円
2. 受益権総口数	1,454,658,467口	1,454,729,409口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1127円 (11,127円)	1.0412円 (10,412円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 （平成28年1月12日現在）	第21期中間計算期間 （平成28年7月12日現在）
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。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。 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。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

## 株式関連

種類	第20期 （平成28年1月12日 現在）				第21期中間計算期間 （平成28年7月12日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								

先物取引								
買 建	497,888,000	-	445,920,000	51,968,000	241,848,000	-	232,560,000	9,288,000
合計	497,888,000	-	445,920,000	51,968,000	241,848,000	-	232,560,000	9,288,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数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。

3. 評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## (その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第20期 (平成28年1月12日現在)	第21期中間計算期間 (平成28年7月12日現在)
期首元本額	1,478,178,436円	1,454,658,467円
期中追加設定元本額	150,713,251円	25,946,048円
期中一部解約元本額	174,233,220円	25,875,106円

## 2【ファンドの現況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「2 ファンドの現況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

## 【純資産額計算書】

## 「TAA株50ポートフォリオ」

(平成28年7月29日現在)

資産総額	102,137,473円
負債総額	834,974円
純資産総額( - )	101,302,499円
発行済数量	87,891,219口
1口当たり純資産額( / )	1.1526円

## 「TAA株100ポートフォリオ」

(平成28年7月29日現在)

資産総額	1,541,617,972円
負債総額	3,411,704円
純資産総額( - )	1,538,206,268円
発行済数量	1,442,950,507口
1口当たり純資産額( / )	1.0660円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「1 委託会社等の概況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

##### (1) 資本金の額

平成28年8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】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「2 事業の内容及び営業の概況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

「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28年8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	297	48,846
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	50	9,312
単位型公社債投資信託	4	166
合計	351	58,325

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】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」について以下の通り記載内容を訂正いたします。

#### 1.財務諸表の作成方法について

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条および「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）に基づいて作成しております。

#### 2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）の財務諸表について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 ) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		3,488,730		9,619,679
有価証券		5,209,385		7,602,477
前払費用		499,710		390,202
未収委託者報酬		2,778,650		3,426,935
未収運用受託報酬		1,519,030		1,649,081
未収投資助言報酬		216,814		208,775
繰延税金資産		417,418		480,820
その他		52,788		19,980
流動資産合計		14,182,529		23,397,951
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	88,529	1	80,574
車両	1	588	1	294
器具備品	1	90,111	1	114,079
有形固定資産合計		179,229		194,948
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		854,449		742,019
ソフトウェア仮勘定		17,421		88,417
その他		8,075		8,043
無形固定資産合計		879,946		838,479
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		35,677,217		35,476,609
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		175,262		-
差入保証金		284,888		285,819
繰延税金資産		-		170,956
その他		17		793
投資その他の資産合計		36,203,608		36,000,401

固定資産合計	37,262,784	37,033,830
資産合計	51,445,314	60,431,781

## 負債の部

## 流動負債

預り金	33,209	34,054
未払収益分配金	-	1,531
未払償還金	137,094	118,764
未払手数料	995,185	1,204,424
未払運用委託報酬	655,766	746,912
未払投資助言報酬	410,223	624,770
その他未払金	324,326	447,074
未払費用	97,490	110,997
未払法人税等	1,556,244	2,793,014
賞与引当金	787,638	864,968
その他	498,615	505,003
流動負債合計	5,495,794	7,451,515

## 固定負債

退職給付引当金	1,253,790	1,404,058
役員退職慰労引当金	25,400	26,800
繰延税金負債	13,483	-
固定負債合計	1,292,673	1,430,858

## 負債合計

負債合計	6,788,467	8,882,374
------	-----------	-----------

## 純資産の部

## 株主資本

資本金	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840	8,281,840

## 利益剰余金

利益準備金	139,807	139,807
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	23,998,814	31,277,901
利益剰余金合計	24,678,621	31,957,708



株主資本合計	42,960,461	50,239,548
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,696,385	1,309,858
評価・換算差額等合計	1,696,385	1,309,858
純資産合計	44,656,846	51,549,407
負債・純資産合計	51,445,314	60,431,781

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	15,670,934	23,796,732
運用受託報酬	7,825,480	10,253,108
投資助言報酬	872,448	887,392
業務受託料	47,100	-
営業収益計	24,415,963	34,937,233
営業費用		
支払手数料	6,834,391	10,915,789
広告宣伝費	28,551	59,346
調査費	4,581,959	5,358,400
支払運用委託報酬	1,811,448	2,043,036
支払投資助言報酬	1,722,179	2,189,966
委託調査費	80,518	90,937
調査費	967,812	1,034,460
委託計算費	148,832	189,969
営業雑経費	581,870	712,706
通信費	53,825	47,397
印刷費	170,610	207,694
協会費	21,379	22,682
その他営業雑経費	336,053	434,931
営業費用計	12,175,604	17,236,212
一般管理費		
役員報酬	1 62,272	1 69,958
給料・手当	2,905,979	2,984,319
賞与引当金繰入額	782,365	864,968
賞与	237,611	245,495
福利厚生費	532,618	581,952
退職給付費用	283,064	298,054
役員退職慰労引当金繰入額	7,250	7,450
役員退職慰労金	-	100
その他人件費	101,498	134,593
不動産賃借料	544,587	544,913

その他不動産経費		25,737		25,766
交際費		20,059		24,568
旅費交通費		100,791		114,715
固定資産減価償却費		440,227		401,740
租税公課		104,874		183,280
業務委託費		194,856		225,301
器具備品費		156,991		173,657
保険料		56,700		57,047
諸経費		135,187		146,268
一般管理費計		6,692,676		7,084,153
営業利益		5,547,682		10,616,866
営業外収益				
受取利息		274		747
有価証券利息		70,792		66,047
受取配当金	4	177,354	4	214,632
為替差益		31,164		-
その他営業外収益		6,906		32,180
営業外収益計		286,492		313,608
営業外費用				
為替差損		-		18,136
控除対象外消費税		19,444		10,447
その他営業外費用		6,244		499
営業外費用計		25,689		29,083
経常利益		5,808,485		10,901,391
特別利益				
投資有価証券売却益		366,068		100,523
投資有価証券償還益		15,343		17,323
事故受取保険金		-	5	5,609
特別利益計		381,411		123,456
特別損失				
投資有価証券売却損		-		726
固定資産除却損	3	8,042	3	6,419
事故損失賠償金	2	25,550		-
特別損失計		33,593		7,145
税引前当期純利益		6,156,304		11,017,702
法人税、住民税及び事業税		2,284,237		3,740,258
法人税等調整額		14,162		137,203

法人税等合計	2,298,400	3,603,055
当期純利益	3,857,904	7,414,647

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年4月 1 日 至 平成27年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,111
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,857,904	3,857,904	3,857,904
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,722,344	3,722,344	3,722,344
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,465

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証 券評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	3,857,904
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	460,336	460,336	460,336
当期変動額合計	460,336	460,336	4,182,680
当期末残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846

当事業年度(自 平成27年4月 1 日 至 平成28年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,46
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,56
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,64
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,279,087	7,279,087	7,279,08
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,54

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証 券評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	386,526	386,526	386,526
当期変動額合計	386,526	386,526	6,892,580
当期末残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407

## 注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31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 ...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>関係会社株式 移動平均法に基づく原価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、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期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の見込額に基づき計上しております。退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</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おりません。</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、内規に基づく期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	<p>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>
5．消費税等の会計処理	<p>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。</p>

## （貸借対照表関係）

1. 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。		
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	272,378千円	287,659千円
車両	6,425	6,720
器具備品	481,704	453,566
計	760,508	747,946

## （損益計算書関係）

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。		
取締役	180,000千円	
監査役	40,000千円	
2. 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. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。		
	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	4,128千円	6,419千円
その他	3,914	-
計	8,042	6,419
4. 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。		
	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
関係会社からの受取配当金	41,126千円	51,062千円
5. 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。		



（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 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

平成26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

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26年3月31日

効力発生日 平成26年6月26日

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27年6月25日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 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

平成27年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

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28年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

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28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

## （リース取引関係）

## 1．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

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期末残高相当額

該当するものではありません。

未経過リース料期末残高相当額等

該当するものではありません。

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
支払リース料	108	-
減価償却費相当額	100	-
支払利息相当額	1	-

## 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。

## （金融商品関係）

## 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資金運用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

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含まれておりません（注2）を参照下さい）。

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	3,488,730	3,488,730	-
有価証券			
満期保有目的の債券	5,209,385	5,215,010	5,624
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,414,879	22,498,520	83,640
その他有価証券	13,194,837	13,194,837	-

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	9,619,679	9,619,679	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,602,477	7,619,170	16,692
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,118,488	22,356,870	238,381
その他有価証券	13,290,620	13,290,620	-

（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・預金

預金はすべて短期であるため、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

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

非上場株式については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、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。

また、関係会社株式は、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、記載しておりません。

(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  
前事業年度(平成27年3月31日)

	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・預金	3,488,730	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	5,200,000	22,400,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	990,647	9,384,052	1,683,297	3,372
合計	9,679,377	31,784,052	1,683,297	3,372

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(平成28年3月31日)

	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・預金	9,619,679	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	7,600,000	22,100,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	995,984	11,352,737	851,097	1,017
合計	18,215,663	33,452,737	851,097	1,017

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

## （有価証券関係）

## 1．満期保有目的の債券

前事業年度（平成27年3月31日）

	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	26,620,113	26,710,130	90,016
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,620,113	26,710,130	90,016
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	1,004,151	1,003,400	751
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,004,151	1,003,400	751
合計		27,624,265	27,713,530	89,264

当事業年度（平成28年3月31日）

	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	29,720,965	29,976,040	255,074
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,720,965	29,976,040	255,074
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,720,965	29,976,040	255,074

## 2. その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	3,113,940	3,105,255	8,684
	国債・地方債等	3,113,940	3,105,255	8,684
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	7,809,441	5,421,939	2,387,501
	小計	10,923,381	8,527,195	2,396,186
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,900,070	1,902,293	2,223
	国債・地方債等	1,900,070	1,902,293	2,223
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	371,386	376,170	4,783
	小計	2,271,456	2,278,463	7,006
	合計	13,194,837	10,805,658	2,389,179

当事業年度（平成28年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,882,680	5,808,946	73,733
	国債・地方債等	5,882,680	5,808,946	73,733
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,418,711	4,470,989	1,947,721
	小計	12,301,391	10,279,936	2,021,454
貸借対照表計上額が取得原価または償却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1）	989,229	1,118,670	129,440
	小計	989,229	1,118,670	129,440
	合計	13,290,620	11,398,606	1,892,014

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式（当事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、前事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円）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、記載しておりません。



## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	1,249,329	366,068	-
合計	1,249,329	366,068	-

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	2,120,246	100,523	726
合計	2,120,246	100,523	726

（デリバティブ取引関係）

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26年4月1日 至平成27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。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	1,106,561 千円
退職給付費用	215,268
退職給付の支払額	68,039
退職給付引当金の期末残高	1,253,790

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	215,268 千円
----------------	------------

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,254千円であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

### 2．簡便法を適用した確定給付制度

#### （1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	1,253,790 千円
退職給付費用	220,314
退職給付の支払額	70,046
退職給付引当金の期末残高	1,404,058

#### （2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	220,314 千円
----------------	------------

### 3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、46,819千円であります。

（税効果会計関係）

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
（流動資産）		
繰延税金資産		
賞与引当金	260,708 千円	266,903 千円
未払事業税	120,645	179,194
その他	36,064	34,722
繰延税金資産合計	417,418	480,820
（固定資産）		
繰延税金資産		
退職給付引当金	405,952	430,318
税務上の繰延資産償却超過額	4,573	2,980
役員退職慰労引当金	8,214	8,207
投資有価証券評価損	97,089	36,550
投資有価証券評価差額	2,266	39,867
その他	1,703	2,207
小計	519,799	520,132
評価性引当額	90,623	8,246
繰延税金資産合計	429,176	511,885
繰延税金負債		
特別分配金否認	56,555	68,623
投資有価証券評価差額	386,104	272,306
繰延税金負債合計	442,659	340,929
繰延税金資産(は負債)の純額	13,483	170,956

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
-----------------------	-----------------------

法定実効税率 (調整)	35.64	%	法定実効税率 (調整)	33.06	%
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.09		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.07	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.26		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.15	
住民税均等割	0.09		住民税均等割	0.05	
税率変更に伴う影響	1.63		税率変更に伴う影響	0.71	
特定外国子会社留保金課税	0.44		特定外国子会社留保金課税	0.16	
所得拡大促進税制による特別控除額	0.37		所得拡大促進税制による特別控除額	0.35	
評価性引当額の増加	0.03		評価性引当額の増減	0.76	
その他	0.03		外国税額控除	0.08	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>37.33</u>		その他	<u>0.00</u>	
			税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>32.70</u>	

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.63%に、それぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が33,334千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,097千円、その他有価証券評価差額金が29,763千円、それぞれ増加しております。

#### （セグメント情報等）

##### 〔セグメント情報〕

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〕

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31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
日本生命保険相互会社	4,553,051

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31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
日本生命保険相互会社	4,199,085

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

## 1 関連当事者との取引

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

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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)
						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90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,829,599	未収運用受託報酬	767,0
								投資助言報酬の受取	676,352	未収投資助言報酬	158,7
								業務受託料の受取	47,100	-	

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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)
						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90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,566,369	未収運用受託報酬	600,6
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,2

(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 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

## （ 1株当たり情報 ）

	前事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
1株当たり純資産額	411,781円19銭	475,337円55銭
1株当たり当期純利益金額	35,573円77銭	68,370円53銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
期中平均株式数	108千株	108千株

## （ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月3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	小暮和敏	印
--------------------	-------	------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	牧野あや子	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27年4月1日から平成28年3月31日までの第21期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見



当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

- 
- 1．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
  - 2．X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月29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

公認会計士

松崎雅則

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているTAA株50ポートフォリオの平成28年1月13日から平成28年7月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、TAA株50ポートフォリオの平成28年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって

終了する中間計算期間(平成28年1月13日から平成28年7月12日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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(ニッセイアセットマネジメント株式会社)が別途保管しております。
  2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月29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

公認会計士

松崎雅則

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているTAA株100ポートフォリオの平成28年1月13日から平成28年7月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、TAA株100ポートフォリオの平成28年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもつ

て終了する中間計算期間(平成28年1月13日から平成28年7月12日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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(ニッセイアセットマネジメント株式会社)が別途保管しております。
  2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)