

# 朝日ライフ SRI 社会貢献ファンド

追加型投信／国内／株式

愛称

あすのはね



朝日ライフ アセットマネジメント

本書は金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。

1. この投資信託説明書（請求目論見書）により行う朝日ライフ S R I 社会貢献ファンドの受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を平成21年12月18日に関東財務局長に提出しており、平成21年12月19日にその効力が生じております。
2. 当ファンドは、主に国内の株式を投資対象としますので、組入れた株式の価格の下落や、組入れた株式の発行会社の経営・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の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。  
したがって、投資家のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
3. 当ファンドは、金融機関の預金または保険契約ではありませんので、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合は、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。
4. 信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。
5. 課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

## 目 次

ファンドの詳細情報 .....	1
第1 ファンドの沿革 .....	1
第2 手続等 .....	1
1 申込（販売）手続等 .....	1
2 換金（解約）手続等 .....	1
第3 管理及び運営 .....	2
1 資産管理等の概要 .....	2
2 受益者の権利等 .....	4
第4 ファンドの経理状況 .....	6
1 財務諸表 .....	9
2 ファンドの現況 .....	15
第5 設定及び解約の実績 .....	15

# ファンドの詳細情報

## 第1 ファンドの沿革

平成12年9月28日 信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

## 第2 手続等

### 1 申込（販売）手続等

取得申込みは、申込期間における販売会社の営業日にいつでも行うことができます。申込受付時間は、原則として午後3時<sup>注</sup>までとし、当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分として取り扱います。

注：販売会社によっては午後3時より前に受け付けを締め切ることがありますので、各販売会社にご確認ください。

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、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係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、当該取得申込金額の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により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います。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。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

当ファンドには、収益分配金の受取方法の別により、収益分配金を受け取る「分配金受取コース」と、税金を差し引いた後の収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。申込方法および申込単位は、販売会社が個別に定めるものとします。ただし、「自動けいぞく投資コース」における収益分配金の再投資については、1口単位となります。

お申込み価額は、取得申込受付日の基準価額です。取得申込みには、お申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等が別に加算されます。ただし、「自動けいぞく投資コース」における収益分配金の再投資については、当該計算期間終了日の基準価額となります。

お申込手数料は、取得申込受付日の基準価額に、3.15%（税抜3.0%<sup>注</sup>）を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額とします。

注：ここでの税とは、申込手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といい、税率は合計で5%です。）をいいます。

取得申込者は、取得申込金額をお申込みの販売会社に、当該販売会社が指定する期日までに支払うものとします。

「自動けいぞく投資コース」を選択する場合には、販売会社との間で「自動けいぞく投資約款<sup>注</sup>」にしたがって契約を締結します。

また、「自動けいぞく投資コース」を選択した取得申込者が、「定時定額購入サービス」を利用する場合には、販売会社との間で「定時定額購入サービス」等に関する契約<sup>注</sup>を締結するものとします。なお、「定時定額購入サービス」等の取扱いの有無については、お申込みの販売会社にご確認ください。

注：販売会社によっては、当該契約または規定について、同様の権利義務関係を定める名称の異なる契約または規定を使用することがあります。この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、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、取得申込みの受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことがあります。取得申込みの受け付けが中止された場合には、取得申込者は当該受付中止以前に行った当日の取得申込みを撤回できます。ただし、取得申込者がその取得申込みを撤回しない場合には、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取得申込みを受け付けたものとします。

### 2 換金（解約）手続等

#### <解約請求について>

解約請求は、販売会社の営業日にいつでも行うことができます。受付時間は、原則として午後3時<sup>注</sup>までとし、当該解約請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分として取り扱います。

注：販売会社によっては午後3時より前に受け付けを締め切ることがありますので、各販売会社にご確認ください。

委託会社は、解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約請求を行う受益者は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。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係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の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。ご解約単位は、販売会社が個別に定める単位とします。

ご解約価額は、解約請求受付日の基準価額から信託財産留保額（基準価額の0.3%）を差し引いた額です。1口当たりの解約価額に解約口数を乗じて得た額から、税金を差し引いた額がお受取金額となります。税金については、交付目論見書の「ファンド情報 1.ファンドの状況 6.手数料等及び税金(5)課税上の取扱い」をご覧ください。

ご解約代金は、解約請求受付日から起算して、原則として4営業日目から販売会社の営業所等において受益者に支払われます。

信託財産の資金管理を円滑に行うために大口の解約請求には制限を設ける場合があります。

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、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、解約請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた解約請求の受け付けを取り消すことがあります。解約請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、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解約請求を受け付けたものとして扱います。

### 第3 管理及び運営

#### 1 資産管理等の概要

##### (1) 資産の評価

###### 基準価額の計算

基準価額は、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控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権総口数で除して計算します。基準価額は、便宜上1万口当たりで表示されます。

当ファンドの信託財産に属する資産のうち、主要投資対象およびその評価方法は以下のとおりです。

株式	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しています。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）また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います。
----	---

###### 基準価額の計算頻度と公表

基準価額は、委託会社の毎営業日に計算されます。基準価額は、販売会社または委託会社へお問い合わせいただけるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に、朝日ライフ「社会貢献」として掲載されます。

委託会社：朝日ライフ アセットマネジメント株式会社 ホームページアドレス <a href="http://www.alamco.co.jp/">http://www.alamco.co.jp/</a> フリーダイヤル 0120-283104 （営業日の9：00～17：00）
--

##### (2) 保管

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等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。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

##### (3) 信託期間

信託期間は無期限ですが、「(5)その他 信託の終了(償還)」の規定により信託を終了させる場合があります。

#### (4) 計算期間

計算期間は、毎年9月21日から翌年9月20日までとします。ただし、各計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を各計算期間の終了日とし、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

##### 信託の終了(償還)

- 1) 委託会社は、信託期間中において、受益権の口数が当初設定受益権口数の10分の1または10億口を下回ることとなった場合、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、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、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、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。
- 2) 委託会社は、1)の事項について、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この信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る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) 2)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月を下らないものとします。
- 4) 委託会社は、3)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、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知られたる受益者に対して交付します。ただし、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) 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、3)の一定の期間が1ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行う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、信託契約を解約し信託を終了させます。
- 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、信託を終了させます。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き継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更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との間において存続します。
- 9) 受託会社はその任務を辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において委託会社が新たな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、信託を終了させます。

##### 償還金について

- 1) 償還金は、信託終了日(以下「償還日」といいます。)の後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込金額支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払います。
- 2) 償還金の支払いは、販売会社において原則として償還日(償還日に該当する日が休業日の場合には翌営業日)から起算して5営業日までに開始します。

##### 信託約款の変更

- 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、この信託約款を変更することができるものとし、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、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この信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る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) 2)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月を下らないものとします。
- 4) 委託会社は、3)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、1)の信託約款の変更をしません。
- 5) 委託会社は、信託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知られたる受益者に対して交付します。ただし、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この信託約款を変更しようとするときは、1) から 5) までの規定にしたがいます。

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 関係法人との契約の更改

- 1) 委託会社と受託会社との間の信託契約は無期限です。ただし、「信託の終了(償還)」に該当することとなった場合には解約されます。
- 2) 委託会社と販売会社との間の募集・販売等に関する契約は、期間満了の3ヵ月前までに委託会社および販売会社のいずれからも別段の意思表示がない限り、同一の条件で更新されます。

#### 運用報告書の作成および交付

委託会社は、毎期決算後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成し、販売会社を通じて知られたる受益者に交付します。

#### 信託事務処理の委託

受託会社は、再信託受託会社と再信託契約を締結することにより、当ファンドの信託財産すべてを再信託受託会社へ移管し、当ファンドにかかる信託事務処理の一部を委託することがあります。その場合には、信託財産の管理に係る事務のうち再信託に係る契約書類に基づく所定の事務を行います。

なお、再信託受託会社が受ける信託事務処理の一部の委託に係る報酬は、受託会社が受け取る信託報酬の中から当事者間で支払われるものとし、信託財産からの直接的な支弁は行いません。

## 2 受益者の権利等

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

#### 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込金額支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資され、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。

受益者が支払開始日から5年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属するものとし、

#### 償還金に対する請求権

受益者は、償還金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。償還金は、信託終了日（以下「償還日」といいます。）の後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（以下「支払開始日」といいます。）から償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込金額支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の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。償還金の支払いは、販売会社において原則として償還日（償還日に該当する日が休業日の場合には翌営業日）から起算して5営業日までに開始します。

受益者が支払開始日から10年間請求を行わない場合は、その権利を失い、その金銭は委託会社に帰属するものとし、

#### 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に解約請求をすることができます。詳細は、「第2 手続等 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

#### 反対者の買取請求権

信託約款の変更の内容が重大なものに該当する場合または信託契約の解約が行われる場合において、所定の期間内に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権について、受託会社に対して買取請求を行うことができます。

#### 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

#### 第4 ファンドの経理状況

当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号により改正されておりますが、第8期計算期間(平成19年9月21日から平成20年9月22日まで)および第9期計算期間(平成20年9月23日から平成21年9月24日まで)については内閣府令第50号附則第2条第1項第1号により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

また、投資信託財産計算規則は、平成19年8月9日付内閣府令第61号および平成21年6月24日付内閣府令第35号により改正されておりますが、第8期計算期間(平成19年9月21日から平成20年9月22日まで)については内閣府令第61号附則第3条により、内閣府令第61号改正前の投資信託財産計算規則および内閣府令第35号改正前の投資信託財産計算規則に基づき作成しており、第9期計算期間(平成20年9月23日から平成21年9月24日まで)については内閣府令第61号改正後の投資信託財産計算規則および内閣府令第35号附則第16条第2項により、内閣府令第35号改正前の投資信託財産計算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。

当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(平成19年9月21日から平成20年9月22日まで)および第9期計算期間(平成20年9月23日から平成21年9月24日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

監査報告書は、該当する財務諸表の直前に添付しております。

# 独立監査人の監査報告書


平成20年11月27日

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人


指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

杉山正治 

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

木村 修 

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている朝日ライフ SRI 社会貢献ファンドの平成19年9月21日から平成20年9月22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、朝日ライフ SRI 社会貢献ファンドの平成20年9月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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

以上

# 独立監査人の監査報告書

平成21年11月19日


朝日ライフ アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人


指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

杉山正治 

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

木村 修 

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている朝日ライフ SRI 社会貢献ファンドの平成20年9月23日から平成21年9月24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、朝日ライフ SRI 社会貢献ファンドの平成21年9月24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。

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

以 上

# 1 財務諸表

## 朝日ライフ SRI 社会貢献ファンド

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	第8期 (平成20年 9月22日現在)	第9期 (平成21年 9月24日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	441,127	900,101
コール・ローン	124,661,126	146,481,427
株式	3,140,288,500	2,967,155,000
未収入金	-	1,752,482
未収配当金	1,833,300	1,486,050
未収利息	1,263	240
流動資産合計	3,267,225,316	3,117,775,300
資産合計	3,267,225,316	3,117,775,300
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	21,398,032	-
未払解約金	904,920	375,995
未払受託者報酬	1,529,407	1,198,045
未払委託者報酬	32,499,805	25,458,406
その他未払費用	95,529	74,818
流動負債合計	56,427,693	27,107,264
負債合計	56,427,693	27,107,264
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,181,568,682	4,154,108,934
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	970,771,059	1,063,440,898
(分配準備積立金)	277,639,271	280,475,657
元本等合計	3,210,797,623	3,090,668,036
純資産合計	3,210,797,623	3,090,668,036
負債純資産合計	3,267,225,316	3,117,775,300

## ( 2 ) 損益及び剰余金計算書

( 単位 : 円 )

	第8期		第9期	
	自平成19年 9月21日 至平成20年 9月22日		自平成20年 9月23日 至平成21年 9月24日	
営業収益				
受取配当金	65,644,898		58,497,195	
受取利息	763,194		97,839	
有価証券売買等損益	1,145,981,442		112,518,524	
その他収益	6,197		3,086	
営業収益合計	1,079,567,153		53,920,404	
営業費用				
受託者報酬	3,291,318		2,191,701	
委託者報酬	69,940,437		46,573,633	
その他費用	205,592		136,866	
営業費用合計	73,437,347		48,902,200	
営業利益	1,153,004,500		102,822,604	
経常利益	1,153,004,500		102,822,604	
当期純利益	1,153,004,500		102,822,604	
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	39,634,847		14,836,443	
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	163,577,316		970,771,059	
剰余金増加額又は欠損金減少額	-		23,739,058	
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		23,739,058	
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,978,722		28,422,736	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,500,143		-	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,478,579		28,422,736	
分配金	-		-	
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	970,771,059		1,063,440,898	

## (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8期		第9期	
	自 平成19年9月21日 至 平成20年9月22日		自 平成20年9月23日 至 平成21年9月24日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算期間末日の証券取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は証券会社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。		株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算期間末日の金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合は予想配当金を計上しております。  有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。		受取配当金 同左  有価証券売買等損益 同左	

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第8期		第9期	
	(平成20年9月22日現在)		(平成21年9月24日現在)	
1. 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額				
期首元本額	4,542,643,714円		4,181,568,682円	
期中追加設定元本額	71,254,766円		73,456,799円	
期中一部解約元本額	432,329,798円		100,916,547円	
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,181,568,682口		4,154,108,934口	
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本を下回っており、その金額は970,771,059円であります。		貸借対照表上の純資産額が元本を下回っており、その金額は1,063,440,898円であります。	
4. 1単位(1万口)当たりの純資産額 (1口当たりの純資産額)	7,678円 (0.7678円)		7,440円 (0.7440円)	

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第 8 期	第 9 期
	自 平成19年 9月21日 至 平成20年 9月22日	自 平成20年 9月23日 至 平成21年 9月24日
1. 分配金の計算過程	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等損益( 0 円)、信託約款に規定する収益調整金( 124,534,086円)および分配準備積立金( 277,639,271円)より、分配可能額は402,173,357円( 1 万口当たり961円)でありましたが、今期は分配を行いませんでした。	計算期間末における費用控除後の配当等収益( 9,322,746円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益( 0 円)、信託約款に規定する収益調整金( 128,809,395円)および分配準備積立金( 271,152,911円)より、分配可能額は409,285,052円( 1 万口当たり985円)でありましたが、今期は分配を行いませんでした。

( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

第 8 期(自 平成19年 9月21日 至 平成20年 9月22日)

種類	貸借対照表計上額( 円 )	当計算期間の損益に含まれた評価差額( 円 )
株式	3,140,288,500	1,243,287,400
合計	3,140,288,500	1,243,287,400

第 9 期(自 平成20年 9月23日 至 平成21年 9月24日)

種類	貸借対照表計上額( 円 )	当計算期間の損益に含まれた評価差額( 円 )
株式	2,967,155,000	37,729,398
合計	2,967,155,000	37,729,398

( デリバティブ取引に関する注記 )

第 8 期 自 平成19年 9月21日 至 平成20年 9月22日	第 9 期 自 平成20年 9月23日 至 平成21年 9月24日
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。	同左

( 関連当事者との取引に関する注記 )

第 8 期 自 平成19年 9月21日 至 平成20年 9月22日	第 9 期 自 平成20年 9月23日 至 平成21年 9月24日
該当事項はありません。	同左

(4) 附属明細表  
有価証券明細表

(株式)

(平成21年9月24日現在)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	高砂熱学工業	100,000	810.00	81,000,000	
	伊藤園	60,000	1,637.00	98,220,000	
	キューピー	36,000	1,005.00	36,180,000	
	帝人	88,000	289.00	25,432,000	
	東レ	27,000	559.00	15,093,000	
	クラレ	89,000	1,000.00	89,000,000	
	積水化学工業	42,000	530.00	22,260,000	
	花王	11,000	2,400.00	26,400,000	
	富士フイルムホールディングス	7,000	2,835.00	19,845,000	
	小林製薬	10,500	4,100.00	43,050,000	
	日東電工	8,800	2,925.00	25,740,000	
	未来工業	39,100	887.00	34,681,700	
	武田薬品工業	5,200	3,950.00	20,540,000	
	ノリタケカンパニーリミテド	73,000	297.00	21,681,000	
	フジミインコーポレーテッド	8,700	1,601.00	13,928,700	
	東京製鐵	25,400	1,141.00	28,981,400	
	DOWAホールディングス	96,000	584.00	56,064,000	
	アサヒホールディングス	25,200	1,687.00	42,512,400	
	兼房	27,000	606.00	16,362,000	
	アマダ	47,000	646.00	30,362,000	
	和井田製作所	15,900	425.00	6,757,500	
	ナブテスコ	67,000	1,128.00	75,576,000	
	オイレス工業	22,000	1,582.00	34,804,000	
	サトー	62,500	1,228.00	76,750,000	
	小松製作所	28,700	1,782.00	51,143,400	
	ハーモニック・ドライブ・システムズ	138	240,100.00	33,133,800	
	ダイキン工業	8,400	3,500.00	29,400,000	
	放電精密加工研究所	55,700	618.00	34,422,600	
	前澤給装工業	17,100	1,450.00	24,795,000	
	マキタ	12,900	2,985.00	38,506,500	
	安川電機	101,000	688.00	69,488,000	
	マブチモーター	3,300	4,740.00	15,642,000	
	オムロン	16,500	1,700.00	28,050,000	
	日東工業	42,800	913.00	39,076,400	
	パナソニック	16,000	1,420.00	22,720,000	
	シャープ	28,000	1,058.00	29,624,000	
	日立マクセル	13,000	1,736.00	22,568,000	
	山武	16,800	2,040.00	34,272,000	
	堀場製作所	48,100	2,325.00	111,832,500	

キーエンス	3,300	19,700.00	65,010,000
ファナック	9,100	8,230.00	74,893,000
芝浦電子	42,800	1,150.00	49,220,000
浜松ホトニクス	38,300	2,150.00	82,345,000
京セラ	7,200	8,440.00	60,768,000
K O A	60,600	838.00	50,782,800
キヤノン	22,500	3,730.00	83,925,000
リコー	64,000	1,373.00	87,872,000
デンソー	28,300	2,725.00	77,117,500
トヨタ自動車	21,500	3,810.00	81,915,000
本田技研工業	27,700	2,875.00	79,637,500
シマノ	7,700	3,900.00	30,030,000
ジーエルサイエンス	17,100	1,075.00	18,382,500
オリンパス	21,900	2,535.00	55,516,500
宝印刷	55,600	791.00	43,979,600
アシックス	57,000	865.00	49,305,000
ヤマハ	4,300	1,095.00	4,708,500
幻冬舎	193	147,800.00	28,525,400
サンエー	6,600	3,800.00	25,080,000
アスクル	29,100	1,863.00	54,213,300
セブン&アイ・ホールディングス	10,700	2,180.00	23,326,000
京都きもの友禅	64,100	1,043.00	66,856,300
リコーリース	18,700	2,075.00	38,802,500
ルネサンス	16,200	373.00	6,042,600
メッセージ	271	176,000.00	47,696,000
シンワアートオークション	56	25,500.00	1,428,000
プレステージ・インターナショナル	203	159,200.00	32,317,600
セコム	10,200	4,520.00	46,104,000
ダイセキ	40,900	1,845.00	75,460,500
合計	(68銘柄)	2,087,861	2,967,155,000

(株式以外の有価証券)  
該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 2 ファンドの現況

### 純資産額計算書

平成21年10月30日

資産総額	2,952,217,737 円
負債総額	5,601,702 円
純資産総額 ( - )	2,946,616,035 円
発行済数量	4,142,396,740 口
1口当たり純資産額 ( / )	0.7113 円
( 1万口当たり純資産額 )	( 7,113 円 )

## 第5 設定及び解約の実績

	期 間	設定数量 ( 口 )	解約数量 ( 口 )
第 1 計算期間	自 平成 12 年 9 月 28 日 至 平成 13 年 9 月 20 日	16,103,596,243	5,922,336,836
第 2 計算期間	自 平成 13 年 9 月 21 日 至 平成 14 年 9 月 20 日	203,387,531	3,155,512,568
第 3 計算期間	自 平成 14 年 9 月 21 日 至 平成 15 年 9 月 22 日	52,565,169	2,087,308,601
第 4 計算期間	自 平成 15 年 9 月 23 日 至 平成 16 年 9 月 21 日	547,236,678	1,099,079,360
第 5 計算期間	自 平成 16 年 9 月 22 日 至 平成 17 年 9 月 20 日	887,282,439	1,096,892,692
第 6 計算期間	自 平成 17 年 9 月 21 日 至 平成 18 年 9 月 20 日	1,152,034,467	1,311,951,318
第 7 計算期間	自 平成 18 年 9 月 21 日 至 平成 19 年 9 月 20 日	629,820,608	360,198,046
第 8 計算期間	自 平成 19 年 9 月 21 日 至 平成 20 年 9 月 22 日	71,254,766	432,329,798
第 9 計算期間	自 平成 20 年 9 月 23 日 至 平成 21 年 9 月 24 日	73,456,799	100,916,547

(注1) 日本国外における設定および解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定数量には、当初設定口数を含みます。

