

# 朝日ライフ 日経平均ファンド

追加型投信／国内／株式／インデックス型

愛称



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 日経平均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22年2月12日に関東財務局長に提出しており、平成22年2月13日にその効力が生じております。
2. 当ファンドは、主に国内の株式を実質的な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、基準価額の下落により、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

第三部	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	25
第5	設定及び解約の実績	26

### 第三部 ファンドの詳細情報

#### 第1 ファンドの沿革

平成12年11月30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。委託会社は、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、2.1%（税抜2.0%<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その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受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付けを取り消すことがあります。取得申込みの受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「第二部 ファンド情報 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。

「朝日ライフ 日経平均マザーファンド」 受益証券	移動平均法に基づき、基準価額により評価しています。
-----------------------------	---------------------------

##### <参考> 「朝日ライフ 日経平均マザーファンド」の主要投資対象およびその評価方法

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「日経平均」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11月16日から翌年11月15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をまたは5億口を下回るようになった場合、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をしません。
- 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て)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、当ファンドに係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ます。

### 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ます。

#### 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11月16日から平成20年11月17日まで)および第9期計算期間(平成20年11月18日から平成21年11月16日まで)について内閣府令第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11月16日から平成20年11月17日まで)については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11月18日から平成21年11月16日まで)については内閣府令第35号附則第16条第2項により、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11月16日から平成20年11月17日まで)および第9期計算期間(平成20年11月18日から平成21年11月16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。

その監査報告書は、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21年1月22日


朝日ライフ アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人


指定有限責任社員  
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 日経平均ファンドの平成19年11月16日から平成20年11月17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、朝日ライフ 日経平均ファンドの平成20年11月17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22年1月20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 日経平均ファンドの平成20年11月18日から平成21年11月16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、朝日ライフ 日経平均ファンドの平成21年11月16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 日経平均ファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	第8期 (平成20年11月17日現在)	第9期 (平成21年11月16日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	138,427,919	286,047,635
親投資信託受益証券	2,480,615,204	2,556,282,792
派生商品評価勘定	5,086,313	272,664
未収利息	758	470
前払金	2,290,000	11,670,000
差入委託証拠金	21,600,000	9,240,000
流動資産合計	2,648,020,194	2,863,513,561
資産合計	2,648,020,194	2,863,513,561
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,235,345	10,605,240
未払解約金	482,765	4,728,598
未払受託者報酬	1,827,662	1,671,962
未払委託者報酬	7,310,573	6,687,771
その他未払費用	91,320	83,535
流動負債合計	16,947,665	23,777,106
負債合計	16,947,665	23,777,106
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,886,811,392	4,539,908,411
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,255,738,863	1,700,171,956
(分配準備積立金)	99,587,297	103,778,137
元本等合計	2,631,072,529	2,839,736,455
純資産合計	2,631,072,529	2,839,736,455
負債純資産合計	2,648,020,194	2,863,513,561

## ( 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11月16日 至平成20年11月17日	自平成20年11月18日 至平成21年11月16日
営業収益		
受取利息	821,351	190,970
有価証券売買等損益	1,720,498,472	437,667,588
派生商品取引等損益	129,324,997	75,879,020
営業収益合計	1,849,002,118	513,737,578
営業費用		
受託者報酬	3,757,168	3,078,257
委託者報酬	15,028,563	12,312,883
その他費用	187,734	153,790
営業費用合計	18,973,465	15,544,930
営業利益	1,867,975,583	498,192,648
経常利益	1,867,975,583	498,192,648
当期純利益	1,867,975,583	498,192,648
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	115,805,244	159,026,564
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	168,404,912	2,255,738,863
剰余金増加額又は欠損金減少額	48,980,260	1,001,722,961
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	48,980,260	1,001,722,961
剰余金減少額又は欠損金増加額	384,143,872	785,322,138
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	384,143,872	785,322,138
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	2,255,738,863	1,700,171,956

## (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 自 平成19年11月16日 至 平成20年11月17日	第9期 自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額により評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	有価証券先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、当該取引所の発表する計算期間末日に知りうる直近の清算値段により評価しております。	有価証券先物取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 同左

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 (平成20年11月17日現在)	第9期 (平成21年11月16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	4,098,671,114円	4,886,811,392円
期中追加設定元本額	1,612,965,553円	1,839,222,857円
期中一部解約元本額	824,825,275円	2,186,125,838円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,886,811,392口	4,539,908,411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2,255,738,863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1,700,171,956円であります。
4. 1単位(1万口)当たりの純資産額 (1口当たりの純資産額)	5,384円 (0.5384円)	6,255円 (0.6255円)

( 損益及び剰余金計算に関する注記 )

項目	第 8 期	第 9 期
	自 平成19年11月16日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16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 ( 40,060,682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 )、信託約款に規定する収益調整金 ( 183,627,111円 ) および分配準備積立金 ( 59,526,615円 ) より、分配可能額は 283,214,408円 ( 1 万口当たり579円 ) でしたが、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 ( 39,451,998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 )、信託約款に規定する収益調整金 ( 199,907,909円 ) および分配準備積立金 ( 64,326,139円 ) より、分配可能額は 303,686,046円 ( 1 万口当たり668円 ) でしたが、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11月16日 至 平成20年11月17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 )
親投資信託受益証券	2,480,615,204	1,715,461,588
合計	2,480,615,204	1,715,461,588

第 9 期(自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16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 )
親投資信託受益証券	2,556,282,792	351,467,680
合計	2,556,282,792	351,467,680

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の状況に関する事項

第 8 期 自平成19年11月16日 至平成20年11月17日	第 9 期 自平成20年11月18日 至平成21年11月16日
<p>1.取引の内容 当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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 株価指数先物取引につきましては、信託約款上の投資制限を遵守しております。</p> <p>3.取引の利用目的 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスク及び信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するためであります。</p> <p>4.取引に係るリスクの内容 株価指数先物取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しておりますが、ヘッジ目的で利用しているため、評価損益が財務諸表に与える影響は限定的です。また、流動性リスクを有しておりますが、市場にて取引を行っているため、当リスクは低いと考えております。</p> <p>5.取引に係るリスクの管理体制 デリバティブ取引の執行・管理については、社内運用委員会により承認されたファンドの運用計画書に従い執行を行い、管理部門がその執行・組入れ状況を管理しております。また、独立部門である考査部門が運用計画書の遵守状況ならびに執行・組入れに係る管理状況を審査し、必要に応じて速やかに関連部門へ注意・勧告を行っております。</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ついての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、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>	<p>1.取引の内容 同左</p> <p>2.取引に対する取組方針 同左</p> <p>3.取引の利用目的 同左</p> <p>4.取引に係るリスクの内容 同左</p> <p>5.取引に係るリスクの管理体制 同左</p> <p>6.取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>

取引の時価等に関する事項  
株式関連

種類	第 8 期 (平成20年11月17日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年超			
市場取引 株価指数先物取引 買建 日経225先物	154,969,032	-	152,820,000	2,149,032
合計	154,969,032	-	152,820,000	2,149,032

種類	第 9 期 (平成21年11月16日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年超			
市場取引 株価指数先物取引 買建 日経225先物	284,732,576	-	274,400,000	10,332,576
合計	284,732,576	-	274,400,000	10,332,576

(注) 時価評価にあたっては、当該取引所の発表する計算期間末日に知りうる清算値段により評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 8 期 自 平成19年11月16日 至 平成20年11月17日	第 9 期 自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16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)

該当事項はありません。

(株式以外の有価証券)

(平成21年11月16日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	朝日ライフ 日経平均マザーファンド	3,392,545,179	2,556,282,792	
合計		3,392,545,179	2,556,282,792	

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

当表に記載すべき内容は、「注記表(デリバティブ取引に関する注記) 取引の時価等に関する事項」にて開示しておりますので、記載を省略しております。

(参考情報)

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

なお、「朝日ライフ 日経平均マザーファンド」の状況は以下のとおりです。

「朝日ライフ 日経平均マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成20年11月17日現在)	(平成21年11月16日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,999,911	4,031,539
株式	2,735,159,700	2,896,936,320
新株予約権証券	-	168,000
未収配当金	24,987,720	17,255,880
未収利息	10	6
前払金	5,720,000	700,000
差入委託証拠金	-	660,000
流動資産合計	2,767,867,341	2,919,751,745
資産合計	2,767,867,341	2,919,751,745
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,705,715	1,265,256
流動負債合計	5,705,715	1,265,256
負債合計	5,705,715	1,265,256
純資産の部		
元本等		
元本	4,284,535,789	3,873,151,307
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	1,522,374,163	954,664,818
元本等合計	2,762,161,626	2,918,486,489
純資産合計	2,762,161,626	2,918,486,489
負債純資産合計	2,767,867,341	2,919,751,745

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成19年11月16日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16日
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。</p> <p>時価評価にあたっては、有価証券報告書における開示対象ファンドの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。</p> <p style="text-align: center;">-</p>	<p>株式</p> <p>同左</p> <p>新株予約権証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、有価証券報告書における開示対象ファンドの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から権利行使に必要な金額を控除した価額に新株付与率を乗じて評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>有価証券先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる当該取引所の発表する直近の清算手段により評価しております。</p>	<p>有価証券先物取引</p> <p>同左</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合は当該金額、未だ確定していない場合は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>	<p>受取配当金</p> <p>同左</p> <p>有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益</p> <p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成20年11月17日現在)	(平成21年11月16日現在)
1.有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額		
期首元本額	3,633,043,073円	4,284,535,789円
期中追加設定元本額	711,024,379円	280,553,516円
期中一部解約元本額	59,531,663円	691,937,998円
2.元本の内訳		
朝日ライフ 日経平均ファンド	3,847,704,676円	3,392,545,179円
朝日ライフ DC日経平均ファンド	436,831,113円	479,009,838円
ALAMCO 日経平均ファンド2009(適格機関投資家専用)	-	1,596,290円
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1,522,374,163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954,664,818円であります。
4.有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	4,284,535,789口	3,873,151,307口
5.1単位(1万口)当たりの純資産額(1口当たりの純資産額)	6,447円 (0.6447円)	7,535円 (0.7535円)
6.担保資産	株価指数先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として、以下の資産を差入れております。  株式 10,250,000円	株価指数先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として、以下の資産を差入れております。  株式 17,540,000円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(自 平成19年11月16日 至 平成20年11月17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	2,735,159,700	1,981,535,378
合計	2,735,159,700	1,981,535,378

(自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16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	2,896,936,320	352,541,309
新株予約権証券	168,000	168,000
合計	2,897,104,320	352,709,309

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の状況に関する事項

自 平成19年11月16日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16日
<p>1.取引の内容 当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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 株価指数先物取引につきましては、信託約款上の投資制限を遵守しております。</p> <p>3.取引の利用目的 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスク及び信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するためであります。</p> <p>4.取引に係るリスクの内容 株価指数先物取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しておりますが、ヘッジ目的で利用しているため、評価損益が財務諸表に与える影響は限定的です。また、流動性リスクを有しておりますが、市場にて取引を行っているため、当リスクは低いと考えております。</p> <p>5.取引に係るリスクの管理体制 デリバティブ取引の執行・管理については、社内運用委員会により承認されたファンドの運用計画書に従い執行を行い、管理部門がその執行・組入れ状況を管理しております。また、独立部門である考査部門が運用計画書の遵守状況ならびに執行・組入れに係る管理状況を審査し、必要に応じて速やかに関連部門へ注意・勧告を行っております。</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ついての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、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>	<p>1.取引の内容 同左</p> <p>2.取引に対する取組方針 同左</p> <p>3.取引の利用目的 同左</p> <p>4.取引に係るリスクの内容 同左</p> <p>5.取引に係るリスクの管理体制 同左</p> <p>6.取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>

取引の時価等に関する事項

株式関連

種類	(平成20年11月17日現在)				
	契約額等(円)			時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超			
市場取引 株価指数先物取引 買建 日経225先物	22,685,715	-	16,980,000	5,705,715	
合計	22,685,715	-	16,980,000	5,705,715	

種類	(平成21年11月16日現在)				
	契約額等(円)			時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超			
市場取引 株価指数先物取引 買建 日経225先物	20,865,256	-	19,600,000	1,265,256	
合計	20,865,256	-	19,600,000	1,265,256	

(注) 時価評価にあたっては、有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる当該取引所の発表する清算値段により評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成19年11月16日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16日
該当事項はありません。	同左

(3) 附属明細表  
 有価証券明細表

(株式)

(平成21年11月16日現在)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	日本水産	12,000	260.00	3,120,000	
	マルハニチロホールディングス	12,000	132.00	1,584,000	
	国際石油開発帝石	12	760,000.00	9,120,000	
	コムシスホールディングス	12,000	878.00	10,536,000	
	大成建設	12,000	167.00	2,004,000	
	大林組	12,000	332.00	3,984,000	
	清水建設	12,000	330.00	3,960,000	
	鹿島建設	12,000	203.00	2,436,000	
	大和ハウス工業	12,000	931.00	11,172,000	
	積水ハウス	12,000	773.00	9,276,000	
	日揮	12,000	1,733.00	20,796,000	
	千代田化工建設	12,000	702.00	8,424,000	
	日清製粉グループ本社	12,000	1,193.00	14,316,000	
	明治ホールディングス	1,200	3,440.00	4,128,000	
	日本ハム	12,000	1,044.00	12,528,000	
	サッポロホールディングス	12,000	455.00	5,460,000	
	アサヒビール	12,000	1,569.00	18,828,000	
	キリンホールディングス	12,000	1,424.00	17,088,000	
	宝ホールディングス	12,000	522.00	6,264,000	
	キッコーマン	12,000	1,026.00	12,312,000	
	味の素	12,000	812.00	9,744,000	
	ニチレイ	12,000	326.00	3,912,000	
	日本たばこ産業	60	250,000.00	15,000,000	
	東洋紡績	12,000	138.00	1,656,000	
	ユニチカ	12,000	66.00	792,000	
	日清紡ホールディングス	12,000	774.00	9,288,000	
	帝人	12,000	250.00	3,000,000	
	東レ	12,000	470.00	5,640,000	
	三菱レイヨン	12,000	271.00	3,252,000	
	王子製紙	12,000	371.00	4,452,000	
	三菱製紙	12,000	111.00	1,332,000	
	北越紀州製紙	12,000	442.00	5,304,000	
	日本製紙グループ本社	1,200	2,230.00	2,676,000	
	クラレ	12,000	1,048.00	12,576,000	
	旭化成	12,000	439.00	5,268,000	
	昭和電工	12,000	162.00	1,944,000	
	住友化学	12,000	359.00	4,308,000	
	日産化学工業	12,000	1,178.00	14,136,000	
	日本曹達	12,000	325.00	3,900,000	

東ソー	12,000	228.00	2,736,000
電気化学工業	12,000	383.00	4,596,000
信越化学工業	12,000	4,740.00	56,880,000
三井化学	12,000	243.00	2,916,000
三菱ケミカルホールディングス	6,000	313.00	1,878,000
宇部興産	12,000	224.00	2,688,000
日本化薬	12,000	748.00	8,976,000
花王	12,000	2,040.00	24,480,000
富士フイルムホールディングス	12,000	2,545.00	30,540,000
資生堂	12,000	1,653.00	19,836,000
協和発酵キリン	12,000	944.00	11,328,000
武田薬品工業	12,000	3,530.00	42,360,000
アステラス製薬	12,000	3,250.00	39,000,000
大日本住友製薬	12,000	869.00	10,428,000
塩野義製薬	12,000	1,836.00	22,032,000
中外製薬	12,000	1,670.00	20,040,000
エーザイ	12,000	3,210.00	38,520,000
第一三共	12,000	1,693.00	20,316,000
新日本石油	12,000	392.00	4,704,000
昭和シェル石油	12,000	771.00	9,252,000
新日鉱ホールディングス	12,000	355.00	4,260,000
横浜ゴム	12,000	356.00	4,272,000
ブリヂストン	12,000	1,431.00	17,172,000
日東紡績	12,000	157.00	1,884,000
旭硝子	12,000	809.00	9,708,000
日本板硝子	12,000	250.00	3,000,000
住友大阪セメント	12,000	155.00	1,860,000
太平洋セメント	12,000	119.00	1,428,000
東海カーボン	12,000	401.00	4,812,000
TOTO	12,000	498.00	5,976,000
日本碍子	12,000	1,986.00	23,832,000
新日本製鐵	12,000	334.00	4,008,000
住友金属工業	12,000	228.00	2,736,000
神戸製鋼所	12,000	160.00	1,920,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	1,200	3,060.00	3,672,000
大平洋金属	12,000	608.00	7,296,000
日本軽金属	12,000	83.00	996,000
三井金属鉱業	12,000	224.00	2,688,000
東邦亜鉛	12,000	425.00	5,100,000
三菱マテリアル	12,000	219.00	2,628,000
住友金属鉱山	12,000	1,480.00	17,760,000
DOWAホールディングス	12,000	492.00	5,904,000
古河機械金属	12,000	114.00	1,368,000
古河電気工業	12,000	360.00	4,320,000
住友電気工業	12,000	1,081.00	12,972,000
フジクラ	12,000	419.00	5,028,000

SUMCO	1,200	1,629.00	1,954,800
東洋製罐	12,000	1,405.00	16,860,000
日本製鋼所	12,000	1,136.00	13,632,000
オークマ	12,000	408.00	4,896,000
小松製作所	12,000	1,799.00	21,588,000
住友重機械工業	12,000	407.00	4,884,000
日立建機	12,000	2,205.00	26,460,000
クボタ	12,000	786.00	9,432,000
荏原製作所	12,000	356.00	4,272,000
ダイキン工業	12,000	3,320.00	39,840,000
日本精工	12,000	597.00	7,164,000
NTN	12,000	346.00	4,152,000
ジェイテクト	12,000	971.00	11,652,000
日立造船	12,000	130.00	1,560,000
三菱重工業	12,000	302.00	3,624,000
IHI	12,000	166.00	1,992,000
コニカミノルタホールディングス	12,000	883.00	10,596,000
ミネベア	12,000	426.00	5,112,000
日立製作所	12,000	269.00	3,228,000
東芝	12,000	479.00	5,748,000
三菱電機	12,000	616.00	7,392,000
富士電機ホールディングス	12,000	153.00	1,836,000
明電舎	12,000	407.00	4,884,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	12,000	684.00	8,208,000
日本電気	12,000	244.00	2,928,000
富士通	12,000	535.00	6,420,000
沖電気工業	12,000	75.00	900,000
パナソニック	12,000	1,205.00	14,460,000
シャープ	12,000	1,009.00	12,108,000
ソニー	12,000	2,530.00	30,360,000
TDK	12,000	5,010.00	60,120,000
三洋電機	12,000	169.00	2,028,000
ミツミ電機	12,000	1,487.00	17,844,000
アルプス電気	12,000	489.00	5,868,000
パイオニア	12,000	253.00	3,036,000
クラリオン	12,000	85.00	1,020,000
横河電機	12,000	677.00	8,124,000
アドバンテスト	24,000	2,005.00	48,120,000
カシオ計算機	12,000	670.00	8,040,000
ファナック	12,000	7,650.00	91,800,000
京セラ	12,000	7,290.00	87,480,000
太陽誘電	12,000	984.00	11,808,000
パナソニック電工	12,000	1,003.00	12,036,000
キヤノン	18,000	3,370.00	60,660,000
リコー	12,000	1,202.00	14,424,000
東京エレクトロン	12,000	4,880.00	58,560,000

デンソー	12,000	2,505.00	30,060,000
三井造船	12,000	236.00	2,832,000
川崎重工業	12,000	207.00	2,484,000
日産自動車	12,000	654.00	7,848,000
いすゞ自動車	12,000	167.00	2,004,000
トヨタ自動車	12,000	3,550.00	42,600,000
日野自動車	12,000	306.00	3,672,000
三菱自動車工業	12,000	129.00	1,548,000
マツダ	12,000	201.00	2,412,000
本田技研工業	24,000	2,880.00	69,120,000
スズキ	12,000	2,175.00	26,100,000
富士重工業	12,000	346.00	4,152,000
テルモ	12,000	4,990.00	59,880,000
ニコン	12,000	1,679.00	20,148,000
オリンパス	12,000	2,950.00	35,400,000
シチズンホールディングス	12,000	517.00	6,204,000
凸版印刷	12,000	738.00	8,856,000
大日本印刷	12,000	1,095.00	13,140,000
ヤマハ	12,000	936.00	11,232,000
東京電力	1,200	2,195.00	2,634,000
中部電力	1,200	2,065.00	2,478,000
関西電力	1,200	2,015.00	2,418,000
東京瓦斯	12,000	340.00	4,080,000
大阪瓦斯	12,000	295.00	3,540,000
東武鉄道	12,000	473.00	5,676,000
東京急行電鉄	12,000	388.00	4,656,000
小田急電鉄	12,000	696.00	8,352,000
京王電鉄	12,000	535.00	6,420,000
京成電鉄	12,000	503.00	6,036,000
東日本旅客鉄道	1,200	5,710.00	6,852,000
西日本旅客鉄道	12	302,000.00	3,624,000
日本通運	12,000	376.00	4,512,000
ヤマトホールディングス	12,000	1,237.00	14,844,000
日本郵船	12,000	305.00	3,660,000
商船三井	12,000	530.00	6,360,000
川崎汽船	12,000	289.00	3,468,000
全日本空輸	12,000	234.00	2,808,000
日本航空	12,000	106.00	1,272,000
三菱倉庫	12,000	938.00	11,256,000
ヤフー	48	26,440.00	1,269,120
トレンドマイクロ	12,000	3,240.00	38,880,000
スカパーJ S A Tホールディングス	12	39,800.00	477,600
日本電信電話	1,200	3,740.00	4,488,000
K D D I	120	460,000.00	55,200,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	12	130,400.00	1,564,800
東宝	1,200	1,321.00	1,585,200

エヌ・ティ・ティ・データ	120	265,500.00	31,860,000	
C S Kホールディングス	12,000	366.00	4,392,000	
コナミ	12,000	1,517.00	18,204,000	
ソフトバンク	36,000	2,195.00	79,020,000	
双日	1,200	164.00	196,800	
伊藤忠商事	12,000	615.00	7,380,000	
丸紅	12,000	470.00	5,640,000	
豊田通商	12,000	1,229.00	14,748,000	
三井物産	12,000	1,165.00	13,980,000	
住友商事	12,000	855.00	10,260,000	
三菱商事	12,000	1,969.00	23,628,000	
J・フロント リテイリング	12,000	394.00	4,728,000	
三越伊勢丹ホールディングス	12,000	809.00	9,708,000	
セブン&アイ・ホールディングス	12,000	1,954.00	23,448,000	
高島屋	12,000	581.00	6,972,000	
丸井グループ	12,000	539.00	6,468,000	
イオン	12,000	752.00	9,024,000	
ユニー	12,000	647.00	7,764,000	
ファーストリテイリング	12,000	17,540.00	210,480,000	*
新生銀行	12,000	114.00	1,368,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,000	480.00	5,760,000	
りそなホールディングス	1,200	990.00	1,188,000	
中央三井トラスト・ホールディングス	12,000	316.00	3,792,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,200	3,050.00	3,660,000	
千葉銀行	12,000	565.00	6,780,000	
横浜銀行	12,000	435.00	5,220,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,000	334.00	4,008,000	
静岡銀行	12,000	892.00	10,704,000	
住友信託銀行	12,000	479.00	5,748,000	
みずほ信託銀行	12,000	82.00	984,000	
みずほフィナンシャルグループ	12,000	172.00	2,064,000	
大和証券グループ本社	12,000	450.00	5,400,000	
野村ホールディングス	12,000	625.00	7,500,000	
みずほ証券	12,000	314.00	3,768,000	
松井証券	12,000	604.00	7,248,000	
三井住友海上グループホールディングス	3,600	2,245.00	8,082,000	
損害保険ジャパン	12,000	572.00	6,864,000	
東京海上ホールディングス	6,000	2,420.00	14,520,000	
T & Dホールディングス	1,200	2,185.00	2,622,000	
クレディセゾン	12,000	1,062.00	12,744,000	
三井不動産	12,000	1,424.00	17,088,000	
三菱地所	12,000	1,342.00	16,104,000	
平和不動産	12,000	284.00	3,408,000	
東急不動産	12,000	330.00	3,960,000	
住友不動産	12,000	1,563.00	18,756,000	
電通	12,000	1,907.00	22,884,000	

	東京ドーム	12,000	278.00	3,336,000	
	セコム	12,000	4,220.00	50,640,000	
合計	(225銘柄)	2,486,796		2,896,936,320	

注 \*差入証拠金代用有価証券として以下の有価証券を差入れております。

銘柄	株数
ファーストリテイリング	1,000

(株式以外の有価証券)

(平成21年11月16日現在)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	DOWAホールディングス新株予約権	7,000	24	168,000	
合計	(1銘柄)	7,000		168,000	

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  
当表に記載すべき内容は、「注記表(デリバティブ取引に関する注記) 取引の時価等に関する事項」にて開示しておりますので、記載を省略しております。

## 2 ファンドの現況

### 純資産額計算書

平成21年12月30日

資産総額	3,025,972,907 円
負債総額	32,374,831 円
純資産総額 ( - )	2,993,598,076 円
発行済数量	4,442,295,317 口
1口当たり純資産額 ( / )	0.6739 円
(1万口当たり純資産額)	(6,739 円)

<参考> マザーファンドの現況

平成21年12月30日

資産総額	3,147,087,259 円
負債総額	1,070,000 円
純資産総額 ( - )	3,146,017,259 円
発行済数量	3,871,899,272 口
1口当たり純資産額 ( / )	0.8125 円
(1万口当たり純資産額)	(8,125 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11月30日 至 平成13年11月15日	2,073,634,799	7,742,290
第 2 計算期間	自 平成13年11月16日 至 平成14年11月15日	722,659	9,502,593
第 3 計算期間	自 平成14年11月16日 至 平成15年11月17日	351,836,286	3,496,635
第 4 計算期間	自 平成15年11月18日 至 平成16年11月15日	487,745	2,882,069
第 5 計算期間	自 平成16年11月16日 至 平成17年11月15日	1,058,147,370	579,516,092
第 6 計算期間	自 平成17年11月16日 至 平成18年11月15日	780,690,909	1,200,940,106
第 7 計算期間	自 平成18年11月16日 至 平成19年11月15日	2,343,031,355	705,800,224
第 8 計算期間	自 平成19年11月16日 至 平成20年11月17日	1,612,965,553	824,825,275
第 9 計算期間	自 平成20年11月18日 至 平成21年11月16日	1,839,222,857	2,186,125,838

(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。



朝日ライフ アセットマネジメント