

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	平成24年6月20日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 宇治原 潔
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4603
<b>【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】</b>	DCニッセイバランスアクティブ
<b>【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 上限5,000億円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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23年12月20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、有価証券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】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <訂正前>

（略）

ファンドの特色

（略）

国内株式マザーファンドおよび国内債券マザーファンドの運用をニッセイアセットマネジメントが、海外株式マザーファンドおよび海外債券マザーファンドの運用をザ・パトナム・アドバイザリー・カンパニー・エルエルシーが行います。

（略）

パトナム・インベストメンツの概要

（平成23年3月末現在）

パトナム・インベストメンツは1937年創立の米国で最も古い資産運用会社の1つです。運用資産は約1,272億ドル(約10兆円)、投信残高は約691億ドル(約5兆円)の規模を誇ります。設定済み投信は70本以上、投資家数は約500万人にのびります。ファンドマネージャー、アナリストなどの運用担当専門職を136名有しています。

（略）

###### <訂正後>

（略）

ファンドの特色

（略）

国内株式マザーファンドおよび国内債券マザーファンドの運用をニッセイアセットマネジメントが、海外株式マザーファンドおよび海外債券マザーファンドの運用をザ・パトナム・アドバイザリー・カンパニー・エルエルシーが行います。

（略）

パトナム・インベストメンツの概要

（平成23年9月末現在）

パトナム・インベストメンツは1937年創立の米国で最も古い資産運用会社の1つです。運用資産は約1,139億ドル(約8兆円)、投信残高は約577億ドル(約4兆円)の規模を誇ります。設定済み投信は70本以上、投資家数は約500万人にのびります。ファンドマネージャー、アナリストなどの運用担当専門職を137名有しています。

（略）

## (3) 【ファンドの仕組み】

## &lt;訂正前&gt;

(略)

委託会社の概況（平成23年10月末現在）

(略)

4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 皆川 卓士

(略)

## &lt;訂正後&gt;

(略)

委託会社の概況（平成24年4月末現在）

(略)

4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 宇治原 潔

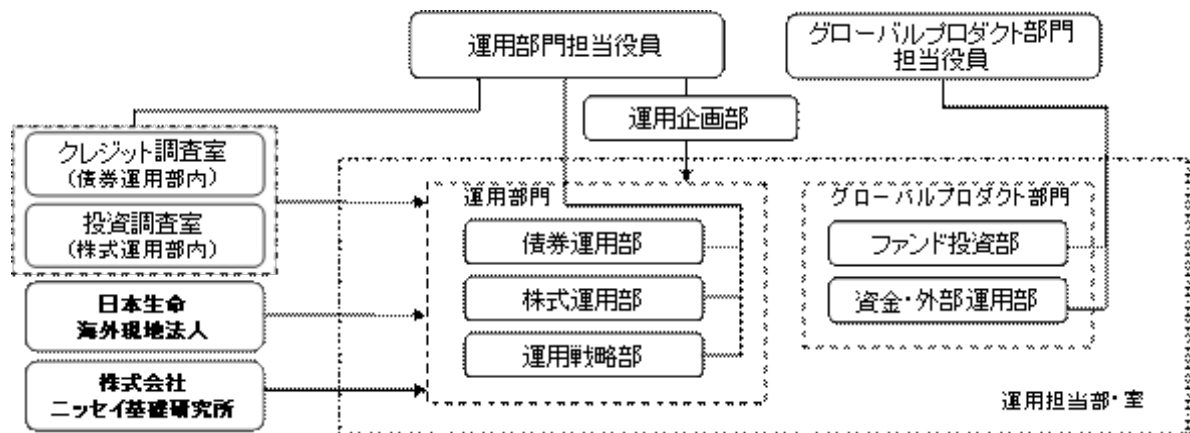
(略)

## 2 【投資方針】

## (3) 【運用体制】

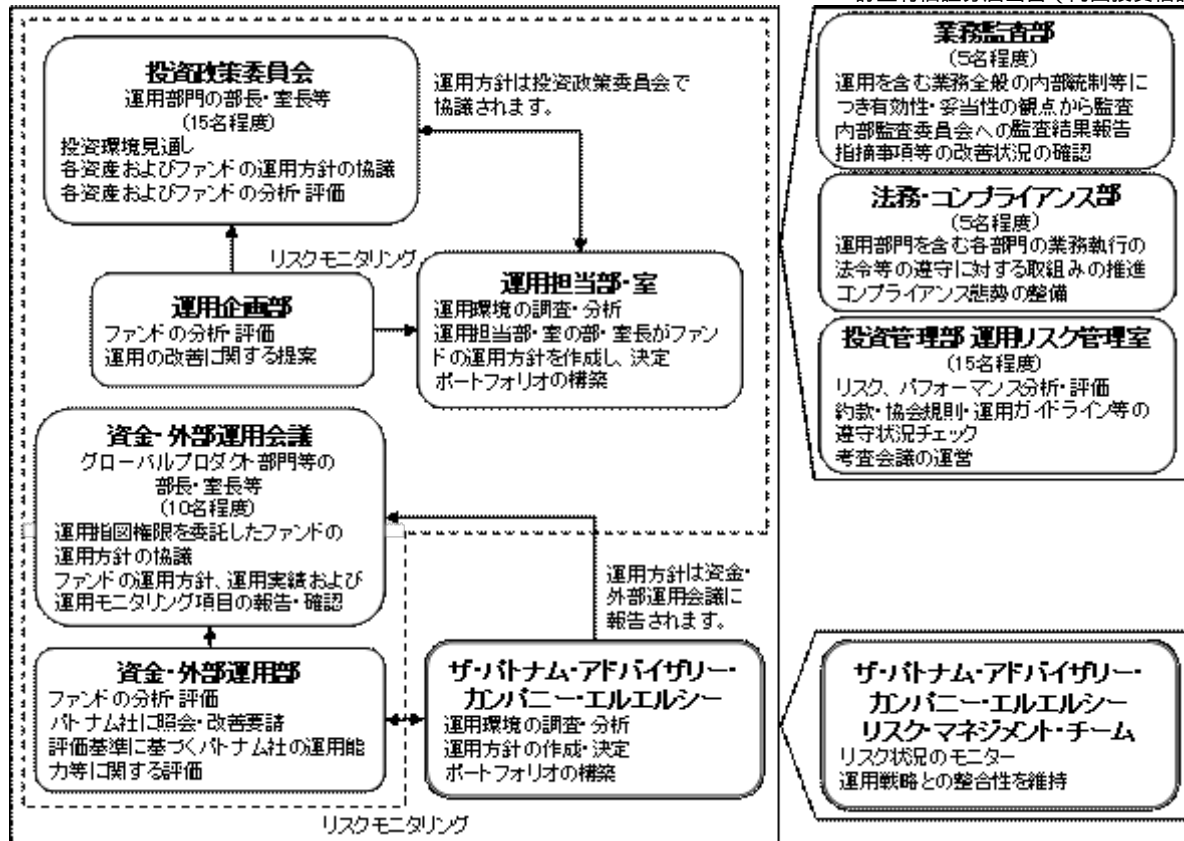
原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」「(3) 運用体制」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。

## 委託会社の組織体制



(略)

## 内部管理体制および意思決定を監督する組織



( 略 )

## 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。

## (1)【投資状況】

(平成24年4月27日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	452,450,214	96.64
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		15,709,121	3.36
純資産総額		468,159,335	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。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式マザーファンド」

(平成24年4月27日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	20,842,311,730	97.30
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		578,979,525	2.70
純資産総額		21,421,291,255	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) (2012年6月限)	東京証券取引所	577,716,205	553,725,000	2.58

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

(平成24年4月27日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	30,114,129,373	96.80
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		996,644,520	3.20
純資産総額		31,110,773,893	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、下記のとおり国債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(%)
長期国債先物(買建) (2012年6月限)	東京証券取引所	853,875,750	858,720,000	2.76

「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」

(平成24年4月27日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	--------	---------	---------

株式	アメリカ	13,234,511,226	57.85
	イギリス	3,727,225,061	16.29
	フランス	723,949,413	3.17
	ドイツ	551,933,679	2.41
	オーストラリア	526,465,186	2.30
	スイス	512,590,792	2.24
	アイルランド	486,711,154	2.13
	イタリア	427,609,892	1.87
	スペイン	385,475,382	1.69
	カナダ	385,174,249	1.68
	ベルギー	300,315,904	1.31
	香港	90,578,370	0.40
	ポルトガル	39,843,467	0.17
	小計	21,392,383,775	93.51
投資証券	アメリカ	119,790,162	0.52
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,365,604,480	5.97
純資産総額		22,877,778,417	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。

「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」

（平成24年4月27日現在）

資産の種類	国名又は地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	5,943,136,295	31.26
	ドイツ	4,075,642,591	21.44
	フランス	1,651,161,851	8.68
	イギリス	1,257,784,823	6.61
	カナダ	433,104,777	2.28
	オーストリア	394,781,668	2.08
	スイス	247,516,861	1.30
	オランダ	185,433,853	0.98
	フィンランド	180,027,509	0.95
	デンマーク	177,556,459	0.93
	マレーシア	105,246,082	0.55
	スウェーデン	74,153,334	0.39
	小計	14,725,546,103	77.45
地方債証券	カナダ	274,265,675	1.44
特殊債券	オランダ	632,860,330	3.33
	国際機関	415,223,227	2.19
	スウェーデン	112,227,732	0.59
	ドイツ	108,473,347	0.57
	アメリカ	74,844,348	0.39
	フランス	49,312,813	0.26
	小計	1,392,941,797	7.33
社債券	アメリカ	569,681,201	3.00
	イギリス	99,287,803	0.52
	フィンランド	54,010,836	0.28
	小計	722,979,840	3.80
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,896,872,466	9.98
純資産総額		19,012,605,881	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。

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

(平成24年4月27日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	ニッセイ国内株式 マザーファンド	親投資信託 受益証券	336,443,713	4,920	165,536,023	4,685	157,623,879	33.67
2	日本	ニッセイ国内債券 マザーファンド	親投資信託 受益証券	116,750,356	12,380	144,540,327	12,480	145,704,444	31.12
3	日本	ニッセイ/パトナ ム・海外株式マ ザーファンド	親投資信託 受益証券	112,488,237	8,831	99,338,363	8,446	95,007,564	20.29
4	日本	ニッセイ/パトナ ム・海外債券マ ザーファンド	親投資信託 受益証券	30,130,472	18,264	55,030,294	17,960	54,114,327	11.56
								投資比率：合計	96.64

(注1) 投資有価証券は4銘柄のみで、簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額であります。

(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

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	96.64
合計		96.64

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額の比率であります。

## (参考情報)

「ニッセイ国内株式マザーファンド」

(平成24年4月27日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額(円) 下段：評価額(円)		投資 比率 (%)
						単価	金額	
1	日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	294,400	2,580 3,305	759,532,113 972,992,000	4.54
2	日本	三菱UFJフィナンシ ャル・グループ	株式	銀行業	1,864,000	324 387	603,936,000 721,368,000	3.37
3	日本	ホンダ	株式	輸送用機器	233,700	2,631 2,896	614,842,288 676,795,200	3.16
4	日本	三井住友フィナンシ ャル・グループ	株式	銀行業	207,500	2,173 2,584	450,856,711 536,180,000	2.50
5	日本	日立製作所	株式	電気機器	1,008,000	404 512	407,232,000 516,096,000	2.41
6	日本	三菱地所	株式	不動産業	306,000	1,184 1,424	362,304,000 435,744,000	2.03
7	日本	コマツ	株式	機械	186,400	1,808 2,315	337,011,200 431,516,000	2.01
8	日本	キャノン	株式	電気機器	115,200	3,390 3,670	390,528,000 422,784,000	1.97
9	日本	NTTドコモ	株式	情報・通信業	3,100	136,500 136,200	423,150,000 422,220,000	1.97
10	日本	三菱商事	株式	卸売業	236,100	1,507 1,743	355,802,700 411,522,300	1.92



11	日本	日産自動車	株式	輸送用機器	472,700	726 836	343,393,243 395,177,200	1.84
----	----	-------	----	-------	---------	------------	----------------------------	------

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額(円) 下段：評価額(円)		投資 比率 (%)
						単価	金額	
12	日本	アステラス製薬	株式	医薬品	111,900	3,025 3,245	338,497,500 363,115,500	1.70
13	日本	伊藤忠商事	株式	卸売業	392,300	908 906	356,326,971 355,423,800	1.66
14	日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	71,100	4,775 4,980	339,502,500 354,078,000	1.65
15	日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	166,400	1,767 2,059	293,970,721 342,617,600	1.60
16	日本	ソニー	株式	電気機器	258,600	1,698 1,316	439,103,409 340,317,600	1.59
17	日本	オムロン	株式	電気機器	173,800	1,620 1,707	281,556,618 296,676,600	1.38
18	日本	大塚ホールディングス	株式	医薬品	107,100	2,142 2,410	229,408,200 258,111,000	1.20
19	日本	キリンホールディングス	株式	食料品	252,000	991 1,022	249,754,723 257,544,000	1.20
20	日本	住友化学	株式	化学	764,000	294 331	224,990,406 252,884,000	1.18
21	日本	ヤマトホールディングス	株式	陸運業	204,100	1,260 1,237	257,166,000 252,471,700	1.18
22	日本	THK	株式	機械	156,400	1,611 1,604	252,032,217 250,865,600	1.17
23	日本	大和ハウス工業	株式	建設業	238,000	910 1,034	216,580,000 246,092,000	1.15
24	日本	住友不動産	株式	不動産業	126,000	1,427 1,924	179,854,527 242,424,000	1.13
25	日本	J S R	株式	化学	152,000	1,375 1,586	209,000,000 241,072,000	1.13
26	日本	大日本スクリーン製造	株式	電気機器	332,000	597 725	198,302,021 240,700,000	1.12
27	日本	T & Dホールディングス	株式	保険業	274,500	715 867	196,267,500 237,991,500	1.11
28	日本	新生銀行	株式	銀行業	2,281,000	80 104	181,360,462 237,224,000	1.11
29	日本	フジ・メディア・ホールディングス	株式	情報・通信業	1,725	112,800 135,100	194,580,000 233,047,500	1.09
30	日本	パイオニア	株式	電気機器	565,700	346 406	195,732,200 229,674,200	1.07
							投資比率：合計	52.14

(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

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	電気機器	14.70
	銀行業	10.79
	輸送用機器	10.63
	機械	5.79
	卸売業	5.69
	化学	5.27
	医薬品	5.16

種類	業種	投資比率(%)
株式	情報・通信業	5.00
	小売業	4.32
	陸運業	3.90
	不動産業	3.64
	食料品	3.17
	電気・ガス業	2.89
	保険業	2.71
	建設業	2.28
	繊維製品	1.91
	非鉄金属	1.56
	その他製品	1.49
	金属製品	1.28
	鉱業	1.02
	サービス業	0.94
	鉄鋼	0.75
	石油・石炭製品	0.72
	ガラス・土石製品	0.61
	倉庫・運輸関連業	0.45
	パルプ・紙	0.36
	証券、商品先物取引業	0.22
精密機器	0.05	
合計		97.30

(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。

### 「ニッセイ国内債券マザーファンド」

(平成24年4月27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310回利付国債(2年)	0.200	2013/11/15	国債証券	1,817,900,000	100.15	1,820,584,324	5.85
							100.15	1,820,554,134	
2	日本	第95回利付国債(5年)	0.600	2016/3/20	国債証券	1,464,900,000	101.43	1,485,895,083	4.78
							101.62	1,488,616,731	
3	日本	第288回利付国債(10年)	1.700	2017/9/20	国債証券	1,237,100,000	107.34	1,327,877,898	4.27
							107.45	1,329,251,579	
4	日本	第94回利付国債(5年)	0.600	2015/12/20	国債証券	1,205,000,000	101.39	1,221,767,987	3.93
							101.57	1,223,942,600	
5	日本	第95回利付国債(20年)	2.300	2027/6/20	国債証券	1,044,500,000	110.95	1,158,867,893	3.76
							111.87	1,168,461,260	
6	日本	第300回利付国債(10年)	1.500	2019/3/20	国債証券	1,091,900,000	106.72	1,165,234,981	3.75
							106.87	1,166,869,854	
7	日本	第93回利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	国債証券	800,700,000	101.20	810,319,927	2.60
							101.21	810,388,470	

8	日本	第314回利付国債(10年)	1.100	2021/3/20	国債証券	716,700,000	101.67 102.91	728,693,340 737,584,638	2.37
9	日本	第319回利付国債(10年)	1.100	2021/12/20	国債証券	690,400,000	102.25 102.23	705,954,712 705,768,304	2.27
10	日本	第85回利付国債(20年)	2.100	2026/3/20	国債証券	632,600,000	109.45 109.99	692,368,024 695,790,414	2.24
11	日本	第290回利付国債(10年)	1.400	2018/3/20	国債証券	612,900,000	105.95 106.05	649,345,179 649,986,579	2.09

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	
12	日本	第320回利付国債(10年)	1.000	2021/12/20	国債証券	541,300,000	101.27 101.29	548,185,336 548,282,770	1.76
13	日本	第27回利付国債(20年)	5.000	2014/9/22	国債証券	469,300,000	113.16 111.64	531,041,108 523,917,134	1.68
14	日本	第97回利付国債(5年)	0.400	2016/6/20	国債証券	517,300,000	100.40 100.84	519,372,846 521,645,320	1.68
15	日本	第298回利付国債(10年)	1.300	2018/12/20	国債証券	479,500,000	105.33 105.51	505,052,555 505,920,450	1.63
16	日本	第308回利付国債(2年)	0.100	2013/9/15	国債証券	494,200,000	99.99 99.99	494,158,004 494,165,406	1.59
17	日本	第89回利付国債(5年)	0.400	2015/6/20	国債証券	486,200,000	100.56 100.83	488,922,720 490,220,874	1.58
18	日本	第291回利付国債(10年)	1.300	2018/3/20	国債証券	448,300,000	105.41 105.48	472,570,962 472,844,425	1.52
19	日本	第16回物価連動国債(10年)	1.400	2018/6/10	国債証券	438,800,000	106.08 107.71	465,498,786 472,630,383	1.52
20	日本	第96回利付国債(5年)	0.500	2016/3/20	国債証券	463,300,000	101.08 101.23	468,303,640 469,012,489	1.51
21	日本	第99回利付国債(5年)	0.400	2016/9/20	国債証券	434,200,000	100.61 100.80	436,831,295 437,686,626	1.41
22	日本	第82回利付国債(20年)	2.100	2025/9/20	国債証券	382,000,000	109.01 110.32	416,420,740 421,407,120	1.35
23	日本	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	国債証券	382,500,000	105.26 105.38	402,604,200 403,078,500	1.30
24	日本	第292回利付国債(10年)	1.700	2018/3/20	国債証券	364,000,000	107.63 107.81	391,773,200 392,432,040	1.26
25	日本	第26回利付国債(30年)	2.400	2037/3/20	国債証券	343,200,000	110.87 111.36	380,494,776 382,197,816	1.23
26	日本	第93回利付国債(20年)	2.000	2027/3/20	国債証券	331,400,000	106.79 107.99	353,910,102 357,872,232	1.15
27	日本	第97回利付国債(20年)	2.200	2027/9/20	国債証券	324,200,000	109.43 110.34	354,763,025 357,712,554	1.15
28	日本	第311回利付国債(2年)	0.200	2013/12/15	国債証券	355,200,000	100.16 100.15	355,768,320 355,743,456	1.14
29	日本	第34回利付国債(30年)	2.200	2041/3/20	国債証券	330,700,000	106.62 106.99	352,584,014 353,819,237	1.14
30	日本	第267回利付国債(10年)	1.300	2014/12/20	国債証券	338,500,000	103.19 103.11	349,298,150 349,037,505	1.12
								投資比率:合計	64.63

(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

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

国債証券	-	96.80
合計		96.80

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額の比率であります。

「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」

(平成24年4月27日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額（円）		投資比率（%）
						単価	金額	
1	アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	262,700	2,055 2,747	539,827,195 721,760,264	3.15
2	イギリス	BG GROUP PLC	株式	エネルギー	354,403	1,731 1,880	613,611,417 666,213,865	2.91
3	イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	エネルギー	184,109	2,878 2,881	529,797,899 530,418,507	2.32
4	アメリカ	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	248,492	1,721 1,872	427,573,763 465,237,010	2.03
5	アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9,200	38,654 49,339	355,612,448 453,920,300	1.98
6	アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	60,300	6,187 7,189	373,056,683 433,519,282	1.89
7	アメリカ	MONSANTO CO	株式	素材	66,200	5,683 6,246	376,234,307 413,481,672	1.81
8	アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	112,700	2,493 3,556	280,908,469 400,774,949	1.75
9	アメリカ	AETNA INC	株式	ヘルスケア機器・サービス	101,700	3,261 3,679	331,602,044 374,125,712	1.64
10	フランス	SANOFI	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	55,988	5,754 6,089	322,182,856 340,915,814	1.49
11	アメリカ	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	ヘルスケア機器・サービス	68,700	3,976 4,739	273,142,564 325,573,443	1.42
12	スイス	TYCO INTERNATIONAL LTD	株式	資本財	69,300	3,575 4,599	247,733,342 318,683,091	1.39
13	アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	93,500	3,144 3,259	293,944,327 304,713,377	1.33
14	アメリカ	NATIONAL OILWELL VARCO INC	株式	エネルギー	48,800	5,183 6,231	252,938,676 304,049,405	1.33
15	アイルランド	ACCENTURE PLC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	57,500	4,344 5,224	249,760,738 300,366,465	1.31
16	ベルギー	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	株式	食品・飲料・タバコ	50,052	5,038 6,000	252,186,738 300,315,904	1.31
17	イギリス	TULLOW OIL PLC	株式	エネルギー	144,951	1,707 2,042	247,433,662 296,006,090	1.29
18	アメリカ	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	株式	ヘルスケア機器・サービス	62,900	3,785 4,579	238,080,856 288,026,396	1.26
19	アメリカ	SALESFORCE.COM INC	株式	ソフトウェア・サービス	22,600	8,401 12,682	189,856,482 286,610,443	1.25
20	アメリカ	LOWE'S COS INC	株式	小売	108,000	2,055 2,552	221,887,879 275,594,584	1.20
21	アメリカ	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	株式	素材	17,400	10,544 15,669	183,468,128 272,638,131	1.19
22	アメリカ	WW GRAINGER INC	株式	資本財	16,000	14,753 17,006	236,048,558 272,096,918	1.19
23	アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	16,900	15,107 15,912	255,306,282 268,920,035	1.18
24	イギリス	TELECITY GROUP PLC	株式	ソフトウェア・サービス	250,633	819 1,068	205,189,302 267,767,099	1.17

25	イギリス	KINGFISHER PLC	株式	小売	688,547	314 385	216,523,333 264,840,699	1.16
----	------	----------------	----	----	---------	------------	----------------------------	------

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額（円） 下段：評価額（円）		投資比率（%）
						単価	金額	
26	イギリス	COMPASS GROUP PLC	株式	消費者サービス	307,390	771 855	236,911,513 262,965,721	1.15
27	アメリカ	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	株式	各種金融	58,200	3,374 4,452	196,381,722 259,133,149	1.13
28	イギリス	AON PLC	株式	保険	59,300	3,635 4,219	215,563,048 250,213,047	1.09
29	アメリカ	BAKER HUGHES INC	株式	エネルギー	70,200	3,920 3,512	275,184,981 246,562,014	1.08
30	アメリカ	CENTURYLINK INC	株式	電気通信サービス	78,700	2,894 3,122	227,781,372 245,682,158	1.07
投資比率：合計								45.47

（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）平成24年4月27日現在の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

（注3）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	業種	投資比率（%）
株式	エネルギー	15.08
	小売	7.42
	各種金融	7.11
	資本財	6.60
	素材	6.58
	ヘルスケア機器・サービス	5.65
	銀行	5.25
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.15
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.06
	食品・飲料・タバコ	4.77
	ソフトウェア・サービス	4.26
	耐久消費財・アパレル	4.26
	保険	3.67
	電気通信サービス	3.01
	消費者サービス	2.61
	自動車・自動車部品	2.51
	半導体・半導体製造装置	1.63
	不動産	1.09
	運輸	0.81
	食品・生活必需品小売り	0.54
家庭用品・パーソナル用品	0.45	
	小計	93.51
投資証券	-	0.52
	合計	94.03

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各種別及び各業種の評価金額（平成24年4月27日現在の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額）の比率であります。

（注2）業種はG I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & P及びMSCI Inc.に帰属します。

## 「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」

（平成24年4月27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	ドイツ	DEUTSCHLAND REP	4.250	2014/1/4	国債証券	14,750,000	11,608 11,472	1,712,129,496 1,692,167,306	8.90
2	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	1.000	2016/8/31	国債証券	17,000,000	8,212 8,226	1,396,075,040 1,398,449,036	7.36
3	フランス	FRANCE OAT	3.750	2021/4/25	国債証券	7,380,000	11,392 11,493	840,699,272 848,192,646	4.46
4	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	1.250	2014/4/15	国債証券	9,800,000	8,298 8,273	813,246,130 810,795,491	4.26
5	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	2.750	2016/11/30	国債証券	8,690,000	8,846 8,847	768,709,076 768,814,026	4.04
6	ドイツ	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1.500	2013/3/15	国債証券	6,700,000	10,910 10,858	730,952,559 727,518,090	3.83
7	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	3.125	2016/10/31	国債証券	7,640,000	9,027 8,975	689,633,998 685,707,552	3.61
8	ドイツ	DEUTSCHLAND REP	6.000	2016/6/20	国債証券	4,813,000	13,178 13,103	634,245,514 630,642,814	3.32
9	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	6.250	2030/5/15	国債証券	4,800,000	12,691 12,275	609,166,621 589,193,881	3.10
10	オランダ	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN	1.750	2015/10/6	特殊債券	6,600,000	8,105 8,164	534,943,048 538,854,782	2.83
11	フランス	FRENCH T-NOTE	2.500	2016/7/25	国債証券	4,320,000	11,113 11,151	480,070,584 481,729,115	2.53
12	ドイツ	BUNDESOBLIGATION	4.250	2012/10/12	国債証券	4,197,000	11,089 10,923	465,398,215 458,426,379	2.41
13	イギリス	UK GILT	4.250	2039/9/7	国債証券	2,740,000	16,068 15,443	440,267,522 423,135,706	2.23
14	イギリス	UK GILT	2.250	2014/3/7	国債証券	3,100,000	13,596 13,593	421,461,963 421,368,268	2.22
15	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	2.750	2017/12/31	国債証券	3,640,000	8,872 8,900	322,954,537 323,976,517	1.70
16	フランス	FRANCE OAT	3.250	2021/10/25	国債証券	2,910,000	10,830 11,039	315,145,394 321,240,090	1.69
17	ドイツ	DEUTSCHLAND REP	4.250	2039/7/4	国債証券	2,200,000	14,389 14,600	316,554,035 321,192,379	1.69
18	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	4.375	2041/5/15	国債証券	3,000,000	10,746 10,136	322,386,816 304,080,095	1.60
19	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	4.250	2017/11/15	国債証券	3,070,000	9,563 9,549	293,571,211 293,164,254	1.54
20	カナダ	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.700	2012/12/18	地方債証券	3,260,000	8,539 8,413	278,358,511 274,265,675	1.44
21	イギリス	UK GILT	2.750	2015/1/22	国債証券	1,890,000	14,000 13,942	264,601,433 263,502,741	1.39
22	スイス	SWISS GOVT	2.000	2022/5/25	国債証券	2,463,000	10,086 10,049	248,423,903 247,516,861	1.30
23	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	0.375	2012/10/31	国債証券	3,000,000	8,135 8,128	244,054,704 243,845,234	1.28
24	国際機関	EUROPEAN UNION	3.250	2018/4/4	特殊債券	2,010,000	11,214 11,568	225,407,456 232,522,840	1.22

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	

25	カナダ	CANADA GOVT	3.500	2020/6/1	国債証券	2,300,000	9,148 9,178	210,401,403 211,100,562	1.11
26	オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.500	2021/9/15	国債証券	1,740,000	11,099 11,490	193,128,516 199,924,401	1.05
27	オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.500	2015/7/15	国債証券	1,690,000	11,469 11,530	193,831,474 194,857,268	1.02
28	オランダ	NETHERLANDS GOVT	4.000	2037/1/15	国債証券	1,420,000	13,452 13,059	191,022,451 185,433,853	0.98
29	アメリカ	US TREASURY NOTE/BOND	3.500	2018/2/15	国債証券	2,000,000	9,063 9,235	181,256,675 184,707,250	0.97
30	国際機関	AFRICAN DEVELOPMENT BANK	4.850	2012/7/24	特殊債券	2,200,000	8,412 8,305	185,060,080 182,700,387	0.96
投資比率：合計									76.04

（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）平成24年4月27日現在の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

（注3）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	業種	投資比率（％）
国債証券	-	77.45
特殊債券	-	7.33
社債券	-	3.80
地方債証券	-	1.44
合計		90.02

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額（平成24年4月27日現在の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額）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】

該当事項はありません。

#### （参考情報）

「ニッセイ国内株式マザーファンド」

（平成24年4月27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 （2012年6月限）	買建	69	577,716,205	553,725,000	2.58

（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。

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

（平成24年4月27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 （％）
----	-----	-------	----------	-------	-------	-------	-----------------

国債先物取引	東京証券取引所	長期国債先物(2012年6月限)	買建	6	853,875,750	858,720,000	2.76
--------	---------	------------------	----	---	-------------	-------------	------

(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24年4月27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(円)		1万口当たり純資産総額(円)	
第1期末	(平成14年3月20日)	分配付:	10,350,044	分配付:	10,350
		分配落:	10,350,044	分配落:	10,350
第2期末	(平成14年9月20日)	分配付:	46,975,476	分配付:	9,210
		分配落:	46,975,476	分配落:	9,210
第3期末	(平成15年3月20日)	分配付:	313,999,686	分配付:	8,873
		分配落:	313,999,686	分配落:	8,873
第4期末	(平成15年9月22日)	分配付:	346,417,461	分配付:	9,748
		分配落:	346,417,461	分配落:	9,748
第5期末	(平成16年3月22日)	分配付:	354,848,297	分配付:	10,107
		分配落:	354,848,297	分配落:	10,107
第6期末	(平成16年9月21日)	分配付:	366,034,754	分配付:	10,137
		分配落:	366,034,754	分配落:	10,137
第7期末	(平成17年3月22日)	分配付:	381,515,973	分配付:	10,480
		分配落:	381,515,973	分配落:	10,480
第8期末	(平成17年9月20日)	分配付:	409,008,283	分配付:	11,140
		分配落:	409,008,283	分配落:	11,140
第9期末	(平成18年3月20日)	分配付:	441,308,468	分配付:	12,312
		分配落:	441,308,468	分配落:	12,312
第10期末	(平成18年9月20日)	分配付:	468,218,480	分配付:	12,119
		分配落:	468,218,480	分配落:	12,119
第11期末	(平成19年3月20日)	分配付:	514,934,547	分配付:	12,780
		分配落:	514,934,547	分配落:	12,780
第12期末	(平成19年9月20日)	分配付:	548,987,708	分配付:	12,702
		分配落:	548,987,708	分配落:	12,702
第13期末	(平成20年3月21日)	分配付:	473,348,432	分配付:	10,769
		分配落:	473,348,432	分配落:	10,769
第14期末	(平成20年9月22日)	分配付:	486,614,230	分配付:	10,590
		分配落:	486,614,230	分配落:	10,590
第15期末	(平成21年3月23日)	分配付:	377,995,817	分配付:	8,152
		分配落:	377,995,817	分配落:	8,152
第16期末	(平成21年9月24日)	分配付:	414,915,163	分配付:	9,269
		分配落:	414,915,163	分配落:	9,269
第17期末	(平成22年3月23日)	分配付:	423,144,417	分配付:	9,327
		分配落:	423,144,417	分配落:	9,327
第18期末	(平成22年9月21日)	分配付:	419,602,211	分配付:	8,907
		分配落:	419,602,211	分配落:	8,907



第19期末	(平成23年3月22日)	分配付： 435,154,538 分配落： 435,154,538	分配付： 9,034 分配落： 9,034
第20期末	(平成23年9月20日)	分配付： 417,148,183 分配落： 417,148,183	分配付： 8,297 分配落： 8,297

		純資産総額(円)	1万口当たり純資産総額(円)
第21期末	(平成24年3月21日)	分配付： 478,472,469 分配落： 478,472,469	分配付： 9,218 分配落： 9,218
	平成23年4月末日	447,028,106	9,189
	5月末日	444,368,425	9,064
	6月末日	449,020,177	9,045
	7月末日	445,066,755	8,903
	8月末日	424,407,469	8,441
	9月末日	419,227,191	8,291
	10月末日	431,066,279	8,517
	11月末日	418,907,034	8,204
	12月末日	426,554,174	8,278
	平成24年1月末日	436,584,160	8,443
	2月末日	467,419,659	9,014
	3月末日	480,298,167	9,194
	平成24年4月27日	468,159,335	8,965

## 【分配の推移】

		1万口当たり分配金
第1期	(平成14年3月20日)	0円
第2期	(平成14年9月20日)	0円
第3期	(平成15年3月20日)	0円
第4期	(平成15年9月22日)	0円
第5期	(平成16年3月22日)	0円
第6期	(平成16年9月21日)	0円
第7期	(平成17年3月22日)	0円
第8期	(平成17年9月20日)	0円
第9期	(平成18年3月20日)	0円
第10期	(平成18年9月20日)	0円
第11期	(平成19年3月20日)	0円
第12期	(平成19年9月20日)	0円
第13期	(平成20年3月21日)	0円
第14期	(平成20年9月22日)	0円
第15期	(平成21年3月23日)	0円
第16期	(平成21年9月24日)	0円
第17期	(平成22年3月23日)	0円
第18期	(平成22年9月21日)	0円

		1万口当たり分配金
第19期	(平成23年3月22日)	0円
第20期	(平成23年9月20日)	0円
第21期	(平成24年3月21日)	0円

## 【収益率の推移】

		収益率
第1期	自平成13年11月30日 至平成14年3月20日	3.50%
第2期	自平成14年3月21日 至平成14年9月20日	11.01%
第3期	自平成14年9月21日 至平成15年3月20日	3.66%
第4期	自平成15年3月21日 至平成15年9月22日	9.86%
第5期	自平成15年9月23日 至平成16年3月22日	3.68%
第6期	自平成16年3月23日 至平成16年9月21日	0.30%
第7期	自平成16年9月22日 至平成17年3月22日	3.38%
第8期	自平成17年3月23日 至平成17年9月20日	6.30%
第9期	自平成17年9月21日 至平成18年3月20日	10.52%
第10期	自平成18年3月21日 至平成18年9月20日	1.57%
第11期	自平成18年9月21日 至平成19年3月20日	5.45%
第12期	自平成19年3月21日 至平成19年9月20日	0.61%
第13期	自平成19年9月21日 至平成20年3月21日	15.22%
第14期	自平成20年3月22日 至平成20年9月22日	1.66%
第15期	自平成20年9月23日 至平成21年3月23日	23.02%
第16期	自平成21年3月24日 至平成21年9月24日	13.70%
第17期	自平成21年9月25日 至平成22年3月23日	0.63%
第18期	自平成22年3月24日 至平成22年9月21日	4.50%

		収益率
第19期	自平成22年9月22日 至平成23年3月22日	1.43%
第20期	自平成23年3月23日 至平成23年9月20日	8.16%
第21期	自平成23年9月21日 至平成24年3月21日	11.10%

(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】

		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	自平成13年11月30日 至平成14年3月20日	10,000,000	-	10,000,000
第2期	自平成14年3月21日 至平成14年9月20日	41,027,086	21,834	51,005,252
第3期	自平成14年9月21日 至平成15年3月20日	308,960,334	6,091,591	353,873,995
第4期	自平成15年3月21日 至平成15年9月22日	27,305,700	25,799,392	355,380,303
第5期	自平成15年9月23日 至平成16年3月22日	20,843,872	25,137,704	351,086,471
第6期	自平成16年3月23日 至平成16年9月21日	25,125,531	15,113,091	361,098,911
第7期	自平成16年9月22日 至平成17年3月22日	31,236,607	28,290,774	364,044,744
第8期	自平成17年3月23日 至平成17年9月20日	34,016,741	30,902,449	367,159,036
第9期	自平成17年9月21日 至平成18年3月20日	32,071,936	40,790,058	358,440,914
第10期	自平成18年3月21日 至平成18年9月20日	45,566,691	17,672,761	386,334,844
第11期	自平成18年9月21日 至平成19年3月20日	32,093,186	15,506,440	402,921,590
第12期	自平成19年3月21日 至平成19年9月20日	80,863,942	51,594,790	432,190,742
第13期	自平成19年9月21日 至平成20年3月21日	30,124,473	22,772,806	439,542,409
第14期	自平成20年3月22日 至平成20年9月22日	54,103,635	34,148,906	459,497,138
第15期	自平成20年9月23日 至平成21年3月23日	58,887,483	54,678,833	463,705,788

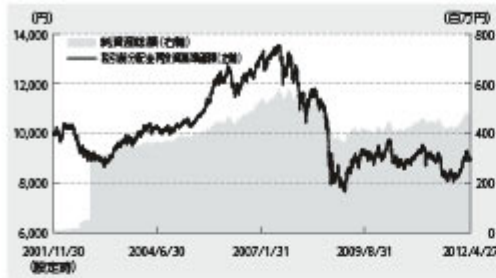
		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第16期	自平成21年3月24日 至平成21年9月24日	32,881,333	48,940,728	447,646,393
第17期	自平成21年9月25日 至平成22年3月23日	31,178,618	25,143,607	453,681,404
第18期	自平成22年3月24日 至平成22年9月21日	31,950,447	14,541,885	471,089,966
第19期	自平成22年9月22日 至平成23年3月22日	25,333,224	14,746,306	481,676,884
第20期	自平成23年3月23日 至平成23年9月20日	29,025,580	7,931,333	502,771,131
第21期	自平成23年9月21日 至平成24年3月21日	27,934,708	11,623,296	519,082,543

(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〉

2012年4月末現在

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(西託報酬)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。

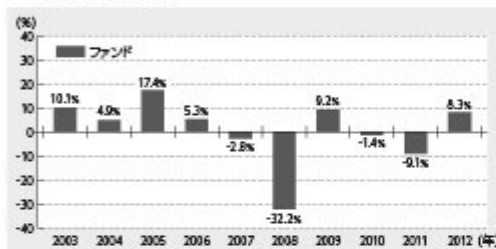
## ●基準価額および純資産総額

基準価額	8,965円
純資産総額	468百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

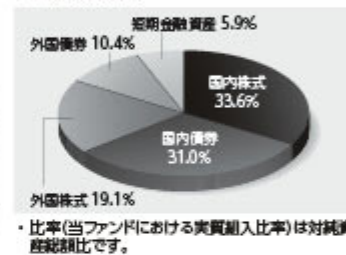
第17期	2010年3月23日	0円
第18期	2010年9月21日	0円
第19期	2011年3月22日	0円
第20期	2011年9月20日	0円
第21期	2012年3月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。  
 ・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。  
 ・2012年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実資産比率)は対純資産総額比です。

## ●各マザーファンドの組入上位銘柄(各マザーファンドのウェイトは対純資産総額比です)

## 1. ニッセイ国内株式マザーファンド

銘柄名	ウェイト
1 トヨタ自動車	4.5%
2 三菱UFJフィナンシャルG	3.4%
3 本田技研	3.2%
4 三井住友フィナンシャルG	2.5%
5 日立	2.4%

## 2. ニッセイ国内債券マザーファンド

銘柄名	ウェイト
1 第310回 2年国債	5.9%
2 第95回 5年国債	4.8%
3 第288回 10年国債	4.3%
4 第94回 5年国債	3.9%
5 第95回 20年国債	3.8%

## 3. ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド

銘柄名	国・地域	ウェイト
1 ウェルズ・ファーゴ・アンド・カンパニー	アメリカ	3.2%
2 BGグループ	イギリス	2.9%
3 ロイヤル・ダッチ/シェル	イギリス	2.3%
4 ファイザー	アメリカ	2.0%
5 アップル	アメリカ	2.0%

・国・地域は法人登録国です。

## 4. ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

銘柄名	通貨	ウェイト
1 ドイツ国債	ユーロ	8.9%
2 アメリカ国債	米ドル	7.4%
3 フランス国債	ユーロ	4.5%
4 アメリカ国債	米ドル	4.3%
5 アメリカ国債	米ドル	4.0%

■ 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。

■ 最新の基準価額および純資産総額等については、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】

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

- 1) 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）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。  
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) 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21期計算期間（平成23年9月21日から平成24年3月21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】

## D Cニッセイバランスアクティブ

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (平成23年9月20日現在)	第21期 (平成24年3月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	-	8,274,720
親投資信託受益証券	420,209,804	473,238,546
未収入金	2,717	-
流動資産合計	420,212,521	481,513,266
資産合計	420,212,521	481,513,266
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,717	-
未払受託者報酬	228,442	226,904
未払委託者報酬	2,741,876	2,723,210
その他未払費用	91,303	90,683
流動負債合計	3,064,338	3,040,797
負債合計	3,064,338	3,040,797
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	502,771,131	519,082,543
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	85,622,948	40,610,074
純資産合計	417,148,183	478,472,469
負債純資産合計	420,212,521	481,513,266

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期 （自平成23年3月23日 至平成23年9月20日）	第21期 （自平成23年9月21日 至平成24年3月21日）
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	2,372
有価証券売買等損益	33,919,960	50,649,922
営業収益合計	33,919,960	50,652,294
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	228,442	226,904
委託者報酬	2,741,876	2,723,210
その他費用	91,303	90,683
営業費用合計	3,061,621	3,040,797
営業利益又は営業損失（ ）	36,981,581	47,611,497
経常利益又は経常損失（ ）	36,981,581	47,611,497
当期純利益又は当期純損失（ ）	36,981,581	47,611,497
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（ ）	235,743	172,462
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	46,522,346	85,622,948
剰余金増加額又は欠損金減少額	765,984	1,978,527
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	765,984	1,978,527
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	3,120,748	4,404,688
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	3,120,748	4,404,688
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	85,622,948	40,610,074

## (3)【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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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3月21日から9月20日まで及び9月21日から翌年3月20日までとしておりますが、当計算期間末日が休業日のため、平成23年9月21日から平成24年3月21日までとなっております。

## (追加情報)

第21期 (自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)
(1) 主要投資対象 当ファンドは平成23年12月21日付で約款変更を行い、主要投資対象を「ニッセイバランスアクティブマザーファンド」から、「ニッセイ国内株式マザーファンド」、「ニッセイ国内債券マザーファンド」、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」及び「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」に変更しました。
(2) 「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」等の適用 第21期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第20期 (平成23年9月20日現在)	第21期 (平成24年3月21日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	502,771,131口	519,082,543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	85,622,948円	40,610,074円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8297円 (8,297円)	0.9218円 (9,218円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第20期 (自平成23年3月23日 至平成23年9月20日)	第21期 (自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)



<p style="text-align: center;">-</p> <p>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売買等損益（0円）、収益調整金（135,090,953円）、及び分配準備積立金（56,936,863円）より、分配対象収益は192,027,816円（1口当たり0.381939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>1. 投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用          146,872円</p> <p>なお、当ファンドの主要な投資対象である親投資信託「ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド」及び「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」の運用の指図に係る権限の一部を委託しており、当該マザーファンドに係る費用のうち、当ファンドが負担している金額を記載しております。</p> <p>2. 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（2,372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（142,604,293円）、及び分配準備積立金（55,653,410円）より、分配対象収益は198,260,075円（1口当たり0.381943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 style="text-align: center;">第20期 （自平成23年3月23日 至平成23年9月20日）</p>	<p style="text-align: center;">第21期 （自平成23年9月21日 至平成24年3月21日）</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針          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          当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは親投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場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          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>1. 金融商品に対する取組方針          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          当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは親投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場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          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>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>
--	--

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 (平成23年9月20日現在)	第21期 (平成24年3月21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。	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．親投資信託受益証券 (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．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>	<p>1．親投資信託受益証券 (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．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20期 (自平成23年3月23日 至平成23年9月20日)	第21期 (自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (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20期 (平成23年9月20日現在)	第21期 (平成24年3月21日現在)
期首元本額	481,676,884円	502,771,131円
期中追加設定元本額	29,025,580円	27,934,708円
期中一部解約元本額	7,931,333円	11,623,296円

## 2 有価証券関係

第20期(平成23年9月20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)
親投資信託受益証券	33,715,113

合計	33,715,113
----	------------

第21期(平成24年3月21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)
親投資信託受益証券	53,543,421
合計	53,543,421

### 3 デリバティブ取引関係

第20期(平成23年9月20日現在)

該当事項はありません。

第21期(平成24年3月21日現在)

該当事項はありません。

### (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	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	ニッセイ国内株式マザー ファンド	384,755,733	189,492,198	
	ニッセイ国内債券マザー ファンド	100,824,507	124,770,327	
	ニッセイ/パトナム・海外 株式マザーファンド	117,705,500	103,945,727	
	ニッセイ/パトナム・海外 債券マザーファンド	30,130,472	55,030,294	
合計		633,416,212	473,238,546	

#### 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

該当事項はありません。

#### 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。

### <参考>

開示対象ファンド（DCニッセイバランスアクティブ）は、「ニッセイ国内株式マザーファンド」、「ニッセイ国内債券マザーファンド」、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」及び「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」の受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの計算期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

### 1. 「ニッセイ国内株式マザーファンド」の状況

#### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成24年3月21日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	409,310,842
株式	22,131,719,200
派生商品評価勘定	14,610,420
未収入金	197,421,042
未収配当金	28,824,050
差入委託証拠金	9,360,000
流動資産合計	22,791,245,554
資産合計	22,791,245,554
負債の部	
流動負債	
前受金	21,264,000
未払金	195,399,946
未払解約金	22,577,252
流動負債合計	239,241,198
負債合計	239,241,198
純資産の部	
元本等	
元本	45,788,333,956
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	23,236,329,600
純資産合計	22,552,004,356
負債純資産合計	22,791,245,554

#### (2) 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	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日の最終相場によっております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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日の清算値段によっております。  本マザー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。
3. 収益及び費用の計上基準	(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。  (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。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年3月21日現在)
1. 計算日における受益権総数	45,788,333,956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	23,236,329,600円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4925円 (4,925円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

(自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)
<p>1. 金融商品に対する取組方針 本マザーファンドは、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 本マザー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などの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p>

## 3. 金融商品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、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。

## 4. 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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年3月21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 (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)

(自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)
該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 1 開示対象ファンドの計算期間における本マザーファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(平成24年3月21日現在)
同計算期間の期首元本額	48,584,800,579円
同計算期間中の追加設定元本額	3,724,586,290円
同計算期間中の一部解約元本額	6,521,052,913円
同計算期間末日の元本額	45,788,333,956円
上記元本額の内訳	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(債券重視型)	1,488,561,344円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(標準型)	1,117,329,098円

ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	681,531,235円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	1,247,133,372円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	4,719,989,029円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	3,252,345,678円
DCニッセイ国内株式アクティブ	629,012,781円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	467,246,683円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	9,394,992,829円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	14,832,037,095円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,067,723,680円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	6,505,675,399円
DCニッセイバランスアクティブ	384,755,733円
合計	45,788,333,956円

## 2 有価証券関係

（平成24年3月21日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,410,524,304
合計	3,410,524,304

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、本マザーファンドの期首（平成23年12月21日）から計算日までの期間に対応するものであります。

## 3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

（平成24年3月21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	359,609,580	-	374,220,000	14,610,420
	合計	359,609,580	-	374,220,000	14,610,420

（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日の清算値段によっております。

（注2）評価損益の算定方法

評価損益は、本マザーファンドの期首（平成23年12月21日）から計算日までの期間に対応するものであります。

（注3）上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## ( 3 ) 附属明細表（平成24年3月21日現在）

## 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）	
国際石油開発帝石	417	563,000	234,771,000	
N I P P O	70,000	942	65,940,000	
大和ハウス工業	242,000	1,101	266,442,000	
大気社	100,600	1,681	169,108,600	
麒麟ホールディングス	196,000	1,025	200,900,000	
不二製油	167,800	1,171	196,493,800	
キューピー	96,100	1,172	112,629,200	
J T	512	459,000	235,008,000	
J・フロント リテイリング	252,000	440	110,880,000	
帝人	339,000	282	95,598,000	
クラレ	85,000	1,217	103,445,000	
旭化成	294,000	506	148,764,000	
グリー	48,700	2,194	106,847,800	
王子製紙	170,000	406	69,020,000	
住友化学	804,000	364	292,656,000	
協和発酵キリン	128,000	886	113,408,000	
三井化学	425,000	259	110,075,000	
J S R	194,600	1,717	334,128,200	
三菱ケミカルホールディングス	108,000	449	48,492,000	
ダイセル	286,000	530	151,580,000	
野村総合研究所	50,700	2,060	104,442,000	
アステラス製薬	113,900	3,445	392,385,500	
日本新薬	48,000	1,001	48,048,000	
中外製薬	137,100	1,436	196,875,600	
ツムラ	51,800	2,326	120,486,800	
大塚ホールディングス	109,000	2,367	258,003,000	
フジ・メディア・ホールディングス	2,054	131,800	270,717,200	
ヤフー	3,215	27,240	87,576,600	
小林製薬	22,400	4,070	91,168,000	
J Xホールディングス	346,400	523	181,167,200	
住友大阪セメント	359,000	243	87,237,000	
丸一鋼管	68,800	1,909	131,339,200	
住友金属鉱山	185,000	1,178	217,930,000	
住友電気工業	133,500	1,131	150,988,500	
ノーリツ	82,700	1,525	126,117,500	
リンナイ	38,000	5,840	221,920,000	
オーエスジー	172,300	1,188	204,692,400	
コマツ	189,700	2,424	459,832,800	
小森コーポレーション	52,700	677	35,677,900	
加藤製作所	5,000	406	2,030,000	
T H K	117,400	1,724	202,397,600	
日立製作所	1,026,000	497	509,922,000	
オムロン	173,800	1,817	315,794,600	
セイコーエプソン	194,900	1,210	235,829,000	
ソニー	258,600	1,733	448,153,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
T D K	28,300	4,595	130,038,500	
バイオニア	575,900	411	236,694,900	



ホシデン	152,000	626	95,152,000	
堀場製作所	40,700	2,777	113,023,900	
カシオ計算機	247,700	588	145,647,600	
ファナック	14,100	15,360	216,576,000	
村田製作所	22,600	4,940	111,644,000	
三菱重工業	538,000	401	215,738,000	
日産自動車	487,400	865	421,601,000	
トヨタ自動車	294,400	3,520	1,036,288,000	
ケーヒン	107,200	1,572	168,518,400	
ダイハツ工業	84,000	1,488	124,992,000	
ホンダ	233,700	3,220	752,514,000	
ドン・キホーテ	66,500	2,860	190,190,000	
大日本スクリーン製造	329,000	758	249,382,000	
キヤノン	117,300	3,895	456,883,500	
リコー	190,000	821	155,990,000	
バンダイナムコホールディングス	119,500	1,169	139,695,500	
凸版印刷	286,000	620	177,320,000	
エフピコ	14,200	5,080	72,136,000	
丸紅	445,000	620	275,900,000	
オンワ - ドホールディングス	310,000	634	196,540,000	
ファミリーマート	28,000	3,335	93,380,000	
三井物産	282,800	1,404	397,051,200	
東京エレクトロン	26,500	4,755	126,007,500	
日立ハイテクノロジーズ	114,900	1,930	221,757,000	
三菱商事	240,300	1,986	477,235,800	
青山商事	151,500	1,587	240,430,500	
丸井グループ	262,600	697	183,032,200	
新生銀行	2,090,000	106	221,540,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,896,900	434	823,254,600	
りそなホールディングス	412,100	410	168,961,000	
三井住友フィナンシャルグループ	221,600	2,860	633,776,000	
横浜銀行	402,000	403	162,006,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	185,000	364	67,340,000	
スルガ銀行	273,000	808	220,584,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,438,900	143	205,762,700	
カブドットコム証券	186,000	315	58,590,000	
東京海上ホールディングス	166,400	2,262	376,396,800	
T & Dホ - ルディングス	279,400	1,029	287,502,600	
三菱地所	312,000	1,505	469,560,000	
住友不動産	137,000	1,977	270,849,000	
東日本旅客鉄道	72,400	5,380	389,512,000	
阪急阪神ホールディングス	332,000	349	115,868,000	
ヤマトホールディングス	207,800	1,283	266,607,400	
全日本空輸	634,000	257	162,938,000	
上組	152,000	693	105,336,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
KDDI	226	530,000	119,780,000	
NTTドコモ	3,155	140,600	443,593,000	
中部電力	161,900	1,522	246,411,800	
東京ガス	492,000	394	193,848,000	
大阪ガス	711,000	324	230,364,000	
ベネッセホールディングス	52,000	3,905	203,060,000	
合計	24,578,579	-	22,131,719,200	

株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

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. 「ニッセイ国内債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成24年3月21日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,037,920,878
国債証券	30,135,522,560
未収入金	5,552,427,543
未収利息	17,360,963
前払金	5,460,000
前払費用	11,291,815
差入委託証拠金	2,520,000
流動資産合計	36,762,503,759
資産合計	36,762,503,759
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,575,750
未払金	5,540,002,255
未払解約金	36,126,212
流動負債合計	5,580,704,217
負債合計	5,580,704,217
純資産の部	
元本等	

元本	25,197,025,278
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	5,984,774,264
純資産合計	31,181,799,542
負債純資産合計	36,762,503,759

## (2) 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 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>国債先物取引 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日の清算値段によっております。</p> <p>本マザー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>
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 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年3月21日現在)
1. 計算日における受益権総数	25,197,025,278口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2375円 (12,375円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

(自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)
<p>1. 金融商品に対する取組方針 本マザーファンドは、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 本マザー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>

## 3. 金融商品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、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。

## 4. 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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年3月21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)

(自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)
該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 1 開示対象ファンドの計算期間における本マザーファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(平成24年3月21日現在)
同計算期間の期首元本額	24,726,329,684円
同計算期間中の追加設定元本額	3,357,669,492円
同計算期間中の一部解約元本額	2,886,973,898円
同計算期間末日の元本額	25,197,025,278円
上記元本額の内訳	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(債券重視型)	1,568,492,970円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(標準型)	499,605,757円

ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(株式重視型)	97,941,189円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)	1,314,674,216円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)	2,110,910,578円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)	467,591,082円
DCニッセイ国内債券アクティブ	741,665,732円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(標準型)VA(適格機関投資家専用)	208,846,715円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	9,882,756,616円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	6,619,093,748円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)SA(適格機関投資家限定)	153,180,228円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	1,345,226,764円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(毎月分配型)	61,542,438円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(成長重視型)	24,672,738円
DCニッセイバランスアクティブ	100,824,507円
合計	25,197,025,278円

## 2 有価証券関係

(平成24年3月21日現在)

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	41,108,624
合計	41,108,624

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、本マザーファンドの期首(平成23年12月21日)から計算日までの期間に対応するものであります。

## 3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

(平成24年3月21日現在)

債券関連

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	国債先物取引 買建	853,875,750	-	849,300,000	4,575,750
	合計	853,875,750	-	849,300,000	4,575,750

(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日の清算値段によっております。

(注2) 評価損益の算定方法

評価損益は、本マザーファンドの期首(平成23年12月21日)から計算日までの期間に対応する

ものであります。

（注3）上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（3）附属明細表（平成24年3月21日現在）

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296回利付国債(2年)	0.100	2012/9/15	142,500,000	142,497,150	
	第298回利付国債(2年)	0.100	2012/11/15	1,647,800,000	1,647,757,484	
	第300回利付国債(2年)	0.200	2013/1/15	1,534,900,000	1,536,035,933	
	第305回利付国債(2年)	0.200	2013/6/15	1,037,300,000	1,038,492,895	
	第307回利付国債(2年)	0.200	2013/8/15	142,600,000	142,786,806	
	第308回利付国債(2年)	0.100	2013/9/15	188,700,000	188,684,904	
	第310回利付国債(2年)	0.200	2013/11/15	301,900,000	302,367,945	
	第311回利付国債(2年)	0.200	2013/12/15	355,200,000	355,778,976	
	第67回利付国債(5年)	1.300	2012/9/20	314,200,000	316,003,234	
	第82回利付国債(5年)	0.900	2014/3/20	121,200,000	123,094,356	
	第89回利付国債(5年)	0.400	2015/6/20	827,600,000	833,724,240	
	第93回利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	602,600,000	608,740,494	
	第94回利付国債(5年)	0.600	2015/12/20	1,296,800,000	1,314,812,552	
	第95回利付国債(5年)	0.600	2016/3/20	976,800,000	990,279,840	
	第96回利付国債(5年)	0.500	2016/3/20	463,300,000	467,868,138	
	第97回利付国債(5年)	0.400	2016/6/20	1,273,700,000	1,280,361,451	
	第98回利付国債(5年)	0.300	2016/6/20	81,200,000	81,284,448	
	第99回利付国債(5年)	0.400	2016/9/20	689,000,000	692,045,380	
	第101回利付国債(5年)	0.400	2016/12/20	254,600,000	255,488,554	
	第1回利付国債(40年)	2.400	2048/3/20	53,800,000	58,671,052	
	第2回利付国債(40年)	2.200	2049/3/20	41,800,000	43,301,038	
	第244回利付国債(10年)	1.000	2012/12/20	17,200,000	17,311,630	
	第256回利付国債(10年)	1.400	2013/12/20	38,300,000	39,163,282	
	第260回利付国債(10年)	1.600	2014/6/20	265,000,000	273,742,350	
	第267回利付国債(10年)	1.300	2014/12/20	338,500,000	349,155,980	
	第271回利付国債(10年)	1.200	2015/6/20	35,600,000	36,785,836	
	第285回利付国債(10年)	1.700	2017/3/20	117,300,000	125,147,370	
	第286回利付国債(10年)	1.800	2017/6/20	318,000,000	341,528,820	
	第288回利付国債(10年)	1.700	2017/9/20	1,344,400,000	1,438,628,996	
	第289回利付国債(10年)	1.500	2017/12/20	109,900,000	116,451,139	
	第299回利付国債(10年)	1.300	2019/3/20	533,700,000	558,175,482	
	第301回利付国債(10年)	1.500	2019/6/20	1,145,000,000	1,212,669,500	
	第302回利付国債(10年)	1.400	2019/6/20	551,200,000	579,763,184	
第303回利付国債(10年)	1.400	2019/9/20	1,354,400,000	1,423,867,176		
第307回利付国債(10年)	1.300	2020/3/20	8,600,000	8,949,504		
第309回利付国債(10年)	1.100	2020/6/20	607,500,000	621,575,775		
第310回利付国債(10年)	1.000	2020/9/20	174,500,000	176,710,915		
第314回利付国債(10年)	1.100	2021/3/20	358,800,000	364,612,560		
第315回利付国債(10年)	1.200	2021/6/20	533,200,000	544,978,388		
第317回利付国債(10年)	1.100	2021/9/20	6,700,000	6,775,643		
第320回利付国債(10年)	1.000	2021/12/20	526,400,000	526,400,000		
第321回利付国債(10年)	1.000	2022/3/20	132,400,000	132,159,032		

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7回利付国債(30年)	2.300	2032/5/20	62,100,000	67,539,960	
	第10回利付国債(30年)	1.100	2033/3/20	133,800,000	117,476,400	
	第13回利付国債(30年)	2.000	2033/12/20	189,900,000	195,986,295	
	第14回利付国債(30年)	2.400	2034/3/20	12,900,000	14,253,726	
	第16回利付国債(30年)	2.500	2034/9/20	124,100,000	139,231,513	
	第20回利付国債(30年)	2.500	2035/9/20	40,700,000	45,704,879	
	第23回利付国債(30年)	2.500	2036/6/20	127,300,000	143,059,740	
	第24回利付国債(30年)	2.500	2036/9/20	123,600,000	138,894,264	
	第26回利付国債(30年)	2.400	2037/3/20	44,400,000	48,990,960	
	第27回利付国債(30年)	2.500	2037/9/20	67,700,000	76,112,402	
	第29回利付国債(30年)	2.400	2038/9/20	215,100,000	237,821,013	
	第30回利付国債(30年)	2.300	2039/3/20	99,500,000	107,752,530	
	第31回利付国債(30年)	2.200	2039/9/20	34,800,000	36,952,032	
	第32回利付国債(30年)	2.300	2040/3/20	5,700,000	6,172,929	
	第33回利付国債(30年)	2.000	2040/9/20	57,600,000	58,556,160	
	第34回利付国債(30年)	2.200	2041/3/20	161,800,000	171,512,854	
	第35回利付国債(30年)	2.000	2041/9/20	259,600,000	263,260,360	
	第23回利付国債(20年)	5.500	2013/9/20	84,300,000	91,054,959	
	第27回利付国債(20年)	5.000	2014/9/22	469,300,000	525,897,580	
	第30回利付国債(20年)	3.700	2015/9/21	47,600,000	53,392,920	
	第55回利付国債(20年)	2.000	2022/3/21	14,900,000	16,297,173	
	第56回利付国債(20年)	2.000	2022/6/20	89,100,000	97,462,926	
	第64回利付国債(20年)	1.900	2023/9/20	47,800,000	51,594,364	
	第65回利付国債(20年)	1.900	2023/12/20	5,400,000	5,821,794	
	第68回利付国債(20年)	2.200	2024/3/20	392,600,000	435,786,000	
	第69回利付国債(20年)	2.100	2024/3/20	69,500,000	76,372,855	
	第70回利付国債(20年)	2.400	2024/6/20	257,800,000	291,739,370	
	第72回利付国債(20年)	2.100	2024/9/20	160,800,000	176,228,760	
	第74回利付国債(20年)	2.100	2024/12/20	194,700,000	213,116,673	
	第80回利付国債(20年)	2.100	2025/6/20	47,300,000	51,660,587	
	第81回利付国債(20年)	2.000	2025/9/20	49,200,000	53,060,724	
	第85回利付国債(20年)	2.100	2026/3/20	37,300,000	40,566,734	
	第87回利付国債(20年)	2.200	2026/3/20	38,500,000	42,349,230	
	第88回利付国債(20年)	2.300	2026/6/20	575,200,000	639,300,288	
	第90回利付国債(20年)	2.200	2026/9/20	1,018,200,000	1,116,303,570	
	第91回利付国債(20年)	2.300	2026/9/20	218,900,000	242,919,897	
	第92回利付国債(20年)	2.100	2026/12/20	109,700,000	118,646,035	
	第93回利付国債(20年)	2.000	2027/3/20	87,200,000	92,931,656	
	第94回利付国債(20年)	2.100	2027/3/20	100,000	107,934	
	第95回利付国債(20年)	2.300	2027/6/20	337,600,000	372,710,400	
	第98回利付国債(20年)	2.100	2027/9/20	11,400,000	12,259,560	
	第100回利付国債(20年)	2.200	2028/3/20	1,100,000	1,195,414	
第101回利付国債(20年)	2.400	2028/3/20	52,000,000	57,958,680		
第102回利付国債(20年)	2.400	2028/6/20	445,900,000	496,349,126		
第103回利付国債(20年)	2.300	2028/6/20	182,300,000	200,294,833		
第105回利付国債(20年)	2.100	2028/9/20	214,700,000	229,452,037		
第106回利付国債(20年)	2.200	2028/9/20	238,900,000	258,781,258		

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110回利付国債（20年）	2.100	2029/3/20	94,200,000	100,422,852
	第111回利付国債（20年）	2.200	2029/6/20	46,700,000	50,417,320
	第112回利付国債（20年）	2.100	2029/6/20	26,600,000	28,320,222
	第113回利付国債（20年）	2.100	2029/9/20	87,000,000	92,501,010
	第116回利付国債（20年）	2.200	2030/3/20	283,600,000	305,020,308
	第117回利付国債（20年）	2.100	2030/3/20	54,600,000	57,886,920
	第121回利付国債（20年）	1.900	2030/9/20	94,300,000	96,815,924
	第128回利付国債（20年）	1.900	2031/6/20	48,900,000	50,027,145
	第129回利付国債（20年）	1.800	2031/6/20	95,900,000	96,520,473
	第130回利付国債（20年）	1.800	2031/9/20	12,000,000	12,069,600
合計				28,967,800,000	30,135,522,560

## 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。

### 3. 「ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド」の状況

#### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成24年3月21日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	665,013,412
コール・ローン	41,147,798
株式	23,248,561,094
投資証券	139,639,326
派生商品評価勘定	88,582,561
未収入金	41,765,739
未収配当金	23,674,827
流動資産合計	24,248,384,757
資産合計	24,248,384,757
負債の部	
流動負債	



派生商品評価勘定	117,023,739
未払解約金	23,700,748
流動負債合計	140,724,487
負債合計	140,724,487
純資産の部	
元本等	
元本	27,298,011,184
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,190,350,914
純資産合計	24,107,660,270
負債純資産合計	24,248,384,757

## (2) 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>(1) 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日に知りうる直近の日の最終相場によっております。</p> <p>(2) 投資証券 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日に知りうる直近の日の最終相場によっております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> <p>本マザーファンドにおける派生商品評価勘定は、為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、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ております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式の配当落ち日において、その予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年3月21日現在)
1. 計算日における受益権総数	27,298,011,184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	3,190,350,914円
3．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8831円 (8,831円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

(自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)	
1．金融商品に対する取組方針	本マザーファンドは、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。
2．金融商品の内容及びそのリスク	本マザー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。これらは投資証券の価格変動リスク、株価変動リスク、金利変動リスク、為替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。
3．金融商品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、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。
4．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。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年3月21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、投資証券 （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）

（自平成23年9月21日 至平成24年3月21日）
該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 開示対象ファンドの計算期間における本マザーファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成24年3月21日現在）
同計算期間の期首元本額	29,476,472,931円
同計算期間中の追加設定元本額	3,771,436,965円
同計算期間中の一部解約元本額	5,949,898,712円
同計算期間末日の元本額	27,298,011,184円
上記元本額の内訳	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	430,677,122円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	431,000,648円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	295,801,558円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	360,732,861円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	1,820,547,183円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	1,411,330,599円
DCニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式	9,550,722,369円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	180,261,578円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	2,664,057,382円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	5,608,523,979円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	454,259,350円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	2,792,782,067円

ニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式S A(適格機関投資家限定)	133,361,343円
ニッセイ/パトナム・バランスアップオープン	1,046,247,645円
DCニッセイバランスアクティブ	117,705,500円
合計	27,298,011,184円

## 2 有価証券関係

(平成24年3月21日現在)

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,283,500,790
投資証券	4,025,612
合計	3,279,475,178

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、本マザーファンドの期首(平成23年12月21日)から計算日までの期間に対応するものであります。

## 3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

(平成24年3月21日現在)

通貨関連

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)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	3,301,463,588	-	3,394,228,477	92,764,889
	香港ドル	126,394,808	-	128,419,984	2,025,176
	英ポンド	539,948,786	-	554,363,576	14,414,790
	イスラエルシェケル	89,068,608	-	92,381,248	3,312,640
	ユーロ	140,125,085	-	144,205,515	4,080,430
	計	4,197,000,875	-	4,313,598,800	116,597,925
	買建				
	米ドル	895,537,287	-	919,690,424	24,153,137
	カナダドル	866,545,452	-	888,570,564	22,025,112
	オーストラリアドル	386,627,041	-	387,880,442	1,253,401
	香港ドル	57,278,317	-	58,977,380	1,699,063
	シンガポールドル	175,472,039	-	179,109,450	3,637,411
	スイスフラン	908,476,001	-	932,328,000	23,851,999
	デンマーククローネ	97,991,837	-	100,650,320	2,658,483
	ノルウェークローネ	98,612,030	-	98,649,982	37,952
	スウェーデンクローネ	335,249,240	-	339,840,404	4,591,164
	ユーロ	151,641,631	-	155,890,656	4,249,025
	計	3,973,430,875	-	4,061,587,622	88,156,747
合計	8,170,431,750	-	8,375,186,422	28,441,178	

(注1) 時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

1. 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

2. 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2) 評価損益の算定方法

評価損益は、本マザーファンドの期首(平成23年12月21日)から計算日までの期間に対応するものであります。

(注3) 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。

(3) 附属明細表(平成24年3月21日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
ACCENTURE PLC-CL A	57,500	63.08	3,627,100.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	254,100	8.06	2,048,046.00	
AETNA INC	101,700	46.30	4,708,710.00	
AFLAC INC	57,200	47.56	2,720,432.00	
AMAZON.COM INC	16,900	192.33	3,250,377.00	
AON CORP	56,500	48.68	2,750,420.00	
APACHE CORP	22,800	105.61	2,407,908.00	
APPLE INC	9,200	605.96	5,574,832.00	
AVON PRODUCTS INC	76,200	18.86	1,437,132.00	
BAKER HUGHES INC	70,200	47.82	3,356,964.00	
BEST BUY CO INC	62,515	26.29	1,643,519.35	
CABOT OIL & GAS CORP	51,200	33.16	1,697,792.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	37,300	35.15	1,311,095.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	58,200	55.13	3,208,566.00	
CBRE GROUP INC - A	103,200	20.77	2,143,464.00	
CENTURYLINK INC	78,700	39.15	3,081,105.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	23,200	183.99	4,268,568.00	
CISCO SYSTEMS INC	160,100	20.57	3,293,257.00	
COCA-COLA ENTERPRISES	78,700	28.32	2,228,784.00	
COVIDIEN PLC	41,700	53.87	2,246,379.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	61,200	51.44	3,148,128.00	
DISH NETWORK CORP-A	72,200	31.20	2,252,640.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	38,205	71.15	2,718,285.75	
EXPRESS SCRIPTS INC	76,000	52.78	4,011,280.00	
FORD MOTOR CO	196,900	12.54	2,469,126.00	
HANESBRANDS INC	85,400	29.07	2,482,578.00	
HOMEAWAY INC	83,100	25.15	2,089,965.00	
JOHNSON CONTROLS INC	58,600	32.38	1,897,468.00	
JPMORGAN CHASE & CO	112,700	45.38	5,114,326.00	
KBR INC	53,600	36.72	1,968,192.00	
LENNAR CORP-A	85,800	26.43	2,267,694.00	
LORILLARD INC	12,300	130.40	1,603,920.00	
LOWE'S COS INC	99,400	30.59	3,040,646.00	
MARATHON OIL CORP	64,900	33.82	2,194,918.00	
MARSH & MCLENNAN COS	71,900	32.64	2,346,816.00	
MONSANTO CO	50,300	79.09	3,978,227.00	
MORGAN STANLEY	143,200	20.41	2,922,712.00	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	48,800	81.86	3,994,768.00	
NOBLE ENERGY INC	26,600	98.70	2,625,420.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	70,500	26.23	1,849,215.00	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
OCEANEERING INTL INC	54,300	53.60	2,910,480.00	
OIL STATES INTERNATIONAL INC	29,000	82.07	2,380,030.00	
OWENS CORNING	55,900	36.50	2,040,350.00	
PALL CORP	39,900	59.70	2,382,030.00	
PFIZER INC	297,092	21.80	6,476,605.60	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	60,300	86.54	5,218,362.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,400	63.49	2,057,076.00	
POST HOLDINGS INC	33,100	29.78	985,718.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	49,400	46.88	2,315,872.00	
PRECISION CASTPARTS CORP	8,300	173.01	1,435,983.00	
PRICELINE.COM INC	3,500	696.465	2,437,627.50	
PULTEGROUP INC	240,800	9.21	2,217,768.00	
QUALCOMM INC	35,600	66.75	2,376,300.00	
SALESFORCE.COM INC	22,600	150.99	3,412,374.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	175,800	15.38	2,703,804.00	
STANDARD PACIFIC CORP	263,700	4.59	1,210,383.00	
STATE STREET CORP	59,400	45.90	2,726,460.00	
STRYKER CORP	26,800	54.82	1,469,176.00	
TE CONNECTIVITY LTD	64,900	36.63	2,377,287.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,500	43.06	1,873,110.00	
TOLL BROTHERS INC	82,900	24.14	2,001,206.00	
TYCO INTERNATIONAL LTD	69,300	52.85	3,662,505.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,700	54.78	3,763,386.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	130,100	39.63	5,155,863.00	
WAL-MART STORES INC	38,100	60.60	2,308,860.00	
WELLS FARGO & CO	262,700	34.32	9,015,864.00	
WW GRAINGER INC	21,100	212.19	4,477,209.00	
米ドル 小計	5,197,912	-	193,372,464.20 (16,181,407,804)	
AGRIUM INC	16,800	87.60	1,471,680.00	
カナダドル 小計	16,800	-	1,471,680.00 (124,386,394)	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	272,545	5.92	1,613,466.40	
NEWCREST MINING LTD	100,876	29.32	2,957,684.32	
ORIGIN ENERGY LTD	119,746	12.93	1,548,315.78	
オーストラリアドル 小計	493,167	-	6,119,466.50 (537,656,327)	
AIA GROUP LTD	405,600	27.70	11,235,120.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	371,000	46.00	17,066,000.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	251,000	32.75	8,220,250.00	
香港ドル 小計	1,027,600	-	36,521,370.00 (393,700,368)	
BG GROUP PLC	342,113	15.135	5,177,880.25	
CARNIVAL PLC	53,372	20.35	1,086,120.20	
COMPASS GROUP PLC	307,390	6.565	2,018,015.35	
KINGFISHER PLC	688,547	3.008	2,071,149.37	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
PERSIMMON PLC	230,031	6.60	1,518,204.60	
STANDARD CHARTERED PLC	95,773	16.24	1,555,353.52	
TELECITY GROUP PLC	294,779	7.12	2,098,826.48	
TUI TRAVEL PLC	369,992	1.91	706,684.72	
TULLOW OIL PLC	144,951	15.01	2,175,714.51	

XSTRATA PLC	89,093	11.46	1,021,005.78
英ポンド 小計	2,616,041	-	19,428,954.78 (2,579,193,747)
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	40,503	54.60	2,211,463.80
AXA SA	169,954	13.005	2,210,251.77
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,987	6.68	1,743,393.16
DANONE	30,683	51.84	1,590,606.72
FIAT INDUSTRIAL	127,055	8.195	1,041,215.72
FIAT SPA	581,709	4.63	2,693,312.67
GEMALTO	27,845	48.685	1,355,633.82
INDITEX	32,986	71.74	2,366,415.64
JERONIMO MARTINS	63,930	14.415	921,550.95
KERRY GROUP PLC-A	23,274	34.05	792,479.70
LANXESS AG	31,102	55.60	1,729,271.20
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	23,215	58.95	1,368,524.25
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	27,786	45.15	1,254,537.90
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	168,178	26.885	4,521,465.53
SANOFI	55,988	58.43	3,271,378.84
UNICREDIT SPA	447,380	4.14	1,852,153.20
ユーロ 小計	2,112,575	-	30,923,654.87 (3,432,216,454)
合計			23,248,561,094 (23,248,561,094)

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	BLACKSTONE GROUP LP	108,500	1,668,730.00	
	米ドル 小計	108,500	1,668,730.00 (139,639,326)	
合計			139,639,326 (139,639,326)	

- (注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。
2. 種類ごとの計及び合計金額欄は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

## 4. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
米ドル	株式 67 銘柄	69.60 %	- %	69.78 %
	投資証券 1 銘柄	- %	100.00 %	
カナダドル	株式 1 銘柄	0.54 %	- %	0.53 %
オーストラリアドル	株式 3 銘柄	2.31 %	- %	2.30 %
香港ドル	株式 3 銘柄	1.69 %	- %	1.68 %
英ポンド	株式 10 銘柄	11.10 %	- %	11.03 %
ユーロ	株式 16 銘柄	14.76 %	- %	14.68 %
合計		100.00 %	100.00 %	100.00 %

(注) 組入株式時価比率及び組入投資証券時価比率は、株式及び投資証券の合計額に対する各通貨ごとの比率であります。

## 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。

## 4. 「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」の状況

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成24年3月21日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	945,071,319
コール・ローン	153,545,448
国債証券	16,019,953,852
地方債証券	282,649,519
特殊債券	1,428,720,744
社債券	755,964,853
派生商品評価勘定	139,215,167
未収入金	28,287,719
未収利息	130,054,339
前払費用	84,793,743
流動資産合計	19,968,256,703
資産合計	19,968,256,703
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	189,059,758
未払金	287,706,743
未払解約金	24,661,993
流動負債合計	501,428,494
負債合計	501,428,494
純資産の部	
元本等	
元本	10,658,731,220
剰余金	



剰余金又は欠損金( )	8,808,096,989
純資産合計	19,466,828,209
負債純資産合計	19,968,256,703

## (2) 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	国債証券・地方債証券・特殊債券・社債券 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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  本マザーファンドにおける派生商品評価勘定は、為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、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ております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年3月21日現在)
1. 計算日における受益権総数	10,658,731,220口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8264円 (18,264円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

(自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)
1. 金融商品に対する取組方針 本マザーファンドは、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。

## 2．金融商品の内容及びそのリスク

本マザー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、為替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。

## 3．金融商品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、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。

## 4．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。

### 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年3月21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・地方債証券・特殊債券・社債券 (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)

(自平成23年9月21日 至平成24年3月21日)
該当事項はありません。

### (その他の注記)

#### 1 開示対象ファンドの計算期間における本マザーファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(平成24年3月21日現在)
同計算期間の期首元本額	10,865,792,487円
同計算期間中の追加設定元本額	580,546,150円
同計算期間中の一部解約元本額	787,607,417円
同計算期間末日の元本額	10,658,731,220円

上記元本額の内訳	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	199,816,188円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	99,998,316円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	45,740,492円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	167,413,249円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	422,408,335円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	218,285,702円
DCニッセイ/パトナム・グローバル債券	1,334,291,959円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	41,818,669円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,234,395,565円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	1,299,239,934円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	70,156,539円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	462,097,606円
ニッセイ/パトナム・グローバル債券SA（適格機関投資家限定）	5,032,938,194円
DCニッセイバランスアクティブ	30,130,472円
合計	10,658,731,220円

## 2 有価証券関係

(平成24年3月21日現在)

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	326,670,877
地方債証券	2,939,961
特殊債券	2,696,981
社債券	7,585,957
合計	319,327,900

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、本マザーファンドの期首（平成23年12月21日）から計算日までの期間に対応するものであります。

## 3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

(平成24年3月21日現在)

通貨関連

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）

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	4,298,653,732	-	4,409,043,631	110,389,899
	カナダドル	377,205,799	-	389,167,072	11,961,273
	オーストラリアドル	39,466,735	-	39,012,121	454,614
	シンガポールドル	11,228,412	-	11,430,120	201,708
	英ポンド	1,189,413,289	-	1,215,335,532	25,922,243
	スイスフラン	537,937,748	-	551,300,800	13,363,052
	デンマーククローネ	13,885,065	-	14,238,156	353,091
	スウェーデンクローネ	216,607,730	-	222,103,011	5,495,281
	ポーランドズロチ	20,969,564	-	21,310,597	341,033
	ユーロ	770,387,077	-	790,546,950	20,159,873
	計	7,475,755,151	-	7,663,487,990	187,732,839
	買建				
	米ドル	3,177,101,419	-	3,253,719,504	76,618,085
	カナダドル	1,364,493,437	-	1,388,379,368	23,885,931
	オーストラリアドル	1,125,014,913	-	1,131,771,653	6,756,740
	シンガポールドル	152,160,207	-	155,314,380	3,154,173
	ノルウェークローネ	475,035,562	-	476,719,129	1,683,567
	スウェーデンクローネ	709,733,915	-	718,730,114	8,996,199
メキシコペソ	264,659,223	-	275,869,262	11,210,039	
ポーランドズロチ	170,390,516	-	174,722,175	4,331,659	
ユーロ	37,165,959	-	38,417,814	1,251,855	
計	7,475,755,151	-	7,613,643,399	137,888,248	
合計	14,951,510,302	-	15,277,131,389	49,844,591	

## (注1) 時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

1. 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
2. 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

## (注2) 評価損益の算定方法

評価損益は、本マザーファンドの期首（平成23年12月21日）から計算日までの期間に対応するものであります。

(注3) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (3) 附属明細表（平成24年3月21日現在）

## 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	評価額	備考
----	----	-----------	-----	------	-----	----

国債 証券	US TREASURY NOTE/BOND	0.375	2012/10/31	3,000,000.00	3,003,390.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	1.250	2014/4/15	9,800,000.00	9,963,072.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	1.000	2016/8/31	17,000,000.00	16,940,160.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	3.125	2016/10/31	7,640,000.00	8,318,584.80		
	US TREASURY NOTE/BOND	2.750	2016/11/30	8,690,000.00	9,320,025.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	4.250	2017/11/15	3,070,000.00	3,542,473.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	2.750	2017/12/31	3,640,000.00	3,903,900.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	3.500	2018/2/15	2,000,000.00	2,227,500.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	5.250	2028/11/15	3,800,000.00	4,890,106.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	5.250	2029/2/15	200,000.00	257,842.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	6.250	2030/5/15	4,800,000.00	6,918,720.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	4.500	2036/2/15	440,000.00	527,859.20		
	US TREASURY NOTE/BOND	4.375	2039/11/15	100,000.00	117,875.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	4.375	2041/5/15	3,000,000.00	3,537,180.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	3.750	2041/8/15	1,500,000.00	1,589,055.00		
	米ドル 小計				68,680,000.00	75,057,742.00	(6,280,831,851)
	CANADA GOVT	4.000	2017/6/1	1,700,000.00	1,886,405.00		
	CANADA GOVT	5.000	2037/6/1	400,000.00	555,084.00		
	カナダドル 小計				2,100,000.00	2,441,489.00	(206,354,650)
	AUSTRALIAN GOVT	5.500	2013/12/15	5,300,000.00	5,454,495.00		
	オーストラリアドル 小計				5,300,000.00	5,454,495.00	(479,231,931)
	UK GILT	2.750	2015/1/22	1,890,000.00	2,003,154.30		
	UK GILT	3.750	2019/9/7	3,090,000.00	3,489,197.10		
	UK GILT	4.000	2022/3/7	500,000.00	569,740.00		
	UK GILT	4.250	2039/9/7	3,840,000.00	4,383,974.40		
	英ポンド 小計				9,320,000.00	10,446,065.80	(1,386,715,235)
	SWISS GOVT	2.000	2022/5/25	6,110,000.00	6,749,839.20		
	スイスフラン 小計				6,110,000.00	6,749,839.20	(621,052,705)
	DENMARK BULLET	4.000	2017/11/15	7,000,000.00	8,041,530.00		
	DENMARK BULLET	7.000	2024/11/10	2,680,000.00	4,026,324.80		
	デンマーククローネ 小計				9,680,000.00	12,067,854.80	(180,173,072)
	SWEDISH GOVT	3.750	2017/8/12	3,800,000.00	4,207,018.00		
	SWEDISH GOVT	3.500	2039/3/30	1,500,000.00	1,780,950.00		
スウェーデンクローネ 小計				5,300,000.00	5,987,968.00	(74,490,322)	

種類	銘柄	利率 (%)	償還日	券面総額	評価額	備考
----	----	-----------	-----	------	-----	----

国債証券	MALAYSIA GOVT	3.835	2015/8/12	3,875,000.00	3,952,306.25	
	マレーシアリングット 小計			3,875,000.00	3,952,306.25	(107,226,069)
	BUNDES OBLIGATION	4.250	2012/10/12	4,197,000.00	4,293,740.85	
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1.500	2013/3/15	6,700,000.00	6,786,497.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250	2014/1/4	14,750,000.00	15,782,352.50	
	DEUTSCHLAND REP	6.000	2016/6/20	4,813,000.00	5,813,285.79	
	DEUTSCHLAND REP	4.750	2028/7/4	710,000.00	893,073.50	
	DEUTSCHLAND REP	4.250	2039/7/4	2,200,000.00	2,840,200.00	
	FINLAND GOVT	1.750	2016/4/15	880,000.00	903,161.60	
	FINLAND GOVT	3.500	2021/4/15	690,000.00	749,974.80	
	FRANCE OAT	3.750	2021/4/25	7,380,000.00	7,899,847.20	
	FRANCE OAT	3.250	2021/10/25	2,910,000.00	2,994,302.70	
	FRENCH T-NOTE	2.500	2016/7/25	4,320,000.00	4,475,692.80	
	NETHERLANDS GOVT	4.000	2037/1/15	1,420,000.00	1,707,379.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.500	2015/7/15	1,690,000.00	1,815,499.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.500	2021/9/15	1,740,000.00	1,837,648.80	
	SPANISH GOVT	5.500	2021/4/30	1,380,000.00	1,427,886.00	
	ユーロ 小計			55,780,000.00	60,220,542.54	(6,683,878,017)
国債証券 計					16,019,953,852	(16,019,953,852)
地方債証券	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.700	2012/12/18	3,260,000.00	3,344,173.20	
	カナダドル 小計			3,260,000.00	3,344,173.20	(282,649,519)
	地方債証券 計					282,649,519
特殊債券	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN	1.750	2015/10/6	6,600,000.00	6,604,290.00	
	FHLMC GOLD A17598	6.500	2034/1/1	11,721.64	13,346.02	
	FHLMC GOLD A20871	6.500	2034/4/1	44,099.04	50,210.28	
	FHLMC GOLD C52510	6.500	2031/5/1	14,442.79	16,444.27	
	FHLMC GOLD G08008	6.500	2034/7/1	37,574.17	42,604.97	
	FNMA 545477	7.000	2032/3/1	35,284.02	40,646.13	
	FNMA 555571	6.500	2033/3/1	17,009.83	19,377.76	
	FNMA 602285	6.500	2031/8/1	10,255.27	11,682.90	
	FNMA 609480	7.000	2031/10/1	11,087.06	12,776.28	
	FNMA 797553	5.000	2020/4/1	10,153.78	11,002.22	
	FNMA 813915	4.500	2020/11/1	29,644.98	31,806.98	
	FNW 2003-W1 2A	7.08359	2042/12/1	547,561.01	634,809.38	
	FNW 2003-W3 1A1	6.500	2042/8/1	10,666.95	11,964.26	
	GNMA 781542	6.000	2033/1/1	31,420.51	35,690.55	
	KFW	4.000	2020/1/27	1,180,000.00	1,300,832.00	
	米ドル 小計			8,590,921.05	8,837,484.00	(739,520,661)

種類	銘柄	利率 (%)	償還日	券面総額	評価額	備考
----	----	-----------	-----	------	-----	----

特殊 債券	AFRICAN DEVELOPMENT BANK	4.850	2012/7/24	2,200,000.00	2,226,444.00	
	カナダドル 小計			2,200,000.00	2,226,444.00	(188,179,047)
	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.500	2014/9/5	6,500,000.00	6,663,475.00	
	ノルウェークローネ 小計			6,500,000.00	6,663,475.00	(96,953,561)
	EDF SA	5.000	2018/2/5	400,000.00	453,028.00	
	EUROPEAN UNION	3.250	2018/4/4	2,010,000.00	2,142,157.50	
	SVENSK EXPORTKREDIT AB	3.625	2014/5/27	1,000,000.00	1,045,390.00	
	ユーロ 小計			3,410,000.00	3,640,575.50	(404,067,475)
	特殊債券 計					1,428,720,744
社債券	BACM 2006-5 A2	5.317	2047/9/1	1,007,355.08	1,022,082.60	
	BACM 2007-2 A2	5.634	2049/4/1	278,912.80	283,935.99	
	CD 2007-CD4 A2B	5.205	2049/12/1	237,044.35	239,386.34	
	CSMC 2007-C4 A2	5.79383	2039/9/1	414,069.97	414,554.41	
	DLJCM 1998-CG1 B4	7.21232	2031/6/1	244,000.00	255,802.28	
	GECMC 2003-C2 D	5.326	2037/7/1	275,000.00	282,977.75	
	GSMS 2006-GG6 A2	5.506	2038/4/1	135,957.05	138,103.81	
	JPMCC 2006-LDP9 A2S	5.298	2047/5/1	426,012.06	438,115.06	
	JPMCC 2007-LD12 A3	5.98351	2051/2/1	546,000.00	586,223.82	
	JPMCC 2007-LDPX A3S	5.317	2049/1/1	316,000.00	328,586.28	
	MLCFC 2006-1 A2	5.439	2039/2/1	41,526.75	41,544.19	
	MLCFC 2006-3 A2	5.291	2046/7/1	658,661.78	673,158.91	
	MLCFC 2006-4 A2FL	0.36175	2049/12/12	206,528.23	206,412.57	
	MLMT 2007-C1 A2	5.7357	2050/6/1	374,125.44	375,621.94	
	MLMT 2007-C1 A3	5.8397	2050/6/1	39,000.00	40,740.96	
	MSC 2006-HQ9 A2	5.618	2044/7/1	106,520.20	106,628.85	
	MSC 2006-T23 A2	5.74376	2041/8/1	105,861.09	107,350.55	
	MSC 2007-IQ14 A2	5.610	2049/4/1	179,808.70	183,964.07	
	MSC 2012-C4 XA	2.896	2045/3/1	6,065,000.00	940,317.60	
	MSRR 2010-C30 A3B	5.8702	2043/12/1	310,143.00	318,256.34	
	米ドル 小計			11,967,526.50	6,983,764.32	(584,401,398)
	EPRE 1-X A	1.32456	2014/4/27	778,925.20	755,557.44	
	英ポンド 小計			778,925.20	755,557.44	(100,300,250)
	FORTUM OYJ	4.500	2016/6/20	450,000.00	498,109.50	
	GE CAPITAL TRUST IV	4.625	2066/9/15	165,000.00	143,959.20	
	ユーロ 小計			615,000.00	642,068.70	(71,263,205)
	社債券 計					755,964,853
合計					18,487,288,968	(18,487,288,968)

- (注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。
2. 種類ごとの計及び合計金額欄は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
----	-----	--------------	--------------------

米ドル	国債証券	15 銘柄	33.98 %	41.14 %
	特殊債券	15 銘柄	4.00 %	
	社債券	20 銘柄	3.16 %	
カナダドル	国債証券	2 銘柄	1.12 %	3.67 %
	地方債証券	1 銘柄	1.53 %	
	特殊債券	1 銘柄	1.02 %	
オーストラリアドル	国債証券	1 銘柄	2.59 %	2.59 %
英ポンド	国債証券	4 銘柄	7.50 %	8.04 %
	社債券	1 銘柄	0.54 %	
スイスフラン	国債証券	1 銘柄	3.36 %	3.36 %
デンマーククローネ	国債証券	2 銘柄	0.97 %	0.97 %
ノルウェークローネ	特殊債券	1 銘柄	0.52 %	0.52 %
スウェーデンクローネ	国債証券	2 銘柄	0.40 %	0.40 %
マレーシアリングギット	国債証券	1 銘柄	0.58 %	0.58 %
ユーロ	国債証券	15 銘柄	36.15 %	38.73 %
	特殊債券	3 銘柄	2.19 %	
	社債券	2 銘柄	0.39 %	
合計			100.00 %	100.00 %

（注）組入債券時価比率は、公社債の合計額に対する各公社債の各通貨ごとの比率であります。

## 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】

（平成24年4月27日現在）

資産総額	468,833,873 円
負債総額	674,538 円



純資産総額( - )	468,159,335 円
発行済数量	522,218,453 口
1万口当たり純資産額( / ×10000)	8,965 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24年4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年間に於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24年4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	156	17,695
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	2	201
単位型公社債投資信託	0	0
合計	158	17,896

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。

(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）の財務諸表及び第16期事業年度（自平成22年4月1日 至平成23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17期事業年度に係る中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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。

#### 財務諸表

##### (1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	第15期 (平成22年3月31日現在)	第16期 (平成23年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	7,338,891	6,270,894
有価証券	7,509,155	11,023,094
前払費用	1 167,143	1 195,613
未収委託者報酬	1,639,083	1,751,247
未収運用受託報酬	1 621,865	1 656,202
未収投資助言報酬	1 176,080	1 171,421
未収収益	26,952	-
未収金	9,402	-
貯蔵品	13,545	-
繰延税金資産	253,992	295,260
その他	68	64,039
流動資産合計	17,756,180	20,427,773

#### 固定資産

有形固定資産				
建物	2	158,855	2	133,329
車両		-	2	5,095
器具備品	2	163,773	2	179,790
有形固定資産合計		322,629		318,215
無形固定資産				
電信加入権		292		-
電話加入権		7,942		-
ソフトウェア		1,516,892		1,372,451
ソフトウェア仮勘定		49,810		51,575
その他		-		8,203
無形固定資産合計		1,574,938		1,432,230
投資その他の資産				
投資有価証券		18,457,108		16,986,491
差入保証金		-	1	284,824
長期差入保証金	1	282,326		-
預託金		458		-
繰延税金資産		665,854		500,589
その他		-		17
投資その他の資産合計		19,405,748		17,771,923
固定資産合計		21,303,315		19,522,370
資産合計		39,059,496		39,950,144

## 負債の部

流動負債				
預り金		29,359		28,412
未払収益分配金		5,024		4,324
未払償還金		159,114		151,440
未払手数料	1	565,051	1	683,709
未払運用委託報酬		438,086		391,985
未払投資助言報酬		100,080		106,084
その他未払金	1	170,412	1	187,916
未払費用	1	53,471	1	119,099
未払法人税等		71,382		145,709
未払消費税等		22,816		-
賞与引当金		502,405		552,829
その他		12,777		42,559
流動負債合計		2,129,982		2,414,070
固定負債				
退職給付引当金		537,616		644,223
役員退職慰労引当金		12,962		11,275
その他		-	1	66,068
固定負債合計		550,578		721,566

負債合計	2,680,560	3,135,637
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	17,323,750	17,625,364
利益剰余金合計	18,003,557	18,305,171
株主資本合計	36,285,397	36,587,011
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	93,537	227,494
評価・換算差額等合計	93,537	227,494
純資産合計	36,378,935	36,814,506
負債・純資産合計	39,059,496	39,950,144

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,527,251	11,004,207
運用受託報酬	3,551,530	3,873,347
投資助言報酬	780,375	751,384
業務受託料	-	47,100
その他営業収益	47,100	-
営業収益計	15,906,257	15,676,039
営業費用		
支払手数料	4,836,212	4,548,772
広告宣伝費	20,846	110,792
公告費	-	466
受益証券発行費	6,873	-
調査費	2,876,269	2,708,450
支払運用委託報酬	1,628,406	1,442,927
支払投資助言報酬	409,100	448,879
委託調査費	-	20,521
調査費	838,762	796,121

委託計算費		106,973		104,902
営業雑経費		454,818		543,623
通信費		58,544		57,003
印刷費		177,070		175,972
協会費		17,981		17,084
販売事務費		24,802		-
その他営業雑経費		176,419		293,563
営業費用計		8,301,993		8,017,006
一般管理費				
役員報酬	1	60,906	1	62,167
給料・手当		3,003,448		2,985,814
賞与引当金繰入額		489,537		547,443
賞与		240,551		256,821
福利厚生費		501,440		550,141
海外派遣関係費		89,982		-
退職給付費用		109,004		163,211
退職給付負担金		64,509		-
役員退職慰労引当金繰入額		4,600		5,550
役員退職慰労金		-		637
その他人件費		6,257		135,147
不動産賃借料		662,795		635,759
その他不動産経費		-		38,835
交際費		17,004		14,220
旅費交通費		69,949		87,941
固定資産減価償却費		604,130		627,055
租税公課		79,700		77,387
業務委託費		156,825		183,393
器具備品賃借料		4,057		-
器具備品費		152,994		178,045
保守料		-		92,961
保険料		-		63,246
寄付金		-		820
諸経費		252,151		39,883
一般管理費計		6,569,846		6,746,486
営業利益		1,034,417		912,546
営業外収益				
受取利息		7,927		3,284
有価証券利息		127,716		107,994
受取配当金		88,280		102,558
雑収入		14,354		-
その他営業外収益		-		22,945
営業外収益計		238,280		236,783
営業外費用				
為替差損		1,142		9,852
雑損失		6,007		-
その他営業外費用		-		15,292
営業外費用計		7,150		25,144

経常利益		1,265,547		1,124,185
特別利益				
投資有価証券売却益		123,026		35,991
投資有価証券償還益		32,782		351
事故受取保険金		-	3	5,462
前期支払投資助言報酬戻入益		25,605		-
前期支払運用委託報酬戻入益		31,404		-
役員退職慰労引当金戻入益		583		-
特別利益計		213,401		41,804
特別損失				
投資有価証券売却損		424,493		17,676
投資有価証券償還損		54,263		355,993
投資有価証券評価損		118,045		5,706
固定資産除却損	4	3,290	4	16,762
事故損失賠償金	2	478	2	22,343
その他特別損失		230		-
特別損失計		600,801		418,482
税引前当期純利益		878,147		747,507
法人税、住民税及び事業税		337,932		272,647
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		43,138		37,686
法人税等合計		373,369		310,333
当期純利益		504,778		437,174

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第16期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	10,000,000	10,000,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,281,840	8,281,840
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計		
前期末残高	8,281,840	8,281,840
当期変動額		
当期変動額合計	-	-



当期末残高	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	139,807	139,807
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	120,000	120,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	120,000	120,000
研究開発積立金		
前期末残高	70,000	70,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	70,000	70,000
別途積立金		
前期末残高	350,000	350,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	350,000	350,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	16,954,532	17,323,750
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	504,778	437,174
当期変動額合計	369,218	301,614
当期末残高	17,323,750	17,625,364
利益剰余金合計		
前期末残高	17,634,339	18,003,557
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	504,778	437,174
当期変動額合計	369,218	301,614
当期末残高	18,003,557	18,305,171
株主資本合計		
前期末残高	35,916,179	36,285,397
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	504,778	437,174
当期変動額合計	369,218	301,614
当期末残高	36,285,397	36,587,011
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	93,537

当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,488,449	133,956
当期変動額合計	1,488,449	133,956
当期末残高	93,537	227,494
評価・換算差額等合計		
前期末残高	1,394,911	93,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,488,449	133,956
当期変動額合計	1,488,449	133,956
当期末残高	93,537	227,494
純資産合計		
前期末残高	34,521,267	36,378,935
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	504,778	437,174
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,488,449	133,956
当期変動額合計	1,857,668	435,570
当期末残高	36,378,935	36,814,506

## （重要な会計方針）

第15期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	第16期 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <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>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>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>満期保有目的の債券 同左</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>
2. 固定資産の減価償却の方法	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、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>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>有形固定資産 定率法によっております。主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年あります。</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> <p>4. 引当金の計上基準 賞与引当金 同左</p>
--	---

<p>第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)</p>	<p>第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)</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>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>退職給付引当金 同左</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>

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。	6. 消費税及び地方消費税の会計処理 同左
-------------------------------------	--------------------------

## (表示方法の変更)

第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第16期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
(貸借対照表)	(貸借対照表) 重要性の観点等から、表示方法を次のように変更することに致しました。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・前期まで区分掲記していた「未収収益」「未収金」「貯蔵品」は、流動資産の「その他」に含めて表示しております。</li> <li>・前期まで区分掲記していた「電信加入権」「電話加入権」は、無形固定資産の「その他」に含めて表示しております。</li> <li>・前期まで「長期差入保証金」として表示していたものは、「差入保証金」として表示しております。</li> <li>・前期まで区分掲記していた「預託金」は、投資その他の資産の「その他」に含めて表示しております。</li> <li>・前期まで区分掲記していた「未払消費税等」は、流動負債の「その他」に含めて表示しております。</li> </ul>

第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第16期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
---------------------------------------	---------------------------------------

<p>(損益計算書)</p> <p>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。</p>	<p>(損益計算書)</p> <p>重要性の観点等から、表示方法を次のように変更することに致しました。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・前期まで「その他営業収益」として表示していたものは、「業務受託料」として表示しております。</li> <li>・前期まで区分掲記していた「受益証券発行費」「販売事務費」は、「その他営業雑経費」に含めて表示しております。</li> <li>・前期まで「調査費」に含めて表示していた「委託調査費」は、区分掲記しております。</li> <li>・前期まで区分掲記していた「海外派遣関係費」は、「その他人件費」に含めて表示しております。</li> <li>・前期まで区分掲記していた「退職給付負担金」は、「退職給付費用」に含めて表示しております。</li> <li>・前期まで「諸経費」に含めて表示していた「役員退職慰労金」「保守料」「保険料」は、区分掲記しております。尚、前期における「役員退職慰労金」「保守料」「保険料」のそれぞれの金額は、1,491千円、93,768千円、63,571千円であります。</li> <li>・前期まで「不動産賃借料」に含めて表示していた「その他不動産経費」は、区分掲記しております。</li> <li>・前期まで区分掲記していた「器具備品賃借料」は、「諸経費」に含めて表示しております。</li> <li>・前期まで「雑収入」「雑損失」として表示していたものは、それぞれ「その他営業外収益」「その他営業外費用」として表示しております。</li> </ul>
---	--

## (注記事項)

## (貸借対照表関係)

第15期 (平成22年3月31日現在)	第16期 (平成23年3月31日現在)																														
<p>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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="width: 70%;">未収運用受託報酬</td><td style="text-align: right;">229,597千円</td></tr> <tr><td>未収投資助言報酬</td><td style="text-align: right;">171,926千円</td></tr> <tr><td>前払費用</td><td style="text-align: right;">52,971千円</td></tr> <tr><td>長期差入保証金</td><td style="text-align: right;">265,746千円</td></tr> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">78,620千円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">5,080千円</td></tr> <tr><td>その他未払金</td><td style="text-align: right;">15,052千円</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	前払費用	52,971千円	長期差入保証金	265,746千円	未払手数料	78,620千円	未払費用	5,080千円	その他未払金	15,052千円	<p>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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="width: 70%;">前払費用</td><td style="text-align: right;">60,402千円</td></tr> <tr><td>未収運用受託報酬</td><td style="text-align: right;">296,706千円</td></tr> <tr><td>未収投資助言報酬</td><td style="text-align: right;">152,956千円</td></tr> <tr><td>差入保証金</td><td style="text-align: right;">280,262千円</td></tr> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">88,132千円</td></tr> <tr><td>その他未払金</td><td style="text-align: right;">14,956千円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">60,986千円</td></tr> <tr><td>その他固定負債</td><td style="text-align: right;">66,068千円</td></tr> </table>	前払費用	60,402千円	未収運用受託報酬	296,706千円	未収投資助言報酬	152,956千円	差入保証金	280,262千円	未払手数料	88,132千円	その他未払金	14,956千円	未払費用	60,986千円	その他固定負債	66,068千円
未収運用受託報酬	229,597千円																														
未収投資助言報酬	171,926千円																														
前払費用	52,971千円																														
長期差入保証金	265,746千円																														
未払手数料	78,620千円																														
未払費用	5,080千円																														
その他未払金	15,052千円																														
前払費用	60,402千円																														
未収運用受託報酬	296,706千円																														
未収投資助言報酬	152,956千円																														
差入保証金	280,262千円																														
未払手数料	88,132千円																														
その他未払金	14,956千円																														
未払費用	60,986千円																														
その他固定負債	66,068千円																														

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 169,123千円	建物 187,418千円
器具備品 585,673千円	車両 1,919千円
合計 754,796千円	器具備品 592,884千円
	合計 782,221千円

## (損益計算書関係)

第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23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.
取締役 180,000千円 監査役 30,000千円	同左
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。	2.
	同左
3.	3.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.固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。	4.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 2,957千円	建物 8,300千円
ソフトウェア 333千円	器具備品 8,461千円
合計 3,290千円	合計 16,762千円

## (株主資本等変動計算書関係)

第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1.発行済株式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	前事業年度末発行済株式総数
普通株式 108,448株	普通株式 108,448株
当事業年度末発行済株式総数	当事業年度末発行済株式総数
普通株式 108,448株	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	当事業年度に増加または減少した発行済株式数
なし	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>	<p>配当金支払額 平成22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</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22年3月31日 効力発生日 平成22年6月25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23年6月27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23年3月31日 効力発生日 平成23年6月27日</p>

## (リース取引関係)

第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23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>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>		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	<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>3,237</td> <td>2,461</td> <td>776</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額</p>		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	3,237	2,461	776
	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																						
	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	3,237	2,461	776																						

1年内	1,329千円	1年内	342千円
1年超	804千円	1年超	462千円
合計	2,134千円	合計	804千円
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、減価償却費相当額及び支払利息相当額	
支払リース料	2,169千円	支払リース料	1,383千円
減価償却費相当額	1,979千円	減価償却費相当額	1,258千円
支払利息相当額	103千円	支払利息相当額	53千円
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。		減価償却費相当額の算定方法 同左	
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。		利息相当額の算定方法 同左	
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		2. オペレーティング・リース取引	
1年内	510千円	—	
1年超	-		
合計	510千円		

## (金融商品関係)

前事業年度（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、適切に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
その他有価証券	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
その他有価証券	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、「投資有価証券その他有価証券」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	-	-	-	-
その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。

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23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、適切なり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23年3月31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。

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)。

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	6,270,894	6,270,894	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,028,251	4,044,880	16,628
その他有価証券	6,994,842	6,994,842	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	10,512,627	10,567,760	55,132
その他有価証券	6,341,364	6,341,364	-

### (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

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 その他有価証券」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・預金	6,270,894	-	-	-
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	-	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	8,732,095	2,405,100	1,236,025	-
その他(注)	8,732,095	2,405,100	1,236,025	-
合計	19,002,989	12,805,100	1,236,025	-

（注）譲渡性預金、投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

（有価証券関係）

前事業年度（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（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）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。

当事業年度(平成23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	12,507,839	12,583,440	75,600
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,507,839	12,583,440	75,600
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	2,033,039	2,029,200	3,839
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,033,039	2,029,200	3,839
合計		14,540,878	14,612,640	71,761

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	5,493,181	5,495,142	1,961
	国債・地方債等	5,493,181	5,495,142	1,961
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	2,608,636	3,659,502	1,050,865
小計		8,101,818	9,154,645	1,052,826
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	999,761	999,700	61
	国債・地方債等	999,761	999,700	61
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	3,835,995	3,181,862	654,133
小計		4,835,756	4,181,562	654,194
合計		12,937,574	13,336,207	398,632

(注1) 譲渡性預金、投資信託受益証券、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資等でありませ

ず。  
(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22年4月1日 至平成23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)
561,210	35,991	17,676

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5,706千円(その他有価証券の投資信託受益証券5,706千円)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。

当事業年度(自平成22年4月1日 至平成23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。この他、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。

当事業年度(自平成22年4月1日 至平成23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. 退職給付債務に関する事項

(1)退職給付債務	644,223千円
(2)退職給付引当金	644,223千円

(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. 退職給付費用に関する事項

(1)勤務費用	130,059千円
(2)退職給付負担金	33,151千円

(3)合計 163,211千円

(注)この他、福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金43,211千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15期 (平成22年3月31日現在)	第16期 (平成23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 200,962千円	賞与引当金 221,131千円
未払事業税 21,062千円	未払事業税 18,935千円
その他 32,093千円	その他 55,977千円
繰延税金資産合計 254,117千円	繰延税金資産合計 296,044千円
繰延税金負債	繰延税金負債
有価証券評価差額 28千円	有価証券評価差額 784千円
その他 97千円	繰延税金負債合計 784千円
繰延税金負債合計 125千円	繰延税金資産の純額 295,260千円
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 215,046千円	退職給付引当金 257,689千円
役員退職慰労引当金 5,185千円	役員退職慰労引当金 4,510千円
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 5,310千円
投資有価証券評価損 695,776千円	投資有価証券評価損 539,831千円
投資有価証券評価差額 327,794千円	投資有価証券評価差額 261,653千円
その他 5,018千円	その他 30,323千円
小計 1,255,430千円	小計 1,099,317千円
円	円
評価性引当額 126,659千円	評価性引当額 120,282千円
円	円
繰延税金資産合計 1,128,770千円	繰延税金資産合計 979,034千円
円	
繰延税金負債	繰延税金負債
特別分配金否認 63,801千円	特別分配金否認 58,098千円
投資有価証券評価差額 399,115千円	投資有価証券評価差額 420,346千円
繰延税金負債合計 462,916千円	繰延税金負債合計 478,445千円
繰延税金資産の純額 665,854千円	繰延税金資産の純額 500,589千円

<p>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</p> <p>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。</p>	<p>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</p> <p>同左</p>
--	---

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

前事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

当社は、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。

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31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]

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23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	2,096,879

[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]

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

該当事項はありません。

[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]

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（追加情報）

当事業年度から「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。

（関連当事者との取引）

前事業年度（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ズ株式会社	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勤定等の取得	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。）

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23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

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%	兼任有 出向有 転籍有	営業 取引	運用受託報酬 の受取	1,352,450	未収運用受 託報酬	296,706
								投資助言報酬 の受取	697,329	未収投資助 言報酬	152,956

(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。

## 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15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
1株当たり純資産額	335,450円49銭	1株当たり純資産額	339,466円90銭
1株当たり当期純利益金額	4,654円56銭	1株当たり当期純利益金額	4,031円18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の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
当期純利益	504,778千円	437,174千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株主に係る当期純利益	504,778千円	437,174千円
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。

当事業年度(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第17期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		1,915,645
有価証券		14,510,640
未収委託者報酬		1,693,267
未収運用受託報酬		901,745
未収投資助言報酬		165,835
繰延税金資産		189,016
その他		302,313
流動資産合計		19,678,463
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	292,426
無形固定資産		1,357,827
投資その他の資産		
投資有価証券		17,148,577
繰延税金資産		707,428
その他		284,450
投資その他の資産合計		18,140,456
固定資産合計		19,790,709
資産合計		39,469,173
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払運用委託報酬		450,621
未払投資助言報酬		132,217
その他未払金		115,419
未払費用		112,560
未払法人税等		68,119
前受投資助言報酬		70,455
賞与引当金		332,982
その他		881,810
流動負債合計		2,164,186
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金		704,019
役員退職慰労引当金		11,725
その他		35,575
固定負債合計		751,320
負債合計		2,915,506
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		

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	17,743,435
利益剰余金合計	18,423,242
株主資本合計	36,705,082
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	151,415
評価・換算差額等合計	151,415
純資産合計	36,553,666
負債・純資産合計	39,469,173

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第17期中間会計期間	
(自平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	5,305,764
運用受託報酬	1,962,058
投資助言報酬	364,956
業務受託料	23,550
営業収益計	7,656,329
営業費用	3,846,408
一般管理費	1 3,379,396
営業利益	430,524
営業外収益	2 74,967
営業外費用	3 6,666
経常利益	498,825
特別利益	4 25,290
特別損失	5 95,074
税引前中間純利益	429,041
法人税、住民税及び事業税	38,652
法人税等調整額	136,758
法人税等合計	175,410
中間純利益	253,630

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第17期中間会計期間	
(自平成23年4月1日 至 平成23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	17,625,364
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	253,630
当中間期変動額合計	118,070
当中間期末残高	17,743,435
利益剰余金合計	

前期末残高	18,305,171
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	253,630
当中間期変動額合計	118,070
当中間期末残高	18,423,242
株主資本合計	
前期末残高	36,587,011
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	253,630
当中間期変動額合計	118,070
当中間期末残高	36,705,082
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	227,494
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）	378,910
当中間期変動額合計	378,910
当中間期末残高	151,415
評価・換算差額等合計	
前期末残高	227,494
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）	378,910
当中間期変動額合計	378,910
当中間期末残高	151,415
純資産合計	
前期末残高	36,814,506
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	253,630
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	378,910
当中間期変動額合計	260,839
当中間期末残高	36,553,666

## （重要な会計方針）

項目	第17期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30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。 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>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	<p>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。</p>
5．リース取引の処理方法	<p>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。</p>
6．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。なお、仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。</p>

## （追加情報）

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

## （注記事項）

[ 中間貸借対照表関係 ]

<p>第17期中間会計期間末 （平成23年9月30日現在）</p>	
1．有形固定資産の減価償却累計額	780,433千円

## [ 中間損益計算書関係 ]

第17期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	46,609千円
無形固定資産	266,699千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
有価証券利息	43,968千円
受取配当金	23,038千円
受取利息	1,567千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	5,821千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	25,290千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	1,778千円
投資有価証券償還損	87,378千円
事故損失賠償金	30千円
固定資産除却損 器具備品	5,887千円

## [ 中間株主資本等変動計算書関係 ]

第17期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23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23年6月27日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成23年3月31日	平成23年6月27日

## [ リース取引関係 ]

第17期中間会計期間  
（自 平成23年4月1日  
至 平成23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 862	千円 330	千円 532

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1年内	171千円
1年超	375千円
合計	547千円

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	268千円
減価償却費相当額	244千円
支払利息相当額	11千円

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17期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成23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を参照ください）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金 有価証券	1,915,645	1,915,645	-



満期保有目的の債券	4,014,240	4,028,080	13,839
その他有価証券	10,496,400	10,496,400	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,017,242	11,074,340	57,097
その他有価証券	6,063,834	6,063,834	-

## (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

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67,500千円)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17期中間会計期間末(平成23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	13,520,429	13,592,830	72,400
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	13,520,429	13,592,830	72,400
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	1,511,053	1,509,590	1,463
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,511,053	1,509,590	1,463
合計		15,031,482	15,102,420	70,937

## 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	6,992,009	6,997,350	5,341
	国債・地方債等	6,992,009	6,997,350	5,341
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	2,572,596	3,199,499	626,903
	小計	9,564,605	10,196,849	632,244
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	3,499,245	3,499,050	195
	国債・地方債等	3,499,245	3,499,050	195
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,714,015	2,864,335	849,679
	小計	7,213,260	6,363,385	849,875
	合計	16,777,865	16,560,234	217,630

（注1）投資信託受益証券、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資等であります。

（注2）非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）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17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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
日本生命保険相互会社	1,067,973

## [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17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23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17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

該当事項はありません。

## [ 1株当たり情報 ]

	第17期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
1株当たり純資産額	337,061円69銭
1株当たり中間純利益	2,338円73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	253,630千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	<u>253,630千円</u>
期中平均株式数	108千株

## [ 重要な後発事象 ]

第17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

該当事項はありません。

## 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】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」「1 名称、資本金の額及び事業の内容」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

#### (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23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23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23年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
株式会社静岡銀行	90,845百万円	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
日本生命保険相互会社	1,100,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

#### (3) 投資顧問会社

##### a. 名称

ザ・パトナム・アドバイザーズ・カンパニー・エルエルシー

##### b. 資本金の額

平成23年9月末現在、204,000米ドル（約15百万円、1米ドル = 76.65円）

(注) 資本の額はCapital-Issued and Outstanding（発行済流通株式資本）を記載しております。

##### c. 事業の内容

内外の有価証券等に関する投資顧問業務およびその他付帯関連する一切の業務を営んでいます。

## 独立監査人の監査報告書

平成23年6月7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23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23年11月28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 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23年4月1日から平成24年3月31日までの第17期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23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、中間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な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、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成23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23年4月1日から平成23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。

#### 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

---

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24年5月10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 山田 信之 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎 雅則 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DCニッセイバランスアクティブの平成23年9月21日から平成24年3月21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。

#### 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、不正また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の表示がないかどうかの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、DCニッセイバランスアクティブの平成24年3月21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。

#### 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、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。