

**【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25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 - 4608
<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24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>

基本方針

（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24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1,243億ドル(約10兆円)、投信残高は約635億ドル(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）

信託金の上限

（略）

ファンドの分類

（略）

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

社団法人 投資信託協会ホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

###### <訂正後>

基本方針

（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24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1,269億ドル(約9兆円)、投信残高は約625億ドル(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400万人にのぼります。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148名有しています。

( 略 )

信託金の上限

( 略 )

ファンドの分類

( 略 )

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

### ( 3 ) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

( 略 )

委託会社の概況(平成24年10月末現在)

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社

( 略 )

< 訂正後 >

( 略 )

委託会社の概況(平成25年4月末現在)

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社

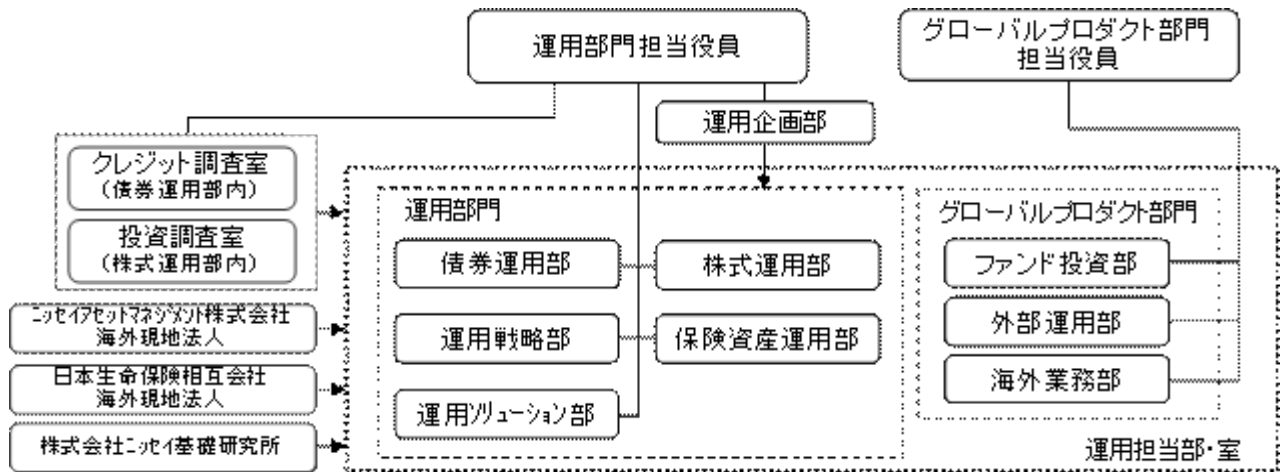
( 略 )

## 2 【投資方針】

### ( 3 ) 【運用体制】

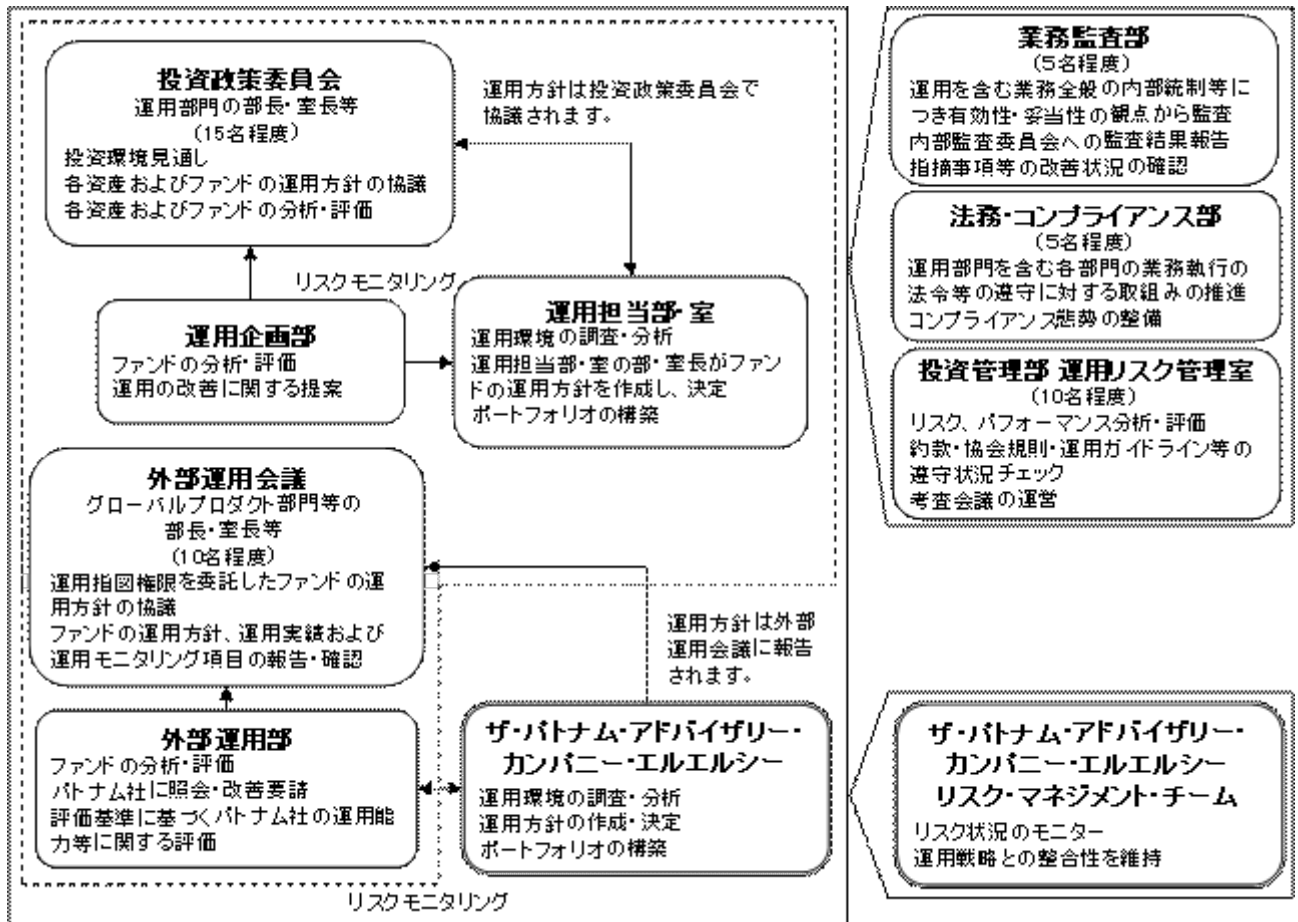
原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」「(3) 運用体制」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。

## 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25年4月30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	605,181,234	97.75
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		13,905,030	2.25
純資産総額		619,086,264	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25年4月30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	23,061,235,600	98.18
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		427,928,476	1.82
純資産総額		23,489,164,076	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） （2013年6月限）	東京証券取引所	350,145,240	373,440,000	1.59

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

（平成25年4月30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	29,105,529,657	96.44
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,073,311,205	3.56
純資産総額		30,178,840,862	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） （2013年6月限）	東京証券取引所	869,235,750	867,180,000	2.87

「ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド」

（平成25年4月30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	17,015,541,040	61.11
	イギリス	4,520,525,306	16.24
	フランス	1,186,703,411	4.26
	スペイン	718,498,935	2.58
	オーストラリア	502,026,891	1.80
	オランダ	451,542,281	1.62
	アイルランド	362,605,705	1.30
	スイス	260,930,635	0.94
	バミューダ	260,363,601	0.94
	ドイツ	243,713,953	0.88
	カナダ	231,707,900	0.83
	シンガポール	218,151,322	0.78
	オーストリア	215,174,625	0.77
	ジャージー	209,793,440	0.75
	イタリア	197,493,391	0.71
	香港	176,706,123	0.64
	スウェーデン	154,314,503	0.56
	小計	26,925,793,062	96.71
投資証券	アメリカ	188,323,661	0.68
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		729,091,732	2.61
純資産総額		27,843,208,455	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25年4月30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	6,208,371,231	30.86
	イギリス	2,091,200,250	10.40
	ドイツ	1,535,866,091	7.64
	イタリア	1,474,502,454	7.33
	スペイン	1,431,709,753	7.12
	フランス	875,239,086	4.35
	ベルギー	787,054,207	3.91
	オーストラリア	543,373,735	2.70
	オーストリア	495,755,621	2.46
	カナダ	384,156,627	1.91
	スウェーデン	248,270,440	1.23
	アイルランド	224,490,658	1.12
	フィンランド	222,731,067	1.11
	デンマーク	215,376,831	1.07
	マレーシア	127,690,251	0.63
小計	16,865,788,302	83.84	
特殊債券	国際機関	510,917,616	2.54
	オランダ	263,914,294	1.31
	ドイツ	135,151,377	0.67
	スウェーデン	132,976,496	0.66
	アメリカ	78,400,176	0.39
	フランス	60,267,672	0.30
	小計	1,181,627,631	5.87
社債券	アメリカ	955,635,335	4.75
	フィンランド	64,250,866	0.32
	オーストラリア	39,400,266	0.20
	小計	1,059,286,467	5.27

コール・ローン、その他資産（負債控除後）	1,008,820,361	5.02
純資産総額	20,115,522,761	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25年4月30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	355,993,452	6,192	220,443,213	6,870	244,567,501	39.50
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	119,053,625	12,884	153,383,273	12,889	153,448,217	24.79
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	104,309,565	11,953	124,681,224	12,298	128,279,903	20.72
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	34,576,206	21,927	75,816,504	22,815	78,885,613	12.74
投資比率：合計									97.75

（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	-	97.75
合計		97.75

（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25年4月30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	215,400	3,880 5,640	835,752,000 1,214,856,000	5.17
2	日本	三菱UFJフィナンシャルG	株式	銀行業	1,513,300	440 663	665,852,000 1,003,317,900	4.27
3	日本	本田技研	株式	輸送用機器	173,700	3,015 3,875	523,705,500 673,087,500	2.87
4	日本	野村ホールディングス	株式	証券、商品先物取引業	738,100	429 793	316,644,900 585,313,300	2.49
5	日本	みずほフィナンシャルG	株式	銀行業	2,701,800	147 215	397,164,600 580,887,000	2.47
6	日本	三菱地所	株式	不動産業	160,000	1,844 3,165	295,040,000 506,400,000	2.16
7	日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	61,600	7,599 8,220	468,093,400 506,352,000	2.16
8	日本	アステラス製薬	株式	医薬品	86,100	4,010 5,670	345,261,000 488,187,000	2.08
9	日本	ブロードリーフ	株式	情報・通信業	252,500	1,251 1,802	315,756,399 455,005,000	1.94
10	日本	日本たばこ産業	株式	食料品	104,800	2,707 3,685	283,671,833 386,188,000	1.64



11	日本	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	情報・通信業	2,248	124,000 161,000	278,751,399 361,928,000	1.54
----	----	--------------	----	--------	-------	--------------------	----------------------------	------

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	東京急行	株式	陸運業	452,000	474 773	214,456,322 349,396,000	1.49
13	日本	日立	株式	電気機器	527,000	489 622	257,703,000 327,794,000	1.40
14	日本	三井住友フィナンシャルG	株式	銀行業	69,600	3,595 4,605	250,206,839 320,508,000	1.36
15	日本	オムロン	株式	電気機器	102,000	2,175 3,075	221,829,142 313,650,000	1.34
16	日本	キヤノン	株式	電気機器	86,700	3,356 3,495	290,982,877 303,016,500	1.29
17	日本	大塚ホールディングス	株式	医薬品	85,800	2,804 3,510	240,570,298 301,158,000	1.28
18	日本	住友不動産	株式	不動産業	65,000	4,311 4,600	280,241,600 299,000,000	1.27
19	日本	カカクコム	株式	サービス業	118,000	1,807 2,516	213,170,961 296,888,000	1.26
20	日本	小松製作所	株式	機械	111,500	2,094 2,659	233,481,000 296,478,500	1.26
21	日本	J S R	株式	化学	131,900	1,621 2,243	213,809,900 295,851,700	1.26
22	日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	59,500	3,635 4,825	216,282,500 287,087,500	1.22
23	日本	JXホールディングス	株式	石油・石炭製品	522,700	542 528	283,115,442 275,985,600	1.17
24	日本	麒麟HD	株式	食料品	161,000	1,053 1,707	169,484,085 274,827,000	1.17
25	日本	大阪瓦斯	株式	電気・ガス業	646,000	322 422	208,012,000 272,612,000	1.16
26	日本	トプコン	株式	精密機器	250,300	686 1,087	171,749,875 272,076,100	1.16
27	日本	スルガ銀行	株式	銀行業	158,000	1,059 1,722	167,322,000 272,076,000	1.16
28	日本	ヤマダ電機	株式	小売業	56,960	3,387 4,695	192,934,982 267,427,200	1.14
29	日本	アマダ	株式	機械	341,000	631 780	215,061,017 265,980,000	1.13
30	日本	旭化成	株式	化学	404,000	510 654	206,020,433 264,216,000	1.12
投資比率：合計								52.43

(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	輸送用機器	11.09
	銀行業	10.88
	電気機器	7.59
	情報・通信業	7.35
	化学	7.08
	機械	6.73
	医薬品	5.38

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	陸運業	4.65
	卸売業	4.59
	食料品	3.65
	不動産業	3.43
	小売業	3.38
	建設業	3.04
	証券、商品先物取引業	2.49
	保険業	2.22
	精密機器	2.19
	サービス業	2.09
	鉄鋼	1.59
	その他金融業	1.33
	石油・石炭製品	1.17
	電気・ガス業	1.16
	繊維製品	1.12
	非鉄金属	1.03
	ゴム製品	0.76
	海運業	0.69
	空運業	0.60
金属製品	0.53	
倉庫・運輸関連業	0.37	
合計	98.18	

（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25年4月30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313回 利付国債(2年)	0.100	2014/2/15	国債証券	2,434,900,000	100.03 100.03	2,435,518,536 2,435,518,536	8.07
2	日本	第106回 利付国債(5年)	0.200	2017/9/20	国債証券	1,976,900,000	99.89 99.87	1,974,639,732 1,974,310,261	6.54
3	日本	第309回 利付国債(10年)	1.100	2020/6/20	国債証券	1,464,400,000	105.26 104.93	1,541,461,910 1,536,565,632	5.09
4	日本	第315回 利付国債(2年)	0.100	2014/4/15	国債証券	1,219,500,000	100.00 100.00	1,219,549,716 1,219,549,716	4.04
5	日本	第97回 利付国債(20年)	2.200	2027/9/20	国債証券	959,800,000	115.68 116.19	1,110,337,816 1,115,172,424	3.70
6	日本	第305回 利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	国債証券	977,300,000	106.64 106.23	1,042,151,204 1,038,176,017	3.44
7	日本	第320回 利付国債(10年)	1.000	2021/12/20	国債証券	834,100,000	104.04 104.05	867,818,470 867,897,732	2.88
8	日本	第324回 利付国債(10年)	0.800	2022/6/20	国債証券	834,000,000	103.17 102.13	860,411,870 851,755,860	2.82
9	日本	第105回 利付国債(5年)	0.200	2017/6/20	国債証券	737,700,000	99.92 99.92	737,124,860 737,095,086	2.44
10	日本	第315回 利付国債(10年)	1.200	2021/6/20	国債証券	689,700,000	105.84 105.72	730,010,588 729,143,943	2.42
11	日本	第320回 利付国債(2年)	0.100	2014/9/15	国債証券	699,400,000	99.98 99.98	699,247,672 699,253,126	2.32

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303回 利付国債(10年)	1.400	2019/9/20	国債証券	636,900,000	106.99 106.76	681,419,310 679,948,071	2.25

13	日本	第118回 利付国債(20年)	2.000	2030/6/20	国債証券	575,500,000	111.68 110.98	642,695,714 638,661,125	2.12
14	日本	第324回 利付国債(2年)	0.100	2015/1/15	国債証券	594,200,000	99.97 99.97	593,995,198 594,045,508	1.97
15	日本	第128回 利付国債(20年)	1.900	2031/6/20	国債証券	469,100,000	108.43 108.17	508,647,000 507,420,779	1.68
16	日本	第93回 利付国債(20年)	2.000	2027/3/20	国債証券	443,500,000	113.47 113.79	503,218,461 504,636,475	1.67
17	日本	第306回 利付国債(10年)	1.400	2020/3/20	国債証券	463,000,000	107.41 106.98	497,300,895 495,335,920	1.64
18	日本	第310回 利付国債(10年)	1.000	2020/9/20	国債証券	443,200,000	104.36 104.19	462,505,792 461,778,944	1.53
19	日本	第102回 利付国債(20年)	2.400	2028/6/20	国債証券	386,700,000	118.01 118.48	456,336,731 458,162,160	1.52
20	日本	第317回 利付国債(2年)	0.100	2014/6/15	国債証券	384,000,000	100.00 99.98	384,000,000 383,934,720	1.27
21	日本	第16回 利付国債(30年)	2.500	2034/9/20	国債証券	323,400,000	114.90 117.62	371,575,537 380,383,080	1.26
22	日本	第36回 利付国債(30年)	2.000	2042/3/20	国債証券	332,500,000	103.80 108.65	345,122,811 361,267,900	1.20
23	日本	第35回 利付国債(30年)	2.000	2041/9/20	国債証券	325,100,000	109.33 108.55	355,424,372 352,892,799	1.17
24	日本	第5回 物価連動国債(10年)	0.800	2015/9/10	国債証券	331,600,000	103.70 104.97	343,881,137 348,088,810	1.15
25	日本	第117回 利付国債(20年)	2.100	2030/3/20	国債証券	299,200,000	118.14 112.71	353,480,728 337,237,296	1.12
26	日本	第98回 利付国債(20年)	2.100	2027/9/20	国債証券	286,800,000	115.04 114.85	329,940,088 329,375,460	1.09
27	日本	第319回 利付国債(2年)	0.100	2014/8/15	国債証券	327,400,000	99.99 99.98	327,374,693 327,334,520	1.08
28	日本	第103回 利付国債(5年)	0.300	2017/3/20	国債証券	281,300,000	100.82 100.35	283,606,660 282,273,298	0.94
29	日本	第105回 利付国債(20年)	2.100	2028/9/20	国債証券	244,300,000	117.80 114.14	287,775,628 278,831,805	0.92
30	日本	第325回 利付国債(10年)	0.800	2022/9/20	国債証券	270,100,000	102.05 102.05	275,630,447 275,634,349	0.91
投資比率：合計									70.25

(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	-	96.44
合計		96.44

(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25年4月30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	MONSANTO CO	株式	素材	67,900	8,977 10,428	609,559,050 708,093,792	2.54
2	アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	140,200	4,325 4,790	606,296,238 671,592,545	2.41
3	アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	各種金融	503,200	1,096 1,212	551,368,719 610,003,999	2.19
4	イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	エネルギー	182,452	3,366 3,307	614,134,673 603,376,792	2.17

5	イギリス	BG GROUP PLC	株式	エネルギー	336,818	1,552 1,643	522,601,453 553,252,565	1.99
6	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	48,257	9,377 10,697	452,485,795 516,186,840	1.85
7	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	10,800	50,523 42,117	545,650,755 454,867,384	1.63
8	アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	48,200	8,289 9,396	399,526,330 452,906,634	1.63
9	イギリス	COMPASS GROUP PLC	株式	消費者サービス	319,472	1,170 1,297	373,637,269 414,284,421	1.49
10	アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・サービス	23,600	14,877 16,441	351,099,163 388,002,125	1.39
11	アメリカ	LOWE'S COS INC	株式	小売	103,000	3,438 3,745	354,111,034 385,780,320	1.39
12	アメリカ	GOOGLE INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	4,634	70,513 80,202	326,758,035 371,657,714	1.33
13	アメリカ	CME GROUP INC	株式	各種金融	62,200	5,858 5,957	364,342,803 370,553,564	1.33
14	イギリス	PRUDENTIAL PLC	株式	保険	217,562	1,350 1,682	293,678,894 365,943,701	1.31
15	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	116,392	2,482 2,980	288,916,603 346,813,894	1.25
16	イギリス	BARCLAYS PLC	株式	銀行	760,985	414 440	314,895,434 334,598,506	1.20
17	アメリカ	TILE SHOP HLDGS INC	株式	食品・生活必需品小売り	134,327	1,611 2,436	216,371,782 327,254,100	1.18
18	アメリカ	SANDISK CORP	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	60,800	4,877 5,304	296,534,869 322,503,045	1.16
19	アメリカ	PULTE GROUP INC	株式	耐久消費財・アパレル	140,000	1,808 2,077	253,064,448 290,763,648	1.04
20	アメリカ	STANDARD PACIFIC CORP	株式	耐久消費財・アパレル	311,346	705 904	219,506,402 281,395,013	1.01
21	アメリカ	NOBLE ENERGY INC	株式	エネルギー	25,200	9,959 11,069	250,977,969 278,935,695	1.00
22	フランス	PERNOD-RICARD	株式	食品・飲料・タバコ	23,284	11,248 11,963	261,893,659 278,547,409	1.00
23	イギリス	PERSIMMON PLC	株式	耐久消費財・アパレル	165,003	1,118 1,664	184,441,657 274,535,275	0.99
24	スペイン	INDITEX SA	株式	小売	20,790	13,567 13,106	282,060,089 272,482,160	0.98
25	アメリカ	AETNA INC	株式	ヘルスケア機器・サービス	49,400	4,504 5,499	222,513,408 271,659,848	0.98

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	アメリカ	MARATHON OIL CORP	株式	エネルギー	82,800	3,058 3,192	253,205,844 264,313,498	0.95
27	オランダ	ING GROEP NV	株式	各種金融	323,325	891 811	287,999,401 262,090,582	0.94
28	アメリカ	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	株式	各種金融	60,800	3,878 4,307	235,809,211 261,836,513	0.94
29	アメリカ	MEADWESTVACO CORP	株式	素材	77,200	3,075 3,382	237,394,280 261,102,505	0.94
30	スイス	NESTLE SA	株式	食品・飲料・タバコ	37,527	6,284 6,953	235,837,381 260,930,635	0.94
投資比率：合計								41.15

（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25年4月30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	12.50
	各種金融	9.46
	銀行	7.77
	素材	7.56
	ヘルスケア機器・サービス	6.42
	保険	6.38
	ソフトウェア・サービス	6.21
	耐久消費財・アパレル	6.13
	資本財	5.45
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.95
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.52
	小売	3.81
	食品・飲料・タバコ	3.57
	消費者サービス	3.14
	半導体・半導体製造装置	1.53
	公益事業	1.46
	不動産	1.41
	食品・生活必需品小売り	1.18
	メディア	0.87
	電気通信サービス	0.86
自動車・自動車部品	0.78	
商業・専門サービス	0.75	
	小計	96.71
投資証券	-	0.68
	合計	97.39

(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25年4月30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25年4月30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	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.500	2022/9/4	国債証券	11,600,000	12,671	1,469,868,003	7.64
							13,240	1,535,866,091	
2	アメリカ	US TREASURY N/B	1.000	2016/8/31	国債証券	15,100,000	9,966	1,504,807,436	7.50
							9,993	1,508,962,280	
3	アメリカ	US TREASURY N/B	1.625	2022/11/15	国債証券	12,407,000	9,744	1,208,885,813	6.03
							9,784	1,213,848,632	
4	アメリカ	US TREASURY N/B	1.625	2022/8/15	国債証券	10,210,000	9,816	1,002,262,608	4.99
							9,827	1,003,352,350	
5	アメリカ	US TREASURY N/B	2.750	2016/11/30	国債証券	8,690,000	10,627	923,449,121	4.58
							10,603	921,389,883	
6	イギリス	TSY 4% 2022	4.000	2022/3/7	国債証券	4,991,000	18,244	910,555,609	4.55
							18,332	914,960,163	
7	フランス	FRANCE (GOVT OF)	3.250	2021/10/25	国債証券	5,980,000	14,353	858,306,739	4.35
							14,636	875,239,086	
8	アメリカ	US TREASURY N/B	3.125	2016/10/31	国債証券	7,640,000	10,754	821,573,084	4.07
							10,718	818,879,892	
9	ベルギー	BELGIUM KINGDOM	4.250	2022/9/28	国債証券	5,070,000	15,238	772,555,549	3.91
							15,524	787,054,207	

10	イギリス	UK TSY 1.75% 2022	1.750	2022/9/7	国債証券	4,810,000	15,277 15,300	734,821,812 735,908,816	3.66
11	イタリア	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.000	2017/2/1	国債証券	4,830,000	13,437 13,578	649,000,002 655,822,587	3.26
12	スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.500	2017/7/30	国債証券	4,570,000	13,660 14,193	624,252,341 648,631,215	3.22
13	スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.000	2015/7/30	国債証券	3,500,000	13,118 13,422	459,141,401 469,764,959	2.34
14	イタリア	BTPS 6.5 11/01/27	6.500	2027/11/1	国債証券	2,740,000	15,100 15,825	413,750,222 433,607,817	2.16
15	アメリカ	US TREASURY N/B	2.750	2017/12/31	国債証券	3,640,000	10,755 10,764	391,483,572 391,818,616	1.95
16	イタリア	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.500	2022/11/1	国債証券	2,660,000	14,246 14,476	378,941,610 385,072,050	1.91
17	アメリカ	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	国債証券	3,070,000	11,451 11,405	351,553,510 350,119,579	1.74
18	カナダ	CANADIAN GOVERNMENT	2.750	2022/6/1	国債証券	3,140,000	10,566 10,637	331,760,568 334,006,774	1.66
19	スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.500	2021/4/30	国債証券	2,180,000	13,163 14,372	286,946,337 313,313,579	1.56
20	国際機関	EUROPEAN UNION	3.250	2018/4/4	特殊債券	2,010,000	14,472 14,507	290,885,321 291,588,684	1.45
21	イギリス	TSY 2 3/4% 2015	2.750	2015/1/22	国債証券	1,670,000	15,826 15,832	264,299,368 264,398,151	1.31
22	オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.500	2021/9/15	国債証券	1,740,000	14,842 15,095	258,256,833 262,652,818	1.31
23	スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	3.500	2022/6/1	国債証券	14,200,000	1,742 1,748	247,341,232 248,270,440	1.23
24	オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.500	2023/4/21	国債証券	2,000,000	11,989 12,204	239,773,830 244,079,178	1.21

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	オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.500	2015/7/15	国債証券	1,690,000	13,921 13,793	235,262,546 233,102,803	1.16
26	オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.750	2022/7/15	国債証券	1,800,000	12,022 12,300	216,389,345 221,393,399	1.10
27	アイルランド	TREASURY 5% 2020	5.000	2020/10/18	国債証券	1,300,000	13,255 14,350	172,321,218 186,551,762	0.93
28	国際機関	EFSF	2.250	2022/9/5	特殊債券	1,360,000	13,213 13,504	179,694,004 183,656,407	0.91
29	イギリス	TSY 3 3/4% 2019	3.750	2019/9/7	国債証券	990,000	17,517 17,771	173,421,055 175,933,120	0.87
30	オランダ	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	2.250	2016/8/24	特殊債券	1,121,000	13,604 13,588	152,497,964 152,325,536	0.76
								投資比率：合計	83.32

(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25年4月30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	-	83.84
特殊債券	-	5.87
社債券	-	5.27
合計		94.98

(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25年4月30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25年4月30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 （2013年6月限）	買建	32	350,145,240	373,440,000	1.59

（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25年4月30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 （2013年6月限）	買建	6	869,235,750	867,180,000	2.87

（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25年4月30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 分配落：381,515,973	分配付：10,480 分配落：10,480
第8期末	(平成17年9月20日)	分配付：409,008,283 分配落：409,008,283	分配付：11,140 分配落：11,140
第9期末	(平成18年3月20日)	分配付：441,308,468 分配落：441,308,468	分配付：12,312 分配落：12,312
第10期末	(平成18年9月20日)	分配付：468,218,480 分配落：468,218,480	分配付：12,119 分配落：12,119
第11期末	(平成19年3月20日)	分配付：514,934,547 分配落：514,934,547	分配付：12,780 分配落：12,780
第12期末	(平成19年9月20日)	分配付：548,987,708 分配落：548,987,708	分配付：12,702 分配落：12,702
第13期末	(平成20年3月21日)	分配付：473,348,432 分配落：473,348,432	分配付：10,769 分配落：10,769
第14期末	(平成20年9月22日)	分配付：486,614,230 分配落：486,614,230	分配付：10,590 分配落：10,590
第15期末	(平成21年3月23日)	分配付：377,995,817 分配落：377,995,817	分配付：8,152 分配落：8,152
第16期末	(平成21年9月24日)	分配付：414,915,163 分配落：414,915,163	分配付：9,269 分配落：9,269
第17期末	(平成22年3月23日)	分配付：423,144,417 分配落：423,144,417	分配付：9,327 分配落：9,327
第18期末	(平成22年9月21日)	分配付：419,602,211 分配落：419,602,211	分配付：8,907 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
第22期末	(平成24年9月20日)	分配付：471,218,750 分配落：471,218,750	分配付：8,811 分配落：8,811
第23期末	(平成25年3月21日)	分配付：594,834,162 分配落：594,834,162	分配付：10,955 分配落：10,955
	平成24年4月末日	468,159,335	8,965
	5月末日	442,883,193	8,405
	6月末日	453,869,451	8,592
	7月末日	455,567,860	8,549
	8月末日	462,506,250	8,583
	9月末日	469,720,454	8,721
	10月末日	477,714,600	8,789
	11月末日	491,283,704	9,044
	12月末日	520,812,518	9,541
	平成25年1月末日	562,468,067	10,212
	2月末日	562,653,903	10,416
	3月末日	590,107,230	10,806
	平成25年4月30日	619,086,264	11,502

## 【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

		1万口当たり分配金
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
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
第22期	（平成24年9月20日）	0円
第23期	（平成25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%
------	----------------------------	--------

		収益率
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%
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%
第22期	自平成24年3月22日 至平成24年9月20日	4.42%
第23期	自平成24年9月21日 至平成25年3月21日	24.33%

(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

		設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
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

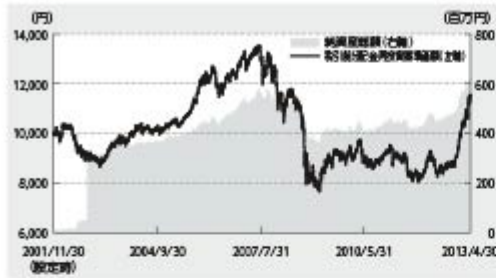
第15期	自平成20年9月23日 至平成21年3月23日	58,887,483	54,678,833	463,705,788
第16期	自平成21年3月24日 至平成21年9月24日	32,881,333	48,940,728	447,646,393
第17期	自平成21年9月25日 至平成22年3月23日	31,178,618	25,143,607	453,681,404
第18期	自平成22年3月24日 至平成22年9月21日	31,950,447	14,541,885	471,089,966
第19期	自平成22年9月22日 至平成23年3月22日	25,333,224	14,746,306	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
第22期	自平成24年3月22日 至平成24年9月20日	30,094,617	14,345,986	534,831,174
第23期	自平成24年9月21日 至平成25年3月21日	35,238,781	27,090,812	542,979,143

(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〉

2013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(四半報除)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。

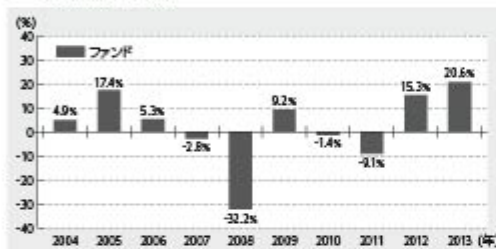
## ● 基準価額および純資産総額

基準価額	11,502円
純資産総額	619百万円

## ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

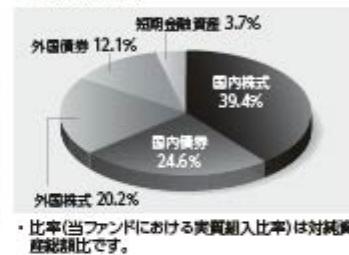
第19期	2011年3月22日	0円
第20期	2011年9月20日	0円
第21期	2012年3月21日	0円
第22期	2012年9月20日	0円
第23期	2013年3月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定以来累計		0円

## ● 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。  
 ・2013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



## ● 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	5.2%
2 三菱UFJフィナンシャルG	4.3%
3 本田技研	2.9%
4 野村ホールディングス	2.5%
5 みずほフィナンシャルG	2.5%

## 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313回 利付国債(2年)	8.1%
2 第106回 利付国債(5年)	6.5%
3 第309回 利付国債(10年)	5.1%
4 第315回 利付国債(2年)	4.0%
5 第97回 利付国債(20年)	3.7%

## 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 モンサント	アメリカ	2.5%
2 JPモルガン・チエース・アンド・カンパニー	アメリカ	2.4%
3 バンク・オブ・アメリカ	アメリカ	2.2%
4 ロイヤル・ダッチ/シエル	イギリス	2.2%
5 BGIグループ	イギリス	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	7.6%
2 アメリカ国債	米ドル	7.5%
3 アメリカ国債	米ドル	6.0%
4 アメリカ国債	米ドル	5.0%
5 アメリカ国債	米ドル	4.6%

■ 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2【管理及び運営】

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <訂正前>

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

（略）

##### <訂正後>

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金額をいいます。

（略）

### 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23期計算期間（平成24年9月21日から平成25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】

## DCニッセイバランスアクティブ

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 (平成24年9月20日現在)	第23期 (平成25年3月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	20,049,894	18,976,317
親投資信託受益証券	454,405,213	579,479,189
流動資産合計	474,455,107	598,455,506
資産合計	474,455,107	598,455,506
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	241,488	270,214
未払委託者報酬	2,898,340	3,243,122
その他未払費用	96,529	108,008
流動負債合計	3,236,357	3,621,344
負債合計	3,236,357	3,621,344
純資産の部		
元本等		
元本	534,831,174	542,979,143
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	63,612,424	51,855,019
純資産合計	471,218,750	594,834,162
負債純資産合計	474,455,107	598,455,506

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期 (自平成24年3月22日 至平成24年9月20日)	第23期 (自平成24年9月21日 至平成25年3月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,488	4,967
有価証券売買等損益	17,903,333	120,423,976
営業収益合計	17,897,845	120,428,943
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	241,488	270,214
委託者報酬	2,898,340	3,243,122
その他費用	96,529	108,008
営業費用合計	3,236,357	3,621,344
営業利益又は営業損失( )	21,134,202	116,807,599
経常利益又は経常損失( )	21,134,202	116,807,599
当期純利益又は当期純損失( )	21,134,202	116,807,599
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( )	885,832	2,466,298
期首剰余金又は期首欠損金( )	40,610,074	63,612,424
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,143,246	3,449,394
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,143,246	3,189,259
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	260,135
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,897,226	2,323,252
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	3,897,226	2,323,252
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	63,612,424	51,855,019



## (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24年9月21日から平成25年3月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第22期 (平成24年9月20日現在)	第23期 (平成25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	534,831,174口	542,979,143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	63,612,424円	- 円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8811円 (8,811円)	1.0955円 (10,955円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 (自平成24年3月22日 至平成24年9月20日)	第23期 (自平成24年9月21日 至平成25年3月21日)
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 313,701円	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 363,078円
<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/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(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(150,105,980円)、及び分配準備積立金(54,169,178円)より、分配対象収益は204,275,158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>	<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/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(4,952円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,694,495円)、収益調整金(155,854,254円)、及び分配準備積立金(51,532,876円)より、分配対象収益は211,086,577円(1口当たり0.388756円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。</p>

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

第22期 (自平成24年3月22日 至平成24年9月20日)	第23期 (自平成24年9月21日 至平成25年3月21日)
<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 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>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 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22期 (平成24年9月20日現在)	第23期 (平成25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22期 （自平成24年3月22日 至平成24年9月20日）	第23期 （自平成24年9月21日 至平成25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22期 （平成24年9月20日現在）	第23期 （平成25年3月21日現在）
期首元本額	519,082,543円	534,831,174円
期中追加設定元本額	30,094,617円	35,238,781円
期中一部解約元本額	14,345,986円	27,090,812円

2 有価証券関係

第22期（平成24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	12,130,904
合計	12,130,904

第23期（平成25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	113,368,685
合計	113,368,685

3 デリバティブ取引関係

第22期（平成24年9月20日現在）

該当事項はありません。

第23期（平成25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	379,814,607	235,105,241	
	ニッセイ国内債券マザー ファンド	111,205,958	143,233,273	
	ニッセイ/パトナム・海外 株式マザーファンド	113,841,020	136,074,171	
	ニッセイ/パトナム・海外 債券マザーファンド	29,806,003	65,066,504	
合計		634,667,588	579,479,189	

## 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。

## &lt;参考&gt;

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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	415,357,572	942,589,743
株式	20,350,438,380	22,627,034,400
派生商品評価勘定	11,672,750	16,306,290
未収入金	158,396,680	122,902,016
未収配当金	6,482,600	26,297,000

差入委託証拠金	10,500,000	23,400,000
流動資産合計	20,952,847,982	23,758,529,449
資産合計	20,952,847,982	23,758,529,449
負債の部		
流動負債		
前受金	17,970,000	6,240,000
未払金	158,001,330	123,481,530
未払解約金	18,237,740	97,126,767
流動負債合計	194,209,070	226,848,297
負債合計	194,209,070	226,848,297
純資産の部		
元本等		
元本	47,137,280,829	38,013,813,044
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	26,378,641,917	14,482,131,892
純資産合計	20,758,638,912	23,531,681,152
負債純資産合計	20,952,847,982	23,758,529,449

## ( 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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
1. 計算日における受益権総数	47,137,280,829口	38,013,813,044口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	26,378,641,917円	14,482,131,892円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4404円 (4,404円)	0.6190円 (6,190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24年3月22日 至平成24年9月20日)	(自平成24年9月21日 至平成25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> <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 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。</p>	<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> <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 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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年9月20日現在)	(平成25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. 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>	<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24年3月22日 至平成24年9月20日）	（自平成24年9月21日 至平成25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9月20日現在）	（平成25年3月21日現在）
同計算期間の期首元本額	45,788,333,956円	47,137,280,829円
同計算期間中の追加設定元本額	6,404,060,840円	1,754,826,959円
同計算期間中の一部解約元本額	5,055,113,967円	10,878,294,744円
同計算期間末日の元本額	47,137,280,829円	38,013,813,044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）	1,488,293,845円	1,117,399,363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）	1,118,582,069円	893,125,484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）	700,763,636円	593,478,864円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバラン ス（債券重視型）	1,405,423,555円	1,233,406,006円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバラン ス（標準型）	5,139,472,810円	4,719,504,107円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバラン ス（株式重視型）	3,524,982,367円	3,419,859,691円
DCニッセイ国内株式アクティブ	635,584,431円	637,124,889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）	365,976,694円	301,865,502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）	9,584,453,169円	6,039,912,372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）	15,164,565,132円	12,043,549,035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）	1,137,270,394円	1,080,105,949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）	6,524,085,906円	5,554,667,175円

D C ニッセイバランスアクティブ 合計	347,826,821円	379,814,607円
	47,137,280,829円	38,013,813,044円

## 2 有価証券関係

(平成24年9月20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	797,596,447
合計	797,596,447

(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。

(平成25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	4,350,700,848
合計	4,350,700,848

(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24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9月20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	360,327,250	-	372,000,000	11,672,750
	合計	360,327,250	-	372,000,000	11,672,750

(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ではありません。

(平成25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	805,423,710	-	821,730,000	16,306,290
	合計	805,423,710	-	821,730,000	16,306,290

(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24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25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)	
大成建設	541,000	266	143,906,000	
NIPPON	88,000	1,172	103,136,000	
大和ハウス工業	108,000	1,861	200,988,000	
大気社	120,200	2,104	252,900,800	
カルビー	14,900	7,640	113,836,000	
カカクコム	37,800	4,425	167,265,000	
エムスリー	413	187,000	77,231,000	
キリンホールディングス	174,000	1,500	261,000,000	
味の素	64,000	1,351	86,464,000	
JT	126,800	3,060	388,008,000	
コスモス薬品	9,700	12,570	121,929,000	
旭化成	438,000	646	282,948,000	
TSIホールディングス	508,200	584	296,788,800	
ブロードリーフ	75,500	1,080	81,540,000	
協和発酵キリン	122,000	1,079	131,638,000	
三菱ガス化学	378,000	678	256,284,000	
JSR	143,700	1,967	282,657,900	
ダイセル	239,000	779	186,181,000	
日立化成工業	104,700	1,478	154,746,600	
武田薬品工業	62,600	5,280	330,528,000	
アステラス製薬	93,900	5,200	488,280,000	
日本新薬	35,000	1,359	47,565,000	
オンコセラピー・サイエンス	223	297,500	66,342,500	
大塚ホールディングス	54,400	3,200	174,080,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	32,400	3,020	97,848,000	
JXホールディングス	570,200	545	310,759,000	
住友ゴム工業	107,300	1,589	170,499,700	
住友大阪セメント	323,000	291	93,993,000	
神戸製鋼所	1,426,000	116	165,416,000	
ジェイエフイーホールディングス	143,900	1,906	274,273,400	
共英製鋼	39,500	1,684	66,518,000	
三菱マテリアル	618,000	285	176,130,000	
住友金属鉱山	194,000	1,447	280,718,000	
リンナイ	17,400	6,700	116,580,000	
アマダ	152,000	671	101,992,000	
コマツ	121,500	2,268	275,562,000	
住友重機械工業	493,000	395	194,735,000	
東洋エンジニアリング	134,000	455	60,970,000	
椿本チエイン	155,000	468	72,540,000	
フジテック	87,000	934	81,258,000	
不二越	472,000	392	185,024,000	
THK	76,500	1,880	143,820,000	
日立製作所	784,000	568	445,312,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
オムロン	77,300	2,451	189,462,300	
ソニー	191,500	1,690	323,635,000	
堀場製作所	33,600	2,972	99,859,200	
カシオ計算機	267,500	780	208,650,000	
三菱重工業	412,000	539	222,068,000	
川崎重工業	854,000	301	257,054,000	
日産自動車	395,700	975	385,807,500	
トヨタ自動車	234,900	4,990	1,172,151,000	
タチエス	35,600	1,652	58,811,200	
ケーヒン	80,500	1,387	111,653,500	
マツダ	807,000	299	241,293,000	
ホンダ	189,300	3,770	713,661,000	
東京精密	148,600	2,024	300,766,400	
トプコン	284,500	864	245,808,000	
キヤノン	95,800	3,535	338,653,000	
リコー	234,000	1,047	244,998,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	48,000	2,594	124,512,000	
凸版印刷	202,000	689	139,178,000	
エフビコ	13,500	6,170	83,295,000	
伊藤忠商事	234,000	1,213	283,842,000	
丸紅	384,000	751	288,384,000	
豊田通商	87,500	2,522	220,675,000	
ファミリーマート	29,300	4,280	125,404,000	
日立ハイテクノロジーズ	52,800	2,033	107,342,400	
三菱商事	178,500	1,857	331,474,500	
青山商事	47,400	2,227	105,559,800	
あおぞら銀行	132,000	292	38,544,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,650,700	577	952,453,900	
三井住友トラスト・ホールディングス	303,000	449	136,047,000	
三井住友フィナンシャルグループ	58,200	4,000	232,800,000	
横浜銀行	202,000	555	112,110,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	261,000	471	122,931,000	
スルガ銀行	170,000	1,530	260,100,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,990,500	212	633,986,000	
野村ホールディングス	804,300	591	475,341,300	
NK S Jホールディングス	76,000	2,085	158,460,000	
東京海上ホールディングス	92,000	2,848	262,016,000	
T & Dホールディングス	326,500	1,141	372,536,500	
三菱地所	218,000	2,587	563,966,000	
東京急行電鉄	492,000	719	353,748,000	
東日本旅客鉄道	25,500	7,940	202,470,000	
阪急阪神ホールディングス	166,000	579	96,114,000	
ヤマトホールディングス	80,400	1,711	137,564,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
商船三井	758,000	335	253,930,000	
日本航空	30,800	4,655	143,374,000	
上組	107,000	873	93,411,000	
日本電信電話	64,800	4,250	275,400,000	
KDDI	20,400	7,500	153,000,000	
光通信	58,400	4,735	276,524,000	
NTTドコモ	2,449	148,400	363,431,600	
角川グループホールディングス	23,300	2,536	59,088,800	

東京ガス	198,000	501	99,198,000	
大阪ガス	702,000	406	285,012,000	
ベネッセホールディングス	23,000	3,990	91,770,000	
ヤマダ電機	61,960	4,190	259,612,400	
ファーストリテイリング	4,000	30,700	122,800,000	
ソフトバンク	27,300	3,850	105,105,000	
合計	25,235,045	-	22,627,034,400	

## 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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	984,473,120	1,020,575,188
国債証券	28,940,106,681	28,822,717,329
派生商品評価勘定	-	4,184,250
未収入金	4,465,317,767	3,180,249,418
未収利息	13,844,132	17,431,337
前払金	2,040,000	-
前払費用	19,094,731	23,429,711
差入委託証拠金	2,340,000	2,340,000
流動資産合計	34,427,216,431	33,070,927,233
資産合計	34,427,216,431	33,070,927,233
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	675,750	-

前受金	-	3,180,000
未払金	4,464,298,299	3,073,944,197
未払解約金	23,847,078	178,278,070
流動負債合計	4,488,821,127	3,255,402,267
負債合計	4,488,821,127	3,255,402,267
純資産の部		
元本等		
元本	23,778,274,738	23,148,173,301
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,160,120,566	6,667,351,665
純資産合計	29,938,395,304	29,815,524,966
負債純資産合計	34,427,216,431	33,070,927,233

## (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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
1. 計算日における受益権総数	23,778,274,738口	23,148,173,301口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2591円 (12,591円)	1.2880円 (12,880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24年3月22日 至平成24年9月20日)	(自平成24年9月21日 至平成25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>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> <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 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。</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> <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 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。</p>
--	--

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年9月20日現在)	(平成25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. 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>	<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24年3月22日 至平成24年9月20日)	(自平成24年9月21日 至平成25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9月20日現在）	（平成25年3月21日現在）
同計算期間の期首元本額	25,197,025,278円	23,778,274,738円
同計算期間中の追加設定元本額	2,112,100,723円	3,635,244,088円
同計算期間中の一部解約元本額	3,530,851,263円	4,265,345,525円
同計算期間末日の元本額	23,778,274,738円	23,148,173,301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）	1,427,838,977円	1,376,365,663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）	455,272,045円	466,569,587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）	91,633,372円	99,631,717円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバラン ス（債券重視型）	1,348,074,155円	1,519,808,100円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバラン ス（標準型）	2,091,695,742円	2,467,601,272円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバラン ス（株式重視型）	460,951,065円	574,856,355円
DCニッセイ国内債券アクティブ	821,914,137円	844,777,365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）	149,002,763円	157,758,665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）	9,195,136,464円	7,523,835,777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）	6,170,708,390円	6,370,644,988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）	148,711,422円	183,745,445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）	1,229,815,214円	1,361,972,339円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月 分配型）	52,605,258円	62,868,073円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長 重視型）	22,664,252円	26,531,997円
DCニッセイバランスアクティブ	112,251,482円	111,205,958円
合計	23,778,274,738円	23,148,173,301円

2 有価証券関係

（平成24年9月20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	7,217,273
合計	7,217,273

（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。

（平成25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	287,966,170
合計	287,966,170

（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24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9月20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	863,475,750	-	862,800,000	675,750
	合計	863,475,750	-	862,800,000	675,750

（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ではありません。

（平成25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	869,235,750	-	873,420,000	4,184,250
	合計	869,235,750	-	873,420,000	4,184,250

（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24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25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308回 利付国債(2年)	0.100	2013/9/15	13,600,000	13,600,000
	第309回 利付国債(2年)	0.100	2013/10/15	16,600,000	16,603,601
	第311回 利付国債(2年)	0.200	2013/12/15	210,200,000	210,431,258
	第312回 利付国債(2年)	0.100	2014/1/15	902,000,000	902,319,271
	第313回 利付国債(2年)	0.100	2014/2/15	1,920,100,000	1,920,772,586
	第315回 利付国債(2年)	0.100	2014/4/15	194,000,000	194,122,220
	第316回 利付国債(2年)	0.100	2014/5/15	155,300,000	155,405,604
	第320回 利付国債(2年)	0.100	2014/9/15	1,025,700,000	1,026,602,616
	第321回 利付国債(2年)	0.100	2014/10/15	1,354,900,000	1,356,160,057
	第324回 利付国債(2年)	0.100	2015/1/15	25,700,000	25,727,756
	第95回 利付国債(5年)	0.600	2016/3/20	229,100,000	232,891,605
	第96回 利付国債(5年)	0.500	2016/3/20	182,400,000	184,873,344
	第99回 利付国債(5年)	0.400	2016/9/20	1,500,500,000	1,517,470,655
	第103回 利付国債(5年)	0.300	2017/3/20	281,300,000	283,589,782
	第105回 利付国債(5年)	0.200	2017/6/20	634,700,000	637,238,800
	第1回 利付国債(40年)	2.400	2048/3/20	56,300,000	66,776,867
	第2回 利付国債(40年)	2.200	2049/3/20	41,800,000	47,311,330
	第3回 利付国債(40年)	2.200	2050/3/20	23,500,000	26,529,620
	第4回 利付国債(40年)	2.200	2051/3/20	52,300,000	58,810,827
	第5回 利付国債(40年)	2.000	2052/3/20	154,500,000	164,211,870
	第285回 利付国債(10年)	1.700	2017/3/20	87,000,000	92,563,650
	第286回 利付国債(10年)	1.800	2017/6/20	28,700,000	30,758,938
	第288回 利付国債(10年)	1.700	2017/9/20	170,200,000	182,331,856
	第294回 利付国債(10年)	1.700	2018/6/20	106,300,000	115,072,939
	第295回 利付国債(10年)	1.500	2018/6/20	92,900,000	99,599,019
	第296回 利付国債(10年)	1.500	2018/9/20	642,200,000	690,159,496
	第297回 利付国債(10年)	1.400	2018/12/20	1,250,200,000	1,339,889,348
	第298回 利付国債(10年)	1.300	2018/12/20	1,097,100,000	1,169,563,455
	第308回 利付国債(10年)	1.300	2020/6/20	67,800,000	72,731,772
	第309回 利付国債(10年)	1.100	2020/6/20	341,700,000	361,450,260
	第310回 利付国債(10年)	1.000	2020/9/20	1,479,800,000	1,553,967,576
	第312回 利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	112,300,000	119,582,655
	第317回 利付国債(10年)	1.100	2021/9/20	177,100,000	186,895,401
	第322回 利付国債(10年)	0.900	2022/3/20	265,200,000	274,911,624
	第324回 利付国債(10年)	0.800	2022/6/20	500,000	513,015
	第325回 利付国債(10年)	0.800	2022/9/20	1,109,900,000	1,136,970,461
	第326回 利付国債(10年)	0.700	2022/12/20	74,700,000	75,700,233
	第327回 利付国債(10年)	0.800	2022/12/20	63,200,000	64,630,216
	第7回 利付国債(30年)	2.300	2032/5/20	62,100,000	70,701,471
	第10回 利付国債(30年)	1.100	2033/3/20	133,800,000	123,949,644

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13回 利付国債(30年)	2.000	2033/12/20	206,200,000	222,860,960
	第14回 利付国債(30年)	2.400	2034/3/20	12,900,000	14,859,768
	第16回 利付国債(30年)	2.500	2034/9/20	300,300,000	351,387,036
	第23回 利付国債(30年)	2.500	2036/6/20	51,000,000	59,891,340
	第25回 利付国債(30年)	2.300	2036/12/20	43,200,000	49,035,024
	第26回 利付国債(30年)	2.400	2037/3/20	162,200,000	187,452,918
	第27回 利付国債(30年)	2.500	2037/9/20	80,200,000	94,394,598
	第29回 利付国債(30年)	2.400	2038/9/20	323,900,000	375,231,672
	第30回 利付国債(30年)	2.300	2039/3/20	27,600,000	31,405,488
	第34回 利付国債(30年)	2.200	2041/3/20	164,100,000	183,486,774
	第35回 利付国債(30年)	2.000	2041/9/20	668,300,000	717,099,266
	第36回 利付国債(30年)	2.000	2042/3/20	282,800,000	303,099,384
	第30回 利付国債(20年)	3.700	2015/9/21	27,500,000	30,006,625
	第55回 利付国債(20年)	2.000	2022/3/21	14,900,000	16,887,958
	第64回 利付国債(20年)	1.900	2023/9/20	300,000	338,823
	第67回 利付国債(20年)	1.900	2024/3/20	77,200,000	87,229,052
	第68回 利付国債(20年)	2.200	2024/3/20	86,100,000	100,092,111
	第69回 利付国債(20年)	2.100	2024/3/20	69,500,000	79,997,280
	第72回 利付国債(20年)	2.100	2024/9/20	891,500,000	1,027,507,240
	第78回 利付国債(20年)	1.900	2025/6/20	329,900,000	372,424,110
	第85回 利付国債(20年)	2.100	2026/3/20	168,400,000	193,811,560
	第88回 利付国債(20年)	2.300	2026/6/20	370,400,000	435,342,232
	第93回 利付国債(20年)	2.000	2027/3/20	126,300,000	143,113,056
	第95回 利付国債(20年)	2.300	2027/6/20	179,100,000	209,686,698
	第97回 利付国債(20年)	2.200	2027/9/20	421,100,000	486,901,086
	第98回 利付国債(20年)	2.100	2027/9/20	3,000,000	3,428,490
	第99回 利付国債(20年)	2.100	2027/12/20	107,200,000	122,347,360
	第100回 利付国債(20年)	2.200	2028/3/20	3,300,000	3,808,662
	第102回 利付国債(20年)	2.400	2028/6/20	297,500,000	351,180,900
	第104回 利付国債(20年)	2.100	2028/6/20	208,200,000	237,073,176
	第105回 利付国債(20年)	2.100	2028/9/20	413,000,000	469,523,180
	第106回 利付国債(20年)	2.200	2028/9/20	197,400,000	227,189,634
	第107回 利付国債(20年)	2.100	2028/12/20	102,600,000	116,442,792
	第108回 利付国債(20年)	1.900	2028/12/20	155,500,000	171,959,675
	第110回 利付国債(20年)	2.100	2029/3/20	130,900,000	148,191,890
第111回 利付国債(20年)	2.200	2029/6/20	196,600,000	224,998,870	
第112回 利付国債(20年)	2.100	2029/6/20	115,700,000	130,738,686	
第113回 利付国債(20年)	2.100	2029/9/20	150,600,000	169,724,694	
第114回 利付国債(20年)	2.100	2029/12/20	298,000,000	334,916,240	
第115回 利付国債(20年)	2.200	2029/12/20	89,600,000	102,089,344	
第117回 利付国債(20年)	2.100	2030/3/20	54,600,000	61,188,036	
第122回 利付国債(20年)	1.800	2030/9/20	250,000,000	267,430,000	
第128回 利付国債(20年)	1.900	2031/6/20	761,200,000	820,664,944	
第130回 利付国債(20年)	1.800	2031/9/20	99,300,000	105,211,329	
第135回 利付国債(20年)	1.700	2032/3/20	54,200,000	56,259,058	

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138回 利付国債(20年)	1.500	2032/6/20	197,300,000	197,741,952	
	第139回 利付国債(20年)	1.600	2032/6/20	12,200,000	12,437,778	
	第140回 利付国債(20年)	1.700	2032/9/20	217,000,000	224,219,590	
	第142回 利付国債(20年)	1.800	2032/12/20	458,900,000	480,963,912	
	第3回 物価連動国債(10年)	0.500	2014/12/10	48,100,000	49,313,659	
	第4回 物価連動国債(10年)	0.500	2015/6/10	133,100,000	138,490,550	
	第5回 物価連動国債(10年)	0.800	2015/9/10	331,600,000	347,943,237	
	第6回 物価連動国債(10年)	0.800	2015/12/10	246,500,000	260,072,906	
	第8回 物価連動国債(10年)	1.000	2016/6/10	11,000,000	11,957,412	
	第10回 物価連動国債(10年)	1.100	2016/12/10	35,600,000	38,936,289	
	第14回 物価連動国債(10年)	1.200	2017/12/10	100,400,000	112,154,379	
	第16回 物価連動国債(10年)	1.400	2018/6/10	219,200,000	247,183,948	

合計	27,121,400,000	28,822,717,329
----	----------------	----------------

## 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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	138,244,035	308,496,200
コール・ローン	118,725,950	235,904,555
株式	22,401,429,442	27,204,392,844
投資証券	132,843,790	182,996,380
派生商品評価勘定	104,067,689	155,109,491
未収入金	332,134,680	-
未収配当金	28,033,017	32,276,361
流動資産合計	23,255,478,603	28,119,175,831
資産合計	23,255,478,603	28,119,175,831
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	32,168,818	205,166,882
未払金	114,522,648	-
未払解約金	29,273,786	83,325,788
流動負債合計	175,965,252	288,492,670
負債合計	175,965,252	288,492,670
純資産の部		
元本等		
元本	26,796,132,351	23,283,558,989
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	3,716,619,000	4,547,124,172
純資産合計	23,079,513,351	27,830,683,161

負債純資産合計	23,255,478,603	28,119,175,831
---------	----------------	----------------

## (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	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	<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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
1. 計算日における受益権総数	26,796,132,351口	23,283,558,989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	3,716,619,000円	- 円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8613円 (8,613円)	1.1953円 (11,953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24年3月22日 至平成24年9月20日)	(自平成24年9月21日 至平成25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。</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 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。</p>	<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。</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 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。</p>
---	---

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年9月20日現在)	(平成25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。

<p>2. 時価の算定方法</p>	<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>	<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24年3月22日 至平成24年9月20日)	(自平成24年9月21日 至平成25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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
同計算期間の期首元本額	27,298,011,184円	26,796,132,351円
同計算期間中の追加設定元本額	3,005,069,645円	1,972,012,429円
同計算期間中の一部解約元本額	3,506,948,478円	5,484,585,791円
同計算期間末日の元本額	26,796,132,351円	23,283,558,989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)	399,808,339円	290,009,075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)	400,593,476円	309,107,595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)	282,219,969円	231,175,701円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)	377,332,217円	320,137,024円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)	1,840,305,019円	1,633,301,301円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)	1,419,538,329円	1,331,569,110円
DCニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式	9,713,777,220円	9,859,312,218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)	131,026,418円	104,469,770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)	2,573,900,226円	1,570,054,950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)	5,429,169,571円	4,173,019,584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)	457,999,381円	420,962,883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)	2,651,242,977円	2,184,347,724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)	139,317,738円	113,206,542円
ニッセイ/パトナム・バランスアップオープ ン	855,267,785円	629,044,492円
DCニッセイバランスアクティブ	124,633,686円	113,841,020円
合計	26,796,132,351円	23,283,558,989円

## 2 有価証券関係

(平成24年9月20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	3,217,140,387
投資証券	5,615,554
合計	3,211,524,833

(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。

(平成25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	3,088,574,409
投資証券	45,415,555
合計	3,133,989,964

(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24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9月20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	4,461,193,061	-	4,462,695,772	1,502,711
	オーストラリアドル	158,971,239	-	160,038,120	1,066,881
	香港ドル	47,313,266	-	47,785,926	472,660
	英ポンド	1,136,149,713	-	1,160,703,764	24,554,051
	ユーロ	94,493,282	-	98,238,062	3,744,780
	計	5,898,120,561	-	5,929,461,644	31,341,083
	買建				
	米ドル	1,436,927,500	-	1,436,975,012	47,512
	カナダドル	1,135,876,534	-	1,146,535,872	10,659,338
	オーストラリアドル	736,240,350	-	751,839,528	15,599,178
	香港ドル	54,713,193	-	54,733,518	20,325
	シンガポールドル	169,859,592	-	172,977,045	3,117,453
	英ポンド	36,240,943	-	36,558,500	317,557
	イスラエルシェケル	60,135,455	-	61,881,088	1,745,633
	スイスフラン	830,572,340	-	855,055,032	24,482,692
	デンマーククローネ	89,302,551	-	92,622,580	3,320,029
	ノルウェークローネ	91,821,788	-	93,422,144	1,600,356
	スウェーデンクローネ	320,629,381	-	329,434,332	8,804,951
ユーロ	935,800,934	-	969,325,864	33,524,930	
計	5,898,120,561	-	6,001,360,515	103,239,954	
合計	11,796,241,122	-	11,930,822,159	71,898,871	

## (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。

(平成25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	4,358,828,991	-	4,519,401,509	160,572,518
	香港ドル	56,894,019	-	59,394,855	2,500,836
	英ポンド	1,412,004,846	-	1,451,209,764	39,204,918
	計	5,827,727,856	-	6,030,006,128	202,278,272
	買建				
	米ドル	1,468,898,865	-	1,502,688,311	33,789,446
	カナダドル	1,337,250,155	-	1,363,416,810	26,166,655
	オーストラリアドル	795,981,098	-	828,608,850	32,627,752
	香港ドル	223,571,455	-	230,880,780	7,309,325
	シンガポールドル	55,882,609	-	57,870,024	1,987,415
	イスラエルシェケル	76,523,657	-	80,328,192	3,804,535
	スイスフラン	871,303,924	-	897,907,248	26,603,324
	デンマーククローネ	109,097,731	-	112,320,900	3,223,169
	ノルウェークローネ	108,806,519	-	110,938,796	2,132,277
	スウェーデンクローネ	232,930,051	-	239,882,356	6,952,305
	ユーロ	547,481,792	-	555,106,470	7,624,678
	計	5,827,727,856	-	5,979,948,737	152,220,881
	合計	11,655,455,712	-	12,009,954,865	50,057,391

## (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24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25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	
AETNA INC	51,900	50.03	2,596,557.00	
AIRGAS INC	22,600	103.35	2,335,710.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	62,368	38.30	2,388,694.40	
AON PLC	42,200	59.71	2,519,762.00	
APPLE INC	11,100	452.08	5,018,088.00	
ASSURED GUARANTY LTD	128,700	20.56	2,646,072.00	
AXIALL CORP	33,900	64.65	2,191,635.00	
BANK OF AMERICA CORP	516,100	12.78	6,595,758.00	
BEST BUY CO INC	42,115	23.07	971,593.05	
BOISE CASCADE CO	59,600	33.53	1,998,388.00	
BROOKDALE SENIOR LIVING INC	89,300	27.65	2,469,145.00	
BRUNSWICK CORP	65,100	34.81	2,266,131.00	
CABOT OIL & GAS CORP	35,400	67.86	2,402,244.00	
CAPITAL SENIOR LIVING CORP	109,700	26.63	2,921,311.00	
CATAMARAN CORP	41,800	52.222	2,182,879.60	



CBRE GROUP INC - A	68,800	24.83	1,708,304.00
CELGENE CORP	21,500	112.32	2,414,880.00
CENTURYLINK INC	34,200	34.58	1,182,636.00
CME GROUP INC	34,100	62.03	2,115,223.00
COMPUTER SCIENCES CORP	46,900	49.10	2,302,790.00
COVIDIEN PLC	37,000	65.50	2,423,500.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	62,400	44.96	2,805,504.00
DISH NETWORK CORP-A	61,300	36.48	2,236,224.00
EMERITUS CORP	68,001	27.16	1,846,907.16
EXCO RESOURCES INC	204,200	7.72	1,576,424.00
FORESTAR GROUP INC	108,400	22.82	2,473,688.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	62,300	37.67	2,346,841.00
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	211,000	10.23	2,158,530.00
GOOGLE INC-CL A	4,753	814.708	3,872,307.12
HALLIBURTON CO	61,300	39.44	2,417,672.00
HANESBRANDS INC	48,000	41.86	2,009,280.00
HOME DEPOT INC	35,000	68.88	2,410,800.00
HOMEAWAY INC	66,800	30.55	2,040,740.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,200	74.70	2,405,340.00
JOHNSON CONTROLS INC	63,100	35.05	2,211,655.00
JPMORGAN CHASE & CO	120,300	49.12	5,909,136.00
LENNAR CORP-A	53,900	43.40	2,339,260.00
LOWE'S COS INC	105,700	38.41	4,059,937.00
MARATHON OIL CORP	82,800	34.60	2,864,880.00
MARSH & MCLENNAN COS	72,200	37.52	2,708,944.00
MASCO CORP	114,500	20.94	2,397,630.00
MEADWESTVACO CORP	90,700	38.00	3,446,600.00
MICRON TECHNOLOGY INC	257,700	9.31	2,399,187.00
MONSANTO CO	69,600	103.12	7,177,152.00
MORGAN STANLEY	100,100	22.74	2,276,274.00

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
NOBLE ENERGY INC	27,600	113.97	3,145,572.00	
NRG ENERGY INC	65,600	25.98	1,704,288.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	70,100	29.95	2,099,495.00	
OCEANEERING INTL INC	37,900	63.80	2,418,020.00	
OIL STATES INTERNATIONAL INC	28,300	79.98	2,263,434.00	
OWENS CORNING	56,400	41.32	2,330,448.00	
PFIZER INC	119,392	28.29	3,377,599.68	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	49,400	91.42	4,516,148.00	
POLYCOM INC	150,600	11.39	1,715,334.00	
PRECISION CASTPARTS CORP	11,900	195.21	2,322,999.00	
PULTEGROUP INC	154,100	21.38	3,294,658.00	
QUALCOMM INC	37,000	65.74	2,432,380.00	
RADIAN GROUP INC	210,300	10.13	2,130,339.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	295,500	8.40	2,482,200.00	
SANDISK CORP	62,400	55.23	3,446,352.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	160,700	17.75	2,852,425.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,200	172.12	1,755,624.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	56,700	38.86	2,203,362.00	
ST JUDE MEDICAL INC	40,900	41.96	1,716,164.00	
STANDARD PACIFIC CORP	311,346	9.07	2,823,908.22	
TILE SHOP HLDGS INC	137,827	20.96	2,888,853.92	
TOLL BROTHERS INC	56,900	36.53	2,078,557.00	
TRONOX LTD-CL A	94,500	20.68	1,954,260.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	45,200	54.88	2,480,576.00	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	34,300	60.072	2,060,469.60	
VISA INC-CLASS A SHARES	20,800	159.33	3,314,064.00	
WINNEBAGO INDUSTRIES	97,300	21.99	2,139,627.00	

WW GRAINGER INC	9,400	226.26	2,126,844.00
ZIONS BANCORPORATION	75,800	25.44	1,928,352.00
ZOETIS INC	45,900	33.51	1,538,109.00
米ドル 小計	6,284,902	-	195,582,675.75 (18,756,378,605)
ILUKA RESOURCES LTD	142,997	9.20	1,315,572.40
ORIGIN ENERGY LTD	178,926	12.78	2,286,674.28
オーストラリアドル 小計	321,923	-	3,602,246.68 (358,495,590)
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,214,000	17.62	21,390,680.00
香港ドル 小計	1,214,000	-	21,390,680.00 (264,174,898)
EZION HOLDINGS LTD	1,381,000	1.97	2,720,570.00
シンガポールドル 小計	1,381,000	-	2,720,570.00 (208,776,542)
ADMIRAL GROUP PLC	92,557	13.32	1,232,859.24
BARCLAYS PLC	552,020	2.952	1,629,563.04
BG GROUP PLC	345,486	11.695	4,040,458.77
CAIRN ENERGY PLC	313,150	2.803	877,759.45
COMPASS GROUP PLC	215,147	8.435	1,814,764.94

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
FIDESSA GROUP PLC	64,089	18.96	1,215,127.44	
KINGFISHER PLC	284,325	2.867	815,159.77	
PERSIMMON PLC	169,249	10.10	1,709,414.90	
PRUDENTIAL PLC	223,161	11.09	2,474,855.49	
REGUS PLC	838,317	1.595	1,337,115.61	
TALKTALK TELECOM GROUP	302,268	2.658	803,428.34	
TAYLOR WIMPEY PLC	1,318,241	0.908	1,196,962.82	
TELECITY GROUP PLC	201,188	9.12	1,834,834.56	
THOMAS COOK GROUP PLC	1,215,348	1.066	1,295,560.96	
TUI TRAVEL PLC	455,112	3.099	1,410,392.08	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	200,883	6.955	1,397,141.26	
英ポンド 小計	6,790,541	-	25,085,398.67 (3,633,870,851)	
NESTLE SA-REG	38,691	68.40	2,646,464.40	
スイスフラン 小計	38,691	-	2,646,464.40 (268,801,389)	
VOLVO AB-B SHS	115,601	97.20	11,236,417.20	
スウェーデンクローネ 小計	115,601	-	11,236,417.20 (166,523,702)	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,987	7.397	1,930,520.83	
BANCO POPULAR ESPANOL	3,049,445	0.66	2,012,633.70	
BANK OF IRELAND	8,020,515	0.163	1,307,343.94	
CREDIT AGRICOLE SA	153,265	6.696	1,026,262.44	
ERSTE GROUP BANK AG	68,295	23.385	1,597,078.57	
GEMALTO	27,974	70.00	1,958,180.00	
INDITEX	12,720	103.10	1,311,432.00	
ING GROEP NV-CVA	285,031	6.134	1,748,380.15	
PERNOD-RICARD SA	30,649	100.00	3,064,900.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	187,147	25.41	4,755,405.27	
SANOFI	38,262	77.82	2,977,548.84	
SOCIETE GENERALE	59,056	28.19	1,664,788.64	
TELECOM ITALIA SPA	2,408,317	0.62	1,493,156.54	
UNICREDIT SPA	474,556	3.68	1,746,366.08	
ユーロ 小計	15,076,219	-	28,593,997.00 (3,547,371,267)	
合計			27,204,392,844 (27,204,392,844)	

## 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	94,000	1,908,200.00	
	米ドル 小計	94,000	1,908,200.00 (182,996,380)	
合計			182,996,380 (182,996,380)	

- (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 75 銘柄	68.94 %	- %	69.15 %
	投資証券 1 銘柄	- %	100.00 %	
オーストラリアドル	株式 2 銘柄	1.32 %	- %	1.31 %
香港ドル	株式 1 銘柄	0.97 %	- %	0.97 %
シンガポールドル	株式 1 銘柄	0.77 %	- %	0.76 %
英ポンド	株式 16 銘柄	13.36 %	- %	13.27 %
スイスフラン	株式 1 銘柄	0.99 %	- %	0.98 %
スウェーデンクローネ	株式 1 銘柄	0.61 %	- %	0.61 %
ユーロ	株式 14 銘柄	13.04 %	- %	12.95 %
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/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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,640,864,984	2,530,172,730
コール・ローン	72,814,996	95,268,728
国債証券	13,073,825,186	14,989,015,204
地方債証券	264,246,593	-
特殊債券	1,183,841,440	1,138,198,051
社債券	890,431,082	1,052,462,551
派生商品評価勘定	127,859,128	220,468,640
未収利息	117,232,461	155,251,409
前払費用	18,012,089	44,939,737
流動資産合計	18,389,127,959	20,225,777,050
資産合計	18,389,127,959	20,225,777,050
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	56,825,215	209,763,772
未払解約金	10,272,864	60,285,222
流動負債合計	67,098,079	270,048,994
負債合計	67,098,079	270,048,994
純資産の部		
元本等		
元本	10,325,414,098	9,141,412,953
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	7,996,615,782	10,814,315,103
純資産合計	18,322,029,880	19,955,728,056
負債純資産合計	18,389,127,959	20,225,777,050

## (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・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。</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>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</p> <p>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9月20日現在)	(平成25年3月21日現在)
1. 計算日における受益権総数	10,325,414,098口	9,141,412,953口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7745円 (17,745円)	2.1830円 (21,830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24年3月22日 至平成24年9月20日)	(自平成24年9月21日 至平成25年3月21日)
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年9月20日現在）	（平成25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. 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>	<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24年3月22日 至平成24年9月20日）	（自平成24年9月21日 至平成25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9月20日現在）	（平成25年3月21日現在）
同計算期間の期首元本額	10,658,731,220円	10,325,414,098円
同計算期間中の追加設定元本額	383,208,888円	381,818,303円
同計算期間中の一部解約元本額	716,526,010円	1,565,819,448円
同計算期間末日の元本額	10,325,414,098円	9,141,412,953円
上記元本額の内訳		
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	185,990,409円	149,468,447円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	93,191,902円	79,638,605円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	43,768,349円	39,691,970円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）	175,596,195円	165,060,279円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）	428,155,772円	421,182,323円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）	220,168,313円	228,945,189円
DCニッセイノパトナム・グローバル債券	1,328,084,382円	1,328,430,871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）	30,495,224円	26,923,371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）	1,197,715,126円	824,323,541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）	1,263,121,450円	1,096,246,299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）	71,031,340円	73,758,044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）	440,556,794円	410,035,094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）	4,817,930,812円	4,267,902,917円
DCニッセイバランスアクティブ	29,608,030円	29,806,003円
合計	10,325,414,098円	9,141,412,953円

## 2 有価証券関係

(平成24年9月20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	191,234,113
地方債証券	7,387,793
特殊債券	35,197,444
社債券	780,568
合計	219,824,332

（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。

(平成25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	13,088,812
特殊債券	7,116,329
社債券	5,165,215
合計	25,370,356

（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24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9月20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	5,982,396,336	-	5,985,468,353	3,072,017
	カナダドル	906,203,359	-	908,748,512	2,545,153
	オーストラリアドル	274,024,080	-	273,222,840	801,240
	英ポンド	1,181,390,896	-	1,205,019,024	23,628,128
	デンマーククローネ	12,634,932	-	13,102,539	467,607
	ノルウェークローネ	90,413,036	-	91,611,328	1,198,292
	スウェーデンクローネ	133,926,784	-	137,469,216	3,542,432
	ユーロ	117,823,678	-	121,626,128	3,802,450
	計	8,698,813,101	-	8,736,267,940	37,454,839
	買建				
	米ドル	2,716,416,765	-	2,714,617,726	1,799,039
	カナダドル	557,382,942	-	558,810,336	1,427,394
	オーストラリアドル	1,121,717,005	-	1,144,957,968	23,240,963
	シンガポールドル	74,633,845	-	76,003,610	1,369,765
	英ポンド	1,040,495,114	-	1,054,258,128	13,763,014
	スイスフラン	80,334,799	-	82,702,820	2,368,021
	ノルウェークローネ	492,502,495	-	499,849,888	7,347,393
	スウェーデンクローネ	392,755,603	-	399,068,784	6,313,181
メキシコペソ	339,719,299	-	341,843,755	2,124,456	
ポーランドズロチ	299,722,853	-	304,129,056	4,406,203	
ユーロ	1,583,132,381	-	1,631,059,782	47,927,401	
計	8,698,813,101	-	8,807,301,853	108,488,752	
合計	17,397,626,202	-	17,543,569,793	71,033,913	

## (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。

(平成25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	4,793,562,712	-	4,953,973,262	160,410,550
	カナダドル	572,361,556	-	575,586,585	3,225,029
	オーストラリアドル	943,583,204	-	972,335,670	28,752,466
	英ポンド	98,731,544	-	99,039,524	307,980
	デンマーククローネ	39,904,928	-	40,912,380	1,007,452
	ノルウェークローネ	46,708,424	-	47,170,312	461,888
	メキシコペソ	141,010,902	-	141,772,032	761,130
	南アフリカランド	8,094,752	-	7,901,652	193,100
	ユーロ	568,818,563	-	580,067,342	11,248,779
	計	7,212,776,585	-	7,418,758,759	205,982,174
	買建				
	米ドル	2,419,213,873	-	2,473,603,640	54,389,767
	カナダドル	656,832,783	-	666,476,055	9,643,272
	オーストラリアドル	1,700,309,233	-	1,767,003,780	66,694,547
	シンガポールドル	80,194,211	-	83,046,246	2,852,035
	英ポンド	660,193,882	-	679,572,631	19,378,749
	スイスフラン	25,177,357	-	25,991,838	814,481
	スウェーデンクローネ	569,031,697	-	583,951,888	14,920,191
メキシコペソ	559,569,896	-	602,870,922	43,301,026	
南アフリカランド	129,225,510	-	129,042,243	183,267	
ポーランドズロチ	194,052,465	-	198,554,508	4,502,043	
ユーロ	39,895,678	-	40,269,876	374,198	
計	7,033,696,585	-	7,250,383,627	216,687,042	
合計	14,246,473,170	-	14,669,142,386	10,704,868	

## (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24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25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	1.250	2014/4/15	9,800,000.00	9,911,720.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	1.000	2016/8/31	15,100,000.00	15,372,404.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	3.125	2016/10/31	7,640,000.00	8,356,784.80		
	US TREASURY NOTE/BOND	2.750	2016/11/30	8,690,000.00	9,396,062.50		
	US TREASURY NOTE/BOND	4.250	2017/11/15	3,070,000.00	3,565,989.20		
	US TREASURY NOTE/BOND	2.750	2017/12/31	3,640,000.00	3,982,669.60		
	US TREASURY NOTE/BOND	1.625	2022/11/15	1,167,000.00	1,138,455.18		
	US TREASURY NOTE/BOND	5.250	2029/2/15	2,300,000.00	3,093,500.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	6.250	2030/5/15	3,900,000.00	5,840,835.00		
	US TREASURY NOTE/BOND	4.500	2036/2/15	440,000.00	554,122.80		
	US TREASURY NOTE/BOND	4.375	2041/5/15	3,000,000.00	3,727,500.00		
	米ドル 小計				58,747,000.00	64,940,043.08 (6,227,750,131)	
	AUSTRALIAN GOVT	4.500	2020/4/15	700,000.00	751,891.00		
	AUSTRALIAN GOVT	5.750	2022/7/15	1,800,000.00	2,124,018.00		
	AUSTRALIAN GOVT	5.500	2023/4/21	2,000,000.00	2,335,140.00		
	オーストラリアドル 小計				4,500,000.00	5,211,049.00 (518,603,596)	
	UK GILT	2.250	2014/3/7	3,100,000.00	3,162,434.00		
	UK GILT	3.750	2019/9/7	990,000.00	1,153,449.00		
	UK GILT	4.000	2022/3/7	181,000.00	215,476.88		
	UK GILT	4.250	2039/9/7	2,040,000.00	2,451,978.00		
	英ポンド 小計				6,311,000.00	6,983,337.88 (1,011,606,325)	
	DENMARK BULLET	4.000	2017/11/15	7,000,000.00	8,173,200.00		
	DENMARK BULLET	7.000	2024/11/10	2,680,000.00	4,268,570.00		
	デンマーククローネ 小計				9,680,000.00	12,441,770.00 (207,031,053)	
	SWEDISH GOVT	3.500	2022/6/1	14,200,000.00	16,143,838.00		
	スウェーデンクローネ 小計				14,200,000.00	16,143,838.00 (239,251,679)	
MALAYSIA GOVT	3.835	2015/8/12	3,875,000.00	3,944,982.50			
マレーシアリングット 小計				3,875,000.00	3,944,982.50 (121,387,112)		

種類	銘柄	利率 (%)	償還日	券面総額	評価額	備考	
国債証券	BELGIUM GOVT	4.250	2022/9/28	5,070,000.00	6,036,037.80		
	DEUTSCHLAND REP	1.500	2022/9/4	11,600,000.00	11,792,560.00		
	FINLAND GOVT	1.750	2016/4/15	880,000.00	921,201.60		
	FINLAND GOVT	3.500	2021/4/15	690,000.00	803,746.50		
	FRANCE OAT	3.250	2021/10/25	5,980,000.00	6,689,048.60		
	IRISH GOVT	5.500	2017/10/18	260,000.00	291,647.20		
	IRISH GOVT	5.000	2020/10/18	1,300,000.00	1,416,389.00		
	ITALY BTP	4.000	2017/2/1	4,830,000.00	5,010,062.40		
	ITALY BTP	5.500	2022/11/1	2,660,000.00	2,870,007.00		
	ITALY BTP	6.500	2027/11/1	2,740,000.00	3,150,698.60		
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.500	2015/7/15	1,690,000.00	1,822,360.80		
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.500	2021/9/15	1,740,000.00	2,022,854.40		
	SPANISH GOVT	4.000	2015/7/30	3,500,000.00	3,621,450.00		
	SPANISH GOVT	5.500	2017/7/30	4,570,000.00	4,945,105.60		
	SPANISH GOVT	5.500	2021/4/30	2,180,000.00	2,317,819.60		
	ユーロ 小計				49,690,000.00	53,710,989.10 (6,663,385,308)	
	国債証券 計					14,989,015,204 (14,989,015,204)	

特殊 債券	FHLMC GOLD A17598	6.500	2034/1/1	6,950.16	7,976.28	
	FHLMC GOLD A20871	6.500	2034/4/1	39,479.71	45,172.68	
	FHLMC GOLD C52510	6.500	2031/5/1	6,428.33	7,447.92	
	FHLMC GOLD G08008	6.500	2034/7/1	28,240.80	32,252.68	
	FNMA 545477	7.000	2032/3/1	29,778.06	35,468.64	
	FNMA 555571	6.500	2033/3/1	12,042.19	13,824.67	
	FNMA 602285	6.500	2031/8/1	9,318.87	10,982.66	
	FNMA 609480	7.000	2031/10/1	8,400.19	10,015.12	
	FNMA 797553	5.000	2020/4/1	5,198.93	5,619.10	
	FNMA 813915	4.500	2020/11/1	21,052.68	22,696.05	
	FNW 2003-W1 2A	6.89593	2042/12/1	495,247.72	589,820.22	
	FNW 2003-W3 1A1	6.500	2042/8/1	9,630.20	11,504.23	
	GNMA 781542	6.000	2033/1/1	24,488.33	27,900.28	
	KFW	4.000	2020/1/27	1,180,000.00	1,363,372.00	
	米ドル 小計			1,876,256.17	2,184,052.53 (209,450,638)	
	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.500	2014/9/5	6,500,000.00	6,635,005.00	
	ノルウェークローネ 小計			6,500,000.00	6,635,005.00 (108,880,432)	

種類	銘柄	利率 (%)	償還日	券面総額	評価額	備考
特殊 債券	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN	2.250	2016/8/24	1,121,000.00	1,183,237.92	
	ELECTRICITE DE FRANCE SA	5.000	2018/2/5	400,000.00	469,172.00	
	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY	2.250	2022/9/5	1,360,000.00	1,395,441.60	
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	4.125	2024/4/15	225,000.00	270,672.75	
	EUROPEAN UNION	3.250	2018/4/4	2,010,000.00	2,250,898.50	
	SVENSK EXPORTKREDIT AB	3.625	2014/5/27	1,000,000.00	1,039,210.00	
	ユーロ 小計			6,116,000.00	6,608,632.77 (819,866,981)	
特殊債券 計					1,138,198,051 (1,138,198,051)	

社債券	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	0.900	2016/2/12	400,000.00	400,908.00	
	BACM 2006-5 A2	5.317	2047/9/1	974,021.27	973,777.75	
	BACM 2006-6 A2	5.309	2045/10/1	196,357.41	202,271.69	
	BACM 2007-2 A2	5.61919	2049/4/1	54,607.76	55,620.18	
	BANC OF AMERICA MERRILL LYNCH CO	5.07701	2042/11/1	1,097,000.00	1,117,799.12	
	CSMC 2007-C4 A2	5.76411	2039/9/1	356,039.43	359,841.89	
	DLJCM 1998-CG1 B4	7.19687	2031/6/1	204,589.53	205,477.44	
	GECMC 2005-C1 AJ	4.826	2048/6/1	503,000.00	535,312.72	
	GSMS 2004-GG2 C	5.532	2038/8/1	295,000.00	303,717.25	
	GSMS 2006-GG6 A2	5.506	2038/4/1	103,379.46	107,182.79	
	JPMCC 2003-CB6 E	5.67154	2037/7/1	120,000.00	123,716.40	
	JPMCC 2006-LDP9 A2S	5.298	2047/5/1	556,740.84	565,464.95	
	JPMCC 2007-LD11 A2	5.79169	2049/6/1	338,513.95	349,129.74	
	JPMCC 2007-LD12 A3	5.92942	2051/2/1	1,072,000.00	1,128,698.08	
	JPMCC 2007-LDPX A3S	5.317	2049/1/1	397,000.00	409,120.41	
	LBUBS 2007-C6 A3	5.933	2040/7/11	813,000.00	856,836.96	
	MLCFC 2006-3 A2	5.291	2046/7/1	589,372.47	596,468.50	
	MLCFC 2006-4 A2FL	0.3222	2049/12/12	119,147.11	118,899.27	
	MLMT 2007-C1 A2	5.74638	2050/6/1	63,715.98	64,916.38	
	MLMT 2007-C1 A3	5.85038	2050/6/1	131,000.00	138,208.93	
	MSC 2006-T23 A2	5.7496	2041/8/1	112,587.50	113,848.47	
	MSC 2007-IQ14 A2	5.610	2049/4/1	82,919.07	85,283.09	
	MSRR 2010-C30 A3B	5.46566	2043/12/1	310,143.00	317,332.11	
	WBCMT 2007-C34 A2	5.569	2046/5/1	324,845.67	325,241.98	
	WFRBS 2012-C9 C	4.543	2045/11/1	630,000.00	658,904.40	
	米ドル 小計				9,844,980.45	10,113,978.50 (969,930,538)
	FORTUM OYJ	4.500	2016/6/20	450,000.00	502,240.50	
	GE CAPITAL TRUST IV	4.625	2066/9/15	165,000.00	163,018.35	
	ユーロ 小計				615,000.00	665,258.85 (82,532,013)
	社債券 計					1,052,462,551 (1,052,462,551)
	合計					17,179,675,806 (17,179,675,806)

- (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 11 銘柄	36.25 %	43.11 %
	特殊債券 14 銘柄	1.22 %	
	社債券 25 銘柄	5.64 %	
オーストラリアドル	国債証券 3 銘柄	3.02 %	3.02 %
英ポンド	国債証券 4 銘柄	5.89 %	5.89 %
デンマーククローネ	国債証券 2 銘柄	1.21 %	1.21 %
ノルウェークローネ	特殊債券 1 銘柄	0.63 %	0.63 %
スウェーデンクローネ	国債証券 1 銘柄	1.39 %	1.39 %
マレーシアリングgit	国債証券 1 銘柄	0.71 %	0.71 %
ユーロ	国債証券 15 銘柄	38.79 %	44.04 %
	特殊債券 6 銘柄	4.77 %	
	社債券 2 銘柄	0.48 %	
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25年4月30日現在)

資産総額	620,115,625 円
負債総額	1,029,361 円
純資産総額( - )	619,086,264 円
発行済数量	538,228,483 口
1万口当たり純資産額( / ×10000 )	11,502 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25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年間における資本金の増減はありません。

##### （2）委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成25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	186	22,403
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	13	1,691
単位型公社債投資信託	0	0
合計	199	24,095

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17期事業年度（自平成23年4月1日 至平成24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18期事業年度に係る中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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。





## ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
流動資産				
現金・預金		6,270,894		1,324,746
有価証券		11,023,094		8,309,605
前払費用	1	195,613	1	200,463
未収委託者報酬		1,751,247		1,465,803
未収運用受託報酬	1	656,202	1	778,921
未収投資助言報酬	1	171,421	1	154,740
繰延税金資産		295,260		273,967
その他		64,039		44,410
流動資産合計		20,427,773		12,552,657
固定資産				
有形固定資産				
建物	2	133,329	2	115,964
車両	2	5,095	2	2,970
器具備品	2	179,790	2	148,251
有形固定資産合計		318,215		267,186
無形固定資産				
ソフトウェア		1,372,451		1,228,624
ソフトウェア仮勘定		51,575		55,978
その他		8,203		8,171
無形固定資産合計		1,432,230		1,292,774
投資その他の資産				
投資有価証券		16,986,491		25,328,584
差入保証金	1	284,824	1	283,591
繰延税金資産		500,589		437,364
その他		17		38
投資その他の資産合計		17,771,923		26,049,578
固定資産合計		19,522,370		27,609,540
資産合計		39,950,144		40,162,198
<b>負債の部</b>				
流動負債				
預り金		28,412		30,600
未払収益分配金		4,324		-
未払償還金		151,440		148,104
未払手数料	1	683,709	1	560,208
未払運用委託報酬		391,985		396,073
未払投資助言報酬		106,084		126,813
その他未払金	1	187,916	1	205,721
未払費用	1	119,099	1	122,185
未払法人税等		145,709		149,239
賞与引当金		552,829		538,159
その他		42,559		22,815
流動負債合計		2,414,070		2,299,923

固定負債		
退職給付引当金	644,223	767,977
役員退職慰労引当金	11,275	13,630
その他	1 66,068	1 4,973
固定負債合計	721,566	786,580
負債合計	3,135,637	3,086,503
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	17,625,364	17,833,930
利益剰余金合計	18,305,171	18,513,737
株主資本合計	36,587,011	36,795,577
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	227,494	280,116
評価・換算差額等合計	227,494	280,116
純資産合計	36,814,506	37,075,694
負債・純資産合計	39,950,144	40,162,198

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月 31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日)
営業収益		
委託者報酬	11,004,207	9,952,331
運用受託報酬	3,873,347	3,987,169
投資助言報酬	751,384	705,920
業務受託料	47,100	47,100
営業収益計	15,676,039	14,692,522
営業費用		
支払手数料	4,548,772	4,131,652
広告宣伝費	110,792	27,241
公告費	466	323
調査費	2,708,450	2,700,559
支払運用委託報酬	1,442,927	1,294,778
支払投資助言報酬	448,879	479,438
委託調査費	20,521	42,633
調査費	796,121	883,708
委託計算費	104,902	101,748
営業雑経費	543,623	390,063
通信費	57,003	55,182

印刷費		175,972		133,820
協会費		17,084		17,984
その他営業雑経費		293,563		183,076
営業費用計		8,017,006		7,351,588
一般管理費				
役員報酬	1	62,167	1	59,718
給料・手当		2,985,814		3,012,857
賞与引当金繰入額		547,443		537,887
賞与		256,821		260,246
福利厚生費		550,141		566,829
退職給付費用		163,211		156,575
役員退職慰労引当金繰入額		5,550		5,455
役員退職慰労金		637		650
其他人件費		135,147		115,587
不動産賃借料		635,759		632,434
その他不動産経費		38,835		27,417
交際費		14,220		14,037
旅費交通費		87,941		90,473
固定資産減価償却費		627,055		654,122
租税公課		77,387		79,628
業務委託費		183,393		179,945
器具備品費		178,045		151,259
保守料		92,961		87,228
保険料		63,246		60,291
寄付金		820		5,000
諸経費		39,883		56,644
一般管理費計		6,746,486		6,754,291
営業利益		912,546		586,642
営業外収益				
受取利息		3,284		1,966
有価証券利息		107,994		93,236
受取配当金		102,558		45,856
その他営業外収益		22,945		17,359
営業外収益計		236,783		158,419
営業外費用				
為替差損		9,852		6,419
賃貸借契約解約損		-		4,124
その他営業外費用		15,292		1,248
営業外費用計		25,144		11,792
経常利益		1,124,185		733,269
特別利益				
投資有価証券売却益		35,991		25,290
投資有価証券償還益		351		-
事故受取保険金	3	5,462	3	14,136
清算配当金		-	5	59,327
特別利益計		41,804		98,754
特別損失				
投資有価証券売却損		17,676		1,778
投資有価証券償還損		355,993		87,378
投資有価証券評価損		5,706		-
固定資産除却損	4	16,762	4	19,104
事故損失賠償金	2	22,343	2	39,244
特別損失計		418,482		147,506
税引前当期純利益		747,507		684,516

法人税、住民税及び事業税	272,647	263,157
法人税等調整額	37,686	77,232
法人税等合計	310,333	340,390
当期純利益	437,174	344,126

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	17,323,750	17,625,364
当期変動額		

剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	17,625,364	17,833,930
利益剰余金合計		
当期首残高	18,003,557	18,305,171
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	18,305,171	18,513,737
株主資本合計		
当期首残高	36,285,397	36,587,011
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	36,587,011	36,795,577
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	93,537	227,494
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	133,956	52,622
当期変動額合計	133,956	52,622
当期末残高	227,494	280,116
評価・換算差額等合計		
当期首残高	93,537	227,494
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	133,956	52,622
当期変動額合計	133,956	52,622
当期末残高	227,494	280,116
純資産合計		
当期首残高	36,378,935	36,814,506
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	133,956	52,622
当期変動額合計	435,570	261,188
当期末残高	36,814,506	37,075,694

（重要な会計方針）

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

…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。

## 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。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。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## 有形固定資産

定率法によっております。

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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## （追加情報）

当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）

## （貸借対照表関係）

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。

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
前払費用	60,402千円	52,725千円
未収運用受託報酬	296,706	383,091
未収投資助言報酬	152,956	135,967
差入保証金	280,262	280,262
未払手数料	88,132	90,057
その他未払金	14,956	19,525
未払費用	60,986	59,677
その他固定負債	66,068	4,973

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。		
	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
建物	187,418千円	206,955千円
車両	1,919	4,043
器具備品	592,884	573,767
計	782,221	784,767

## (損益計算書関係)

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。		
取締役	180,000千円	
監査役	30,000千円	
2. 事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。		
3. 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。		
	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
建物	8,300千円	-千円
器具備品	8,461	11,393
その他	-	7,711
計	16,762	19,104
5. 清算配当金は、会社型投資信託の清算配当であります。		

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成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

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	108,448	-	-	108,448
合計	108,448	-	-	108,448

## 2. 配当に関する事項

## 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

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

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。

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



当事業年度（自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	108,448	-	-	108,448
合計	108,448	-	-	108,448

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

平成23年 6月27日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成23年 3月31日
効力発生日	平成23年 6月27日

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成24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。

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24年 3月31日
効力発生日	平成24年 6月25日

## (リース取引関係)

## 1. ファイナンス・リース取引

## 所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

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（単位：千円）

	前事業年度（平成23年 3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	3,237	2,461	776

(単位：千円)

	当事業年度（平成24年 3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	417	445

未経過リース料期末残高相当額等

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年 3月31日)	当事業年度 (平成24年 3月31日)
1年内	342	174
1年超	462	287
合計	804	462

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

支払リース料	1,383	361
減価償却費相当額	1,258	330
支払利息相当額	53	19

## 減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

## 利息相当額の算定方法

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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含まれておりません(注2参照)

前事業年度（平成23年3月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	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	-

当事業年度（平成24年3月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,324,746	1,324,746	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,010,705	4,019,880	9,174
その他有価証券	4,298,900	4,298,900	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	18,362,076	18,430,810	68,733
その他有価証券	6,899,008	6,899,008	-

## (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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
非上場株式	132,500	67,500

非上場株式については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成23年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	6,270,894	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	4,000,000	10,400,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 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。

当事業年度(平成24年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	1,324,746	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	4,000,000	18,200,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの その他(注)	6,301,000	2,409,250	1,459,100	-
合計	11,625,746	20,609,250	1,459,100	-

(注) 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)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(平成23年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
--	----	------------------	------------	------------

時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	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

## 当事業年度（平成24年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	21,338,974	21,416,990	78,015
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	21,338,974	21,416,990	78,015
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	1,033,806	1,033,700	106
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,033,806	1,033,700	106
	合計	22,372,781	22,450,690	77,908

## 2. その他有価証券

## 前事業年度（平成23年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (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	5,495,142	5,493,181	1,961
	国債・地方債等	5,495,142	5,493,181	1,961
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,659,502	2,608,636	1,050,865
	小計	9,154,645	8,101,818	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	999,700	999,761	61
	国債・地方債等	999,700	999,761	61
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,181,862	3,835,995	654,133
	小計	4,181,562	4,835,756	654,194
	合計	13,336,207	12,937,574	398,632

## 当事業年度（平成24年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (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	4,298,900	4,297,606	1,293
	国債・地方債等	4,298,900	4,297,606	1,293
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	4,307,034	3,281,746	1,025,288
	小計	8,605,934	7,579,352	1,026,581
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	2,591,974	3,160,015	568,040
	小計	2,591,974	3,160,015	568,040
合計		11,197,908	10,739,367	458,540

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式については、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、上記の「その他有価証券」には含めておりません。

区分	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
非上場株式	132,500千円	67,500千円

### 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	561,210	35,991	17,676
合計	561,210	35,991	17,676

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	90,200	25,200	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	31,237	90	1,778
合計	121,437	25,290	1,778

### 4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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）

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）

#### 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

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
(1)退職給付債務	644,223千円	767,977千円
(2)退職給付引当金	644,223千円	767,977千円

(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

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
(1)勤務費用	130,059千円	132,222千円
(2)退職給付負担金	33,151千円	24,353千円

(注) 福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
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	45,640千円

## 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)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	前事業年度	当事業年度
	(平成23年3月31日)	(平成24年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	221,131千円	204,554千円
未払事業税	18,935	19,923
その他	<u>55,977</u>	<u>49,981</u>
繰延税金資産合計	296,044	274,458
繰延税金負債		
有価証券評価差額	<u>784</u>	<u>491</u>
繰延税金負債合計	<u>784</u>	<u>491</u>
繰延税金資産の純額	<u>295,260</u>	<u>273,967</u>
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	257,689	276,081
役員退職慰労引当金	4,510	4,857
税務上の繰延資産償却超過額	5,310	2,519
投資有価証券評価損	539,831	472,994
投資有価証券評価差額	261,653	212,965
その他	<u>30,323</u>	<u>6,911</u>
小計	<u>1,099,317</u>	<u>976,328</u>
評価性引当額	<u>120,282</u>	<u>106,755</u>
繰延税金資産合計	<u>979,034</u>	<u>869,573</u>
繰延税金負債		
特別分配金否認	58,098	50,467
投資有価証券評価差額	<u>420,346</u>	<u>381,742</u>
繰延税金負債合計	<u>478,445</u>	<u>432,209</u>
繰延税金資産の純額	<u>500,589</u>	<u>437,364</u>
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	前事業年度	当事業年度
	(平成23年3月31日)	(平成24年3月31日)
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。		法定実効税率 40.00%
		(調整)
		交際費等永久に損金に算入されない項目 0.93
	住民税均等割	0.85
	税率変更に伴う影響	9.27
	その他	<u>1.32</u>
	税効果会計適用後の法人税等の負担率	49.73
3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正		
「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）および「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が、平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率が変更されることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用される実効税率は、一時差異等に係る解消時期に応じて以下のとおりとなります。		
平成24年3月31日まで 40.00%		
平成24年4月1日から平成27年3月31日 38.01%		
平成27年4月1日以降 35.64%		
この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債を控除した金額）は48,216千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,484千円、その他有価証券評価差額金が15,268千円、それぞれ増加しています。		

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自平成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

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24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

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,205,257

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。



## （関連当事者との取引）

## 1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	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
								業務受託料の受取	47,100	-	-

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	1,525,483	未収運用受託報酬	383,091
								投資助言報酬の受取	632,674	未収投資助言報酬	135,967
								業務受託料の受取	47,100	-	-

（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 親会社に関する注記

## 親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

## （1株当たり情報）

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
1株当たり純資産額	339,466円90銭	341,875円31銭
1株当たり当期純利益金額	4,031円18銭	3,173円18銭

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

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
当期純利益	437,174千円	344,126千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	437,174千円	344,126千円
期中平均株式数	108千株	108千株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第18期中間会計期間末  
(平成24年9月30日現在)

## 資産の部

## 流動資産

現金・預金		861,189
有価証券		7,213,238
前払費用		580,968
未収委託者報酬		1,413,920
未収運用受託報酬		974,209
未収投資助言報酬		153,445
繰延税金資産		193,172

その他		41,624
-----	--	--------

流動資産合計		11,431,768
--------	--	------------

## 固定資産

有形固定資産	1	262,947
--------	---	---------

無形固定資産		1,227,694
--------	--	-----------

## 投資その他の資産

投資有価証券		26,318,839
--------	--	------------

繰延税金資産		545,994
--------	--	---------

その他		283,609
-----	--	---------

投資その他の資産合計		27,148,443
------------	--	------------

固定資産合計		28,639,084
--------	--	------------

資産合計		40,070,853
------	--	------------

## 負債の部

## 流動負債

未払手数料		548,329
-------	--	---------

未払運用委託報酬		430,444
----------	--	---------

未払投資助言報酬		140,037
----------	--	---------

その他未払金		179,488
--------	--	---------

未払費用		99,347
------	--	--------

未払法人税等		129,746
--------	--	---------

前受投資助言報酬		70,261
----------	--	--------

賞与引当金		372,279
-------	--	---------

その他		219,373
-----	--	---------

流動負債合計		2,189,308
--------	--	-----------

## 固定負債

退職給付引当金		821,839
---------	--	---------

役員退職慰労引当金		9,100
-----------	--	-------

固定負債合計		830,939
--------	--	---------

負債合計		3,020,247
------	--	-----------

純資産の部	
株主資本	
資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	18,001,445
利益剰余金合計	18,681,252
株主資本合計	36,963,092
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	87,512
評価・換算差額等合計	87,512
純資産合計	37,050,605
負債・純資産合計	40,070,853

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第18期中間会計期間

(自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		4,485,618
運用受託報酬		2,469,602
投資助言報酬		338,891
業務受託料		23,614
営業収益計		7,317,725
営業費用		3,610,733
一般管理費	1	3,250,777
営業利益		456,214
営業外収益	2	88,157
営業外費用	3	15,890
経常利益		528,480
特別利益	4	107,408
特別損失	5	120,776
税引前中間純利益		515,112
法人税、住民税及び事業税		120,655
法人税等調整額		91,382
法人税等合計		212,037
中間純利益		303,074

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第18期中間会計期間

(自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

株主資本	
資本金	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	17,833,930
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	303,074
当中間期変動額合計	167,514
当中間期末残高	18,001,445
利益剰余金合計	
当期首残高	18,513,737
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560

中間純利益	303,074
当中間期変動額合計	167,514
当中間期末残高	18,681,252
株主資本合計	
当期首残高	36,795,577
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	303,074
当中間期変動額合計	167,514
当中間期末残高	36,963,092
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	280,116
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)	192,603
当中間期変動額合計	192,603
当中間期末残高	87,512
評価・換算差額等合計	
当期首残高	280,116
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)	192,603
当中間期変動額合計	192,603
当中間期末残高	87,512
純資産合計	
当期首残高	37,075,694
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	303,074
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	192,603
当中間期変動額合計	25,088
当中間期末残高	37,050,605

## （重要な会計方針）

項目	第18期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24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。 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。
2．固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定額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。 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。
3．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。 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。 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。 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。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．リース取引の処理方法	平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。なお、仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。



## （会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以降に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当中間会計期間の減価償却費が911千円減少し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ911千円増加しております。

## （注記事項）

## [ 中間貸借対照表関係 ]

第18期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	822,082千円

## [ 中間損益計算書関係 ]

第18期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	37,633千円
無形固定資産	240,255千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
有価証券利息	44,672千円
受取配当金	31,458千円
補助金収入	9,500千円
受取利息	115千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	15,252千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	105,652千円
投資有価証券償還益	1,755千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	119,106千円
投資有価証券償還損	152千円
事故損失賠償金	1千円
固定資産除却損	
建物	1,481千円
器具備品	35千円
計	1,516千円

## [ 中間株主資本等変動計算書関係 ]

第18期中間会計期間  
(自 平成24年4月1日  
至 平成24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24年6月25日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成24年3月31日	平成24年6月25日

## [リース取引関係]

第18期中間会計期間  
 （自 平成24年4月1日  
 至 平成24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	千円	千円
	862	503	359

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1年内	177千円
1年超	198千円
合計	375千円

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	93千円
減価償却費相当額	86千円
支払利息相当額	6千円

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18期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成24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	861,189	861,189	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,013,898	4,022,770	8,871
その他有価証券	3,199,340	3,199,340	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	20,430,130	20,531,710	101,579
その他有価証券	5,821,209	5,821,209	-

## （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18期中間会計期間末（平成24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	23,639,299	23,749,760	110,460
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	23,639,299	23,749,760	110,460
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	804,729	804,720	9
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	804,729	804,720	9
合計		24,444,029	24,554,480	110,450

## 2. その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	2,899,052	2,899,430	377
	国債・地方債 等	2,899,052	2,899,430	377
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,675,650	3,428,202	752,552
	小計	5,574,702	6,327,632	752,930
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	299,928	299,910	18
	国債・地方債 等	299,928	299,910	18
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,999,200	2,393,007	606,192
	小計	3,299,128	2,692,917	606,211
合計		8,873,830	9,020,549	146,718

(注1) 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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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	1,254,877

## 〔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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔1株当たり情報〕

	第18期中間会計期間 （自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
1株当たり純資産額	341,643円97銭
1株当たり中間純利益	2,794円65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	303,074千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	303,074千円
期中平均株式数	108千株

## 〔重要な後発事象〕

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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24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24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24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	1,250,000百万円	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24年9月末現在、204,000米ドル（約15百万円、1米ドル = 77.6円）

(注) 資本の額はCapital-Issued and Outstanding（発行済流通株式資本）を記載していません。

##### 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24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 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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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24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24年4月1日から平成25年3月31日までの第18期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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24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24年4月1日から平成24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25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 岩本 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイバランスアクティブの平成24年9月21日から平成25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、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイバランスアクティブの平成25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](#)