

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年6月20日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 宇治原 潔
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	DCニッセイバランスアクティブ
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成25年12月20日をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、有価証券報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

（略）

ファンドの特色

（略）

国内株式マザーファンドおよび国内債券マザーファンドの運用をニッセイアセットマネジメントが、海外株式マザーファンドおよび海外債券マザーファンドの運用をザ・パトナム・アドバイザー・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25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1,347億ドル(約12兆円)、投信残高は約693億ドル(約6兆円)の規模を誇ります。

設定済み投信は80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173名有しています。

（略）

<訂正後>

（略）

ファンドの特色

（略）

国内株式マザーファンドおよび国内債券マザーファンドの運用をニッセイアセットマネジメントが、海外株式マザーファンドおよび海外債券マザーファンドの運用をザ・パトナム・アドバイザー・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25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1,408億ドル(約14兆円)、投信残高は約705億ドル(約7兆円)の規模を誇ります。

設定済み投信は80本以上、投資家数は400万人以上にのぼります。

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176名有しています。

(略)

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(略)

委託会社の概況(平成25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26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)

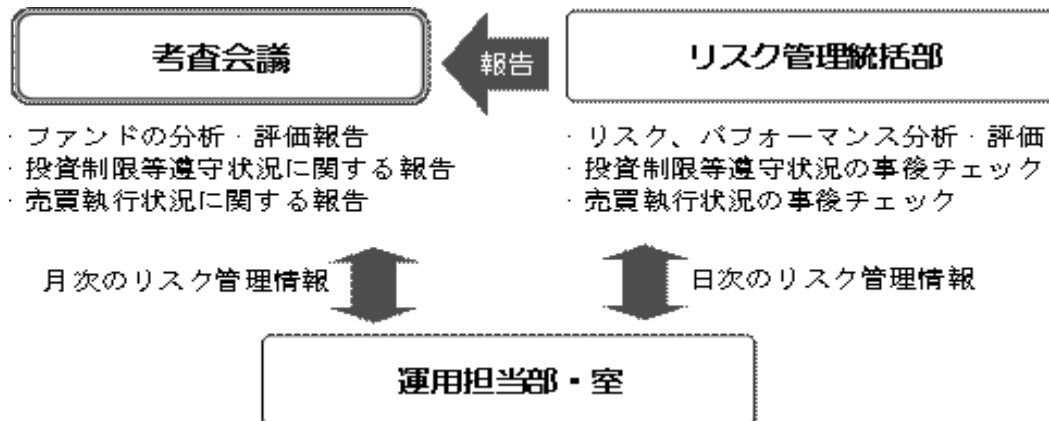
社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネージャー/アナリスト服務規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

内部管理体制および意思決定を監督する組織

・短期金融資産の運用に関する留意点

(略)

(2) 投資リスク管理体制



1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。

(略)

4 【手数料等及び税金】

(3) 【信託報酬等】

< 訂正前 >

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.365% (税抜1.3%) の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

消費税率が8%になった場合は、年1.404%となります。

信託報酬の配分 (年率・税抜)		
委託会社	販売会社	受託会社
0.6%	0.6%	0.1%

(略)

< 訂正後 >

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.404% (税抜1.3%) の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分 (年率・税抜)		
委託会社	販売会社	受託会社
0.6%	0.6%	0.1%

(略)

(4) 【その他の手数料等】

< 訂正前 >

(略)

監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に下記の監査報酬率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.00420% (税抜0.004%)
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00525% (税抜0.005%)
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00735% (税抜0.007%)
10億円以下 の部分	年 0.04200% (税抜0.040%)

消費税率が8%になった場合は、以下の通りとなります。

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.00432% (税抜0.004%)
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00540% (税抜0.005%)
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00756% (税抜0.007%)
10億円以下 の部分	年 0.04320% (税抜0.040%)

(略)

<訂正後>

(略)

監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に下記の監査報酬率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.00432% (税抜0.004%)
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00540% (税抜0.005%)
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00756% (税抜0.007%)
10億円以下 の部分	年 0.04320% (税抜0.040%)

(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】

「DCニッセイバランスアクティブ」

（平成26年4月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	714,523,858	97.60
内 日本	714,523,858	97.60
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,574,369	2.40
純資産総額	732,098,227	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26年4月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	19,710,929,600	98.20
内 日本	19,710,929,600	98.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	361,565,962	1.80
純資産総額	20,072,495,562	100.00

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

その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	311,985,000	1.55
内 日本	311,985,000	1.55

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

その他資産として、株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

（参考情報）

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

（平成26年4月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	24,401,269,780	96.12
内 日本	24,401,269,780	96.12

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	985,044,550	3.88
純資産総額	25,386,314,330	100.00

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

その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引（買建）	869,520,000	3.43
内 日本	869,520,000	3.43

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

その他資産として、債券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。

（参考情報）

「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」

（平成26年4月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	28,000,677,964	95.95
内 アメリカ	14,772,332,061	50.62
内 イギリス	4,055,887,591	13.90
内 フランス	2,353,912,859	8.07
内 イタリア	1,011,500,110	3.47
内 カナダ	811,733,556	2.78
内 スペイン	718,704,929	2.46
内 ドイツ	666,467,268	2.28
内 オーストラリア	635,692,046	2.18
内 オランダ	473,456,901	1.62
内 シンガポール	402,519,523	1.38
内 ポルトガル	321,844,893	1.10
内 スウェーデン	257,930,575	0.88
内 オーストリア	252,511,547	0.87
内 アイルランド	231,015,838	0.79
内 香港	213,929,100	0.73
内 ジャージー	211,649,826	0.73
内 スイス	211,473,519	0.72
内 ベルギー	203,320,998	0.70
内 バミューダ	194,794,824	0.67
投資証券	599,639,669	2.05
内 アメリカ	346,080,558	1.19
内 アイルランド	253,559,111	0.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	581,738,420	1.99

純資産総額	29,182,056,053	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）

「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」

（平成26年4月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	13,125,404,225	78.23
内 アメリカ	2,993,016,284	17.84
内 ベルギー	1,755,980,432	10.47
内 スペイン	1,611,271,064	9.60
内 イタリア	1,458,116,543	8.69
内 ドイツ	1,329,459,324	7.92
内 イギリス	1,251,355,417	7.46
内 メキシコ	541,915,921	3.23
内 カナダ	333,810,869	1.99
内 ポーランド	323,822,724	1.93
内 アイルランド	261,976,709	1.56
内 オーストリア	251,161,238	1.50
内 フィンランド	240,910,629	1.44
内 デンマーク	228,139,015	1.36
内 オーストラリア	207,988,111	1.24
内 南アフリカ	130,709,973	0.78
内 フランス	85,173,334	0.51
内 スウェーデン	62,487,277	0.37
内 スイス	58,109,361	0.35
特殊債券	1,098,848,846	6.55
内 国際機関	554,671,162	3.31
内 オランダ	277,201,315	1.65
内 ドイツ	132,790,638	0.79
内 アメリカ	68,951,881	0.41
内 フランス	65,233,850	0.39
社債券	1,145,636,058	6.83
内 アメリカ	1,035,444,338	6.17
内 フィンランド	68,939,217	0.41
内 オーストラリア	41,252,503	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,407,764,150	8.39
純資産総額	16,777,653,279	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】

「DCニッセイバランスアクティブ」

【投資有価証券の主要銘柄】

(平成26年4月30日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価 (円) 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内株式マザーファ ンド 日本	親投資信託受 益証券	345,763,779	0.6832 236,230,953	0.6944 240,098,368	- -	32.80%
2	ニッセイ国内債券マザーファ ンド 日本	親投資信託受 益証券	159,902,765	1.3058 208,811,965	1.3043 208,561,176	- -	28.49%
3	ニッセイ/パトナム・海外株 式マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	111,499,732	1.6093 179,442,288	1.5925 177,563,323	- -	24.25%
4	ニッセイ/パトナム・海外債 券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	35,899,090	2.4278 87,156,322	2.4597 88,300,991	- -	12.06%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	97.60
	小計		97.60
合計(対純資産総額比)			97.60

(注) 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」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年4月30日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円）	評価単価（円）	利率（％） 償還日	投資 比率
				簿価金額（円）	評価金額（円）		
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	158,100	6,161.46 974,128,272	5,516.00 872,079,600	- -	4.34%
2	三菱UFJフィナンシャル G 日本	株式 銀行業	1,278,600	652.15 833,845,593	542.00 693,001,200	- -	3.45%
3	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	106,000	5,257.21 557,264,971	4,033.00 427,498,000	- -	2.13%
4	三菱商事 日本	株式 卸売業	225,600	1,965.26 443,362,848	1,828.00 412,396,800	- -	2.05%
5	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	51,200	8,804.84 450,808,060	7,590.00 388,608,000	- -	1.94%
6	住友不動産 日本	株式 不動産業	96,000	4,960.00 476,160,000	3,960.00 380,160,000	- -	1.89%
7	ソニー 日本	株式 電気機器	197,500	1,854.85 366,333,184	1,792.00 353,920,000	- -	1.76%
8	ヤマダ電機 日本	株式 小売業	913,400	336.40 307,268,425	377.00 344,351,800	- -	1.72%
9	日立 日本	株式 電気機器	455,000	764.74 347,958,902	727.00 330,785,000	- -	1.65%
10	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	194,800	1,685.30 328,298,126	1,622.00 315,965,600	- -	1.57%
11	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,551,900	213.78 331,776,368	200.00 310,380,000	- -	1.55%
12	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	90,500	3,361.64 304,228,580	3,356.00 303,718,000	- -	1.51%
13	ファナック 日本	株式 電気機器	16,300	18,791.73 306,305,302	18,400.00 299,920,000	- -	1.49%
14	リコー 日本	株式 電気機器	254,000	1,111.43 282,305,430	1,175.00 298,450,000	- -	1.49%
15	本田技研 日本	株式 輸送用機器	86,900	4,284.93 372,360,834	3,380.00 293,722,000	- -	1.46%
16	マツダ 日本	株式 輸送用機器	639,000	506.81 323,856,080	457.00 292,023,000	- -	1.45%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	37,900	8,270.00 313,433,000	7,453.00 282,468,700	- -	1.41%
18	トプコン 日本	株式 精密機器	158,200	1,551.00 245,368,200	1,783.00 282,070,600	- -	1.41%

19	ブロードリーフ 日本	株式 情報・通信業	169,400	1,952.00 330,668,800	1,642.00 278,154,800	- -	1.39%
20	村田製作所 日本	株式 電気機器	31,600	9,078.83 286,891,043	8,500.00 268,600,000	- -	1.34%
21	オリックス 日本	株式 その他金融業	181,100	1,785.30 323,318,111	1,477.00 267,484,700	- -	1.33%
22	デンソー 日本	株式 輸送用機器	54,400	4,802.66 261,265,160	4,652.00 253,068,800	- -	1.26%
23	東京急行 日本	株式 陸運業	393,000	657.19 258,278,710	643.00 252,699,000	- -	1.26%
24	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	221,200	1,208.00 267,211,289	1,137.00 251,504,400	- -	1.25%
25	エムスリー 日本	株式 サービス業	177,200	1,255.43 222,462,990	1,402.00 248,434,400	- -	1.24%
26	大和ハウス 日本	株式 建設業	144,000	1,973.95 284,248,929	1,723.00 248,112,000	- -	1.24%
27	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製 品	452,900	525.27 237,897,338	530.00 240,037,000	- -	1.20%
28	カカクコム 日本	株式 サービス業	159,500	1,764.28 281,403,483	1,455.00 232,072,500	- -	1.16%
29	日立化成 日本	株式 化学	147,200	1,559.50 229,558,989	1,503.00 221,241,600	- -	1.10%
30	東京海上HD 日本	株式 保険業	73,000	3,416.83 249,429,082	3,011.00 219,803,000	- -	1.10%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	14.84
		輸送用機器	11.47
		銀行業	9.15
		情報・通信業	8.65
		化学	5.49
		機械	4.44
		医薬品	4.34
		小売業	4.19
		卸売業	4.08
		食料品	4.06
		建設業	3.51

	不動産業	3.25
	陸運業	2.67
	保険業	2.55
	サービス業	2.39
	精密機器	2.14
	証券、商品先物取引業	1.59
	電気・ガス業	1.46
	その他金融業	1.33
	石油・石炭製品	1.20
	非鉄金属	1.06
	鉄鋼	1.03
	金属製品	1.02
	空運業	0.65
	ゴム製品	0.60
	繊維製品	0.58
	海運業	0.47
	小計	98.20
合計（対純資産総額比）		98.20

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物2606月	買建	27	321,538,515	311,985,000	1.55%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

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

（参考情報）

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年4月30日現在）

銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率

1	第333回 利付国債(2年)	日本	国債証券	1,985,800,000	100.02	100.02	0.100000	7.82%
					1,986,248,978	1,986,217,018	2015/10/15	
2	第332回 利付国債(2年)	日本	国債証券	1,619,400,000	100.02	100.02	0.100000	6.38%
					1,619,774,776	1,619,723,880	2015/9/15	
3	第329回 利付国債(2年)	日本	国債証券	1,490,300,000	100.15	100.13	0.200000	5.88%
					1,492,617,786	1,492,371,517	2015/6/15	
4	第308回 利付国債(10年)	日本	国債証券	1,369,500,000	106.58	106.31	1.300000	5.74%
					1,459,613,100	1,455,929,145	2020/6/20	
5	第140回 利付国債(20年)	日本	国債証券	1,261,000,000	105.69	105.54	1.700000	5.24%
					1,332,815,458	1,330,909,840	2032/9/20	
6	第328回 利付国債(2年)	日本	国債証券	1,123,600,000	100.02	100.02	0.100000	4.43%
					1,123,875,064	1,123,880,900	2015/5/15	
7	第337回 利付国債(2年)	日本	国債証券	984,600,000	100.03	100.02	0.100000	3.88%
					984,895,974	984,855,996	2016/2/15	
8	第331回 利付国債(2年)	日本	国債証券	938,400,000	100.03	100.01	0.100000	3.70%
					938,762,460	938,578,296	2015/8/15	
9	第298回 利付国債(10年)	日本	国債証券	783,500,000	105.37	105.14	1.300000	3.25%
					825,573,950	823,834,580	2018/12/20	
10	第121回 利付国債(20年)	日本	国債証券	664,800,000	110.42	110.87	1.900000	2.90%
					734,072,160	737,103,648	2030/9/20	
11	第127回 利付国債(20年)	日本	国債証券	456,000,000	110.28	110.44	1.900000	1.98%
					502,879,426	503,633,760	2031/3/20	
12	第305回 利付国債(10年)	日本	国債証券	451,200,000	106.07	106.04	1.300000	1.88%
					478,629,642	478,456,992	2019/12/20	
13	第111回 利付国債(20年)	日本	国債証券	383,000,000	115.82	116.00	2.200000	1.75%
					443,614,476	444,287,660	2029/6/20	

14	第313回 利付国債（10年） 日本	国債証券	414,300,000	106.53 441,391,077	106.52 441,341,361	1.300000 2021/3/20	1.74%
15	第329回 利付国債（10年） 日本	国債証券	388,100,000	102.08 396,181,640	102.17 396,537,294	0.800000 2023/6/20	1.56%
16	第334回 利付国債（20年） 日本	国債証券	363,700,000	100.02 363,795,288	100.02 363,783,651	0.100000 2015/11/15	1.43%
17	第17回 物価連動国債（10年） 日本	国債証券	329,600,000	108.05 356,134,382	109.64 361,391,568	0.100000 2023/9/10	1.42%
18	第18回 物価連動国債（10年） 日本	国債証券	329,100,000	108.19 356,083,461	108.94 358,524,666	0.100000 2024/3/10	1.41%
19	第125回 利付国債（20年） 日本	国債証券	309,500,000	114.70 355,006,820	115.00 355,943,570	2.200000 2031/3/20	1.40%
20	第142回 利付国債（20年） 日本	国債証券	329,100,000	106.70 351,178,965	106.85 351,672,969	1.800000 2032/12/20	1.39%
21	第335回 利付国債（20年） 日本	国債証券	347,600,000	100.02 347,689,316	100.02 347,683,424	0.100000 2015/12/15	1.37%
22	第88回 利付国債（20年） 日本	国債証券	295,700,000	117.85 348,482,450	117.43 347,255,295	2.300000 2026/6/20	1.37%
23	第122回 利付国債（20年） 日本	国債証券	293,200,000	108.13 317,054,752	109.33 320,581,948	1.800000 2030/9/20	1.26%
24	第128回 利付国債（20年） 日本	国債証券	277,800,000	109.64 304,594,920	110.18 306,088,374	1.900000 2031/6/20	1.21%
25	第148回 利付国債（20年） 日本	国債証券	292,400,000	100.47 293,794,748	100.30 293,297,668	1.500000 2034/3/20	1.16%
26	第70回 利付国債（20年） 日本	国債証券	234,500,000	117.52 275,605,505	117.30 275,087,260	2.400000 2024/6/20	1.08%

27	第328回 利付国債（10年） 日本	国債証券	266,600,000	100.15 266,999,900	100.55 268,068,966	0.600000 2023/3/20	1.06%
28	第40回 利付国債（30年） 日本	国債証券	259,800,000	103.03 267,695,314	102.36 265,931,280	1.800000 2043/9/20	1.05%
29	第39回 利付国債（30年） 日本	国債証券	245,200,000	105.19 257,927,684	104.71 256,753,824	1.900000 2043/6/20	1.01%
30	第327回 利付国債（2年） 日本	国債証券	251,300,000	100.02 251,357,852	100.02 251,357,852	0.100000 2015/4/15	0.99%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率（％）
公社債券	国内	国債証券	96.12
	小計		96.12
合計（対純資産総額比）			96.12

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
債券先物取引	大阪取引所	長国2606月限	買建	6	869,235,750	869,520,000	3.43%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

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

（参考情報）

「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年4月30日現在）

銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面 金額	簿価単価 （円） 簿価金額 （円）	評価単価 （円） 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率
-----------	----------	----------------------	----------------------------	----------------------------	------------------	----------

1	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 エネルギー	131,367	3,583.62 470,769,651	3,926.90 515,865,951	- -	1.77%
2	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	9,418	56,326.57 530,483,701	54,147.29 509,959,243	- -	1.75%
3	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,607	6,232.87 396,454,239	7,998.93 508,788,432	- -	1.74%
4	MONSANTO CO アメリカ	株式 素材	44,000	11,672.34 513,583,107	11,334.30 498,709,226	- -	1.71%
5	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	23,700	22,154.94 525,072,095	20,795.96 492,864,458	- -	1.69%
6	SANOFI フランス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	43,983	10,668.59 469,236,825	10,939.49 481,151,729	- -	1.65%
7	MICRON TECHNOLOGY INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	182,000	2,273.10 413,705,182	2,575.51 468,743,002	- -	1.61%
8	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP アメリカ	株式 保険	85,468	5,170.86 441,943,156	5,418.83 463,136,912	- -	1.59%
9	MORGAN STANLEY アメリカ	株式 各種金融	132,700	3,166.79 420,233,618	3,131.65 415,570,910	- -	1.42%
10	BARCLAYS PLC イギリス	株式 銀行	948,062	444.20 421,134,931	432.02 409,582,066	- -	1.40%
11	UNICREDIT SPA イタリア	株式 銀行	439,866	755.06 332,129,586	930.52 409,305,473	- -	1.40%
12	EZION HOLDINGS LTD シンガポール	株式 エネルギー	2,178,400	184.18 401,230,219	184.77 402,519,523	- -	1.38%
13	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	67,300	5,663.48 381,152,337	5,966.77 401,563,721	- -	1.38%
14	CME GROUP INC アメリカ	株式 各種金融	55,100	8,553.20 471,281,628	7,267.86 400,459,433	- -	1.37%
15	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	42,400	8,766.53 371,701,133	8,741.34 370,633,066	- -	1.27%
16	THOMAS COOK GROUP PLC イギリス	株式 消費者サービス	1,146,396	290.96 333,564,284	306.31 351,160,101	- -	1.20%
17	GENWORTH FINANCIAL INC- CL A アメリカ	株式 保険	188,600	1,572.88 296,645,681	1,784.38 336,535,557	- -	1.15%

18	ING GROEP NV オランダ	株式 各種金融	232,778	1,358.50 316,229,868	1,430.15 332,908,993	- -	1.14%
19	DISH NETWORK CORP アメリカ	株式 メディア	57,300	5,738.76 328,831,410	5,785.15 331,489,198	- -	1.14%
20	TUI TRAVEL PLC イギリス	株式 消費者サービス	439,197	694.19 304,887,405	739.37 324,730,376	- -	1.11%
21	INDITEX SA スペイン	株式 小売	21,124	16,392.88 346,283,297	15,279.57 322,765,678	- -	1.11%
22	BANCO ESPIRITO SANTO- REG ポルトガル	株式 銀行	1,760,210	149.77 263,627,918	182.84 321,844,893	- -	1.10%
23	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,500	5,463.70 346,945,022	5,060.72 321,356,050	- -	1.10%
24	BG GROUP PLC イギリス	株式 エネルギー	156,338	2,143.52 335,114,126	2,038.36 318,674,587	- -	1.09%
25	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC アメリカ	株式 保険	87,210	3,642.68 317,678,384	3,607.76 314,633,412	- -	1.08%
26	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	131,493	2,256.72 296,743,636	2,333.63 306,856,672	- -	1.05%
27	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	194,900	1,617.59 315,269,943	1,563.77 304,780,020	- -	1.04%
28	CELGENE CORP アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	20,000	16,761.87 335,237,541	15,052.88 301,057,740	- -	1.03%
29	YAHOO! INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	79,700	4,111.24 327,666,052	3,676.51 293,018,349	- -	1.00%
30	NATIXIS フランス	株式 銀行	393,616	668.92 263,300,591	736.76 290,002,302	- -	0.99%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	銀行	9.67
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.57
		ソフトウェア・サービス	8.67
		エネルギー	8.52
		素材	7.57
		各種金融	6.40

		保険	6.11
		メディア	5.00
		耐久消費財・アパレル	4.98
		資本財	4.55
		半導体・半導体製造装置	3.38
		消費者サービス	2.99
		ヘルスケア機器・サービス	2.83
		食品・飲料・タバコ	2.70
		小売	2.69
		不動産	2.04
		公益事業	1.60
		商業・専門サービス	1.32
		運輸	1.12
		食品・生活必需品小売り	1.05
		電気通信サービス	1.03
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.86
		自動車・自動車部品	0.74
		家庭用品・パーソナル用品	0.53
	小計		95.95
投資証券	外国	投資証券	2.05
	小計		2.05
合 計（対純資産総額比）			98.01

（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。

株式（外国）の業種は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。

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）

「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年4月30日現在）

銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（%） 償還日	投資 比率
-----------	----	------------------	--------------------	--------------------	--------------	----------

1	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	1,467,009,000	115.78 1,698,635,051	119.69 1,755,980,432	4.250000 2022/9/28	10.47%
2	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	1,349,364,800	105.10 1,418,276,803	111.67 1,506,876,153	4.400000 2023/10/31	8.98%
3	BUNDESobligation ドイツ	国債証券	1,248,729,400	100.98 1,260,976,501	102.18 1,276,051,599	1.000000 2018/10/12	7.61%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	781,580,370	95.07 743,082,713	95.58 747,073,596	1.000000 2019/8/31	4.45%
5	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	644,917,000	107.34 692,318,399	114.26 736,895,062	4.750000 2023/8/1	4.39%
6	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	643,499,600	104.78 674,323,230	112.07 721,221,481	4.500000 2023/5/1	4.30%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	749,053,000	91.43 684,911,591	93.28 698,724,128	1.625000 2022/8/15	4.16%
8	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	509,386,500	107.94 549,852,163	106.38 541,915,921	8.000000 2015/12/17	3.23%
9	UK TSY 1.75% 2022 イギリス	国債証券	501,606,350	92.11 462,039,641	94.06 471,825,981	1.750000 2022/9/7	2.81%
10	UK TSY 3 1/4% 2044 イギリス	国債証券	488,656,100	92.93 454,152,092	95.95 468,870,414	3.250000 2044/1/22	2.79%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	373,500,400	106.06 396,141,994	105.42 393,777,736	2.750000 2017/12/31	2.35%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	376,578,700	94.08 354,312,149	95.32 358,984,943	2.000000 2023/2/15	2.14%
13	POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド	国債証券	309,762,600	104.59 324,011,679	104.53 323,822,724	5.000000 2016/4/25	1.93%
14	EUROPEAN UNION 国際機関	特殊債券	284,897,400	110.19 313,954,085	110.37 314,464,052	3.250000 2018/4/4	1.87%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	342,717,400	79.81 273,529,611	86.71 297,197,674	2.750000 2042/8/15	1.77%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	290,899,350	101.08 294,055,607	100.90 293,534,898	1.000000 2016/8/31	1.75%
17	TSY 2 3/4% 2015 イギリス	国債証券	288,358,900	102.48 295,518,851	101.71 293,307,138	2.750000 2015/1/22	1.75%
18	CANADIAN GOVERNMENT カナダ	国債証券	278,289,000	101.25 281,792,658	104.10 289,723,895	2.750000 2022/6/1	1.73%

19	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券	218,279,600	114.98 250,999,712	115.06 251,161,238	3.500000 2021/9/15	1.50%
20	TREASURY 5% 2020 アイルランド	国債証券	184,262,000	112.41 207,147,340	118.93 219,153,852	5.000000 2020/10/18	1.31%
21	AUSTRALIAN GOVERNMENT オーストラリア	国債証券	184,804,400	110.27 203,796,748	112.54 207,988,111	5.500000 2023/4/21	1.24%
22	EFSF 国際機関	特殊債券	192,766,400	101.45 195,563,440	104.67 201,770,518	2.250000 2022/9/5	1.20%
23	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN オランダ	特殊債券	158,890,540	104.43 165,942,102	104.23 165,619,554	2.250000 2016/8/24	0.99%
24	KINGDOM OF DENMARK デンマーク	国債証券	132,930,000	113.38 150,716,034	112.78 149,930,417	4.000000 2017/11/15	0.89%
25	KFW ドイツ	特殊債券	121,079,800	109.51 132,605,386	109.67 132,790,638	4.000000 2020/1/27	0.79%
26	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券	129,700,900	103.57 134,341,598	100.77 130,709,973	8.000000 2018/12/21	0.78%
27	FINNISH GOVERNMENT フィンランド	国債証券	124,731,200	103.32 128,882,254	103.02 128,500,576	1.750000 2016/4/15	0.77%
28	FINNISH GOVERNMENT フィンランド	国債証券	97,800,600	112.65 110,180,199	114.93 112,410,053	3.500000 2021/4/15	0.67%
29	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN オランダ	特殊債券	111,020,000	101.05 112,193,481	100.50 111,581,761	3.500000 2014/9/5	0.67%
30	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	85,044,000	113.81 96,792,828	122.75 104,394,911	5.850000 2022/1/31	0.62%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	78.23
		特殊債券	6.55
		社債券	6.83
	小計	91.61	
合 計（対純資産総額比）			91.61

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

「DCニッセイバランスアクティブ」

【純資産の推移】

平成26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 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第6計算期間末 (平成16年9月21日)	366,034,754	366,034,754	1.0137	1.0137
第7計算期間末 (平成17年3月22日)	381,515,973	381,515,973	1.0480	1.0480
第8計算期間末 (平成17年9月20日)	409,008,283	409,008,283	1.1140	1.1140
第9計算期間末 (平成18年3月20日)	441,308,468	441,308,468	1.2312	1.2312
第10計算期間末 (平成18年9月20日)	468,218,480	468,218,480	1.2119	1.2119
第11計算期間末 (平成19年3月20日)	514,934,547	514,934,547	1.2780	1.2780
第12計算期間末 (平成19年9月20日)	548,987,708	548,987,708	1.2702	1.2702
第13計算期間末 (平成20年3月21日)	473,348,432	473,348,432	1.0769	1.0769
第14計算期間末 (平成20年9月22日)	486,614,230	486,614,230	1.0590	1.0590
第15計算期間末 (平成21年3月23日)	377,995,817	377,995,817	0.8152	0.8152
第16計算期間末 (平成21年9月24日)	414,915,163	414,915,163	0.9269	0.9269
第17計算期間末 (平成22年3月23日)	423,144,417	423,144,417	0.9327	0.9327
第18計算期間末 (平成22年9月21日)	419,602,211	419,602,211	0.8907	0.8907
第19計算期間末 (平成23年3月22日)	435,154,538	435,154,538	0.9034	0.9034

第20計算期間末 (平成23年9月20日)	417,148,183	417,148,183	0.8297	0.8297
第21計算期間末 (平成24年3月21日)	478,472,469	478,472,469	0.9218	0.9218
第22計算期間末 (平成24年9月20日)	471,218,750	471,218,750	0.8811	0.8811
第23計算期間末 (平成25年3月21日)	594,834,162	594,834,162	1.0955	1.0955
第24計算期間末 (平成25年9月20日)	660,108,706	660,108,706	1.2013	1.2013
第25計算期間末 (平成26年3月20日)	686,313,375	686,313,375	1.2187	1.2187
平成25年4月末日	619,086,264	-	1.1502	-
5月末日	633,386,279	-	1.1601	-
6月末日	615,520,145	-	1.1314	-
7月末日	625,623,100	-	1.1462	-
8月末日	628,033,676	-	1.1374	-
9月末日	655,395,202	-	1.1844	-
10月末日	661,119,768	-	1.1973	-
11月末日	683,607,455	-	1.2363	-
12月末日	708,198,456	-	1.2720	-
平成26年1月末日	686,329,274	-	1.2273	-
2月末日	705,744,555	-	1.2408	-
3月末日	692,175,407	-	1.2375	-
4月末日	732,098,227	-	1.2238	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000

第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
第25計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	0.3
第7計算期間	3.4
第8計算期間	6.3
第9計算期間	10.5
第10計算期間	1.6
第11計算期間	5.5
第12計算期間	0.6
第13計算期間	15.2
第14計算期間	1.7
第15計算期間	23.0
第16計算期間	13.7
第17計算期間	0.6
第18計算期間	4.5
第19計算期間	1.4
第20計算期間	8.2
第21計算期間	11.1
第22計算期間	4.4
第23計算期間	24.3
第24計算期間	9.7
第25計算期間	1.4

(注)収益率は、以下の計算式により算出しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

収益率 = (当計算期間未分配付基準価額 - 前計算期間未分配付基準価額) ÷ 前計算期間未分配付基準価額 × 100

(4) 【設定及び解約の実績】

「DCニッセイバランスアクティブ」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第6計算期間	25,125,531	15,113,091	361,098,911
第7計算期間	31,236,607	28,290,774	364,044,744
第8計算期間	34,016,741	30,902,449	367,159,036
第9計算期間	32,071,936	40,790,058	358,440,914
第10計算期間	45,566,691	17,672,761	386,334,844

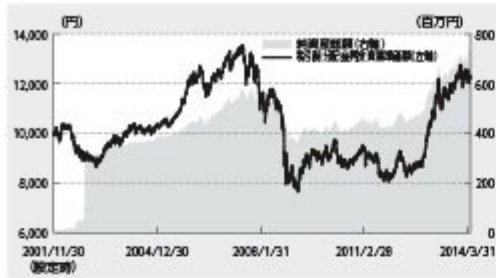
第11計算期間	32,093,186	15,506,440	402,921,590
第12計算期間	80,863,942	51,594,790	432,190,742
第13計算期間	30,124,473	22,772,806	439,542,409
第14計算期間	54,103,635	34,148,906	459,497,138
第15計算期間	58,887,483	54,678,833	463,705,788
第16計算期間	32,881,333	48,940,728	447,646,393
第17計算期間	31,178,618	25,143,607	453,681,404
第18計算期間	31,950,447	14,541,885	471,089,966
第19計算期間	25,333,224	14,746,306	481,676,884
第20計算期間	29,025,580	7,931,333	502,771,131
第21計算期間	27,934,708	11,623,296	519,082,543
第22計算期間	30,094,617	14,345,986	534,831,174
第23計算期間	35,238,781	27,090,812	542,979,143
第24計算期間	37,680,188	31,153,427	549,505,904
第25計算期間	36,080,857	22,433,393	563,153,368

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2014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。

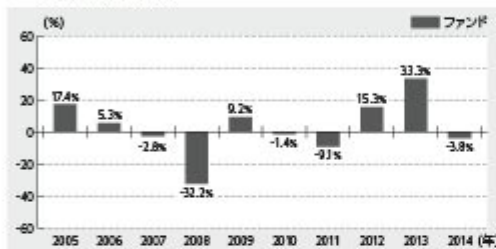
●基準価額および純資産総額

基準価額	12,238円
純資産総額	732百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

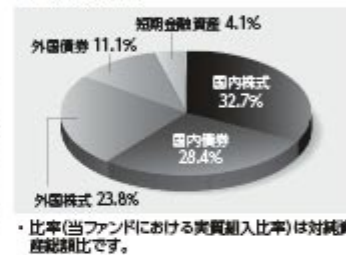
第21期	2012年3月	0円
第22期	2012年9月	0円
第23期	2013年3月	0円
第24期	2013年9月	0円
第25期	2014年3月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
 ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
 ・2014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比率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	比率
1 トヨタ自動車	4.3%
2 三菱UFJフィナンシャルG	3.5%
3 三井住友フィナンシャルG	2.1%
4 三菱商事	2.1%
5 ソフトバンク	1.9%

2. ニッセイ国内債券マザーファンド

銘柄名	比率
1 第333回 利付国債(2年)	7.8%
2 第332回 利付国債(2年)	6.4%
3 第329回 利付国債(2年)	5.9%
4 第308回 利付国債(10年)	5.7%
5 第140回 利付国債(20年)	5.2%

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	比率
1 ロイヤル・ダッチ/シエル	イギリス	1.8%
2 グーグル	アメリカ	1.8%
3 アストラゼネカ	イギリス	1.7%
4 モンサント	アメリカ	1.7%
5 ピザ	アメリカ	1.7%

・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	比率
1 ベルギー国債	ユーロ	10.5%
2 スペイン国債	ユーロ	9.0%
3 ドイツ国債	ユーロ	7.6%
4 アメリカ国債	米ドル	4.5%
5 イタリア国債	ユーロ	4.4%

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

■ 最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第3【ファンドの経理状況】

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドの計算期間は6か月であるため、財務諸表は6か月ごとに作成しております。

3) 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25期計算期間（平成25年9月21日から平成26年3月20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24期 (平成25年9月20日現在)	第25期 (平成26年3月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,758,526	14,985,799
親投資信託受益証券	632,736,687	654,378,875
未収入金	21,020,000	21,700,000
流動資産合計	664,515,213	691,064,674
資産合計	664,515,213	691,064,674
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,106	1,270
未払受託者報酬	328,732	354,447
未払委託者報酬	3,945,243	4,253,870
その他未払費用	131,426	141,712
流動負債合計	4,406,507	4,751,299
負債合計	4,406,507	4,751,299
純資産の部		
元本等		
元本	549,505,904	563,153,368

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	110,602,802	123,160,007
純資産合計	660,108,706	686,313,375
負債純資産合計	664,515,213	691,064,674

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第24期 (自平成25年3月22日 至平成25年9月20日)	第25期 (自平成25年9月21日 至平成26年3月20日)
営業収益		
受取利息	6,265	5,766
有価証券売買等損益	61,857,498	13,912,188
営業収益合計	61,863,763	13,917,954
営業費用		
受託者報酬	328,732	354,447
委託者報酬	3,945,243	4,253,870
その他費用	131,426	141,712
営業費用合計	4,405,401	4,750,029
営業利益又は営業損失（ ）	57,458,362	9,167,925
経常利益又は経常損失（ ）	57,458,362	9,167,925
当期純利益又は当期純損失（ ）	57,458,362	9,167,925
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（ ）	1,300,015	345,562
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	51,855,019	110,602,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,606,429	8,268,254
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,606,429	8,268,254
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,016,993	4,533,412
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,016,993	4,533,412
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	110,602,802	123,160,007

（ 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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

項目	第24期 (平成25年9月20日現在)	第25期 (平成26年3月20日現在)
1. 受益権総口数	549,505,904口	563,153,368口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2013円 (12,013円)	1.2187円 (12,187円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第24期 (自平成25年3月22日 至平成25年9月20日)	第25期 (自平成25年9月21日 至平成26年3月20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	447,279円	507,439円
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(5,807円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(56,152,540円)、収益調整金(161,466,272円)及び分配準備積立金(52,157,498円)より分配対象収益は269,782,117円(1口当たり0.490954円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,866円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(8,818,497円)、収益調整金(172,430,002円)及び分配準備積立金(104,052,372円)より分配対象収益は285,304,737円(1口当たり0.506620円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	第24期 (自平成25年3月22日 至平成25年9月20日)	第25期 (自平成25年9月21日 至平成26年3月20日)
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。	同左

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。親投資信託受益証券の価格変動リスク、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等のリスクに晒されております。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第24期 (平成25年9月20日現在)	第25期 (平成26年3月20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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第24期 （平成25年9月20日現在）	第25期 （平成26年3月20日現在）
	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額（円）	最終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	57,295,758	10,713,232
合計	57,295,758	10,713,232

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本額の変動

項目	第24期 （平成25年9月20日現在）	第25期 （平成26年3月20日現在）
期首元本額	542,979,143円	549,505,904円
期中追加設定元本額	37,680,188円	36,080,857円
期中一部解約元本額	31,153,427円	22,433,393円

（４）【附属明細表】（平成26年3月20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	券面総額 又は口数	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	317,825,163	216,248,240	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	151,017,111	197,213,245	
	ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド	97,191,457	156,390,773	
	ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド	34,847,715	84,526,617	
親投資信託受益証券 合計		600,881,446	654,378,875	
合計		600,881,446	654,378,875	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第４ 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

(参考)

開示対象ファンド（DCニッセイバランスアクティブ）は、「ニッセイ国内株式マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券マザーファンド」受益証券、「ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド」受益証券及び「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」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開示対象期間末日（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。

「ニッセイ国内株式マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年9月20日現在)	(平成26年3月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	299,192,608	409,206,670
株式	22,474,347,200	19,217,988,300
派生商品評価勘定	8,399,045	-
未収入金	33,137,111	4,831,226
未収配当金	4,724,300	27,688,550
前払金	-	18,570,000
差入委託証拠金	10,545,000	14,850,000
流動資産合計	22,830,345,264	19,693,134,746
資産合計	22,830,345,264	19,693,134,746
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	20,623,625
前受金	8,702,000	-
未払金	33,220,790	8,610,106
未払解約金	57,941,996	71,149,526
流動負債合計	99,864,786	100,383,257
負債合計	99,864,786	100,383,257
純資産の部		
元本等		

元本	31,345,100,778	28,796,262,491
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,614,620,300	9,203,511,002
純資産合計	22,730,480,478	19,592,751,489
負債純資産合計	22,830,345,264	19,693,134,746

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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年9月20日現在）	（平成26年3月20日現在）
1. 受益権総口数	31,345,100,778口	28,796,262,491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	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,614,620,300円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は9,203,511,002円であります。
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7252円 (7,252円)	0.6804円 (6,804円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年3月22日 至 平成25年9月20日）	（自 平成25年9月21日 至 平成26年3月20日）
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。	同左

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、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、価格変動リスク、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等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年9月20日現在)	(平成26年3月20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。	同左

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
------------	--	----

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年9月20日現在	平成26年3月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,563,863,503	1,895,700,876
合計	5,563,863,503	1,895,700,876

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

株式関連

種類	(平成25年9月20日 現在)				(平成26年3月20日 現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
先物取引								
買建	221,578,000	-	229,995,000	8,417,000	304,850,000	-	284,250,000	20,600,000
合計	221,578,000	-	229,995,000	8,417,000	304,850,000	-	284,250,000	20,600,000

(注) 時価の算定方法

1. 株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

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

4. 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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当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25年9月20日現在)	(平成26年3月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	38,013,813,044円	31,345,100,778円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	4,596,878,365円	3,452,537,897円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	11,265,590,631円	6,001,376,184円
元本の内訳		
ファンド名		
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)	814,099,826円	677,407,644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)	651,670,700円	502,189,688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)	456,030,621円	336,616,621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)	243,325,105円	206,808,376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)	4,053,215,096円	3,241,549,759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)	9,496,918,581円	8,288,494,592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)	999,546,559円	1,023,972,898円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)	1,143,296,455円	1,164,589,605円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)	4,503,152,669円	4,651,039,012円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)	3,359,235,327円	3,468,232,917円
DCニッセイ国内株式アクティブ	630,803,339円	613,226,003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)	4,657,219,106円	4,304,310,213円
DCニッセイバランスアクティブ	336,587,394円	317,825,163円
計	31,345,100,778円	28,796,262,491円

附属明細表(平成26年3月20日現在)

第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ショーボンドHD	22,100	4,290	94,809,000	
コムシスホールディングス	69,100	1,619	111,872,900	
NIPPON	67,000	1,356	90,852,000	
大和ハウス	132,000	1,743	230,076,000	
大気社	56,200	2,065	116,053,000	
日本M&Aセンター	2,500	8,000	20,000,000	
山崎製パン	71,000	1,111	78,881,000	
カルビー	10,400	2,278	23,691,200	

カカクコム	156,600	1,712	268,099,200
エムスリー	866	311,500	269,759,000
キリンHD	134,000	1,303	174,602,000
サントリー食品インター	55,000	3,505	192,775,000
J Pホールディングス	84,400	412	34,772,800
日本たばこ産業	88,800	3,030	269,064,000
オープンハウス	76,900	1,750	134,575,000
セブン&アイ・HLDGS	36,300	3,697	134,201,100
T S Iホールディングス	165,300	590	97,527,000
ブロードリーフ	169,400	1,462	247,662,800
協和発酵キリン	92,000	1,006	92,552,000
三菱瓦斯化学	291,000	574	167,034,000
J S R	112,100	1,838	206,039,800
三菱ケミカルHLDGS	309,400	429	132,732,600
ダイセル	185,000	858	158,730,000
宇部興産	662,000	183	121,146,000
日立化成	147,200	1,360	200,192,000
アステラス製薬	43,500	6,075	264,262,500
日本新薬	40,000	1,910	76,400,000
中外製薬	36,100	2,479	89,491,900
小野薬品	11,300	9,440	106,672,000
大塚ホールディングス	47,400	2,999	142,152,600
伊藤忠テクノソリューションズ	25,800	4,435	114,423,000
ポーラ・オルビスHD	24,300	3,755	91,246,500
J Xホールディングス	445,500	505	224,977,500
住友ゴム	83,800	1,298	108,772,400
新日鐵住金	569,000	270	153,630,000
神戸製鋼所	388,000	133	51,604,000
住友鉱山	68,000	1,210	82,280,000
住友電工	79,800	1,433	114,353,400
ノーリツ	47,700	1,829	87,243,300
リンナイ	13,400	8,130	108,942,000
ユニプレス	37,400	1,919	71,770,600
アマダ	126,000	719	90,594,000
SMC	5,500	23,135	127,242,500
荏原製作所	222,000	619	137,418,000
椿本チエイン	162,000	799	129,438,000
グローリー	46,700	2,723	127,164,100
不二越	165,000	640	105,600,000
T H K	76,800	2,130	163,584,000
日立	445,000	728	323,960,000
三菱電機	116,000	1,115	129,340,000
オムロン	57,300	3,800	217,740,000
富士通	325,000	575	186,875,000

パナソニック	88,000	1,133	99,704,000
ソニー	148,200	1,757	260,387,400
T D K	33,400	4,190	139,946,000
堀場製作所	26,100	3,740	97,614,000
OBARA GROUP	46,600	3,610	168,226,000
カシオ	238,200	1,138	271,071,600
ファナック	16,100	17,585	283,118,500
村田製作所	30,200	9,058	273,551,600
F P G	111,400	919	102,376,600
トヨタ自動車	182,600	5,425	990,605,000
ケーヒン	65,200	1,459	95,126,800
マツダ	628,000	441	276,948,000
本田技研	130,700	3,536	462,155,200
スズキ	78,600	2,551	200,508,600
富士重工業	49,400	2,615	129,181,000
スター精密	78,300	1,198	93,803,400
トプコン	199,500	1,492	297,654,000
朝日インテック	38,100	3,820	145,542,000
キヤノン	73,500	3,006	220,941,000
リコー	178,900	1,183	211,638,700
エイベックス・グループHD	61,800	1,654	102,217,200
伊藤忠	182,900	1,204	220,211,600
丸紅	151,000	689	104,039,000
ファミリーマート	22,600	4,375	98,875,000
日立ハイテクノロジーズ	41,200	2,380	98,056,000
三菱商事	221,300	1,863	412,281,900
A O K Iホールディングス	39,800	1,447	57,590,600
青山商事	37,300	2,662	99,292,600
三菱UFJフィナンシャルG	1,254,100	546	684,738,600
三井住友トラストHD	413,000	434	179,242,000
三井住友フィナンシャルG	103,500	4,220	436,770,000
千葉銀行	163,000	605	98,615,000
ふくおかフィナンシャルG	281,000	409	114,929,000
みずほフィナンシャルG	1,524,100	201	306,344,100
オリックス	178,300	1,399	249,441,700
野村ホールディングス	337,700	641	216,465,700
N K S Jホールディングス	29,400	2,391	70,295,400
第一生命	50,700	1,428	72,399,600
東京海上HD	71,600	2,949	211,148,400
T & Dホールディングス	115,500	1,196	138,138,000
三菱地所	28,000	2,308	64,624,000
住友不動産	96,000	3,914	375,744,000
タカラレーベン	276,400	307	84,854,800
東京急行	382,000	586	223,852,000

東日本旅客鉄道	45,600	7,161	326,541,600
商船三井	276,000	382	105,432,000
日本航空	24,000	4,845	116,280,000
日本電信電話	35,200	5,619	197,788,800
光通信	17,900	8,270	148,033,000
N T T ドコモ	191,200	1,549	296,168,800
中部電力	61,000	1,128	68,808,000
大阪瓦斯	544,000	396	215,424,000
N T T データ	50,300	3,855	193,906,500
ヤマダ電機	667,500	351	234,292,500
ファーストリテイリング	2,800	35,405	99,134,000
ソフトバンク	46,400	8,212	381,036,800
合計	17,369,966		19,217,988,300

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

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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。

「ニッセイ国内債券マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年9月20日現在）	（平成26年3月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,023,147,187	961,945,206

国債証券	26,550,546,268	24,880,652,538
派生商品評価勘定	2,854,250	1,124,250
未収入金	3,496,613,036	4,353,806,435
未収利息	9,487,008	15,371,620
前払費用	23,261,154	17,763,966
差入委託証拠金	4,680,000	2,700,000
流動資産合計	31,110,588,903	30,233,364,015
資産合計	31,110,588,903	30,233,364,015
負債の部		
流動負債		
前受金	3,890,000	540,000
未払金	3,500,484,767	4,285,218,988
未払解約金	106,072,925	99,016,972
流動負債合計	3,610,447,692	4,384,775,960
負債合計	3,610,447,692	4,384,775,960
純資産の部		
元本等		
元本	21,389,364,203	19,793,676,300
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,110,777,008	6,054,911,755
純資産合計	27,500,141,211	25,848,588,055
負債純資産合計	31,110,588,903	30,233,364,015

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年9月20日現在)	(平成26年3月20日現在)
1. 受益権総口数	21,389,364,203口	19,793,676,300口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2857円 (12,857円)	1.3059円 (13,059円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成25年3月22日 至 平成25年9月20日)	(自 平成25年9月21日 至 平成26年3月20日)
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。	同左
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、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、価格変動リスク、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等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、債券先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、市場金利の変動によるリスクを有しております。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年9月20日現在)	(平成26年3月20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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年9月20日現在	平成26年3月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	143,206,261	47,642,267
合計	143,206,261	47,642,267

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

債券関連

種類	(平成25年9月20日 現在)				(平成26年3月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 先物取引 買 建	860,290,000	-	863,160,000	2,870,000	869,220,000	-	870,360,000	1,140,000
合計	860,290,000	-	863,160,000	2,870,000	869,220,000	-	870,360,000	1,140,000

(注) 時価の算定方法

- 債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 債券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。
- 評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの開示対象期間における当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25年9月20日現在）	（平成26年3月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	23,148,173,301円	21,389,364,203円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	4,204,861,181円	2,072,236,139円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	5,963,670,279円	3,667,924,042円
元本の内訳		
ファンド名		
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）	1,187,836,683円	1,033,285,434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）	403,495,769円	325,044,109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）	90,765,859円	70,026,143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）	150,746,666円	133,911,376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）	5,914,159,912円	4,848,892,333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）	5,881,354,894円	5,258,867,963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）	199,038,173円	208,788,706円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	1,669,222,418円	1,775,961,068円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	2,789,446,932円	3,009,214,778円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	669,005,444円	721,252,619円
DCニッセイ国内債券アクティブ	883,730,408円	911,594,386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）	1,336,397,673円	1,265,229,092円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	60,521,790円	55,275,431円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	25,924,948円	25,315,751円
DCニッセイバランスアクティブ	127,716,634円	151,017,111円
計	21,389,364,203円	19,793,676,300円

附属明細表（平成26年3月20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	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考

国債証券	第322回 利付国債(2年)	87,800,000	87,800,000	
	第327回 利付国債(2年)	236,600,000	236,711,202	
	第328回 利付国債(2年)	269,000,000	269,137,190	
	第329回 利付国債(2年)	1,856,900,000	1,860,075,299	
	第330回 利付国債(2年)	2,030,600,000	2,034,173,856	
	第331回 利付国債(2年)	2,448,100,000	2,449,275,088	
	第332回 利付国債(2年)	238,500,000	238,621,635	
	第334回 利付国債(2年)	77,600,000	77,644,232	
	第335回 利付国債(2年)	653,800,000	654,192,280	
	第103回 利付国債(5年)	223,700,000	225,031,015	
	第106回 利付国債(5年)	191,600,000	192,098,160	
	第112回 利付国債(5年)	193,600,000	195,596,016	
	第115回 利付国債(5年)	129,500,000	129,702,020	
	第1回 利付国債(40年)	56,300,000	66,581,506	
	第2回 利付国債(40年)	41,800,000	47,319,272	
	第3回 利付国債(40年)	23,500,000	26,598,475	
	第4回 利付国債(40年)	30,100,000	34,058,752	
	第5回 利付国債(40年)	149,400,000	160,670,736	
	第6回 利付国債(40年)	13,600,000	14,220,976	
	第297回 利付国債(10年)	800,000	846,264	
	第298回 利付国債(10年)	1,216,500,000	1,281,132,645	
	第303回 利付国債(10年)	223,700,000	238,276,292	
	第305回 利付国債(10年)	700,500,000	743,587,755	
	第308回 利付国債(10年)	1,710,000,000	1,821,406,500	
	第313回 利付国債(10年)	85,200,000	90,967,188	
	第314回 利付国債(10年)	9,200,000	9,696,984	
	第315回 利付国債(10年)	255,700,000	271,233,775	
	第319回 利付国債(10年)	8,800,000	9,262,440	
	第323回 利付国債(10年)	7,300,000	7,560,902	
	第324回 利付国債(10年)	111,400,000	114,496,920	
	第327回 利付国債(10年)	124,000,000	127,221,520	
	第328回 利付国債(10年)	427,200,000	430,318,560	
	第329回 利付国債(10年)	12,200,000	12,489,994	
	第330回 利付国債(10年)	834,500,000	853,309,630	
	第331回 利付国債(10年)	396,600,000	398,206,230	
	第332回 利付国債(10年)	6,500,000	6,514,950	
	第7回 利付国債(30年)	20,800,000	24,102,624	
	第10回 利付国債(30年)	24,000,000	22,817,280	
	第16回 利付国債(30年)	46,600,000	54,761,524	
	第23回 利付国債(30年)	32,500,000	38,174,175	
	第25回 利付国債(30年)	43,200,000	49,059,648	
	第26回 利付国債(30年)	134,600,000	155,438,772	
	第27回 利付国債(30年)	68,200,000	80,185,468	
	第28回 利付国債(30年)	67,500,000	79,476,525	

第29回 利付国債(30年)	176,100,000	204,121,032	
第30回 利付国債(30年)	115,300,000	131,466,213	
第35回 利付国債(30年)	50,100,000	54,080,946	
第36回 利付国債(30年)	359,700,000	388,260,180	
第37回 利付国債(30年)	1,900,000	2,007,616	
第39回 利付国債(30年)	644,500,000	679,625,250	
第40回 利付国債(30年)	181,600,000	187,187,832	
第72回 利付国債(20年)	110,100,000	126,523,617	
第84回 利付国債(20年)	138,800,000	158,717,800	
第88回 利付国債(20年)	309,700,000	365,349,993	
第92回 利付国債(20年)	202,100,000	233,825,658	
第94回 利付国債(20年)	71,000,000	82,147,710	
第97回 利付国債(20年)	188,100,000	220,029,975	
第99回 利付国債(20年)	661,400,000	764,995,082	
第105回 利付国債(20年)	89,300,000	103,168,290	
第110回 利付国債(20年)	40,000,000	46,094,800	
第111回 利付国債(20年)	277,500,000	323,243,100	
第113回 利付国債(20年)	5,000,000	5,745,400	
第114回 利付国債(20年)	119,300,000	136,959,979	
第116回 利付国債(20年)	220,100,000	255,445,859	
第117回 利付国債(20年)	1,000,000	1,146,080	
第118回 利付国債(20年)	800,000	903,552	
第121回 利付国債(20年)	671,700,000	747,225,948	
第122回 利付国債(20年)	293,200,000	321,845,640	
第123回 利付国債(20年)	32,700,000	37,296,312	
第125回 利付国債(20年)	157,900,000	182,106,070	
第127回 利付国債(20年)	644,600,000	713,804,256	
第128回 利付国債(20年)	277,800,000	306,888,438	
第130回 利付国債(20年)	74,500,000	80,961,385	
第131回 利付国債(20年)	160,800,000	172,173,384	
第132回 利付国債(20年)	3,900,000	4,163,874	
第134回 利付国債(20年)	800,000	864,608	
第135回 利付国債(20年)	93,600,000	99,638,136	
第136回 利付国債(20年)	400,000	419,324	
第142回 利付国債(20年)	133,400,000	142,911,420	
第143回 利付国債(20年)	99,300,000	102,818,199	
第144回 利付国債(20年)	500,000	509,405	
第145回 利付国債(20年)	798,900,000	837,758,496	
第146回 利付国債(20年)	301,000,000	314,584,130	
第10回 物価連動国債(10年)	9,700,000	10,907,650	
第13回 物価連動国債(10年)	32,300,000	37,256,435	
第14回 物価連動国債(10年)	39,400,000	45,414,468	
第15回 物価連動国債(10年)	155,800,000	180,909,507	
第16回 物価連動国債(10年)	128,000,000	149,097,214	

国債証券 合計	23,593,100,000	24,880,652,538	
合計	23,593,100,000	24,880,652,538	

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

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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。

「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年9月20日現在)	(平成26年3月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	464,214,371	375,493,743
コール・ローン	115,265,677	269,329,266
株式	27,736,121,459	28,177,262,586
投資証券	199,975,860	886,793,095
派生商品評価勘定	115,294,218	110,858,500
未収入金	342,528,173	-
未収配当金	34,994,473	57,276,909
流動資産合計	29,008,394,231	29,877,014,099
資産合計	29,008,394,231	29,877,014,099
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	63,769,181	149,291,696
未払金	206,732,760	-
未払解約金	50,285,183	62,332,816
流動負債合計	320,787,124	211,624,512

負債合計	320,787,124	211,624,512
純資産の部		
元本等		
元本	20,373,527,667	18,436,312,993
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,314,079,440	11,229,076,594
純資産合計	28,687,607,107	29,665,389,587
負債純資産合計	29,008,394,231	29,877,014,099

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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年9月20日現在）	（平成26年3月20日現在）
1. 受益権総口数	20,373,527,667口	18,436,312,993口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4081円 (14,081円)	1.6091円 (16,091円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年3月22日 至 平成25年9月20日）	（自 平成25年9月21日 至 平成26年3月20日）

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。	同左
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、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、価格変動リスク、為替変動リスク、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等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年9月20日現在)	(平成26年3月20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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年9月20日現在	平成26年3月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,594,480,147	1,178,876,576
投資証券	74,815,783	42,181,942
合計	4,669,295,930	1,136,694,634

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

通貨関連

種類	(平成25年9月20日 現在)				(平成26年3月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
	市場取引以外の 取引							
為替予約取引								
売 建	5,755,975,902	-	5,813,303,648	57,327,746	7,733,499,877	-	7,711,557,349	21,942,528
アメリカ・ ドル	3,801,763,964	-	3,803,808,123	2,044,159	3,619,224,083	-	3,569,395,619	49,828,464
イギリス・ ポンド	1,552,878,997	-	1,596,025,742	43,146,745	1,312,034,272	-	1,308,792,200	3,242,072
シンガポ ール・ドル	168,061,125	-	174,520,527	6,459,402	213,746,932	-	213,244,680	502,252

ユーロ	233,271,816	-	238,949,256	5,677,440	2,588,494,590	-	2,620,124,850	31,630,260
買建	5,755,975,902	-	5,864,828,685	108,852,783	7,733,499,877	-	7,673,124,153	60,375,724
アメリカ・ドル	1,954,211,938	-	1,954,112,872	99,066	4,114,275,794	-	4,147,100,395	32,824,601
イスラエル・シケル	84,095,225	-	87,731,712	3,636,487	93,020,621	-	90,816,512	2,204,109
オーストラリア・ドル	835,907,613	-	864,574,860	28,667,247	859,425,725	-	848,277,762	11,147,963
カナダ・ドル	1,238,636,610	-	1,271,877,192	33,240,582	1,206,946,148	-	1,115,011,253	91,934,895
スイス・フラン	1,140,004,296	-	1,168,655,072	28,650,776	976,329,582	-	985,270,146	8,940,564
スウェーデン・クローナ	108,463,697	-	112,944,659	4,480,962	23,723,875	-	24,067,856	343,981
デンマーク・クローネ	118,852,076	-	121,900,220	3,048,144	126,219,663	-	127,836,700	1,617,037
ノルウェー・クローネ	110,981,861	-	115,487,694	4,505,833	113,374,867	-	114,537,178	1,162,311
香港・ドル	164,822,586	-	167,544,404	2,721,818	220,183,602	-	220,206,351	22,749
合計	11,511,951,804	-	11,678,132,333	51,525,037	15,466,999,754	-	15,384,681,502	38,433,196

(注) 時価の算定方法

1. 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。

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で評価しております。

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。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

2. 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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当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25年9月20日現在)	(平成26年3月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	23,283,558,989円	20,373,527,667円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	2,595,210,173円	1,966,609,013円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	5,505,241,495円	3,903,823,687円
元本の内訳		
ファンド名		

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)	207,069,497円	153,451,388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)	220,995,589円	151,681,206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)	174,004,399円	114,378,284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)	82,536,286円	62,481,560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)	1,030,770,341円	729,537,290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)	3,220,621,643円	2,486,074,353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)	381,479,455円	345,461,503円
DCニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式	9,505,242,077円	9,591,683,501円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)	290,908,487円	263,695,270円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)	1,527,628,007円	1,404,281,570円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)	1,282,099,095円	1,177,979,254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)	1,792,870,640円	1,465,506,707円
ニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式SA(適格機関投資家限定)	87,865,330円	76,577,078円
ニッセイ/パトナム・バランスアップオープン	461,072,257円	316,332,572円
DCニッセイバランスアクティブ	108,364,564円	97,191,457円
計	20,373,527,667円	18,436,312,993円

附属明細表(平成26年3月20日現在)

第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AIRGAS INC	19,600	107.35	2,104,060.00	
	ALCATEL-LUCENT-SPONSORED ADR	613,900	3.87	2,375,793.00	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	37,300	37.08	1,383,084.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	83,368	49.73	4,145,890.64	
	APPLIED MATERIALS INC	135,900	19.47	2,645,973.00	
	ASSURED GUARANTY LTD	77,100	26.11	2,013,081.00	
	BANK OF AMERICA CORP	190,100	17.44	3,315,344.00	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	61,900	54.74	3,388,406.00	
	BRUNSWICK CORP	40,725	46.08	1,876,608.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	58,200	33.46	1,947,372.00	
	CAPITAL SENIOR LIVING CORP	88,600	26.72	2,367,392.00	
	CARLYLE GROUP/THE	77,100	33.32	2,568,972.00	

CATAMARAN CORP	70,100	45.84	3,213,384.00	
CELGENE CORP	19,500	150.84	2,941,380.00	
CHARLES SCHWAB CORP	91,900	27.58	2,534,602.00	
CME GROUP INC	53,700	75.71	4,065,627.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	33,000	63.24	2,086,920.00	
COTY INC-CL A	95,500	15.06	1,438,230.00	
DISH NETWORK CORP	55,900	61.94	3,462,446.00	
ELECTRONIC ARTS INC	73,600	30.23	2,224,928.00	
FACEBOOK INC-A	65,600	68.24	4,476,544.00	
FORESTAR REAL ESTATE GROUP	99,400	18.84	1,872,696.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	59,879	44.16	2,644,256.64	
GENERAL DYNAMICS CORP	16,200	108.02	1,749,924.00	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	183,900	17.56	3,229,284.00	
GOOGLE INC-CL A	4,609	1,199.25	5,527,343.25	
GROUPON INC	173,100	8.20	1,419,420.00	
HALLIBURTON CO	38,900	56.78	2,208,742.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	85,010	34.84	2,961,748.40	
HOME DEPOT INC	26,170	79.75	2,087,057.50	
HOVNANIAN ENTERPRISES-A	324,200	4.98	1,614,516.00	
HOWARD HUGHES CORP/THE	13,800	141.90	1,958,220.00	
IMPAX LABORATORIES INC	61,900	27.39	1,695,441.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,700	151.18	1,466,446.00	
KODIAK OIL & GAS CORP	228,800	11.85	2,711,280.00	
LAM RESEARCH CORP	41,500	54.49	2,261,335.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	40,100	42.00	1,684,200.00	
LIFEPOINT HOSPITALS INC	29,400	52.44	1,541,736.00	
LOWE'S COS INC	49,400	49.58	2,449,252.00	
MARATHON OIL CORP	84,200	33.29	2,803,018.00	
MASCO CORP	105,200	23.08	2,428,016.00	
MEADWESTVACO CORP	65,500	36.55	2,394,025.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	161,700	23.98	3,877,566.00	
MONSANTO CO	42,900	112.87	4,842,123.00	
MORGAN STANLEY	129,400	31.81	4,116,214.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,400	122.88	2,138,112.00	
NRG ENERGY INC	65,900	29.79	1,963,161.00	
PENN NATIONAL GAMING INC	118,800	12.40	1,473,120.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	41,400	79.66	3,297,924.00	
PULTE GROUP INC	96,500	19.61	1,892,365.00	
RADIAN GROUP INC	186,280	15.60	2,905,968.00	
RE/MAX HOLDINGS INC-CL A	72,016	31.51	2,269,224.16	
SEALED AIR CORP	77,600	32.16	2,495,616.00	
SEARS HOMETOWN AND OUTLET ST	38,600	22.26	859,236.00	

	SPIRIT AIRLINES INC	28,600	62.99	1,801,514.00	
	ST JUDE MEDICAL INC	27,200	67.04	1,823,488.00	
	STANDARD PACIFIC CORP	234,546	8.84	2,073,386.64	
	TAYLOR MORRISON HOME CORP-A	77,242	24.05	1,857,670.10	
	TILE SHOP HLDGS INC	65,215	16.42	1,070,830.30	
	TRONOX LTD	60,442	24.10	1,456,652.20	
	VISA INC-CLASS A SHARES	23,100	223.82	5,170,242.00	
	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	41,845	37.54	1,570,861.30	
	WHIRLPOOL CORP	12,900	146.35	1,887,915.00	
	YAHOO! INC	77,700	38.61	2,999,997.00	
	ZIONS BANCORPORATION	64,300	31.97	2,055,671.00	
アメリカ・ドル	小計	5,545,047		161,182,850.13 (16,492,229,225)	
イギリス・ポンド	ASTRAZENECA PLC	62,034	39.77	2,467,402.35	
	BARCLAYS PLC	1,127,422	2.41	2,722,724.13	
	BG GROUP PLC	134,102	10.70	1,434,891.40	
	BRITVIC PLC	237,458	7.25	1,721,570.50	
	EXPERIAN PLC	88,557	10.65	943,132.05	
	FIDESSA GROUP PLC	49,368	25.96	1,281,593.28	
	PERSIMMON PLC	71,782	13.77	988,438.14	
	PETS AT HOME GROUP PLC-WI	170,470	2.46	419,356.20	
	PRUDENTIAL PLC	128,240	13.39	1,717,774.80	
	REGUS PLC	566,549	2.23	1,267,936.66	
	TELECITY GROUP PLC	164,634	6.84	1,126,096.56	
	THOMAS COOK GROUP PLC	1,118,030	1.77	1,978,913.10	
	TUI TRAVEL PLC	418,953	4.42	1,851,772.26	
イギリス・ポンド	小計	4,337,599		19,921,601.43 (3,371,930,258)	
オーストラリア・ドル	ORIGIN ENERGY LIMITED	149,066	14.35	2,139,097.10	
オーストラリア・ドル	小計	149,066		2,139,097.10 (197,502,835)	
カナダ・ドル	NORBORD INC	53,300	29.18	1,555,294.00	
カナダ・ドル	小計	53,300		1,555,294.00 (141,500,648)	
シンガポール・ドル	EZION HOLDINGS LTD	2,124,400	2.13	4,524,972.00	
シンガポール・ドル	小計	2,124,400		4,524,972.00 (363,581,501)	
スイス・フラン	NOVARTIS AG	23,414	71.60	1,676,442.40	
スイス・フラン	小計	23,414		1,676,442.40 (194,685,255)	
スウェーデン・クローナ	ASSA ABLOY AB	36,116	336.80	12,163,868.80	

	VOLVO AB	157,067	99.95	15,698,846.65	
スウェーデン・クローナ 小計		193,183		27,862,715.45 (444,688,938)	
ユーロ	ANTENA 3 TELEVISION	166,978	12.52	2,090,564.56	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	2,402,981	1.37	3,311,307.81	
	BUZZI UNICEM SPA	87,208	13.22	1,152,889.76	
	COMMERZBANK AG	98,881	12.80	1,265,676.80	
	DALATA HOTEL GROUP LTD	132,634	2.77	367,396.18	
	ERSTE GROUP BANK AG	71,148	24.34	1,732,098.06	
	EURAZEO	22,042	62.37	1,374,759.54	
	FAURECIA	46,101	31.90	1,470,621.90	
	GAZTRANSPORT ET TECHNIGA-W/I	18,287	49.00	896,063.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	31,138	59.87	1,864,232.06	
	INDITEX SA	20,602	108.10	2,227,076.20	
	ING GROEP NV	227,019	10.12	2,297,432.28	
	MEDIASET SPA	383,539	4.05	1,553,332.95	
	NATIXIS	383,877	5.21	2,001,918.55	
	NH HOTELES S.A.	216,663	4.82	1,044,315.66	
	NUMERICABLE GROUP- W/I	46,018	29.06	1,337,283.08	
	REMY COINTREAU	18,717	62.07	1,161,764.19	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	126,516	25.90	3,277,396.98	
	ROYAL KPN NV	394,584	2.68	1,058,668.87	
	SANOFI	42,895	73.20	3,139,914.00	
	SIEMENS AG	14,164	95.12	1,347,279.68	
	SOCIETE GENERALE	23,996	44.89	1,077,180.44	
	SOLVAY SA	12,009	111.50	1,339,003.50	
	UNICREDIT SPA	428,982	6.48	2,779,803.36	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	213,069	6.50	1,386,013.84		
UNIPOL GRUPPO FINANZIARI-PRF	501,533	4.75	2,385,290.94		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	115,085	14.16	1,629,603.60		
WACKER CHEMIE AG	15,450	95.65	1,477,792.50		
ユーロ 小計		6,262,116		48,046,680.29 (6,798,124,794)	
香港・ドル	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	643,500	20.40	13,127,400.00	
香港・ドル 小計		643,500		13,127,400.00 (173,019,132)	
合計		19,331,625		28,177,262,586 (28,177,262,586)	

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALTISOURCE RESIDENTIAL CORP	50,000.00	1,544,500.00	

		BLACKSTONE GROUP LP/THE	78,800.00	2,661,076.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	52,539.00	1,904,013.36	
	アメリカ・ドル	小計	181,339.00	6,109,589.36 (625,133,184)	
	ユーロ	HIBERNIA REIT PLC-W/I	1,744,639.00	1,849,317.34	
	ユーロ	小計	1,744,639.00	1,849,317.34 (261,659,911)	
投資証券 合計				886,793,095 (886,793,095)	
合計				886,793,095 (886,793,095)	

(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。

(注) 2. 種類別合計額及び合計金額欄は、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。

(注) 3. 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 計金額に対す る比率
アメリカ・ドル	株式 65銘柄	55.59%	-%	58.90%
	投資証券 3銘柄	-%	2.11%	
イギリス・ポンド	株式 13銘柄	11.37%	-%	11.60%
オーストラリア・ドル	株式 1銘柄	0.67%	-%	0.68%
カナダ・ドル	株式 1銘柄	0.48%	-%	0.49%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	1.23%	-%	1.25%
スイス・フラン	株式 1銘柄	0.66%	-%	0.67%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	1.50%	-%	1.53%
ユーロ	株式 28銘柄	22.92%	-%	24.29%
	投資証券 1銘柄	-%	0.88%	
香港・ドル	株式 1銘柄	0.58%	-%	0.60%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

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

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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。

「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年9月20日現在)	(平成26年3月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,308,955,532	1,244,029,291
コール・ローン	142,798,093	145,511,296
国債証券	14,352,288,079	13,429,132,306
特殊債券	1,190,453,498	1,095,955,671
社債券	980,697,016	1,012,832,469
派生商品評価勘定	154,719,691	95,321,665
未収入金	634,351	-
未収利息	115,982,485	140,062,905
前払費用	52,822,032	23,140,499
流動資産合計	18,299,350,777	17,185,986,102
資産合計	18,299,350,777	17,185,986,102
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	163,143,265	72,999,112
未払金	1,766,544	7,803,320
未払解約金	39,919,065	30,092,289
流動負債合計	204,828,874	110,894,721
負債合計	204,828,874	110,894,721
純資産の部		
元本等		
元本	7,976,117,968	7,039,539,280
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,118,403,935	10,035,552,101
純資産合計	18,094,521,903	17,075,091,381
負債純資産合計	18,299,350,777	17,185,986,102

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
--------------------	---

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年9月20日現在）	（平成26年3月20日現在）
1. 受益権総口数	7,976,117,968口	7,039,539,280口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2686円 (22,686円)	2.4256円 (24,256円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年3月22日 至 平成25年9月20日）	（自 平成25年9月21日 至 平成26年3月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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>	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当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、価格変動リスク、為替変動リスク、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等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左

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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年9月20日現在)	(平成26年3月20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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年9月20日現在	平成26年3月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)

国債証券	276,135,841	268,956,649
特殊債券	31,415,930	6,740,781
社債券	19,289,127	2,212,105
合計	326,840,898	273,485,325

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成25年9月20日 現在）				（平成26年3月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	8,506,693,519	-	8,656,103,954	149,410,435	5,490,445,034	-	5,433,860,581	56,584,453
アメリカ・ドル	4,611,777,104	-	4,620,970,270	9,193,166	2,125,830,751	-	2,121,990,443	3,840,308
イギリス・ポンド	764,336,750	-	784,297,200	19,960,450	600,732,798	-	595,325,072	5,407,726
オーストラリア・ドル	1,492,924,375	-	1,580,740,770	87,816,395	429,907,190	-	433,499,289	3,592,099
カナダ・ドル	289,922,360	-	294,064,344	4,141,984	674,782,178	-	630,612,998	44,169,180
スイス・フラン	21,695,135	-	22,244,585	549,450	33,220,775	-	33,503,505	282,730
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	15,556,917	-	15,469,464	87,453
デンマーク・クローネ	56,139,209	-	57,540,301	1,401,092	85,646,000	-	86,791,000	1,145,000
ノルウェー・クローネ	50,640,183	-	52,555,797	1,915,614	51,961,504	-	52,054,072	92,568
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	210,449,652	-	211,607,732	1,158,080
メキシコ・ペソ	53,072,194	-	54,359,943	1,287,749	298,093,110	-	284,021,634	14,071,476
ユーロ	1,116,281,107	-	1,136,537,584	20,256,477	913,475,701	-	921,076,562	7,600,861
南アフリカ・ランド	49,905,102	-	52,793,160	2,888,058	50,788,458	-	47,908,810	2,879,648
買 建	8,506,693,519	-	8,647,680,380	140,986,861	5,490,445,034	-	5,456,183,134	34,261,900
アメリカ・ドル	3,894,916,415	-	3,917,249,051	22,332,636	3,364,614,283	-	3,340,017,343	24,596,940
イギリス・ポンド	424,658,476	-	430,502,646	5,844,170	255,901,409	-	255,470,152	431,257
オーストラリア・ドル	1,391,313,033	-	1,435,111,260	43,798,227	531,802,310	-	532,778,577	976,267

カナダ・ドル	132,763,721	-	133,736,040	972,319	153,290,595	-	145,714,848	7,575,747
シンガポール・ドル	18,846,254	-	19,585,374	739,120	61,788,957	-	61,887,210	98,253
スウェーデン・クローナ	216,749,192	-	224,866,067	8,116,875	171,435,338	-	171,996,496	561,158
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	176,200,618	-	175,733,381	467,237
ノルウェー・クローネ	132,388,258	-	134,234,415	1,846,157	126,297,377	-	125,630,890	666,487
ポーランド・ズロチ	146,187,356	-	152,507,448	6,320,092	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	455,049,956	-	465,062,851	10,012,895	44,778,076	-	45,198,543	420,467
ユーロ	1,424,062,936	-	1,459,069,248	35,006,312	604,336,071	-	601,755,694	2,580,377
南アフリカ・ランド	269,757,922	-	275,755,980	5,998,058	-	-	-	-
合計	17,013,387,038	-	17,303,784,334	8,423,574	10,980,890,068	-	10,890,043,715	22,322,553

（注） 時価の算定方法

1．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。

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で評価しております。

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。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

2．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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの開示対象期間における当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25年9月20日現在）	（平成26年3月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	9,141,412,953円	7,976,117,968円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	596,850,817円	339,937,993円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	1,762,145,802円	1,276,516,681円
元本の内訳		
ファンド名		
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）	123,962,947円	101,621,653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）	66,165,634円	50,233,142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）	34,728,634円	25,250,916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)	24,723,214円	20,689,994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)	617,157,608円	480,027,128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)	964,425,642円	817,933,375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)	76,165,000円	75,764,034円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)	174,224,617円	174,648,454円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)	457,487,539円	465,040,586円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)	255,993,274円	260,080,709円
DCニッセイ/パトナム・グローバル債券	1,371,435,602円	1,368,101,075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)	383,481,646円	344,375,674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)	3,394,495,055円	2,820,924,825円
DCニッセイバランスアクティブ	31,671,556円	34,847,715円
計	7,976,117,968円	7,039,539,280円

附属明細表(平成26年3月20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	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 1 2016/08/31	6,070,000.00	6,121,170.10	
		US TREASURY N/B 1 2019/08/31	5,813,000.00	5,544,555.66	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	7,300,000.00	6,770,750.00	
		US TREASURY N/B 2 2023/02/15	3,670,000.00	3,479,306.80	
		US TREASURY N/B 2.75 2017/12/31	3,640,000.00	3,841,328.40	
		US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	3,340,000.00	2,793,075.00	
		US TREASURY N/B 3.5 2018/02/15	930,000.00	1,007,589.90	
		アメリカ・ドル 小計		30,763,000.00	29,557,775.86 (3,024,351,626)
	イギリス・ポンド	TSY 2 3/4% 2015 2.75 2015/01/22	1,670,000.00	1,702,965.80	

	TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	990,000.00	1,085,980.50	
	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	2,905,000.00	2,730,089.95	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	2,830,000.00	2,710,545.70	
イギリス・ポンド 小計		8,395,000.00	8,229,581.95 (1,392,939,041)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	1,940,000.00	2,165,292.20	
オーストラリア・ドル 小計		1,940,000.00	2,165,292.20 (199,921,429)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2018/09/01	2,090,000.00	2,059,674.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	2,970,000.00	3,087,107.10	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	350,000.00	470,148.00	
カナダ・ドル 小計		5,410,000.00	5,616,929.20 (511,028,219)	
スイス・フラン	SWITZERLAND 2 2022/05/25	450,000.00	496,561.50	
スイス・フラン 小計		450,000.00	496,561.50 (57,665,687)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	3,540,000.00	3,955,702.20	
スウェーデン・クローナ 小計		3,540,000.00	3,955,702.20 (63,133,007)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 4 2017/11/15	7,000,000.00	7,930,090.00	
	KINGDOM OF DENMARK 7 2024/11/10	2,680,000.00	4,115,676.00	
デンマーク・クローネ 小計		9,680,000.00	12,045,766.00 (228,267,266)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 5 2016/04/25	9,170,000.00	9,552,847.50	
ポーランド・ズロチ 小計		9,170,000.00	9,552,847.50 (321,644,375)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2015/12/17	64,890,000.00	69,323,933.70	
メキシコ・ペソ 小計		64,890,000.00	69,323,933.70 (533,101,050)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	10,640,000.00	12,629,148.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	8,900,000.00	9,717,554.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	1,560,000.00	1,877,210.40	

		BUNDESobligation 1 2018/10/12	8,810,000.00	8,990,252.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	476,000.00	478,165.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2016/08/01	636,000.00	676,455.96	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	5,060,000.00	5,570,857.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	4,550,000.00	5,111,879.50	
		FINNISH GOVERNMENT 1.75 2016/04/15	880,000.00	907,755.20	
		FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	690,000.00	788,808.00	
		FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	554,000.00	697,801.78	
		IRISH TSY 5.5% 2017 5.5 2017/10/18	260,000.00	300,110.20	
		TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	1,300,000.00	1,523,652.00	
	ユーロ 小計		44,316,000.00	49,269,651.04 (6,971,162,926)	
	南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2018/12/21	13,330,000.00	13,367,057.40	
	南アフリカ・ランド 小計		13,330,000.00	13,367,057.40 (125,917,681)	
国債証券 合計				13,429,132,306 (13,429,132,306)	
特殊債券	アメリカ・ドル	FHLMC GOLD A17598 6.5 2034/01/01	6,786.50	7,638.07	
		FHLMC GOLD A20871 6.5 2034/04/01	38,168.84	42,946.05	
		FHLMC GOLD C52510 6.5 2031/05/01	2,248.84	2,530.03	
		FHLMC GOLD G08008 6.5 2034/07/01	19,274.42	21,772.96	
		FNMA 545477 7 2032/03/01	23,410.37	26,004.23	
		FNMA 555571 6.5 2033/03/01	8,708.43	9,782.26	
		FNMA 602285 6.5 2031/08/01	6,257.15	7,118.82	
		FNMA 609480 7 2031/10/01	4,689.61	5,268.49	
		FNMA 797553 5 2020/04/01	3,636.67	3,877.70	
		FNMA 813915 4.5 2020/11/01	13,746.41	14,642.81	
		FNW 2003-W1 2A 6.6832 2042/12/01	435,972.03	509,306.88	

		FNW 2003-W3 1A1 6.5 2042/08/01	7,417.61	8,428.40	
		GNMA 781542 6 2033/01/01	19,391.39	22,370.48	
		KFW 4 2020/01/27	1,180,000.00	1,300,560.60	
	アメリカ・ドル	小計	1,769,708.27	1,982,247.78 (202,823,593)	
	ノルウェー・クローネ	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN 3.5 2014/09/05	6,500,000.00	6,544,850.00	
	ノルウェー・クローネ	小計	6,500,000.00	6,544,850.00 (110,869,759)	
	ユーロ	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN 2.25 2016/08/24	1,121,000.00	1,169,528.09	
		EFSF 2.25 2022/09/05	1,360,000.00	1,410,292.80	
		ELECTRICITE DE FRANCE 5 2018/02/05	400,000.00	461,028.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.125 2024/04/15	225,000.00	268,314.75	
		EUROPEAN UNION 3.25 2018/04/04	2,010,000.00	2,219,582.70	
	ユーロ	小計	5,116,000.00	5,528,746.34 (782,262,320)	
特殊債券 合計				1,095,955,671 (1,095,955,671)	
社債券	アメリカ・ドル	AUST & NZ BANKING GROUP 0.9 2016/02/12	400,000.00	401,688.00	
		BACM 2005-1 AJ 5.29031 2042/11/10	775,000.00	803,279.75	
		BACM 2006-5 A2 5.317 2047/09/01	844,115.73	849,999.20	
		BACM 2006-6 A2 5.309 2045/10/01	40,835.23	40,931.18	
		BACM 2007-2 A2 5.61079 2049/04/01	22,376.47	22,647.67	
		BERKSHIRE HATHAWAY FIN 4.3 2043/05/15	95,000.00	88,502.95	
		Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Inc 5.17131 2042/11/01	525,819.29	531,881.96	
		COMM 2005-LP5 D 5.08627 2043/05/01	500,000.00	518,175.00	
		COMM 2012-CR1 XA 2.22352 2045/05/01	1,739,876.13	204,104.86	
		COMM 2013-CR8 AM 3.83347 2046/06/01	215,000.00	216,257.75	
		DBRR 2013-EZ3 A 1.636 2049/12/15	474,847.60	476,329.12	

	DLJCM 1998-CG1 B4 7.17636 2031/06/01	5,342.62	5,340.16	
	GMACC 2004-C2 A4 5.301 2038/08/01	100,822.35	101,912.23	
	GSMS 2004-GG2 C 5.532 2038/08/01	295,000.00	298,778.95	
	GSMS 2006-GG6 A2 5.506 2038/04/01	8,832.43	8,836.39	
	GSMS 2013-GC14 AS 4.507 2046/08/01	281,000.00	295,271.99	
	JPMCC 2003-CB6 E 5.87795 2037/07/01	120,000.00	127,161.60	
	JPMCC 2004-LN2 A2 5.115 2041/07/01	553,602.33	556,674.81	
	JPMCC 2007-LD11 A2 5.80027 2049/06/01	178,536.82	178,681.41	
	JPMCC 2007-LD12 A3 5.95956 2051/02/01	576,232.14	579,533.93	
	MLCFC 2006-4 A2FL 0.275 2049/12/12	113,440.23	113,079.48	
	MLMT 2007-C1 A3 5.84056 2050/06/01	94,723.90	97,215.13	
	MSC 2007-IQ14 A2 5.61 2049/04/01	138,943.80	140,468.01	
	MSRR 2010-C30 A3B 5.246 2043/12/01	356,034.12	356,917.08	
	WBCMT 2007-C34 A2 5.569 2046/05/01	292,473.22	287,588.91	
	WFRBS 2012-C9 C 4.543 2045/11/01	630,000.00	630,869.40	
	WFRBS 2013-C12 XA 1.515 2048/03/01	4,372,129.64	385,403.22	
	WFRBS 2013-C14 XA 0.93108 2046/06/01	3,908,013.89	226,547.56	
	WFRBS 2013-C17 XA 1.6155 2046/12/01	4,842,002.84	441,687.49	
	アメリカ・ドル 小計	22,500,000.78	8,985,765.19 (919,423,494)	
	ユーロ			
	FORTUM OYJ 4.5 2016/06/20	450,000.00	487,962.00	
	GE CAPITAL TRUST IV 4.625 2066/09/15	165,000.00	172,218.75	
	ユーロ 小計	615,000.00	660,180.75 (93,408,974)	
社債券 合計			1,012,832,469 (1,012,832,469)	
合計			15,537,920,446 (15,537,920,446)	

(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。

(注) 2. 種類別合計額及び合計金額欄は、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。

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 7銘柄	17.71%	26.69%
	特殊債券 14銘柄	1.19%	
	社債券 29銘柄	5.38%	
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	8.16%	8.96%
オーストラリア・ドル	国債証券 1銘柄	1.17%	1.29%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	2.99%	3.29%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.34%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	0.37%	0.41%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	1.34%	1.47%
ノルウェー・クローネ	特殊債券 1銘柄	0.65%	0.71%
ポーランド・ズロチ	国債証券 1銘柄	1.88%	2.07%
メキシコ・ペソ	国債証券 1銘柄	3.12%	3.43%
ユーロ	国債証券 13銘柄	40.83%	50.50%
	特殊債券 5銘柄	4.58%	
	社債券 2銘柄	0.55%	
南アフリカ・ランド	国債証券 1銘柄	0.74%	0.81%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

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

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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】

「DCニッセイバランスアクティブ」

（平成26年4月30日現在）

資産総額	733,256,889円
負債総額	1,158,662円
純資産総額（ - ）	732,098,227円
発行済数量	598,219,126口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2238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26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26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	216	25,243
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	21	3,196
単位型公社債投資信託	0	0
合計	237	28,440

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18期事業年度（自平成24年4月1日 至平成25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19期事業年度に係る中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25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24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,324,746		1,199,671
有価証券		8,309,605		6,810,580
前払費用	1	200,463	1	420,669
未収委託者報酬		1,465,803		1,578,598
未収運用受託報酬	1	778,921	1	957,692
未収投資助言報酬	1	154,740	1	158,845
繰延税金資産		273,967		360,157
その他		44,410		50,805
流動資産合計		12,552,657		11,537,020
固定資産				
有形固定資産				
建物	2	115,964	2	123,366
車両	2	2,970	2	1,731
器具備品	2	148,251	2	125,394
有形固定資産合計		267,186		250,493
無形固定資産				
ソフトウェア		1,228,624		1,068,747
ソフトウェア仮勘定		55,978		51,802
その他		8,171		8,139
無形固定資産合計		1,292,774		1,128,689
投資その他の資産				
投資有価証券		25,328,584		28,546,974
関係会社株式		-		66,222
差入保証金	1	283,591	1	285,266
繰延税金資産		437,364		172,442
その他		38		17
投資その他の資産合計		26,049,578		29,070,923
固定資産合計		27,609,540		30,450,106
資産合計		40,162,198		41,987,127

負債の部

流動負債

預り金		30,600		29,275
未払償還金		148,104		144,737
未払手数料	1	560,208	1	587,015
未払運用委託報酬		396,073		488,571
未払投資助言報酬		126,813		163,129
その他未払金	1	205,721	1	219,369
未払費用	1	122,185	1	80,370
未払法人税等		149,239		437,800
前受運用受託報酬		-		58
賞与引当金		538,159		745,159
その他		22,815		68,729
流動負債合計		2,299,923		2,964,217

固定負債

退職給付引当金		767,977		929,869
役員退職慰労引当金		13,630		12,650
その他	1	4,973		-
固定負債合計		786,580		942,519

負債合計		3,086,503		3,906,737
------	--	-----------	--	-----------

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		17,833,930		18,272,607
利益剰余金合計		18,513,737		18,952,414
株主資本合計		36,795,577		37,234,254

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		280,116		846,135
--------------	--	---------	--	---------

評価・換算差額等合計		280,116		846,135
------------	--	---------	--	---------

純資産合計		37,075,694		38,080,390
-------	--	------------	--	------------

負債・純資産合計

40,162,198

41,987,127

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	9,952,331		9,738,507	
運用受託報酬	3,987,169		5,029,976	
投資助言報酬	705,920		681,350	
業務受託料	47,100		47,100	
営業収益計	14,692,522		15,496,935	
営業費用				
支払手数料	4,131,652		4,096,763	
広告宣伝費	27,241		4,527	
公告費	323		-	
調査費	2,700,559		3,009,996	
支払運用委託報酬	1,294,778		1,372,587	
支払投資助言報酬	479,438		751,264	
委託調査費	42,633		44,108	
調査費	883,708		842,036	
委託計算費	101,748		104,631	
営業雑経費	390,063		447,523	
通信費	55,182		56,472	
印刷費	133,820		142,821	
協会費	17,984		19,986	
その他営業雑経費	183,076		228,242	
営業費用計	7,351,588		7,663,442	
一般管理費				
役員報酬	1	59,718	1	57,777
給料・手当		3,012,857		2,915,416
賞与引当金繰入額		537,887		726,623
賞与		260,246		224,092
福利厚生費		566,829		559,429
退職給付費用		156,575		208,549
役員退職慰労引当金繰入額		5,455		7,100
役員退職慰労金		650		-
其他人件費		115,587		121,504
不動産賃借料		632,434		619,902
その他不動産経費		27,417		26,829
交際費		14,037		11,456

旅費交通費		90,473		74,226
固定資産減価償却費		654,122		583,306
租税公課		79,628		80,741
業務委託費		179,945		163,637
器具備品費		151,259		134,449
保守料		87,228		88,640
保険料		60,291		60,440
寄付金		5,000		-
諸経費		56,644		41,887
一般管理費計		6,754,291		6,706,012
営業利益		586,642		1,127,480
営業外収益				
受取利息		1,966		172
有価証券利息		93,236		86,415
受取配当金		45,856		79,789
補助金収入		-		9,500
その他営業外収益		17,359		10,147
営業外収益計		158,419		186,025
営業外費用				
為替差損		6,419		15,251
賃貸借契約解約損		4,124		-
控除対象外消費税		-		5,693
その他営業外費用		1,248		646
営業外費用計		11,792		21,591
経常利益		733,269		1,291,913
特別利益				
投資有価証券売却益		25,290		125,271
投資有価証券償還益		-		1,755
事故受取保険金	3	14,136		-
清算配当金	5	59,327		-
特別利益計		98,754		127,026
特別損失				
投資有価証券売却損		1,778		400,864
投資有価証券償還損		87,378		4,005
固定資産除却損	4	19,104	4	8,268
事故損失賠償金	2	39,244	2	58
特別損失計		147,506		413,196
税引前当期純利益		684,516		1,005,743
法人税、住民税及び事業税		263,157		557,322
法人税等調整額		77,232		125,815
法人税等合計		340,390		431,507
当期純利益		344,126		574,236

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成23年4月1日	(自	平成24年4月1日
	至	平成24年3月31日)	至	平成25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	17,625,364	17,833,930
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	17,833,930	18,272,607
利益剰余金合計		
当期首残高	18,305,171	18,513,737
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	18,513,737	18,952,414
株主資本合計		
当期首残高	36,587,011	36,795,577
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	36,795,577	37,234,254
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	227,494	280,116
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	52,622	566,019
当期変動額合計	52,622	566,019
当期末残高	280,116	846,135
評価・換算差額等合計		
当期首残高	227,494	280,116
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	52,622	566,019
当期変動額合計	52,622	566,019
当期末残高	280,116	846,135
純資産合計		
当期首残高	36,814,506	37,075,694
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236

株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	52,622	566,019
当期変動額合計	261,188	1,004,695
当期末残高	37,075,694	38,080,390

（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。

関係会社株式

移動平均法に基づく原価法によっております。

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。

（会計方針の変更）

平成23年度の税制改正に伴い、当事業年度より、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。この結果、従来の方法に比べて、当事業年度の減価償却費が3,082千円減少し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益が3,082千円増加しております。

(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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
前払費用	52,725千円	54,152千円
未収運用受託報酬	383,091	493,954
未収投資助言報酬	135,967	133,324
差入保証金	280,262	280,262
未払手数料	90,057	112,306
その他未払金	19,525	35,771
未払費用	59,677	12,606
その他固定負債	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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
建物	206,955千円	232,440千円
車両	4,043	5,282
器具備品	573,767	599,393
計	784,767	837,116

(損益計算書関係)

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。

取締役	180,000千円
監査役	40,000千円

2. 事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。

3. 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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
器具備品	11,393千円	3,568千円
その他	7,711	4,700
計	19,104	8,268

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において、次のとおり決議しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成24年3月31日

効力発生日 平成24年6月25日

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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24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24年3月31日

効力発生日 平成24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25年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成25年3月31日

効力発生日 平成25年6月24日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

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
（単位：千円）			
	当事業年度（平成25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	589	273
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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）	
1年内	174	186	
1年超	287	108	
合計	462	295	
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23年4月1日 至平成24年3月31日）	当事業年度 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）	
支払リース料	361	186	
減価償却費相当額	330	172	
支払利息相当額	19	12	
<p>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。</p> <p>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。</p>			

（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さないよう、分離して行っております。

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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	-

当事業年度（平成25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	1,199,671	1,199,671	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,010,860	4,020,850	9,989
その他有価証券	2,799,720	2,799,720	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	21,902,802	22,023,000	120,197
その他有価証券	6,576,671	6,576,671	-

（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、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、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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	-	66,222

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

また、関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成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				
其他(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。

当事業年度(平成25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	1,199,671	-	-	-
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	21,800,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	3,606,000	2,706,150	989,200	-
合計	8,805,671	24,506,150	989,200	-

(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

当事業年度（平成25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	25,913,663	26,043,000	130,186
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	25,913,663	26,043,000	130,186
時価が貸借対照 表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		25,913,663	26,043,000	130,186

2. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成25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	2,799,720	2,799,436	283
	国債・地方債等	2,799,720	2,799,436	283
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	5,851,826	4,439,350	1,412,476
	小計	8,651,546	7,238,786	1,412,760
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）	724,845	808,500	83,654
	小計	724,845	808,500	83,654
	合計	9,376,391	8,047,286	1,329,105

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式、関係会社株式については、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23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
非上場株式	67,500千円	67,500千円
関係会社株式	- 千円	66,222千円

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自平成24年 4月 1日 至平成25年 3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	2,175,318	125,271	400,864
合計	2,175,318	125,271	400,864

(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24年 3月31日)	当事業年度 (平成25年 3月31日)
(1)退職給付債務	767,977千円	929,869千円
(2)退職給付引当金	767,977千円	929,869千円

(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23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
(1)勤務費用	132,222千円	186,034千円
(2)退職給付負担金	24,353千円	22,515千円

(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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25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	45,640千円	44,561千円

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 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	204,554千円	283,235千円
未払事業税	19,923	38,976
その他	49,981	38,054
繰延税金資産合計	274,458	360,265
繰延税金負債		
有価証券評価差額	491	107
繰延税金負債合計	491	107
繰延税金資産の純額	273,967	360,157
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	276,081	333,409
役員退職慰労引当金	4,857	2,339
税務上の繰延資産償却超過額	2,519	4,508
投資有価証券評価損	472,994	492,770
投資有価証券評価差額	212,965	31,716
その他	6,911	3,505
小計	976,328	868,247
評価性引当額	106,755	95,324
繰延税金資産合計	869,573	772,923
繰延税金負債		
特別分配金否認	50,467	85,903
投資有価証券評価差額	381,742	514,578
繰延税金負債合計	432,209	600,481
繰延税金資産の純額	437,364	172,442

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 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.00%	法定実効税率 38.01%
(調整)		(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.93	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.38
住民税均等割	0.85	住民税均等割 0.58
税率変更に伴う影響	9.27	税率変更に伴う影響 3.66
その他	1.32	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.44
税効果会計適用後の法人税等の負担率	49.73	その他 0.71
		税効果会計適用後の法人税等の負担率 42.90

(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

(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

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25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	2,745,589

[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	-	-

当事業年度(自平成24年4月1日 至平成25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	2,098,663	未収運用受託報酬	493,954
								投資助言報酬の受取	599,826	未収投資助言報酬	133,324
								業務受託料の受取	47,100	-	-
								関係会社株式の取得	66,222	-	-

(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23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
1株当たり純資産額	341,875円31銭	351,139円62銭
1株当たり当期純利益金額	3,173円18銭	5,295円04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23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
当期純利益	344,126千円	574,236千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	344,126千円	574,236千円
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19期中間会計期間末

(平成25年9月30日現在)

資産の部

流動資産

現金・預金		1,039,584
有価証券		6,516,182
前払費用		388,146
未収委託者報酬		1,933,274
未収運用受託報酬		1,482,202
未収投資助言報酬		180,423
繰延税金資産		235,931
その他		42,368
流動資産合計		11,818,113

固定資産

有形固定資産	1	222,797
無形固定資産		1,070,936
投資その他の資産		
投資有価証券		29,773,352
関係会社株式		66,222
差入保証金		284,888
繰延税金資産		207,304
その他		17
投資その他の資産合計		30,331,785

固定資産合計		31,625,520
--------	--	------------

資産合計		43,443,634
------	--	------------

負債の部

流動負債

預り金		29,713
未払償還金		143,917
未払手数料		769,667
未払運用委託報酬		583,578
未払投資助言報酬		270,956
その他未払金		135,155
未払費用		87,802
未払法人税等		583,441
前受運用受託報酬		23
前受投資助言報酬		70,261
賞与引当金		426,613
その他		105,966
流動負債合計		3,207,097

固定負債

退職給付引当金	1,024,873
役員退職慰労引当金	16,300
固定負債合計	1,041,173
負債合計	4,248,270
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	19,168,379
利益剰余金合計	19,848,186
株主資本合計	38,130,026
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,065,336
評価・換算差額等合計	1,065,336
純資産合計	39,195,363
負債・純資産合計	43,443,634

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第19期中間会計期間	
(自平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	6,054,540
運用受託報酬	3,127,116
投資助言報酬	386,556
業務受託料	23,614
営業収益計	9,591,829
営業費用	4,773,795
一般管理費	1 3,333,810
営業利益	1,484,223
営業外収益	2 101,186
営業外費用	3 3,584
経常利益	1,581,825
特別利益	4 103,675
特別損失	5 6,903
税引前中間純利益	1,678,597
法人税、住民税及び事業税	557,717
法人税等調整額	89,547
法人税等合計	647,265
中間純利益	1,031,331

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第19期中間会計期間

(自平成25年4月1日 至 平成25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	18,272,607
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	1,031,331
当中間期変動額合計	895,771
当中間期末残高	19,168,379
利益剰余金合計	
当期首残高	18,952,414
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560

中間純利益	1,031,331
当中間期変動額合計	895,771
当中間期末残高	19,848,186
株主資本合計	
当期首残高	37,234,254
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	1,031,331
当中間期変動額合計	895,771
当中間期末残高	38,130,026
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	846,135
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）	219,201
当中間期変動額合計	219,201
当中間期末残高	1,065,336
評価・換算差額等合計	
当期首残高	846,135
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）	219,201
当中間期変動額合計	219,201
当中間期末残高	1,065,336
純資産合計	
当期首残高	38,080,390
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	1,031,331
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	219,201
当中間期変動額合計	1,114,973
当中間期末残高	39,195,363

(重要な会計方針)

項目	第19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25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 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。 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。

(注記事項)

[中間貸借対照表関係]

第19期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	868,286千円

[中間損益計算書関係]

第19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	31,169千円
無形固定資産	215,065千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	40,265千円
有価証券利息	38,819千円
為替差益	20,176千円
受取利息	82千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	3,395千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	102,298千円
投資有価証券売却益	1,377千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	6,903千円

[中間株主資本等変動計算書関係]

第19期中間会計期間
 (自 平成25年4月1日
 至 平成25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25年6月24日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成25年3月31日	平成25年6月24日

[リース取引関係]

第19期中間会計期間
 （自 平成25年4月1日
 至 平成25年9月30日）

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間会計期間末残高相当額

	取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	中間 会計期間末残高 相当額
有形固定資産 (器具備品)	千円 862	千円 675	千円 186

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1年内	183千円
1年超	15千円
合計	198千円

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	4千円

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19期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成25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	1,039,584	1,039,584	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,016,432	4,023,430	6,997
その他有価証券	2,499,750	2,499,750	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,567,200	22,631,520	64,319
その他有価証券	7,138,652	7,138,652	-

（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）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式（中間貸借対照表計上額66,222千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

〔有価証券関係〕

第19期中間会計期間末（平成25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	23,585,186	23,663,320	78,133
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	23,585,186	23,663,320	78,133
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	2,998,446	2,991,630	6,816
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,998,446	2,991,630	6,816
合計		26,583,632	26,654,950	71,317

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	2,499,429	2,499,750	321
	国債・地方債等	2,499,429	2,499,750	321
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,846,150	5,443,586	1,597,436
	小計	6,345,579	7,943,336	1,597,757
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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	1,744,700	1,695,065	49,634
	小計	1,744,700	1,695,065	49,634
合計		8,090,279	9,638,402	1,548,123

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

また、関係会社株式(中間貸借対照表計上額66,222千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

[デリバティブ取引関係]

第19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25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19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25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19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25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	1,937,710

[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19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25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19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25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19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

該当事項はありません。

[1株当たり情報]

	第19期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
1株当たり純資産額	361,420円80銭
1株当たり中間純利益	9,509円92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おりません。

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	1,031,331千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	<u>1,031,331千円</u>
期中平均株式数	108千株

[重要な後発事象]

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25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25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25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25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25年9月末現在、204,000米ドル（約19百万円。1米ドル=97.75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25年6月7日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成26年5月12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25年9月21日から平成26年3月20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26年3月20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．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
 - 2．X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年11月22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25年4月1日から平成26年3月31日までの第19期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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25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25年4月1日から平成25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

1．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。