

【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27年6月19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26年12月19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26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1,534億ドル(約16兆円)、投信残高は約745億ドル(約8兆円)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179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26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1,571億ドル(約17兆円)、投信残高は約759億ドル(約8兆円)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185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26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27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)

3【投資リスク】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「3 投資リスク」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。

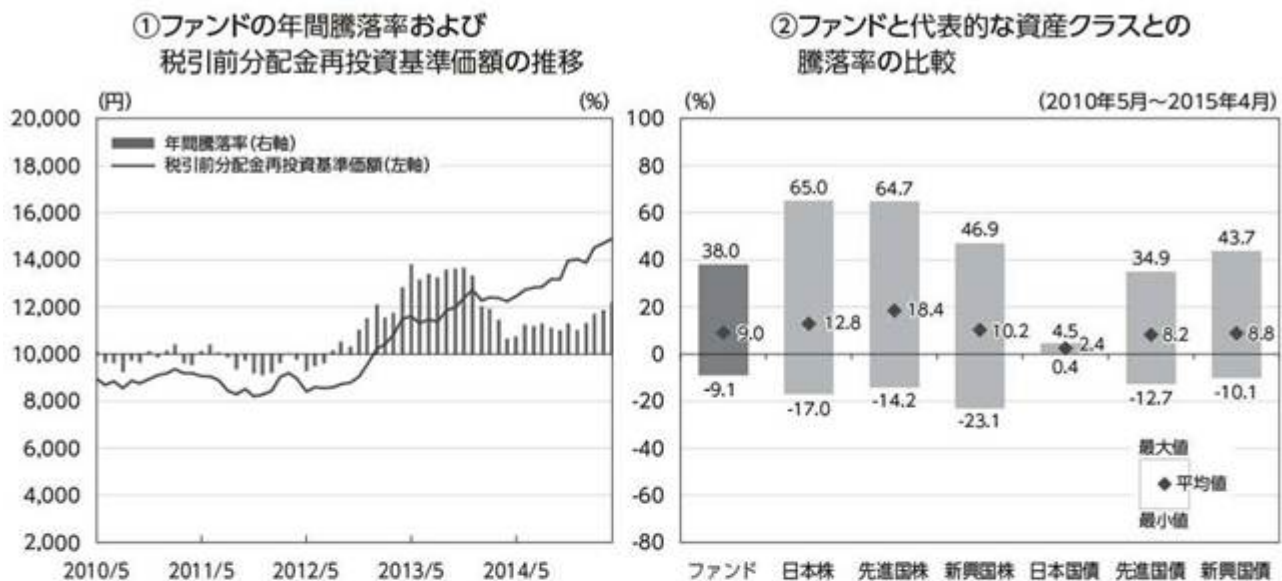
(略)

(2) 投資リスク管理体制

(略)

(参考情報)

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。



- ・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります。ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。
- ・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間におけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株・・・TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債・・・NOMURA-BPI 国債
- 先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

■ 前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

4【手数料等及び税金】

(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 0.00432%	(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 <u>0.04320%</u>	(税抜 <u>0.040%</u>)

(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 <u>0.01080%</u>	(税抜 <u>0.010%</u>)

(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27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	911,421,419	96.82
内 日本	911,421,419	96.82
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	29,939,605	3.18
純資産総額	941,361,024	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27年4月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	19,629,273,490	97.32
内 日本	19,629,273,490	97.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	540,872,999	2.68
純資産総額	20,170,146,489	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)	524,205,000	2.60
内 日本	524,205,000	2.60

(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27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	23,227,250,528	95.45
内 日本	23,227,250,528	95.45
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,106,947,100	4.55
純資産総額	24,334,197,628	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)	887,340,000	3.65
内 日本	887,340,000	3.65

(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)

「ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド」

(平成27年4月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	31,200,106,544	96.90
内 アメリカ	17,688,247,178	54.93
内 イギリス	3,513,170,452	10.91
内 アイルランド	1,695,767,909	5.27
内 フランス	1,244,443,172	3.86
内 オランダ	1,113,279,261	3.46
内 スペイン	959,048,379	2.98
内 スイス	787,141,653	2.44
内 イタリア	679,115,474	2.11
内 スウェーデン	649,335,256	2.02
内 カナダ	582,639,797	1.81
内 ドイツ	546,962,064	1.70
内 オーストラリア	523,957,832	1.63
内 バミューダ	309,420,111	0.96
内 シンガポール	240,239,513	0.75
内 ベルギー	224,984,732	0.70
内 香港	221,295,577	0.69
内 ジャージー	221,058,184	0.69
投資証券	434,945,731	1.35
内 アイルランド	318,952,719	0.99
内 アメリカ	115,993,012	0.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	564,473,402	1.75
純資産総額	32,199,525,677	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27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	11,278,378,044	72.77
内 アメリカ	3,620,748,448	23.36
内 イタリア	1,367,627,115	8.82
内 イギリス	1,230,628,781	7.94
内 フランス	1,134,155,122	7.32
内 スペイン	722,770,156	4.66
内 ベルギー	337,836,513	2.18
内 ドイツ	321,081,005	2.07
内 オランダ	300,796,940	1.94
内 カナダ	267,489,813	1.73
内 ニュージーランド	262,329,357	1.69
内 オーストリア	247,320,017	1.60
内 メキシコ	241,640,060	1.56
内 フィンランド	228,336,481	1.47
内 オーストラリア	213,279,377	1.38
内 ポーランド	212,229,927	1.37
内 アイルランド	169,054,317	1.09
内 南アフリカ	138,025,751	0.89
内 スウェーデン	85,712,764	0.55
内 デンマーク	84,286,683	0.54
内 スイス	66,104,550	0.43
内 ノルウェー	26,924,867	0.17
特殊債券	825,556,956	5.33
内 国際機関	538,978,965	3.48
内 ドイツ	156,093,680	1.01
内 アメリカ	70,572,287	0.46
内 フランス	59,912,024	0.39
社債券	1,157,253,504	7.47
内 アメリカ	1,047,026,904	6.76
内 フィンランド	62,469,520	0.40
内 オーストラリア	47,757,080	0.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,238,269,461	14.44
純資産総額	15,499,457,965	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27年4月30日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	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	368,289,391	0.9613 354,036,592	0.9836 362,249,444	- -	38.48%
2	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	119,374,075	1.9907 237,649,908	2.0017 238,951,085	- -	25.38%
3	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	159,898,858	1.3587 217,268,616	1.3576 217,078,689	- -	23.06%
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	33,313,853	2.7902 92,955,644	2.7959 93,142,201	- -	9.89%

(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	96.82
	小計		96.82
合計(対純資産総額比)			96.82

(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。

(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27年4月30日現在)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	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	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	101,600	7,535.00 765,556,000	8,358.00 849,172,800	- -	4.21%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	916,600	669.80 613,938,680	855.90 784,517,940	- -	3.89%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	138,800	2,470.00 342,836,000	3,644.50 505,856,600	- -	2.51%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	51,600	6,289.00 324,512,400	8,084.00 417,134,400	- -	2.07%
5	任天堂 日本	株式 その他製品	19,600	12,655.00 248,038,000	20,320.00 398,272,000	- -	1.97%
6	日立製作所 日本	株式 電気機器	459,000	907.50 416,542,500	819.30 376,058,700	- -	1.86%
7	三菱商事 日本	株式 卸売業	142,000	2,264.79 321,600,960	2,590.50 367,851,000	- -	1.82%
8	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	34,300	9,032.00 309,797,600	10,595.00 363,408,500	- -	1.80%
9	三井住友トラスト・ホール ディングス 日本	株式 銀行業	594,000	466.00 276,804,000	530.30 314,998,200	- -	1.56%
10	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	160,600	1,707.50 274,224,500	1,869.50 300,241,700	- -	1.49%
11	デンソー 日本	株式 輸送用機器	49,000	5,678.00 278,222,000	5,964.00 292,236,000	- -	1.45%
12	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	56,800	4,383.72 248,995,683	5,021.00 285,192,800	- -	1.41%
13	協和発酵キリン 日本	株式 医薬品	160,000	1,156.00 184,960,000	1,756.00 280,960,000	- -	1.39%
14	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	65,600	3,405.50 223,400,800	4,211.00 276,241,600	- -	1.37%
15	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	36,600	7,427.00 271,828,200	7,505.00 274,683,000	- -	1.36%

16	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	67,700	4,262.60 288,578,023	4,024.50 272,458,650	- -	1.35%
17	損保ジャパン日本興亜ホールディングス 日本	株式 保険業	68,700	3,091.00 212,351,700	3,930.00 269,991,000	- -	1.34%
18	住友不動産 日本	株式 不動産業	58,000	4,227.50 245,195,000	4,642.00 269,236,000	- -	1.33%
19	大阪瓦斯 日本	株式 電気・ガス業	527,000	445.80 234,936,600	509.20 268,348,400	- -	1.33%
20	長谷工コーポレーション 日本	株式 建設業	218,900	969.00 212,114,100	1,191.00 260,709,900	- -	1.29%
21	大塚商会 日本	株式 情報・通信業	46,000	3,961.42 182,225,606	5,530.00 254,380,000	- -	1.26%
22	サントリー食品インターナショナル 日本	株式 食料品	49,300	4,160.00 205,088,000	5,110.00 251,923,000	- -	1.25%
23	T D K 日本	株式 電気機器	28,600	7,402.80 211,720,346	8,650.00 247,390,000	- -	1.23%
24	J Xホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	473,000	480.50 227,276,500	522.70 247,237,100	- -	1.23%
25	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	46,700	4,328.00 202,117,600	5,242.00 244,801,400	- -	1.21%
26	大東建託 日本	株式 建設業	17,300	13,500.00 233,550,000	13,975.00 241,767,500	- -	1.20%
27	日本化薬 日本	株式 化学	162,000	1,433.00 232,146,000	1,452.00 235,224,000	- -	1.17%
28	日立化成 日本	株式 化学	99,700	2,151.00 214,454,700	2,325.00 231,802,500	- -	1.15%
29	イオンモール 日本	株式 不動産業	103,100	2,055.71 211,944,119	2,240.00 230,944,000	- -	1.14%
30	宇部興産 日本	株式 化学	1,158,000	182.00 210,756,000	199.00 230,442,000	- -	1.14%

(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	12.30
		輸送用機器	11.04
		銀行業	8.97
		情報・通信業	7.52
		機械	5.38

	化学	5.17
	医薬品	4.91
	卸売業	4.07
	小売業	4.03
	陸運業	3.64
	食料品	3.41
	サービス業	3.19
	保険業	3.17
	不動産業	2.78
	建設業	2.49
	電気・ガス業	2.47
	その他製品	1.97
	精密機器	1.57
	ゴム製品	1.41
	石油・石炭製品	1.23
	空運業	1.12
	鉄鋼	1.11
	証券、商品先物取引業	0.96
	金属製品	0.83
	ガラス・土石製品	0.72
	繊維製品	0.71
	その他金融業	0.60
	非鉄金属	0.55
	小計	97.32
合計（対純資産総額比）		97.32

（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 2706月	買建	33	521,747,820	524,205,000	2.60%

（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27年4月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	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122回 利付国債（5年） 日本	国債証券	2,137,700,000	100.00 2,137,751,442	100.13 2,140,650,026	0.100000 2019/12/20	8.80%
2	第349回 利付国債（2年） 日本	国債証券	2,034,200,000	100.17 2,037,727,538	100.18 2,037,983,612	0.100000 2017/2/15	8.37%
3	第350回 利付国債（2年） 日本	国債証券	1,023,300,000	100.18 1,025,187,294	100.19 1,025,285,202	0.100000 2017/3/15	4.21%
4	第330回 利付国債（2年） 日本	国債証券	990,700,000	100.02 990,997,196	100.02 990,997,196	0.200000 2015/7/15	4.07%
5	第113回 利付国債（5年） 日本	国債証券	906,900,000	100.90 915,076,103	100.90 915,098,376	0.300000 2018/6/20	3.76%
6	第17回 物価連動国債（10年） 日本	国債証券	662,300,000	109.82 727,355,632	111.05 735,542,100	0.100000 2023/9/10	3.02%
7	第337回 利付国債（10年） 日本	国債証券	648,000,000	99.55 645,084,000	99.95 647,695,440	0.300000 2024/12/20	2.66%
8	第119回 利付国債（5年） 日本	国債証券	637,900,000	100.25 639,515,640	100.24 639,469,234	0.100000 2019/6/20	2.63%
9	第318回 利付国債（10年） 日本	国債証券	580,600,000	105.69 613,647,752	105.69 613,688,394	1.000000 2021/9/20	2.52%
10	第331回 利付国債（2年） 日本	国債証券	601,000,000	100.01 601,072,913	100.01 601,072,913	0.100000 2015/8/15	2.47%
11	第26回 利付国債（30年） 日本	国債証券	454,600,000	123.44 561,171,878	123.13 559,762,618	2.400000 2037/3/20	2.30%
12	第140回 利付国債（20年） 日本	国債証券	453,000,000	112.64 510,280,089	112.61 510,127,830	1.700000 2032/9/20	2.10%
13	第336回 利付国債（10年） 日本	国債証券	483,500,000	102.01 493,218,350	101.82 492,309,370	0.500000 2024/12/20	2.02%
14	第40回 利付国債（30年） 日本	国債証券	436,800,000	111.04 485,064,670	111.17 485,590,560	1.800000 2043/9/20	2.00%
15	第114回 利付国債（20年） 日本	国債証券	375,600,000	119.38 448,419,285	119.60 449,221,356	2.100000 2029/12/20	1.85%
16	第128回 利付国債（20年） 日本	国債証券	353,400,000	116.28 410,945,294	116.45 411,551,970	1.900000 2031/6/20	1.69%
17	第109回 利付国債（20年） 日本	国債証券	334,800,000	118.18 395,687,667	116.86 391,274,064	1.900000 2029/3/20	1.61%
18	第29回 利付国債（30年） 日本	国債証券	298,600,000	123.68 369,328,556	123.71 369,398,060	2.400000 2038/9/20	1.52%
19	第123回 利付国債（5年） 日本	国債証券	338,900,000	100.11 339,297,112	100.12 339,310,069	0.100000 2020/3/20	1.39%

20	第139回 利付国債(20年) 日本	国債証券	301,600,000	111.07 334,987,120	111.20 335,406,344	1.600000 2032/6/20	1.38%
21	第88回 利付国債(20年) 日本	国債証券	253,400,000	120.99 306,601,330	120.42 305,146,814	2.300000 2026/6/20	1.25%
22	第146回 利付国債(20年) 日本	国債証券	269,000,000	112.26 302,003,610	111.90 301,027,140	1.700000 2033/9/20	1.24%
23	第118回 利付国債(5年) 日本	国債証券	297,900,000	100.74 300,130,050	100.65 299,860,182	0.200000 2019/6/20	1.23%
24	第99回 利付国債(20年) 日本	国債証券	241,600,000	119.16 287,911,430	119.13 287,834,992	2.100000 2027/12/20	1.18%
25	第113回 利付国債(20年) 日本	国債証券	223,500,000	119.38 266,814,330	119.60 267,326,115	2.100000 2029/9/20	1.10%
26	第107回 利付国債(5年) 日本	国債証券	262,400,000	100.51 263,756,608	100.51 263,740,864	0.200000 2017/12/20	1.08%
27	第137回 利付国債(20年) 日本	国債証券	231,200,000	112.68 260,516,160	112.78 260,765,856	1.700000 2032/6/20	1.07%
28	第116回 利付国債(20年) 日本	国債証券	209,300,000	121.23 253,736,483	121.01 253,284,395	2.200000 2030/3/20	1.04%
29	第132回 利付国債(20年) 日本	国債証券	221,400,000	112.31 248,668,686	113.12 250,447,680	1.700000 2031/12/20	1.03%
30	第322回 利付国債(10年) 日本	国債証券	234,600,000	104.73 245,696,580	105.38 247,233,210	0.900000 2022/3/20	1.02%

(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	95.45
	小計		95.45
合計(対純資産総額比)			95.45

(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2706月限	買建	6	882,136,200	887,340,000	3.65%

(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27年4月30日現在)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は 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	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC アメリカ	株式 保険	122,510	4,993.23 611,721,832	4,923.02 603,120,405	- -	1.87%
2	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP アメリカ	株式 保険	78,168	6,634.11 518,575,138	6,741.34 526,957,846	- -	1.64%
3	CHALLENGER LTD オーストラリア	株式 各種金融	773,309	623.65 482,278,801	677.55 523,957,832	- -	1.63%
4	NOVARTIS AG スイス	株式 医薬品・バイオテック ノロジー・ライフサイエンス	42,487	11,921.44 506,506,447	12,248.02 520,381,710	- -	1.62%
5	BANK OF IRELAND アイルランド	株式 銀行	10,570,926	42.10 445,119,483	45.77 483,856,018	- -	1.50%
6	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	59,600	7,784.68 463,967,077	8,013.46 477,602,216	- -	1.48%
7	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	7,137	61,282.07 437,370,136	65,340.51 466,335,291	- -	1.45%
8	ASSA ABLOY AB スウェーデン	株式 資本財	62,852	5,856.22 368,075,642	7,011.47 440,685,540	- -	1.37%
9	E*TRADE FINANCIAL アメリカ	株式 各種金融	121,000	2,800.34 338,841,928	3,474.80 420,450,800	- -	1.31%
10	MICRON TECHNOLOGY INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造 装置	118,100	4,079.43 481,781,722	3,435.53 405,736,093	- -	1.26%
11	EXELON CORP アメリカ	株式 公益事業	99,500	4,267.77 424,643,755	4,024.58 400,445,710	- -	1.24%
12	MONSANTO CO アメリカ	株式 素材	28,400	14,413.28 409,337,152	13,685.00 388,654,000	- -	1.21%
13	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品・バイオテック ノロジー・ライフサイエンス	46,868	8,404.75 393,913,982	8,192.88 383,984,134	- -	1.19%

14	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR イギリス	株式 電気通信サービス	89,745	4,175.70 374,749,093	4,238.77 380,409,311	- -	1.18%
15	THOMAS COOK GROUP PLC イギリス	株式 消費者サービス	1,432,565	232.29 332,784,813	264.48 378,896,537	- -	1.18%
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	35,000	10,861.23 380,143,108	10,456.53 365,978,550	- -	1.14%
17	ING GROEP NV オランダ	株式 銀行	193,759	1,493.47 289,374,327	1,852.72 358,981,454	- -	1.11%
18	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバコ	56,949	5,408.75 308,023,303	5,830.13 332,020,415	- -	1.03%
19	MORGAN STANLEY アメリカ	株式 各種金融	74,300	4,582.69 340,493,867	4,461.31 331,475,333	- -	1.03%
20	NATIXIS フランス	株式 銀行	342,514	723.75 247,897,450	962.80 329,774,746	- -	1.02%
21	CALPINE CORP アメリカ	株式 公益事業	123,400	2,587.47 319,294,097	2,646.56 326,585,504	- -	1.01%
22	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	109,306	2,779.97 303,867,947	2,983.07 326,067,886	- -	1.01%
23	ANADARKO PETROLEUM CORP アメリカ	株式 エネルギー	29,100	9,917.12 288,588,461	11,174.10 325,166,310	- -	1.01%
24	HIBERNIA REIT PLC-W/I アイルランド	投資証券 -	1,960,172	142.87 280,056,046	162.71 318,952,719	- -	0.99%
25	ASSURED GUARANTY LTD バミューダ	株式 保険	95,700	3,060.89 292,928,014	3,233.23 309,420,111	- -	0.96%
26	ANTENA 3 TELEVISION スペイン	株式 メディア	157,850	1,516.04 239,307,450	1,898.36 299,656,362	- -	0.93%
27	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	5,800	35,688.10 206,990,980	51,095.03 296,351,174	- -	0.92%
28	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC アメリカ	株式 資本財	52,879	5,364.51 283,670,453	5,456.14 288,515,755	- -	0.90%
29	SEALED AIR CORP アメリカ	株式 素材	54,500	5,021.80 273,688,100	5,250.28 286,140,260	- -	0.89%
30	TUI AG-DI ドイツ	株式 消費者サービス	126,645	1,972.17 249,765,976	2,214.78 280,492,079	- -	0.87%

(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	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.70
		保険	7.60
		ソフトウェア・サービス	7.52
		食品・飲料・タバコ	7.17
		素材	5.77
		資本財	5.34
		各種金融	5.30
		銀行	5.29
		エネルギー	5.24
		メディア	4.54
		消費者サービス	4.46
		耐久消費財・アパレル	4.13
		小売	4.02
		公益事業	3.95
		運輸	3.42
		電気通信サービス	3.20
		ヘルスケア機器・サービス	3.02
		半導体・半導体製造装置	2.61
		不動産	2.27
		家庭用品・パーソナル用品	1.38
商業・専門サービス	0.69		
食品・生活必需品小売り	0.29		
	小計		96.90
投資証券	外国	投資証券	1.35
	小計		1.35
合 計（対純資産総額比）			98.25

（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27年4月30日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は 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	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	755,650,000	99.79 754,115,085	99.74 753,700,423	0.625000 2017/9/30	4.86%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	648,550,000	105.27 682,777,273	106.36 689,843,178	2.750000 2024/2/15	4.45%
3	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	535,774,500	123.61 662,313,721	126.77 679,249,553	4.750000 2023/8/1	4.38%
4	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	525,191,300	120.02 630,382,645	119.82 629,320,979	3.250000 2021/10/25	4.06%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	606,900,000	99.23 602,277,128	99.14 601,680,660	0.625000 2018/4/30	3.88%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	550,256,000	100.80 554,658,048	100.80 554,680,058	1.000000 2016/8/31	3.58%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	525,980,000	97.40 512,338,840	98.69 519,115,961	1.000000 2019/8/31	3.35%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	467,670,000	99.90 467,207,931	100.17 468,507,129	2.750000 2042/8/15	3.02%
9	UK TSY 3 1/4% 2044 イギリス	国債証券	373,114,000	112.82 420,958,408	114.06 425,603,677	3.250000 2044/1/22	2.75%
10	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	276,486,100	123.46 341,363,563	124.86 345,245,428	4.400000 2023/10/31	2.23%
11	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	283,100,600	111.44 315,490,139	111.26 315,006,037	5.250000 2017/8/1	2.03%
12	UK TSY 1.75% 2022 イギリス	国債証券	308,784,000	100.82 311,340,731	100.72 311,016,508	1.750000 2022/9/7	2.01%
13	EUROPEAN UNION 国際機関	特殊債券	265,902,900	110.54 293,937,042	109.87 292,160,811	3.250000 2018/4/4	1.88%
14	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	279,131,900	100.04 279,257,509	99.67 278,227,512	0.500000 2025/5/25	1.80%
15	NEW ZEALAND GOVERNMENT ニュージーランド	国債証券	226,865,710	112.40 255,006,132	115.63 262,329,357	5.500000 2023/4/15	1.69%
16	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	191,820,500	127.76 245,085,216	129.24 247,927,996	4.250000 2022/9/28	1.60%

17	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券	203,726,600	121.09 246,696,614	121.39 247,320,017	3.500000 2021/9/15	1.60%
18	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	166,685,400	125.55 209,283,520	146.31 243,884,076	2.500000 2044/7/4	1.57%
19	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	215,104,740	113.21 243,537,284	112.33 241,640,060	8.000000 2020/6/11	1.56%
20	Netherlands Government Bond オランダ	国債証券	201,080,800	115.98 233,223,565	114.65 230,557,234	2.250000 2022/7/15	1.49%
21	AUSTRALIAN GOVERNMENT オーストラリア	国債証券	174,827,760	119.53 208,989,104	121.99 213,279,377	5.500000 2023/4/21	1.38%
22	POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド	国債証券	203,090,840	104.65 212,554,873	104.49 212,229,927	3.250000 2019/7/25	1.37%
23	EFSF 国際機関	特殊債券	179,914,400	112.44 202,299,349	114.99 206,888,965	2.250000 2022/9/5	1.33%
24	TSY 3 3/4% 2019 イギリス	国債証券	181,962,000	111.50 202,893,088	110.93 201,857,725	3.750000 2019/9/7	1.30%
25	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	124,352,600	154.73 192,421,969	147.96 183,997,081	4.750000 2044/9/1	1.19%
26	CANADIAN GOVERNMENT カナダ	国債証券	161,418,900	107.63 173,741,618	109.95 177,486,537	2.750000 2022/6/1	1.15%
27	TREASURY 5% 2020 アイルランド	国債証券	134,935,800	125.33 169,118,066	125.28 169,054,317	5.000000 2020/10/18	1.09%
28	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	91,280,100	164.14 149,835,411	174.91 159,659,848	4.500000 2041/4/25	1.03%
29	KFW ドイツ	特殊債券	140,420,000	110.34 154,939,428	111.16 156,093,680	4.000000 2020/1/27	1.01%
30	UK TSY 1% 2017 イギリス	国債証券	154,392,000	100.96 155,889,602	100.68 155,457,304	1.000000 2017/9/7	1.00%

（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	72.77
		特殊債券	5.33
		社債券	7.47
	小計	85.56	
合 計（対純資産総額比）			85.56

（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27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
第26計算期間末 (平成26年9月22日)	858,448,206	858,448,206	1.3214	1.3214
第27計算期間末 (平成27年3月20日)	935,825,170	935,825,170	1.4772	1.4772
平成26年4月末日	732,098,227	-	1.2238	-
5月末日	799,613,145	-	1.2452	-
6月末日	817,767,505	-	1.2719	-
7月末日	829,841,468	-	1.2814	-
8月末日	834,384,471	-	1.2853	-
9月末日	857,660,320	-	1.3174	-
10月末日	858,394,184	-	1.3184	-
11月末日	895,521,522	-	1.3963	-
12月末日	895,247,921	-	1.4012	-
平成27年1月末日	886,585,813	-	1.3878	-
2月末日	914,315,700	-	1.4522	-
3月末日	932,644,191	-	1.4695	-
4月末日	941,361,024	-	1.4898	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第26計算期間	0.0000
第27計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第26計算期間	8.4
第27計算期間	11.8

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額により算出しております（第1計算期間については、前計算期間末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。

(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

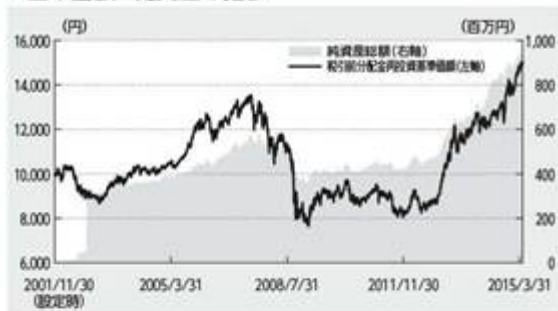
第13計算期間	30,124,473	22,772,806	439,542,409
第14計算期間	54,103,635	34,148,906	459,497,138
第15計算期間	58,887,483	54,678,833	463,705,788
第16計算期間	32,881,333	48,940,728	447,646,393
第17計算期間	31,178,618	25,143,607	453,681,404
第18計算期間	31,950,447	14,541,885	471,089,966
第19計算期間	25,333,224	14,746,306	481,676,884
第20計算期間	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
第26計算期間	106,841,433	20,345,205	649,649,596
第27計算期間	34,671,310	50,794,652	633,526,254

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2015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(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

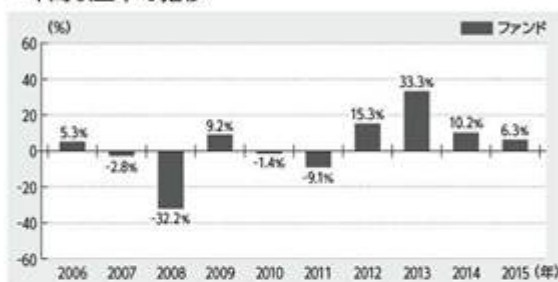
● 基準価額および純資産総額

基準価額	14,898円
純資産総額	941百万円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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
第26期	2014年9月	0円
第27期	2015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。
- ・2015年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 各マザーファンドの組入上位銘柄(各マザーファンドの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	4.2%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.9%
3	ソニー	2.5%
4	日本電信電話	2.1%
5	任天堂	2.0%

2. ニッセイ国内債券マザーファンド

	銘柄名	比率
1	第122回 利付国債(5年)	8.8%
2	第349回 利付国債(2年)	8.4%
3	第350回 利付国債(2年)	4.2%
4	第330回 利付国債(2年)	4.1%
5	第113回 利付国債(5年)	3.8%

3. ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド

	銘柄名	国・地域	比率
1	ハートフォード・フィナンシャル・サービス	アメリカ	1.9%
2	アメリカン・インターナショナル・グループ	アメリカ	1.6%
3	チャレンジャー	オーストラリア	1.6%
4	ノバルティス	スイス	1.6%
5	アイルランド銀行	アイルランド	1.5%

・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	アメリカ国債	米ドル	4.9%
2	アメリカ国債	米ドル	4.5%
3	イタリア国債	ユーロ	4.4%
4	フランス国債	ユーロ	4.1%
5	アメリカ国債	米ドル	3.9%

■ 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27期計算期間（平成26年9月23日から平成27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26期 (平成26年9月22日現在)	第27期 (平成27年3月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	47,134,203	48,078,822
親投資信託受益証券	808,498,292	895,372,996
未収入金	9,270,000	-
流動資産合計	864,902,495	943,451,818
資産合計	864,902,495	943,451,818
負債の部		
流動負債		
未払解約金	615,392	1,393,246
未払受託者報酬	435,707	465,149
未払委託者報酬	5,228,984	5,582,264
その他未払費用	174,206	185,989
流動負債合計	6,454,289	7,626,648
負債合計	6,454,289	7,626,648
純資産の部		
元本等		
元本	649,649,596	633,526,254
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	208,798,610	302,298,916
純資産合計	858,448,206	935,825,170
負債純資産合計	864,902,495	943,451,818

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第26期 （自平成26年3月21日 至平成26年9月22日）	第27期 （自平成26年9月23日 至平成27年3月20日）
営業収益		
受取利息	7,035	8,640
有価証券売買等損益	70,129,417	105,744,704
営業収益合計	70,136,452	105,753,344
営業費用		
受託者報酬	435,707	465,149
委託者報酬	5,228,984	5,582,264
その他費用	174,206	185,989
営業費用合計	5,838,897	6,233,402
営業利益又は営業損失（ ）	64,297,555	99,519,942
経常利益又は経常損失（ ）	64,297,555	99,519,942
当期純利益又は当期純損失（ ）	64,297,555	99,519,942
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（ ）	565,608	2,963,050
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	123,160,007	208,798,610
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,402,573	13,308,472
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	26,402,573	13,308,472
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,495,917	16,365,058
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	4,495,917	16,365,058
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（ ）	208,798,610	302,298,916

(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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月20日及び9月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、平成26年9月23日から平成27年3月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第26期 (平成26年9月22日現在)	第27期 (平成27年3月20日現在)
1. 受益権総口数	649,649,596口	633,526,254口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3214円 (13,214円)	1.4772円 (14,772円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第26期 (自平成26年3月21日 至平成26年9月22日)	第27期 (自平成26年9月23日 至平成27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	613,339円	687,867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(6,451円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(63,725,496円)、収益調整金(219,958,581円)及び分配準備積立金(109,167,643円)より分配対象収益は392,858,171円(1口当たり0.604723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(8,006円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(96,548,886円)、収益調整金(223,396,700円)及び分配準備積立金(159,711,056円)より分配対象収益は479,664,648円(1口当たり0.757135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26期 (自平成26年3月21日 至平成26年9月22日)	第27期 (自平成26年9月23日 至平成27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、金利変動リスク等の市場リスク、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26期 (平成26年9月22日現在)	第27期 (平成27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26期 （平成26年9月22日現在）	第27期 （平成27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	65,000,214	97,829,622
合計	65,000,214	97,829,622

（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26期 （平成26年9月22日現在）	第27期 （平成27年3月20日現在）
期首元本額	563,153,368円	649,649,596円
期中追加設定元本額	106,841,433円	34,671,310円
期中一部解約元本額	20,345,205円	50,794,652円

(4) 【附属明細表】（平成27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	373,753,072	359,288,828	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	151,198,393	205,478,616	
	ニッセイ/バトナム・海外株式マザーファン ド	119,374,075	237,649,908	
	ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファン ド	33,313,853	92,955,644	
親投資信託受益証券 合計		677,639,393	895,372,996	
合計		677,639,393	895,372,996	

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はありません。

「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26年9月22日現在）	（平成27年3月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	241,680,930	247,747,169
株式	20,868,524,130	20,691,544,200
派生商品評価勘定	4,056,440	8,357,800
未収入金	-	401,235,840
未収配当金	6,666,623	32,663,000
差入委託証拠金	4,830,000	6,300,000
流動資産合計	21,125,758,123	21,387,848,009
資産合計	21,125,758,123	21,387,848,009
負債の部		
流動負債		
前受金	4,204,000	6,354,000
未払解約金	29,879,324	55,092,496
流動負債合計	34,083,324	61,446,496
負債合計	34,083,324	61,446,496
純資産の部		
元本等		
元本	26,296,542,418	22,184,634,799
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,204,867,619	858,233,286
純資産合計	21,091,674,799	21,326,401,513
負債純資産合計	21,125,758,123	21,387,848,009

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26年9月22日現在）	（平成27年3月20日現在）
1. 受益権総口数	26,296,542,418口	22,184,634,799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5,204,867,619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858,233,286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）	0.8021円 (8,021円)	0.9613円 (9,613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26年3月21日 至平成26年9月22日）	（自平成26年9月23日 至平成27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	<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、金利変動リスク等の市場リスク、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、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。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成26年9月22日現在）	（平成27年3月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	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26年9月22日現在	平成27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	1,405,065,274	2,318,036,769
合計	1,405,065,274	2,318,036,769

(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26年9月22日 現在)				(平成27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	181,506,000	-	185,570,000	4,064,000	463,526,000	-	471,900,000	8,374,000
合計	181,506,000	-	185,570,000	4,064,000	463,526,000	-	471,900,000	8,374,000

(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26年9月22日現在）	（平成27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	28,796,262,491円	26,296,542,418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	2,300,171,151円	2,811,399,446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	4,799,891,224円	6,923,307,065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）	606,051,175円	515,375,448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）	440,472,942円	373,168,856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）	308,271,597円	271,411,151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）	175,362,636円	120,360,563円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型） SA（適格機関投資家限定）	2,541,926,723円	1,818,773,719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）	7,127,602,703円	5,423,575,632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）	965,772,903円	894,921,065円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス （債券重視型）	1,179,344,556円	1,122,059,891円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス （標準型）	4,731,013,352円	4,516,627,547円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス （株式重視型）	3,552,127,334円	3,474,082,931円
DCニッセイ国内株式アクティブ	599,962,129円	564,069,509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）	3,711,749,061円	2,716,455,415円
DCニッセイバランスアクティブ	356,885,307円	373,753,072円
計	26,296,542,418円	22,184,634,799円

附属明細表（平成27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	
長谷工コーポレーション	233,700	1,158.00	270,624,600	
大東建託	18,400	13,725.00	252,540,000	
日本M&Aセンター	56,500	4,040.00	228,260,000	
江崎グリコ	25,000	5,060.00	126,500,000	
カルビー	9,300	5,020.00	46,686,000	
カカクコム	123,800	2,000.00	247,600,000	
エムスリー	96,800	2,632.00	254,777,600	
サントリー食品インターナショナル	52,500	4,765.00	250,162,500	
日本たばこ産業	69,800	3,665.00	255,817,000	
コスモス薬品	5,600	18,390.00	102,984,000	
セブン&アイ・ホールディングス	28,800	5,097.00	146,793,600	
T S Iホールディングス	183,400	803.00	147,270,200	
ブロードリーフ	105,800	2,257.00	238,790,600	
住友化学	198,000	606.00	119,988,000	
住友精化	68,000	872.00	59,296,000	
協和発酵キリン	172,000	1,565.00	269,180,000	
宇部興産	1,233,000	197.00	242,901,000	
日立化成	106,200	2,667.00	283,235,400	
日本化薬	175,000	1,492.00	261,100,000	
アステラス製薬	171,700	2,000.00	343,400,000	
日本新薬	30,000	4,090.00	122,700,000	
中外製薬	22,800	3,765.00	85,842,000	
参天製薬	15,700	8,480.00	133,136,000	
パーク24	26,100	2,483.00	64,806,300	
伊藤忠テクノソリューションズ	13,800	5,150.00	71,070,000	
大塚商会	49,200	5,390.00	265,188,000	
ポラ・オルビスホールディングス	36,300	6,110.00	221,793,000	
JXホールディングス	507,500	478.50	242,838,750	
ブリヂストン	60,700	4,806.50	291,754,550	
日本碍子	58,000	2,589.00	150,162,000	
新日鐵住金	760,000	311.20	236,512,000	
UACJ	340,000	334.00	113,560,000	
ノーリツ	88,300	2,010.00	177,483,000	
ユニプレス	84,100	2,434.00	204,699,400	

S M C	6,400	36,470.00	233,408,000	
小松製作所	93,700	2,455.00	230,033,500	
クボタ	119,000	1,946.00	231,574,000	
荏原製作所	384,000	542.00	208,128,000	
椿本チエイン	128,000	1,000.00	128,000,000	
日立製作所	498,000	830.90	413,788,200	
三菱電機	156,000	1,461.50	227,994,000	
ソニー	148,500	3,359.50	498,885,750	
T D K	30,500	8,990.00	274,195,000	
アルプス電気	43,100	2,991.00	128,912,100	
O B A R A G R O U P	24,700	7,020.00	173,394,000	
デンソー	52,500	5,718.00	300,195,000	
イリソ電子工業	18,100	8,820.00	159,642,000	
カシオ計算機	94,500	2,307.00	218,011,500	
ファナック	4,100	27,340.00	112,094,000	
ローム	22,700	8,880.00	201,576,000	
三菱重工業	236,000	687.70	162,297,200	
トヨタ自動車	108,700	8,598.00	934,602,600	
マツダ	99,100	2,400.00	237,840,000	
本田技研工業	45,500	4,116.50	187,300,750	
スズキ	62,300	3,645.00	227,083,500	
富士重工業	73,800	4,038.50	298,041,300	
トプコン	62,200	3,010.00	187,222,000	
朝日インテック	25,100	7,930.00	199,043,000	
キヤノン	34,200	4,166.50	142,494,300	
リコー	89,900	1,310.50	117,813,950	
ビジョン	13,100	9,720.00	127,332,000	
任天堂	21,400	17,845.00	381,883,000	
三井物産	125,800	1,657.00	208,450,600	
日立ハイテクノロジーズ	64,700	4,015.00	259,770,500	
三菱商事	103,500	2,437.50	252,281,250	
A O K I ホールディングス	60,500	1,694.00	102,487,000	
青山商事	55,100	3,910.00	215,441,000	
ケーズホールディングス	46,100	3,890.00	179,329,000	
新生銀行	777,000	249.00	193,473,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	980,600	790.00	774,674,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	633,000	517.00	327,261,000	
三井住友フィナンシャルグループ	49,000	4,869.50	238,605,500	
千葉銀行	128,000	903.00	115,584,000	

横浜銀行	231,000	741.70	171,332,700	
ジャックス	202,000	615.00	124,230,000	
野村ホールディングス	267,900	737.50	197,576,250	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	73,300	3,865.00	283,304,500	
東京海上ホールディングス	38,800	4,589.00	178,053,200	
T & Dホールディングス	116,900	1,613.50	188,618,150	
住友不動産	61,000	4,348.00	265,228,000	
イオンモール	110,100	2,414.00	265,781,400	
東京急行電鉄	285,000	814.00	231,990,000	
東日本旅客鉄道	36,600	10,415.00	381,189,000	
山九	248,000	539.00	133,672,000	
日本航空	60,200	3,890.00	234,178,000	
日本電信電話	55,200	7,388.00	407,817,600	
K D D I	28,100	8,278.00	232,611,800	
中部電力	55,200	1,425.50	78,687,600	
四国電力	96,600	1,472.00	142,195,200	
大阪瓦斯	561,000	504.50	283,024,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	31,600	5,330.00	168,428,000	
ファーストリテイリング	2,300	46,815.00	107,674,500	
ソフトバンク	39,100	7,068.00	276,358,800	
合計	13,544,100		20,691,544,200	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」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26年9月22日現在)	(平成27年3月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	945,635,492	1,011,461,549
国債証券	24,244,033,767	23,413,804,673
派生商品評価勘定	-	5,263,800
未収入金	3,418,230,520	2,621,917,453
未収利息	17,577,813	14,302,825
前払金	1,800,000	-
前払費用	12,924,414	13,740,221
差入委託証拠金	1,980,000	3,240,000
流動資産合計	28,642,182,006	27,083,730,521
資産合計	28,642,182,006	27,083,730,521
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	496,200	-
前受金	-	5,280,000
未払金	3,415,377,427	2,321,311,839
未払解約金	32,749,038	59,587,825
流動負債合計	3,448,622,665	2,386,179,664
負債合計	3,448,622,665	2,386,179,664
純資産の部		
元本等		
元本	19,096,042,759	18,173,238,025
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,097,516,582	6,524,312,832
純資産合計	25,193,559,341	24,697,550,857
負債純資産合計	28,642,182,006	27,083,730,521

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26年9月22日現在）	（平成27年3月20日現在）
1. 受益権総口数	19,096,042,759口	18,173,238,025口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3193円 (13,193円)	1.3590円 (13,590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26年3月21日 至平成26年9月22日）	（自平成26年9月23日 至平成27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、金利変動リスク等の市場リスク、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、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。</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26年9月22日現在）	（平成27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26年9月22日現在	平成27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	55,468,846	59,545,465

合計	55,468,846	59,545,465
----	------------	------------

（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26年9月22日 現在）			（平成27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	874,800,000	-	874,320,000	480,000	882,120,000	-	887,400,000	5,280,000
合計	874,800,000	-	874,320,000	480,000	882,120,000	-	887,400,000	5,280,000

（注） 時価の算定方法

1. 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。
2. 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。
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26年9月22日現在）	（平成27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	19,793,676,300円	19,096,042,759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	1,725,385,823円	3,585,509,280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	2,423,019,364円	4,508,314,014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）	985,453,211円	957,770,453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）	303,878,748円	294,190,737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)	68,361,778円	68,780,923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)	120,963,933円	94,883,402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)	4,133,125,504円	3,423,203,137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)	4,916,274,561円	4,331,194,140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)	214,132,656円	229,787,021円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (債券重視型)	1,917,915,944円	2,085,695,616円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (標準型)	3,263,942,126円	3,561,905,628円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (株式重視型)	787,658,274円	880,623,140円
DCニッセイ国内債券アクティブ	962,357,848円	1,029,753,083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)	1,186,324,897円	1,004,596,507円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(毎月分配型)	55,407,993円	46,368,225円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(成長重視型)	22,590,847円	13,287,620円
DCニッセイバランスアクティブ	157,654,439円	151,198,393円
計	19,096,042,759円	18,173,238,025円

附属明細表(平成27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329回 利付国債(2年)	251,000,000	251,091,307	
	第330回 利付国債(2年)	990,700,000	991,157,424	
	第331回 利付国債(2年)	601,000,000	601,100,260	
	第332回 利付国債(2年)	125,500,000	125,539,620	
	第333回 利付国債(2年)	78,200,000	78,235,414	
	第334回 利付国債(2年)	143,400,000	143,486,458	
	第338回 利付国債(2年)	57,800,000	57,856,598	
	第339回 利付国債(2年)	89,200,000	89,294,552	
	第340回 利付国債(2年)	23,200,000	23,226,448	
	第343回 利付国債(2年)	77,100,000	77,207,169	
	第344回 利付国債(2年)	57,300,000	57,384,231	
	第348回 利付国債(2年)	7,800,000	7,813,416	

第349回 利付国債(2年)	1,382,500,000	1,384,988,500	
第350回 利付国債(2年)	1,011,300,000	1,013,191,131	
第102回 利付国債(5年)	184,500,000	185,446,485	
第113回 利付国債(5年)	722,000,000	728,779,580	
第117回 利付国債(5年)	106,300,000	107,019,651	
第118回 利付国債(5年)	336,900,000	339,180,813	
第119回 利付国債(5年)	421,100,000	422,169,594	
第120回 利付国債(5年)	448,000,000	451,010,560	
第122回 利付国債(5年)	2,900,800,000	2,905,586,320	
第1回 利付国債(40年)	56,300,000	72,181,104	
第2回 利付国債(40年)	41,800,000	51,394,772	
第3回 利付国債(40年)	23,500,000	28,969,625	
第6回 利付国債(40年)	174,100,000	199,144,285	
第7回 利付国債(40年)	58,400,000	63,217,416	
第297回 利付国債(10年)	800,000	841,280	
第315回 利付国債(10年)	382,900,000	409,657,052	
第316回 利付国債(10年)	124,500,000	132,426,915	
第322回 利付国債(10年)	234,600,000	247,624,992	
第323回 利付国債(10年)	1,353,600,000	1,428,873,696	
第330回 利付国債(10年)	1,000,000	1,048,350	
第331回 利付国債(10年)	54,900,000	56,639,232	
第333回 利付国債(10年)	617,900,000	636,912,783	
第336回 利付国債(10年)	98,800,000	100,670,284	
第338回 利付国債(10年)	604,900,000	609,581,926	
第16回 利付国債(30年)	46,600,000	58,335,744	
第25回 利付国債(30年)	29,800,000	36,233,224	
第26回 利付国債(30年)	454,600,000	561,726,490	
第27回 利付国債(30年)	40,200,000	50,530,194	
第28回 利付国債(30年)	67,500,000	85,073,625	
第29回 利付国債(30年)	298,600,000	371,067,234	
第30回 利付国債(30年)	124,100,000	151,933,148	
第34回 利付国債(30年)	65,500,000	79,181,640	
第37回 利付国債(30年)	1,900,000	2,172,688	
第39回 利付国債(30年)	58,600,000	67,040,158	
第40回 利付国債(30年)	78,200,000	87,604,332	
第42回 利付国債(30年)	116,200,000	127,326,150	
第43回 利付国債(30年)	445,900,000	488,866,924	
第72回 利付国債(20年)	73,100,000	85,560,626	
第79回 利付国債(20年)	243,600,000	284,461,464	
第84回 利付国債(20年)	138,800,000	162,594,484	
第88回 利付国債(20年)	253,400,000	306,345,396	

第92回 利付国債(20年)	202,100,000	240,632,386	
第99回 利付国債(20年)	276,000,000	330,084,960	
第105回 利付国債(20年)	81,500,000	97,612,550	
第107回 利付国債(20年)	141,200,000	169,270,560	
第109回 利付国債(20年)	334,800,000	392,489,388	
第112回 利付国債(20年)	16,700,000	20,025,972	
第113回 利付国債(20年)	223,500,000	267,842,400	
第114回 利付国債(20年)	375,600,000	450,077,724	
第116回 利付国債(20年)	209,300,000	253,608,810	
第117回 利付国債(20年)	1,500,000	1,797,060	
第118回 利付国債(20年)	800,000	946,480	
第121回 利付国債(20年)	80,000,000	93,417,600	
第122回 利付国債(20年)	130,600,000	150,679,750	
第123回 利付国債(20年)	1,300,000	1,556,958	
第124回 利付国債(20年)	3,700,000	4,375,842	
第125回 利付国債(20年)	146,400,000	177,466,080	
第127回 利付国債(20年)	190,100,000	221,785,868	
第128回 利付国債(20年)	353,400,000	411,640,320	
第130回 利付国債(20年)	85,400,000	98,057,134	
第131回 利付国債(20年)	160,800,000	182,019,168	
第132回 利付国債(20年)	366,700,000	414,510,346	
第133回 利付国債(20年)	26,800,000	30,734,240	
第134回 利付国債(20年)	800,000	916,904	
第136回 利付国債(20年)	400,000	445,524	
第137回 利付国債(20年)	231,200,000	261,142,712	
第139回 利付国債(20年)	301,600,000	335,614,448	
第140回 利付国債(20年)	213,500,000	240,768,220	
第141回 利付国債(20年)	171,900,000	193,382,343	
第145回 利付国債(20年)	152,100,000	170,364,168	
第147回 利付国債(20年)	52,400,000	57,635,284	
第148回 利付国債(20年)	102,000,000	110,226,300	
第149回 利付国債(20年)	8,900,000	9,594,823	
第150回 利付国債(20年)	295,000,000	311,956,600	
第151回 利付国債(20年)	211,600,000	215,730,432	
第17回 物価連動国債(10年)	370,600,000	409,392,555	
国債証券 合計	21,900,400,000	23,413,804,673	
合計	21,900,400,000	23,413,804,673	

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26年9月22日現在)	(平成27年3月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	313,026,476	332,334,115
コール・ローン	286,173,574	81,270,589
株式	30,188,359,392	31,781,243,581
投資証券	616,311,463	420,427,191
派生商品評価勘定	253,815,269	136,621,710
未収入金	621,172,653	406,662,216
未収配当金	43,994,373	48,359,570
流動資産合計	32,322,853,200	33,206,918,972
資産合計	32,322,853,200	33,206,918,972
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	295,080,148	158,710,297
未払金	733,754,725	568,619,842
未払解約金	68,878,288	60,499,344
流動負債合計	1,097,713,161	787,829,483
負債合計	1,097,713,161	787,829,483
純資産の部		
元本等		
元本	17,943,433,949	16,284,490,304
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	13,281,706,090	16,134,599,185
純資産合計	31,225,140,039	32,419,089,489
負債純資産合計	32,322,853,200	33,206,918,972

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>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p>
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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>
4. 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26年9月22日現在）	（平成27年3月20日現在）
1. 受益権総口数	17,943,433,949口	16,284,490,304口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7402円 (17,402円)	1.9908円 (19,908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26年3月21日 至 平成26年9月22日）	（自 平成26年9月23日 至 平成27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、金利変動リスク等の市場リスク、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	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年9月22日現在)	(平成27年3月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左

2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	同左
------------	---	----

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年9月22日現在	平成27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	1,673,197,857	1,954,422,194
投資証券	108,186,962	30,094,824
合計	1,565,010,895	1,984,517,018

(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26年9月22日 現在)				(平成27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	7,352,611,066	-	7,647,102,833	294,491,767	6,943,165,044	-	6,864,291,366	78,873,678
アメリカ・ドル	4,094,658,455	-	4,314,338,721	219,680,266	3,427,010,104	-	3,447,185,017	20,174,913
イギリス・ポンド	1,179,622,860	-	1,208,399,127	28,776,267	1,286,358,883	-	1,239,173,059	47,185,824
オーストラリア・ドル	219,303,054	-	223,757,978	4,454,924	82,244,682	-	81,900,559	344,123
カナダ・ドル	-	-	-	-	325,448,450	-	323,122,475	2,325,975
シンガポール・ドル	218,901,108	-	228,594,048	9,692,940	72,345,336	-	72,287,040	58,296
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	166,580,610	-	161,701,680	4,878,930
ノルウェー・クローネ	27,789,544	-	28,135,267	345,723	-	-	-	-
ユーロ	1,612,336,045	-	1,643,877,692	31,541,647	1,583,176,979	-	1,538,921,536	44,255,443
買 建	7,352,611,066	-	7,605,837,954	253,226,888	6,647,835,044	-	6,546,872,779	100,962,265
アメリカ・ドル	3,257,952,611	-	3,394,339,398	136,386,787	3,516,154,940	-	3,543,183,781	27,028,841
イギリス・ポンド	158,664,991	-	159,070,618	405,627	161,710,211	-	156,293,935	5,416,276
イスラエル・シケル	91,304,406	-	91,927,040	622,634	93,846,259	-	92,081,280	1,764,979

オーストラリア・ドル	586,326,252	-	596,948,749	10,622,497	461,535,961	-	452,874,474	8,661,487
カナダ・ドル	1,341,241,842	-	1,406,700,360	65,458,518	1,348,569,106	-	1,261,503,600	87,065,506
スイス・フラン	963,851,355	-	983,658,148	19,806,793	635,872,694	-	617,543,190	18,329,504
スウェーデン・クローナ	274,255,253	-	279,531,642	5,276,389	-	-	-	-
デンマーク・クローネ	205,274,309	-	208,495,760	3,221,451	200,970,894	-	191,971,362	8,999,532
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	54,896,379	-	52,324,032	2,572,347
ユーロ	320,913,288	-	323,345,364	2,432,076	-	-	-	-
香港・ドル	152,826,759	-	161,820,875	8,994,116	174,278,600	-	179,097,125	4,818,525
合計	14,705,222,132	-	15,252,940,787	41,264,879	13,591,000,088	-	13,411,164,145	22,088,587

（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26年9月22日現在）	（平成27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	18,436,312,993円	17,943,433,949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	1,880,597,557円	2,219,042,168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	2,373,476,601円	3,877,985,813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）	143,305,101円	119,122,275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）	138,854,100円	115,004,558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）	109,339,619円	94,113,873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）	55,290,505円	37,083,872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）	601,128,785円	425,172,854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）	2,247,530,586円	1,690,749,640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）	342,459,567円	313,925,170円
DCニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式	9,499,053,524円	9,293,616,923円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視 型）	278,793,449円	259,395,165円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準 型）	1,491,020,828円	1,392,341,617円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視 型）	1,259,485,939円	1,204,867,008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）	1,328,279,634円	960,736,191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）	63,190,743円	55,367,472円
ニッセイ/パトナム・バランスアップオープン	262,618,271円	203,619,611円
DCニッセイバランスアクティブ	123,083,298円	119,374,075円
計	17,943,433,949円	16,284,490,304円

附属明細表（平成27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	ACTIVISION BLIZZARD INC	57,450	23.15	1,329,967.50	
	AMAZON.COM INC	5,800	373.24	2,164,792.00	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	41,000	55.19	2,262,790.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	73,268	55.65	4,077,364.20	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	29,100	80.43	2,340,513.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SPN ADR	15,800	121.45	1,918,910.00	
	AOL INC	56,800	41.15	2,337,320.00	
	APPLIED MATERIALS INC	108,100	24.08	2,603,048.00	
	ASSURED GUARANTY LTD	87,800	26.08	2,289,824.00	
	AXIALL CORP	34,200	44.78	1,531,476.00	
	BANK OF AMERICA CORP	93,600	15.61	1,461,096.00	
	BIOGEN IDEC INC	3,900	433.65	1,691,235.00	
	BOISE CASCADE CO	49,600	37.61	1,865,456.00	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	28,500	68.32	1,947,120.00	
	BRUNSWICK CORP	37,325	51.10	1,907,307.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	70,000	28.32	1,982,400.00	
	CALPINE CORP	123,400	21.81	2,691,354.00	
	CANADIAN SOLAR INC	53,200	34.70	1,846,040.00	
	CAPITAL SENIOR LIVING CORP	79,800	26.35	2,102,730.00	
	CARDINAL HEALTH INC	24,600	89.92	2,212,032.00	
	CATAMARAN CORP	36,900	48.91	1,804,779.00	
	CELGENE CORP	19,800	125.33	2,481,534.00	
	CHARLES SCHWAB CORP	61,300	29.42	1,803,446.00	
	CHARTER COMMUNICATION-A	12,500	188.18	2,352,250.00	
	CME GROUP INC	16,300	99.67	1,624,621.00	
	COMPUTER SCIENCES CORP	31,900	66.78	2,130,282.00	
COOPER COS INC/THE	9,600	187.36	1,798,656.00		
COTY INC-CL A	82,000	23.13	1,896,660.00		

DISH NETWORK CORP	27,600	74.38	2,052,888.00	
DOLLAR GENERAL CORP	22,600	74.91	1,692,966.00	
E*TRADE FINANCIAL	121,000	27.32	3,305,720.00	
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,900	91.48	1,454,532.00	
ESTEE LAUDER COS INC	21,600	81.67	1,764,072.00	
EXELON CORP	81,900	33.25	2,723,175.00	
EXXON MOBIL CORP	31,500	84.41	2,658,915.00	
FACEBOOK INC-A	28,700	82.75	2,374,925.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	52,879	45.08	2,383,785.32	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	201,800	7.26	1,465,068.00	
GOOGLE INC-CL C	7,118	557.99	3,971,772.82	
HALLIBURTON CO	40,500	41.55	1,682,775.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	122,510	42.57	5,215,250.70	
HERSHEY CO/THE	19,400	100.55	1,950,670.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	60,030	29.46	1,768,483.80	
HOME DEPOT INC	17,870	115.16	2,057,909.20	
HOWARD HUGHES CORP/THE	11,600	153.25	1,777,700.00	
HUNTSMAN CORP	61,400	21.30	1,307,820.00	
IMPAX LABORATORIES INC	55,200	46.81	2,583,912.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12,000	187.12	2,245,440.00	
KENNEDY-WILSON HOLDINGS INC	72,700	26.06	1,894,562.00	
LAM RESEARCH CORP	21,900	78.95	1,729,005.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	42,100	52.55	2,212,355.00	
LIVE NATION INC	46,700	25.51	1,191,317.00	
LOWE'S COS INC	31,000	74.56	2,311,360.00	
MEADWESTVACO CORP	29,000	51.51	1,493,790.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	118,100	28.05	3,312,705.00	
MOBILEYE NV	32,800	43.27	1,419,256.00	
MONSANTO CO	28,400	115.38	3,276,792.00	
MORGAN STANLEY	74,300	36.11	2,682,973.00	
MYLAN NV	29,900	63.94	1,911,806.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,900	162.52	2,259,028.00	
NRG ENERGY INC	86,500	24.62	2,129,630.00	
PALL CORP	20,800	104.08	2,164,864.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	22,900	78.86	1,805,894.00	

	PINNACLE FOODS INC	54,500	40.21	2,191,445.00	
	PTC THERAPEUTICS INC	16,600	69.23	1,149,218.00	
	PULTE GROUP INC	101,600	21.37	2,171,192.00	
	RADIAN GROUP INC	95,980	16.81	1,613,423.80	
	RE/MAX HOLDINGS INC-CL A	66,516	32.24	2,144,475.84	
	SEALED AIR CORP	54,500	46.53	2,535,885.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,700	284.49	1,906,083.00	
	SPIRIT AIRLINES INC	29,300	79.95	2,342,535.00	
	STANDARD PACIFIC CORP	199,046	8.65	1,721,747.90	
	TILE SHOP HLDGS INC	59,415	10.81	642,276.15	
	TIVO INC	138,300	10.59	1,464,597.00	
	UNION PACIFIC CORP	16,000	117.55	1,880,800.00	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	17,800	118.73	2,113,394.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	14,600	202.09	2,950,514.00	
	VISA INC-CLASS A SHARES	59,600	66.81	3,981,876.00	
	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	89,745	33.15	2,975,046.75	
	WHIRLPOOL CORP	9,100	194.14	1,766,674.00	
	YAHOO! INC	36,500	44.98	1,641,770.00	
アメリカ・ドル	小計	4,093,452		173,881,073.48 (20,996,139,623)	
イギリス・ポンド	ADMIRAL GROUP PLC	81,140	15.18	1,231,705.20	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	39,025	30.61	1,194,555.25	
	ASTRAZENECA PLC	46,868	47.85	2,242,868.14	
	BAE SYSTEMS PLC	179,095	5.47	979,649.65	
	BG GROUP PLC	127,753	8.59	1,098,037.03	
	BRITVIC PLC	179,904	7.69	1,384,361.28	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	56,949	31.55	1,796,740.95	
	PRUDENTIAL PLC	109,306	17.52	1,915,041.12	
	REGUS PLC	498,843	2.30	1,150,830.80	
	ST JAMES'S PLACE PLC	121,288	9.66	1,172,248.52	
	TELECITY GROUP PLC	158,734	9.10	1,444,479.40	
	THOMAS COOK GROUP PLC	1,295,977	1.42	1,851,951.13	
	TSB BANKING GROUP PLC- WI	354,551	3.27	1,159,381.77	

	TUI AG-DI	126,645	11.81	1,495,677.45	
イギリス・ポンド	小計	3,376,078		20,117,527.69 (3,585,748,135)	
オーストラリア・ドル	CHALLENGER LTD	683,726	7.14	4,881,803.64	
	G8 EDUCATION LTD	119,106	3.56	424,017.36	
オーストラリア・ドル	小計	802,832		5,305,821.00 (491,053,733)	
カナダ・ドル	BOMBARDIER INC-SUB RCT	251,131	2.49	625,316.19	
カナダ・ドル	小計	251,131		625,316.19 (59,486,329)	
シンガポール・ドル	EZION HOLDINGS LTD	2,266,480	0.94	2,130,491.20	
シンガポール・ドル	小計	2,266,480		2,130,491.20 (185,416,650)	
スイス・フラン	NESTLE SA	28,772	76.55	2,202,496.60	
	NOVARTIS AG	35,606	99.20	3,532,115.20	
スイス・フラン	小計	64,378		5,734,611.80 (700,081,408)	
スウェーデン・クローナ	ASSA ABLOY AB	62,852	510.00	32,054,520.00	
	COM HEM HOLDING AB-W/I	206,229	77.25	15,931,190.25	
スウェーデン・クローナ	小計	269,081		47,985,710.25 (667,961,086)	
ユーロ	ACCOR	25,193	49.76	1,253,729.64	
	AENA SA	20,031	79.10	1,584,452.10	
	AER LINGUS GROUP PLC	525,636	2.37	1,245,757.32	
	AKZO NOBEL NV	27,879	68.98	1,923,093.42	
	ANTENA 3 TELEVISION	157,850	13.68	2,159,388.00	
	BANK OF IRELAND	8,726,585	0.36	3,150,297.18	
	DALATA HOTEL GROUP LTD	388,979	3.45	1,341,977.55	
	EURAZEO	24,737	66.34	1,641,052.58	
	GAZTRANSPORT ET TECHNIGA-W/I	21,055	56.60	1,191,713.00	
	INDITEX SA	65,929	29.59	1,951,168.75	
	ING GROEP NV	162,021	13.53	2,192,144.13	
	KERRY GROUP PLC-A	22,848	65.61	1,499,057.28	
	LUXOTTICA GROUP SPA	36,761	58.50	2,150,518.50	
	MEDIASET SPA	418,176	4.25	1,780,593.40	
	NATIXIS	342,514	6.60	2,261,277.42	
	NH HOTELES GROUP SA	257,914	4.68	1,207,037.52	
	ROYAL KPN NV	552,691	3.00	1,659,731.07	

	SANOFI	21,999	92.98	2,045,467.02	
	SYMRISE AG	27,459	59.53	1,634,799.02	
	TELECOM ITALIA-RNC	1,777,698	0.87	1,548,374.95	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	112,043	17.44	1,954,029.92	
	ZALANDO SE	22,902	21.96	503,065.33	
ユーロ 小計		13,738,900		37,878,725.10 (4,877,643,431)	
香港・ドル	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	531,000	26.35	13,991,850.00	
香港・ドル 小計		531,000		13,991,850.00 (217,713,186)	
合計		25,393,332		31,781,243,581 (31,781,243,581)	

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	48,700.00	1,025,622.00	
	アメリカ・ドル 小計		48,700.00	1,025,622.00 (123,843,857)	
	ユーロ	HIBERNIA REIT PLC-W/I	1,960,172.00	2,303,202.10	
	ユーロ 小計		1,960,172.00	2,303,202.10 (296,583,334)	
投資証券 合計				420,427,191 (420,427,191)	
合計				420,427,191 (420,427,191)	

(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 81銘柄	64.76%	-%	65.59%
	投資証券 1銘柄	-%	0.38%	
イギリス・ポンド	株式 14銘柄	11.06%	-%	11.14%
オーストラリア・ドル	株式 2銘柄	1.51%	-%	1.52%
カナダ・ドル	株式 1銘柄	0.18%	-%	0.18%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	0.57%	-%	0.58%
スイス・フラン	株式 2銘柄	2.16%	-%	2.17%

スウェーデン・クローナ	株式	2銘柄	2.06%	-%	2.07%
ユーロ	株式	22銘柄	15.05%	-%	16.07%
	投資証券	1銘柄	-%	0.91%	
香港・ドル	株式	1銘柄	0.67%	-%	0.68%

(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。

「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成26年9月22日現在)	(平成27年3月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,611,081,025	927,553,130
コール・ローン	172,506,987	71,949,242
国債証券	13,454,828,864	12,579,070,626
特殊債券	1,000,934,647	818,448,890
社債券	1,083,471,368	1,062,765,834
派生商品評価勘定	265,395,667	141,243,235
未収入金	1,560,318,377	-
未収利息	160,504,057	108,132,602
前払費用	12,500,244	19,111,348
流動資産合計	19,321,541,236	15,728,274,907
資産合計	19,321,541,236	15,728,274,907
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	238,025,490	70,193,322
未払金	2,432,405,823	5,193,478
未払解約金	49,687,285	35,953,132
流動負債合計	2,720,118,598	111,339,932
負債合計	2,720,118,598	111,339,932
純資産の部		
元本等		
元本	6,355,622,352	5,596,863,056
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,245,800,286	10,020,071,919
純資産合計	16,601,422,638	15,616,934,975
負債純資産合計	19,321,541,236	15,728,274,907

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、特殊債券及び社債券</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、価格情報会社の提供する価額等で評価して おります。</p>
2. デリバティブ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26年9月22日現在）	（平成27年3月20日現在）
1. 受益権総口数	6,355,622,352口	5,596,863,056口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6121円 (26,121円)	2.7903円 (27,903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26年3月21日 至 平成26年9月22日)	(自 平成26年9月23日 至 平成27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、金利変動リスク等の市場リスク、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26年9月22日現在)	(平成27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26年9月22日現在	平成27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	621,896,791	293,033,214
特殊債券	23,122,689	9,320,682
社債券	24,823,248	10,821,411
合計	620,196,232	291,532,485

(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26年9月22日 現在)				(平成27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	7,507,768,044	-	7,743,980,063	236,212,019	5,698,092,882	-	5,611,643,214	86,449,668

アメリカ・ドル	2,357,087,242	-	2,483,269,498	126,182,256	2,448,842,707	-	2,472,040,677	23,197,970
イギリス・ポンド	277,478,593	-	283,497,480	6,018,887	101,715,110	-	100,109,957	1,605,153
オーストラリア・ドル	175,735,842	-	178,458,118	2,722,276	520,177,094	-	500,644,172	19,532,922
カナダ・ドル	606,843,294	-	628,633,395	21,790,101	689,635,908	-	653,259,640	36,376,268
スイス・フラン	8,656,488	-	8,730,282	73,794	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	12,909,388	-	13,124,688	215,300	201,101,415	-	195,759,744	5,341,671
デンマーク・クローネ	89,829,754	-	91,732,720	1,902,966	143,807,040	-	138,756,960	5,050,080
ニュージーランド・ドル	185,940,367	-	186,473,091	532,724	508,922,004	-	503,822,350	5,099,654
ノルウェー・クローネ	82,239,145	-	83,387,237	1,148,092	77,441,210	-	73,819,680	3,621,530
ポーランド・ズロチ	95,055,080	-	96,950,350	1,895,270	122,602,668	-	117,931,005	4,671,663
メキシコ・ペソ	366,028,692	-	384,214,308	18,185,616	86,900,490	-	84,673,113	2,227,377
ユーロ	3,164,244,435	-	3,217,976,276	53,731,841	738,274,726	-	714,952,776	23,321,950
南アフリカ・ランド	85,719,724	-	87,532,620	1,812,896	58,672,510	-	55,873,140	2,799,370
買 建	7,507,768,044	-	7,771,350,240	263,582,196	5,512,692,882	-	5,497,293,127	15,399,755
アメリカ・ドル	5,150,680,802	-	5,350,377,789	199,696,987	3,249,250,175	-	3,264,408,076	15,157,901
イギリス・ポンド	132,832,859	-	135,407,349	2,574,490	376,691,303	-	363,879,323	12,811,980
オーストラリア・ドル	810,604,767	-	828,229,200	17,624,433	485,441,120	-	479,969,528	5,471,592
カナダ・ドル	238,004,327	-	249,718,950	11,714,623	325,850,725	-	319,966,815	5,883,910
シンガポール・ドル	58,920,651	-	61,512,768	2,592,117	62,071,971	-	62,027,280	44,691
スイス・フラン	8,077,347	-	8,243,334	165,987	34,419,490	-	33,427,323	992,167

スウェーデン・クローナ	34,224,986	-	34,983,420	758,434	196,477,950	-	192,378,576	4,099,374
ニュージーランド・ドル	208,747,079	-	209,674,812	927,733	383,763,230	-	386,926,400	3,163,170
ノルウェー・クローネ	166,682,522	-	170,332,612	3,650,090	115,059,445	-	112,854,384	2,205,061
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	4,913,734	-	4,843,800	69,934
メキシコ・ペソ	294,236,180	-	311,044,800	16,808,620	122,323,916	-	121,520,202	803,714
ユーロ	368,337,281	-	374,325,506	5,988,225	156,429,823	-	155,091,420	1,338,403
南アフリカ・ランド	36,419,243	-	37,499,700	1,080,457	-	-	-	-
合計	15,015,536,088	-	15,515,330,303	27,370,177	11,210,785,764	-	11,108,936,341	71,049,913

(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26年9月22日現在)	(平成27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	7,039,539,280円	6,355,622,352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	400,190,850円	495,951,601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	1,084,107,778円	1,254,710,897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)	93,417,448円	83,507,568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)	45,262,767円	40,304,536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)	23,759,767円	21,988,089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)	18,022,195円	12,998,100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)	391,844,136円	298,825,028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)	732,477,839円	594,161,803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)	74,424,906円	73,561,335円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (債券重視型)	181,779,143円	181,858,006円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (標準型)	486,108,268円	488,041,938円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (株式重視型)	273,733,687円	281,524,511円
DCニッセイ/パトナム・グローバル債券	1,433,167,717円	1,475,164,496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)	309,259,964円	241,125,642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)	2,254,059,116円	1,770,488,151円
DCニッセイバランスアクティブ	38,305,399円	33,313,853円
計	6,355,622,352円	5,596,863,056円

附属明細表（平成27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	4,624,000.00	4,659,743.52		
		US TREASURY N/B 1 2019/08/31	11,092,000.00	10,894,340.56		
		US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	9,582,000.00	10,233,192.72		
		US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	3,651,000.00	3,806,423.07		
	アメリカ・ドル 小計			28,949,000.00	29,593,699.87 (3,573,439,259)	
	イギリス・ポンド	TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	990,000.00	1,110,740.40		
		UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	2,722,000.00	2,795,902.30		
		UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	2,492,000.00	2,982,051.80		
	イギリス・ポンド 小計			6,204,000.00	6,888,694.50 (1,227,840,908)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	1,832,000.00	2,276,351.60		
	オーストラリア・ドル 小計			1,832,000.00	2,276,351.60 (210,676,341)	
	カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	2,970,000.00	3,331,716.30		
		CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	350,000.00	544,425.00		
	カナダ・ドル 小計			3,320,000.00	3,876,141.30 (368,737,322)	
	スイス・フラン	SWITZERLAND 2 2022/05/25	450,000.00	522,981.00		
	スイス・フラン 小計			450,000.00	522,981.00 (63,845,520)	
	スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	3,540,000.00	4,373,139.00		
スウェーデン・クローナ 小計			3,540,000.00	4,373,139.00 (60,874,095)		

デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 4 2017/11/15	7,000,000.00	7,832,440.00	
	KINGDOM OF DENMARK 7 2024/11/10	2,680,000.00	4,438,884.00	
デンマーク・クローネ 小計		9,680,000.00	12,271,324.00 (212,048,479)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT 5.5 2023/04/15	2,501,000.00	2,905,461.72	
ニュージーランド・ドル 小計		2,501,000.00	2,905,461.72 (260,823,299)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2019/07/25	6,158,000.00	6,515,164.00	
ポーランド・ズロチ 小計		6,158,000.00	6,515,164.00 (203,142,814)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	27,507,000.00	30,989,111.13	
メキシコ・ペソ 小計		27,507,000.00	30,989,111.13 (245,123,869)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	2,726,000.00	3,560,101.48	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	3,735,000.00	4,753,870.65	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	434,000.00	578,252.92	
	BUNDESobligation 1 2018/10/12	1,647,000.00	1,717,837.47	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2022/07/04	4,253,000.00	4,797,426.53	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	1,495,000.00	2,251,051.40	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	5,056,000.00	6,401,603.84	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	4,050,000.00	5,231,668.50	
	FINNISH GOVERNMENT 1.75 2016/04/15	880,000.00	898,471.20	
	FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	690,000.00	835,624.50	
	FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	10,031,000.00	12,098,188.48	
	FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	435,000.00	787,210.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	1,540,000.00	1,885,144.80	
	TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	741,000.00	934,356.54	
	ユーロ 小計		37,713,000.00	46,730,809.11

				(6,017,526,289)	
	南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2018/12/21	13,330,000.00	13,732,699.30	
	南アフリカ・ランド	小計	13,330,000.00	13,732,699.30 (134,992,434)	
国債証券 合計				12,579,070,626 (12,579,070,626)	
特殊債券	アメリカ・ドル	FHLMC GOLD A17598 6.5 2034/01/01	6,611.06	7,576.07	
		FHLMC GOLD A20871 6.5 2034/04/01	31,380.38	36,158.04	
		FHLMC GOLD C52510 6.5 2031/05/01	2,176.86	2,494.61	
		FHLMC GOLD G08008 6.5 2034/07/01	14,479.86	16,593.48	
		FNMA 545477 7 2032/03/01	21,160.85	25,314.09	
		FNMA 555571 6.5 2033/03/01	7,583.80	9,009.55	
		FNMA 602285 6.5 2031/08/01	5,375.69	6,465.98	
		FNMA 609480 7 2031/10/01	2,808.78	3,180.85	
		FNMA 797553 5 2020/04/01	2,717.91	2,893.75	
		FNMA 813915 4.5 2020/11/01	9,736.48	10,278.99	
		FNW 2003-W1 2A 6.52879 2042/12/01	392,657.43	457,445.90	
		FNW 2003-W3 1A1 6.5 2042/08/01	6,720.13	7,773.30	
		GNMA 781542 6 2033/01/01	16,032.00	18,696.35	
		KFW 4 2020/01/27	1,180,000.00	1,312,691.00	
			アメリカ・ドル	小計	1,699,441.23
特殊債券	ユーロ	EFSF 2.25 2022/09/05	1,360,000.00	1,580,170.40	
		ELECTRICITE DE FRANCE 5 2018/02/05	400,000.00	455,212.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.125 2024/04/15	225,000.00	305,817.75	
		EUROPEAN UNION 3.25 2018/04/04	2,010,000.00	2,217,492.30	
	ユーロ	小計	3,995,000.00	4,558,692.45 (587,022,827)	
特殊債券 合計				818,448,890 (818,448,890)	
社債券	アメリカ・ドル	APPLE INC 3.45 2024/05/06	330,000.00	349,400.70	

AUST & NZ BANKING GROUP 0.9 2016/02/12	400,000.00	401,580.00	
BACM 2005-1 AJ 5.4305 2042/11/10	694,038.81	693,858.35	
BACM 2005-4 A5A 4.933 2045/07/01	109,457.33	110,006.80	
BACM 2006-5 A2 5.317 2047/09/01	101,430.86	101,357.82	
BACM 2006-6 A2 5.309 2045/10/01	38,076.79	38,099.62	
BACM 2007-2 A2 5.59653 2049/04/01	18,393.71	18,399.40	
BERKSHIRE HATHAWAY FIN 4.3 2043/05/15	95,000.00	104,681.45	
CGCMT 2007-C6 A4 5.7029 2049/12/01	200,000.00	216,314.00	
COMM 2005-LP5 D 5.26986 2043/05/01	500,000.00	501,735.00	
COMM 2012-CR1 XA 2.10892 2045/05/01	1,652,820.84	167,166.29	
COMM 2012-CR3 XA 2.16572 2045/10/01	531,937.63	57,693.94	
DBRR 2013-EZ3 A 1.636 2049/12/15	112,157.44	112,684.57	
GMACC 2004-C2 A4 5.301 2038/08/01	1,668.59	1,670.37	
GSMS 2013-GC10 XA 1.72436 2046/02/01	1,804,951.14	171,344.01	
JPMBB 2013-C12 XA 0.8887 2045/07/01	18,236,628.14	712,687.42	
JPMCC 2003-CB6 E 5.84715 2037/07/01	120,000.00	124,044.00	
JPMCC 2004-LN2 A2 5.115 2041/07/01	38,524.45	38,555.64	
JPMCC 2007-LD12 A3 5.93772 2051/02/01	56,944.01	57,044.78	
JPMCC 2012-C6 D 5.20761 2045/05/01	190,000.00	209,533.90	
JPMCC 2013-C10 C 4.15878 2047/12/01	277,000.00	286,165.93	
JPMCC 2013-C16 XA 1.35791 2046/12/01	4,720,885.46	306,243.83	
JPMCC 2013-LC11 C 3.9582 2046/04/01	340,000.00	345,484.20	
MLMT 2007-C1 A3 5.83736 2050/06/01	37,629.85	37,664.83	
MSBAM 2014-C17 XA 1.28461 2047/08/01	1,979,552.39	153,177.76	

	MSC 2007-IQ14 A2 5.61 2049/04/01	123,322.20	123,848.78	
	MSRR 2010-C30 A3B 5.246 2043/12/01	332,292.12	335,123.24	
	UBSBB 2012-C4 XA 1.84402 2045/12/01	2,886,794.45	286,716.42	
	WFRBS 2012-C10 XA 1.7871 2045/12/01	4,684,513.72	448,026.87	
	WFRBS 2013-C12 XA 1.48981 2048/03/01	2,601,712.43	206,315.78	
	WFRBS 2013-C14 XA 0.91198 2046/06/01	6,344,032.96	329,318.74	
	WFRBS 2013-C17 XA 1.58647 2046/12/01	4,783,241.33	387,203.37	
	WFRBS 2014-C19 C 4.646 2047/03/01	635,000.00	677,437.05	
	アメリカ・ドル 小計	54,978,006.65	8,110,584.86 (979,353,122)	
	ユーロ			
	FORTUM OYJ 4.5 2016/06/20	450,000.00	475,168.50	
	GE CAPITAL TRUST IV 4.625 2066/09/15	165,000.00	172,596.60	
	ユーロ 小計	615,000.00	647,765.10 (83,412,712)	
社債券 合計			1,062,765,834 (1,062,765,834)	
合計			14,460,285,350 (14,460,285,350)	

(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	組入債券 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	国債証券 4銘柄	22.88%	33.09%
	特殊債券 14銘柄	1.48%	
	社債券 33銘柄	6.27%	
イギリス・ポンド	国債証券 3銘柄	7.86%	8.49%
オーストラリア・ドル	国債証券 1銘柄	1.35%	1.46%
カナダ・ドル	国債証券 2銘柄	2.36%	2.55%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.41%	0.44%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	0.39%	0.42%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	1.36%	1.47%
ニュージーランド・ドル	国債証券 1銘柄	1.67%	1.80%

ポーランド・ズロチ	国債証券	1銘柄	1.30%	1.40%
メキシコ・ペソ	国債証券	1銘柄	1.57%	1.70%
ユーロ	国債証券	14銘柄	38.53%	46.25%
	特殊債券	4銘柄	3.76%	
	社債券	2銘柄	0.53%	
南アフリカ・ランド	国債証券	1銘柄	0.86%	0.93%

(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27年4月30日現在)

資産総額	942,852,339円
負債総額	1,491,315円
純資産総額(-)	941,361,024円
発行済数量	631,890,622口
1口当たり純資産額(/)	1.4898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27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27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	267	36,901
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	30	4,415
単位型公社債投資信託	1	105
合計	298	41,422

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19期事業年度（自平成25年4月1日 至平成26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20期事業年度に係る中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,199,671		1,509,845
有価証券		6,810,580		7,325,806
前払費用	1	420,669	1	207,351
未収委託者報酬		1,578,598		1,897,225
未収運用受託報酬	1	957,692	1	1,419,102
未収投資助言報酬	1	158,845	1	190,027
繰延税金資産		360,157		406,503
その他		50,805		26,376
流動資産合計		11,537,020		12,982,239
固定資産				
有形固定資産				
建物	2	123,366	2	102,335
車両	2	1,731	2	1,009
器具備品	2	125,394	2	105,718
有形固定資産合計		250,493		209,063
無形固定資産				
ソフトウェア		1,068,747		949,954
ソフトウェア仮勘定		51,802		28,053
その他		8,139		8,107
無形固定資産合計		1,128,689		986,115
投資その他の資産				
投資有価証券		28,546,974		31,159,584
関係会社株式		66,222		66,222
差入保証金	1	285,266	1	284,888
繰延税金資産		172,442		160,839
その他		17		17
投資その他の資産合計		29,070,923		31,671,552
固定資産合計		30,450,106		32,866,731
資産合計		41,987,127		45,848,971
負債の部				
流動負債				
預り金		29,275		29,930
未払償還金		144,737		137,842
未払手数料	1	587,015	1	711,826
未払運用委託報酬		488,571		508,934
未払投資助言報酬		163,129		310,490
その他未払金	1	219,369	1	248,117

未払費用	1	80,370	1	79,355
未払法人税等		437,800		1,283,286
前受運用受託報酬		58		-
賞与引当金		745,159		769,569
その他		68,729		168,940
流動負債合計		2,964,217		4,248,293
固定負債				
退職給付引当金		929,869		1,106,561
役員退職慰労引当金		12,650		19,950
固定負債合計		942,519		1,126,511
負債合計		3,906,737		5,374,805
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		18,272,607		20,276,469
利益剰余金合計		18,952,414		20,956,276
株主資本合計		37,234,254		39,238,116
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		846,135		1,236,049
評価・換算差額等合計		846,135		1,236,049
純資産合計		38,080,390		40,474,166
負債・純資産合計		41,987,127		45,848,971

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		9,738,507		12,436,743
運用受託報酬		5,029,976		6,674,387
投資助言報酬		681,350		791,350
業務受託料		47,100		47,100
営業収益計		15,496,935		19,949,580
営業費用				
支払手数料		4,096,763		5,367,041
広告宣伝費		4,527		13,397

公告費		-		161
調査費		3,009,996		3,767,832
支払運用委託報酬		1,372,587		1,587,647
支払投資助言報酬		751,264		1,228,668
委託調査費		44,108		66,025
調査費		842,036		885,490
委託計算費		104,631		128,890
営業雑経費		447,523		538,997
通信費		56,472		55,199
印刷費		142,821		147,275
協会費		19,986		20,172
その他営業雑経費		228,242		316,349
営業費用計		7,663,442		9,816,320
一般管理費				
役員報酬	1	57,777	1	63,866
給料・手当		2,915,416		2,906,149
賞与引当金繰入額		726,623		766,843
賞与		224,092		248,914
福利厚生費		559,429		569,577
退職給付費用		208,549		241,558
役員退職慰労引当金繰入額		7,100		7,300
その他人件費		121,504		97,103
不動産賃借料		619,902		574,467
その他不動産経費		26,829		26,330
交際費		11,456		14,005
旅費交通費		74,226		79,754
固定資産減価償却費		583,306		511,498
租税公課		80,741		93,822
業務委託費		163,637		208,262
器具備品費		134,449		143,717
保守料		88,640		83,044
保険料		60,440		59,043
諸経費		41,887		48,305
一般管理費計		6,706,012		6,743,562
営業利益		1,127,480		3,389,697
営業外収益				
受取利息		172		166
有価証券利息		86,415		76,250

受取配当金	79,789	81,042
為替差益	-	20,176
補助金収入	9,500	-
その他営業外収益	10,147	13,559
<hr/>		
営業外収益計	186,025	191,194
<hr/>		
営業外費用		
為替差損	15,251	-
控除対象外消費税	5,693	4,451

その他営業外費用		646		1,182
<hr/>				
営業外費用計		21,591		5,634
<hr/>				
経常利益		1,291,913		3,575,257
特別利益				
投資有価証券売却益		125,271		1,377
投資有価証券償還益		1,755		102,298
特別利益計		127,026		103,675
特別損失				
投資有価証券売却損		400,864		-
投資有価証券償還損		4,005		6,903
固定資産除却損	3	8,268	3	8,924
事故損失賠償金	2	58	2	2,387

寄付金 - 142,550

特別損失計 413,196 160,764

税引前当期純利益	1,005,743	3,518,168
法人税、住民税及び事業税	557,322	1,474,066
法人税等調整額	125,815	95,320
法人税等合計	431,507	1,378,745
当期純利益	574,236	2,139,422

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	17,833,930	18,513,737	36,795,577
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	574,236	574,236	574,236
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	438,676	438,676	438,676
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	18,272,607	18,952,414	37,234,254

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	280,116	280,116	37,075,694
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	574,236
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	566,019	566,019	566,019
当期変動額合計	566,019	566,019	1,004,695
当期末残高	846,135	846,135	38,080,390

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	18,272,607	18,952,414	37,234,254
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	2,139,422	2,139,422	2,139,422
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,003,862	2,003,862	2,003,862
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	846,135	846,135	38,080,390
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	2,139,422
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	389,913	389,913	389,913
当期変動額合計	389,913	389,913	2,393,775
当期末残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166

注記事項

（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、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期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、当期末における退職給付債務に基づき、当期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。

(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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
前払費用	54,152千円	46,554千円
未収運用受託報酬	493,954	738,331
未収投資助言報酬	133,324	151,082
差入保証金	280,262	280,263
未払手数料	112,306	145,292
その他未払金	35,771	61,527
未払費用	12,606	7,311

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
建物	232,440千円	254,648千円
車両	5,282	6,004
器具備品	599,393	520,399
計	837,116	781,053

(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. 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24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
器具備品	3,568千円	8,924千円
その他	4,700	-
計	8,268	8,924

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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25年6月24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25年3月31日

効力発生日 平成25年6月24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26年6月26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26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26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

(単位：千円)

	当事業年度（平成26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	762	100

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1年内	186	107
1年超	108	0
合計	295	107

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24年4月1日 至平成25年3月31日)	当事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
支払リース料	186	186
減価償却費相当額	172	172
支払利息相当額	12	6

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2参照)。

前事業年度（平成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	-

当事業年度（平成26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	1,509,845	1,509,845	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,626,076	4,632,360	6,283
その他有価証券	2,699,730	2,699,730	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,227,190	23,229,720	72,529
その他有価証券	7,864,894	7,864,894	-

（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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	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 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	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの その他(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。

当事業年度(平成26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	1,509,845	-	-	-
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	4,600,000	23,200,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの その他(注)	4,888,361	3,035,620	1,624,417	3,044
合計	10,998,206	26,235,620	1,624,417	3,044

（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

当事業年度(平成26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	26,554,298	26,634,680	80,381
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,554,298	26,634,680	80,381
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	1,298,967	1,297,400	1,567
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,298,967	1,297,400	1,567
合計		27,853,266	27,932,080	78,813

2. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成26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	1,799,820	1,799,764	55
	国債・地方債等	1,799,820	1,799,764	55
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	7,295,640	5,502,350	1,793,290
	小計	9,095,460	7,302,114	1,793,345
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	899,910	899,912	2
	国債・地方債等	899,910	899,912	2
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	569,254	583,000	13,745
	小計	1,469,164	1,482,912	13,748
合計		10,564,624	8,785,027	1,779,597

（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24年4月1日 至平成25年3月31日）	当事業年度 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）
非上場株式	67,500千円	67,500千円
関係会社株式	66,222千円	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

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26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	256,377	1,377	-
合計	256,377	1,377	-

（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）

前事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を支払っております。

2．退職給付債務に関する事項

(1)退職給付債務	929,869千円
(2)退職給付引当金	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

(1)勤務費用	186,034千円
(2)退職給付負担金	22,515千円

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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。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。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	929,869 千円
退職給付費用	212,344
退職給付の支払額	35,652
退職給付引当金の期末残高	1,106,561

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	212,344 千円
----------------	------------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,191千円であります。

（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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	283,235 千円	274,274 千円
未払事業税	38,976	98,319
その他	38,054	33,928
繰延税金資産合計	360,265	406,523
繰延税金負債		
有価証券評価差額	107	19
繰延税金負債合計	107	19
繰延税金資産の純額	360,157	406,503
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	333,409	394,378
役員退職慰労引当金	2,339	3,835
税務上の繰延資産償却超過額	4,508	7,110

投資有価証券評価損	492,770	486,598
投資有価証券評価差額	31,716	4,898
その他	3,505	2,461
小計	868,247	899,283
評価性引当額	95,324	97,929
繰延税金資産合計	772,923	801,354
繰延税金負債		
特別分配金否認	85,903	92,089
投資有価証券評価差額	514,578	548,424
繰延税金負債合計	600,481	640,514
繰延税金資産の純額	172,442	160,839

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25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
法定実効税率	38.01	% 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	0.38	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.15	
住民税均等割	0.58	住民税均等割	0.17	
税率変更に伴う影響	3.66	税率変更に伴う影響	0.98	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.44	その他	0.11	
その他	0.71	税効果会計適用後の法人税等の負担率	39.19	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.90			

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について、前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が19,365千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が34,514千円、その他有価証券評価差額金が15,149千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自平成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

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26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	3,851,374

[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	-	-

当事業年度(自平成25年4月1日 至平成26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	3,139,318	未収運用受 託報酬	738,331
								投資助言報酬 の受取	664,956	未収投資助 言報酬	151,082
								業務受託料 の受取	47,100	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、一般的取引条件と同様に決定しております。

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社(非上場)

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	当事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	351,139円62銭	373,212円65銭
1株当たり当期純利益金額	5,295円04銭	19,727円63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いません。

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24年4月1日 至平成25年3月31日)	当事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
当期純利益	574,236千円	2,139,422千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	574,236千円	2,139,422千円
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20期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		1,522,695
有価証券		6,810,810
前払費用		295,938
未収委託者報酬		2,147,820
未収運用受託報酬		1,670,638
未収投資助言報酬		206,291
繰延税金資産		236,575
その他		24,277
流動資産合計		12,915,047
固定資産		
有形固定資産	1	186,661
無形固定資産		933,336
投資その他の資産		
投資有価証券		32,607,421
関係会社株式		66,222
差入保証金		284,888
繰延税金資産		55,058
その他		17
投資その他の資産合計		33,013,609
固定資産合計		34,133,607
資産合計		47,048,655
負債の部		
流動負債		
預り金		31,366
未払償還金		137,842
未払手数料		794,767
未払運用委託報酬		574,370
未払投資助言報酬		353,064
その他未払金		136,179
未払費用		92,039

未払法人税等		754,602
前受投資助言報酬		72,269
賞与引当金		423,658
その他	2	233,717
流動負債合計		<u>3,603,878</u>
固定負債		
退職給付引当金		1,192,922
役員退職慰労引当金		23,600
固定負債合計		<u>1,216,522</u>
負債合計		<u>4,820,400</u>
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		<u>8,281,840</u>
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		21,794,709
利益剰余金合計		<u>22,474,516</u>
株主資本合計		<u>40,756,356</u>
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,471,898
評価・換算差額等合計		<u>1,471,898</u>
純資産合計		<u>42,228,254</u>
負債・純資産合計		<u>47,048,655</u>

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第20期中間会計期間	
(自平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	6,889,577

運用受託報酬		3,667,305
投資助言報酬		422,741
業務受託料		23,614
営業収益計		11,003,238
営業費用		5,336,884
一般管理費	1	3,275,988
営業利益		2,390,365
営業外収益	2	124,617
営業外費用	3	10,149
経常利益		2,504,834
特別利益	4	18,039
特別損失	5	413
税引前中間純利益		2,522,460
法人税、住民税及び事業税		723,566
法人税等調整額		145,094
法人税等合計		868,661
中間純利益		1,653,799

(3) 中間株主資本等変動計算書

第20期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	1,653,799	1,653,799	1,653,799
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	-	1,518,239	1,518,239	1,518,239
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	21,794,709	22,474,516	40,756,356

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	1,653,799
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	235,848	235,848	235,848
当中間期変動額合計	235,848	235,848	1,754,088
当中間期末残高	1,471,898	1,471,898	42,228,254

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第20期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>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。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>

3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	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。

(中間貸借対照表関係)

第20期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
1．有形固定資産の減価償却累計額	806,775千円
2．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第20期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1．減価償却の実施額 有形固定資産 無形固定資産	26,053千円 187,096千円
2．営業外収益のうち主要なもの 受取配当金 有価証券利息 為替差益	87,194千円 35,848千円 16千円

受取利息	97千円
3. 営業外費用のうち主要なもの 控除対象外消費税	3,952千円
4. 特別利益のうち主要なもの 投資有価証券償還益	12,353千円
投資有価証券売却益	5,686千円
5. 特別損失のうち主要なもの 事故損失賠償金	376千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第20期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)					
1. 発行済株式の種類及び総数					
	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26年6月26日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成26年3月31日	平成26年6月26日

(リース取引関係)

第20期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
---	--

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。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 848	千円 14

未経過リース料中間会計期間末残高相当額等

1年内	15千円
1年超	0千円
合計	15千円

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料	93千円
減価償却費相当額	86千円
支払利息相当額	1千円

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。

(金融商品関係)

第20期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成26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含まれておりません（注2参照）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,522,695	1,522,695	-

有価証券				
満期保有目的の債券	5,810,910	5,816,850	5,939	
その他有価証券	999,900	999,900	-	
投資有価証券				
満期保有目的の債券	21,728,395	21,803,240	74,844	
その他有価証券	10,811,526	10,811,526	-	

（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、中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、中間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

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 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20期中間会計期間末（平成26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	27,539,306	27,620,090	80,783
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	27,539,306	27,620,090	80,783
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	0	0	0
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	0	0	0
合計		27,539,306	27,620,090	80,783

2．その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (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 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,501,414	1,502,000	585
	国債・地方債等	1,501,414	1,502,000	585
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
(3)その他(注1)	5,983,480	8,133,619	2,150,139	
	小計	7,484,894	9,635,619	2,150,724
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	2,002,300	2,001,500	800
	国債・地方債等	2,002,300	2,001,500	800
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
(3)その他(注1)	178,170	174,307	3,863	
	小計	2,180,470	2,175,807	4,663
	合計	9,665,365	11,811,426	2,146,060

(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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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	2,371,866

[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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	第20期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
1株当たり純資産額	389,387円12銭
1株当たり中間純利益金額	15,249円70銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間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いません。

2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	1,653,799千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	1,653,799千円
期中平均株式数	108千株

(重要な後発事象)

第20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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26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26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26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26年9月末現在、204,000米ドル（約22百万円。1米ドル = 109.45円）

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

c. 事業の内容

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

独立監査人の監査報告書

平成26年6月6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26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. 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](#)

独立監査人の監査報告書

平成27年5月13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

公認会計士

松崎雅則

印

業務執行社員

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26年9月23日から平成27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27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26年11月27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26年4月1日から平成27年3月31日までの第20期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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に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26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26年4月1日から平成26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. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。