

【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28年6月20日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 赤林 富二
【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27年12月18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27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1,592億ドル（約19兆円）、投信残高は約771億ドル（約9兆円）の規模を誇ります。

設定済み投信は80本以上、投資家数は500万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186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27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1,467億ドル(約18兆円)、投信残高は約690億ドル(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190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27年10月末現在）

（ 略 ）

4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 宇治原 潔

（ 略 ）

<訂正後>

（ 略 ）

委託会社の概況（平成28年4月末現在）

（ 略 ）

4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 赤林 富二

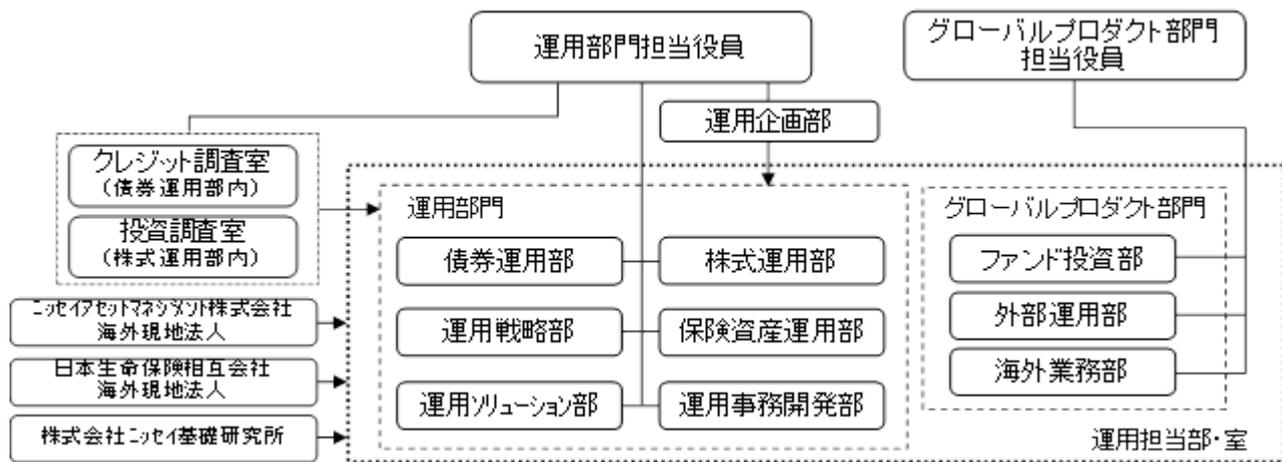
（ 略 ）

2【投資方針】

（3）【運用体制】

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

委託会社の組織体制



（略）

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。

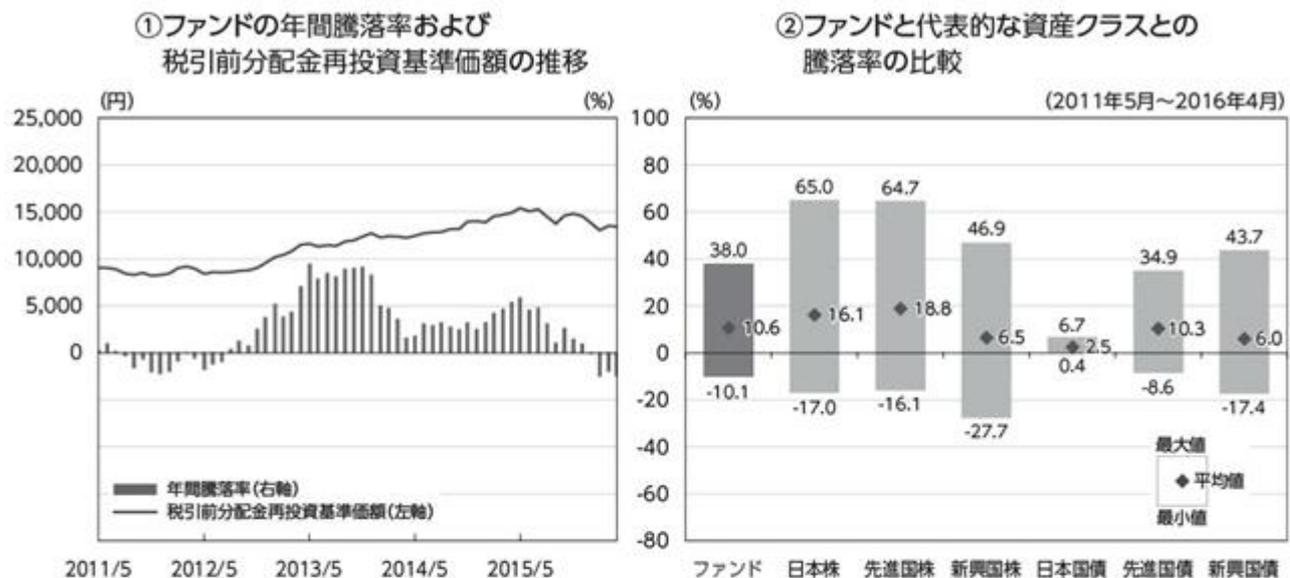
（略）

（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・ディバースィファイド(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・ディバースィファイドは、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。

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28年4月28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	861,853,898	94.25
内 日本	861,853,898	94.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	52,543,305	5.75
純資産総額	914,397,203	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28年4月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	15,402,484,140	97.73
内 日本	15,402,484,140	97.73
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	357,263,756	2.27
純資産総額	15,759,747,896	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)	331,625,000	2.10
内 日本	331,625,000	2.10

(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28年4月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	19,277,635,956	94.51
内 日本	19,277,635,956	94.51
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,120,130,617	5.49
純資産総額	20,397,766,573	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)	908,940,000	4.46
内 日本	908,940,000	4.46

(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28年4月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	25,072,421,582	93.37
内 アメリカ	15,565,536,823	57.96
内 イギリス	2,941,037,260	10.95
内 アイルランド	1,120,548,373	4.17
内 イタリア	826,461,862	3.08
内 スペイン	812,286,201	3.02
内 フランス	796,564,006	2.97
内 スイス	629,120,301	2.34
内 オランダ	610,771,401	2.27
内 スウェーデン	420,486,701	1.57
内 ドイツ	353,896,712	1.32
内 バミューダ	255,453,880	0.95
内 ベルギー	242,361,803	0.90
内 香港	185,323,965	0.69
内 ジャージイー	169,269,268	0.63
内 イギリス領バージン諸島	143,303,026	0.53
投資証券	407,407,701	1.52
内 アイルランド	248,672,888	0.93
内 イギリス	158,734,813	0.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,374,367,793	5.12
純資産総額	26,854,197,076	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28年4月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	8,776,539,711	70.84
内 アメリカ	1,839,084,749	14.84
内 イタリア	1,614,258,674	13.03
内 イギリス	1,072,022,611	8.65
内 スペイン	968,383,068	7.82
内 フランス	772,700,668	6.24
内 ドイツ	357,034,182	2.88
内 ベルギー	305,481,288	2.47

	内 カナダ	236,492,812	1.91
	内 オーストリア	228,907,366	1.85
	内 ニュージーランド	226,247,552	1.83
	内 メキシコ	193,132,010	1.56
	内 オーストラリア	183,238,079	1.48
	内 ポーランド	182,762,010	1.48
	内 アイルランド	154,900,568	1.25
	内 オランダ	103,720,627	0.84
	内 南アフリカ	100,684,547	0.81
	内 スウェーデン	78,811,064	0.64
	内 デンマーク	76,668,000	0.62
	内 スイス	58,979,016	0.48
	内 ノルウェー	23,030,820	0.19
特殊債券		750,731,371	6.06
	内 国際機関	496,817,605	4.01
	内 ドイツ	141,769,123	1.14
	内 アメリカ	58,070,524	0.47
	内 フランス	54,074,119	0.44
社債券		803,948,981	6.49
	内 アメリカ	803,948,981	6.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,058,795,402	16.62
純資産総額		12,390,015,465	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28年4月28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	388,239,329	0.8668 336,541,305	0.8538 331,478,739	- -	36.25%
2	ニッセイノパトナム・海外株 式マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	164,392,516	1.6814 276,419,238	1.7075 280,700,221	- -	30.70%
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	121,768,219	1.4508 176,663,736	1.4574 177,465,002	- -	19.41%

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	27,645,458	2.6571	2.6120	-	7.90%
				73,456,817	72,209,936	-	

(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	94.25
	小計		94.25
合計(対純資産総額比)			94.25

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(平成28年4月28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	93,400	7,517.70 702,153,850	5,654.00 528,083,600	- -	3.35%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	847,000	738.66 625,652,484	520.10 440,524,700	- -	2.80%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	142,100	2,916.11 414,380,585	2,778.00 394,753,800	- -	2.50%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	77,500	4,790.73 371,281,580	4,864.00 376,960,000	- -	2.39%
5	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	35,000	11,248.55 393,699,410	9,824.00 343,840,000	- -	2.18%
6	山九 日本	株式 陸運業	608,000	557.67 339,064,879	517.00 314,336,000	- -	1.99%
7	任天堂 日本	株式 その他製品	20,700	16,483.15 341,201,361	15,155.00 313,708,500	- -	1.99%
8	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	66,600	5,320.95 354,375,648	4,543.00 302,563,800	- -	1.92%
9	大東建託 日本	株式 建設業	19,300	13,996.69 270,136,173	15,495.00 299,053,500	- -	1.90%
10	日本電産 日本	株式 電気機器	36,400	8,597.82 312,960,912	8,185.00 297,934,000	- -	1.89%
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	555,000	677.03 375,753,280	515.60 286,158,000	- -	1.82%
12	カシオ計算機 日本	株式 電気機器	132,300	2,467.52 326,453,819	2,115.00 279,814,500	- -	1.78%
13	住友不動産 日本	株式 不動産業	85,000	3,599.12 305,925,230	3,245.00 275,825,000	- -	1.75%
14	ニコン 日本	株式 精密機器	159,900	1,693.04 270,717,272	1,611.00 257,598,900	- -	1.63%
15	エムスリー 日本	株式 サービス業	82,600	2,586.70 213,661,465	3,010.00 248,626,000	- -	1.58%

16	日本碍子	株式		2,158.53	2,314.00	-	
	日本	ガラス・土石製品	106,000	228,805,082	245,284,000	-	1.56%
17	三菱商事	株式		1,990.68	1,863.00	-	
	日本	卸売業	131,500	261,775,656	244,984,500	-	1.55%
18	住友化学	株式		611.66	506.00	-	
	日本	化学	474,000	289,928,191	239,844,000	-	1.52%
19	塩野義製薬	株式		5,341.18	5,643.00	-	
	日本	医薬品	41,400	221,124,922	233,620,200	-	1.48%
20	富士重工業	株式		4,928.19	3,716.00	-	
	日本	輸送用機器	62,700	308,998,087	232,993,200	-	1.48%
21	住友金属鉱山	株式		1,207.02	1,252.00	-	
	日本	非鉄金属	186,000	224,505,943	232,872,000	-	1.48%
22	積水化学工業	株式		1,363.08	1,387.00	-	
	日本	化学	163,400	222,727,825	226,635,800	-	1.44%
23	荏原製作所	株式		557.28	505.00	-	
	日本	機械	446,000	248,547,120	225,230,000	-	1.43%
24	協和発酵キリン	株式		1,919.67	1,984.00	-	
	日本	医薬品	113,400	217,690,741	224,985,600	-	1.43%
25	ユニプレス	株式		2,447.31	1,970.00	-	
	日本	輸送用機器	112,100	274,343,504	220,837,000	-	1.40%
26	参天製薬	株式		1,932.13	1,596.00	-	
	日本	医薬品	137,600	265,861,457	219,609,600	-	1.39%
27	S M C	株式		31,451.83	27,345.00	-	
	日本	機械	7,900	248,469,519	216,025,500	-	1.37%
28	住友電気工業	株式		1,527.48	1,345.00	-	
	日本	非鉄金属	159,400	243,480,521	214,393,000	-	1.36%
29	東京瓦斯	株式		547.77	485.10	-	
	日本	電気・ガス業	441,000	241,567,600	213,929,100	-	1.36%
30	日立化成	株式		1,926.98	1,876.00	-	
	日本	化学	113,200	218,135,192	212,363,200	-	1.35%

（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	輸送用機器	9.76
		電気機器	9.24
		サービス業	7.17
		医薬品	6.89
		銀行業	6.31
		情報・通信業	5.71

	陸運業	5.49
	機械	5.04
	化学	4.88
	小売業	4.20
	食料品	4.19
	建設業	3.82
	その他製品	3.50
	保険業	3.17
	卸売業	3.12
	非鉄金属	2.84
	精密機器	2.45
	不動産業	2.00
	電気・ガス業	1.93
	ガラス・土石製品	1.56
	証券、商品先物取引業	1.05
	空運業	0.99
	繊維製品	0.96
	倉庫・運輸関連業	0.81
	鉄鋼	0.66
	小計	97.73
合計（対純資産総額比）		97.73

（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 2806月	買建	25	340,003,500	331,625,000	2.10%

(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28年4月28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341回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	1,390,100,000	103.61 1,440,307,330	103.83 1,443,424,236	0.300000 2025/12/20	7.08%
2	第123回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	964,300,000	100.34 967,604,662	101.22 976,151,247	0.100000 2020/3/20	4.79%
3	第113回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	906,900,000	100.78 914,001,027	101.17 917,547,006	0.300000 2018/6/20	4.50%
4	第352回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	910,700,000	100.20 912,594,256	100.38 914,160,660	0.100000 2017/5/15	4.48%
5	第328回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	855,100,000	105.50 902,130,500	105.50 902,130,500	0.600000 2023/3/20	4.42%
6	第318回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	731,700,000	106.04 775,912,001	106.54 779,619,033	1.000000 2021/9/20	3.82%
7	第126回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	753,700,000	101.50 765,021,316	101.42 764,432,688	0.100000 2020/12/20	3.75%
8	第156回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	741,400,000	102.02 756,412,176	102.06 756,717,324	0.400000 2036/3/20	3.71%
9	第356回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	673,500,000	100.49 676,820,355	100.50 676,901,175	0.100000 2017/9/15	3.32%

10	第153回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	555,600,000	112.47 624,924,186	119.49 663,886,440	1.300000 2035/6/20	3.25%
11	第360回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	645,700,000	100.61 649,669,610	100.60 649,600,028	0.100000 2018/1/15	3.18%
12	第26回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	454,600,000	125.62 571,077,612	142.22 646,550,304	2.400000 2037/3/20	3.17%
13	第116回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	428,400,000	122.42 524,453,805	129.61 555,279,228	2.200000 2030/3/20	2.72%
14	第355回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	506,400,000	100.42 508,526,880	100.46 508,764,888	0.100000 2017/8/15	2.49%
15	第140回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	400,400,000	122.83 491,842,885	125.17 501,192,692	1.700000 2032/9/20	2.46%
16	第351回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	481,000,000	100.28 482,377,974	100.28 482,377,974	0.100000 2017/4/15	2.36%
17	第50回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	361,700,000	112.33 406,304,207	112.77 407,921,643	0.800000 2046/3/20	2.00%
18	第118回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	261,000,000	122.77 320,446,926	127.25 332,143,380	2.000000 2030/6/20	1.63%
19	第42回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	229,000,000	110.89 253,949,550	136.00 311,458,320	1.700000 2044/3/20	1.53%
20	第99回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	224,100,000	119.92 268,758,648	124.77 279,618,534	2.100000 2027/12/20	1.37%
21	第113回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	218,000,000	120.95 263,671,000	127.40 277,745,080	2.100000 2029/9/20	1.36%
22	第128回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	218,100,000	122.39 266,951,292	127.19 277,412,295	1.900000 2031/6/20	1.36%
23	第151回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	232,400,000	105.23 244,574,764	117.63 273,390,712	1.200000 2034/12/20	1.34%
24	第137回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	196,700,000	115.12 226,444,974	124.99 245,857,297	1.700000 2032/6/20	1.21%

25	第155回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	213,200,000	112.21 239,234,359	113.71 242,431,852	1.000000 2035/12/20	1.19%
26	第149回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	178,500,000	110.47 197,188,950	122.84 219,274,755	1.500000 2034/6/20	1.07%
27	第45回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	159,000,000	107.65 171,178,560	131.45 209,019,810	1.500000 2044/12/20	1.02%
28	第350回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	205,900,000	100.21 206,332,789	100.21 206,332,789	0.100000 2017/3/15	1.01%
29	第39回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	127,500,000	115.76 147,600,636	140.48 179,117,100	1.900000 2043/6/20	0.88%
30	第30回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	124,100,000	124.39 154,371,713	143.26 177,791,865	2.300000 2039/3/20	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 (%)
公社債券	国内	国債証券	94.51
	小計		94.51
合 計（対純資産総額比）			94.51

（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	長国先 2806 月	買建	6	904,566,480	908,940,000	4.46%

（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28年4月28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	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	8,937	81,139.27 725,141,678	77,465.93 692,313,105	- -	2.58%
2	EXELON CORP アメリカ	株式 公益事業	113,900	2,952.27 336,264,122	3,879.66 441,893,558	- -	1.65%
3	NOVARTIS AG スイス	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	51,564	9,568.27 493,378,532	8,427.98 434,580,618	- -	1.62%
4	CALPINE CORP アメリカ	株式 公益事業	249,300	1,413.58 352,405,494	1,707.71 425,732,103	- -	1.59%
5	IMPERIAL BRANDS PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバ コ	67,548	5,534.06 373,815,019	5,842.54 394,652,553	- -	1.47%

6	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	45,000	8,376.12 376,925,400	8,643.91 388,975,950	- -	1.45%
7	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC アメリカ	株式 保険	77,710	4,621.57 359,142,398	4,937.65 383,704,975	- -	1.43%
8	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR イギリス	株式 電気通信サービス	99,645	3,443.81 343,159,080	3,651.38 363,842,009	- -	1.35%
9	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP アメリカ	株式 保険	57,668	6,541.09 377,212,154	6,215.14 358,414,837	- -	1.33%
10	COTY INC-CL A アメリカ	株式 家庭用品・パーソ ナル用品	106,900	2,942.39 314,542,292	3,290.30 351,733,604	- -	1.31%
11	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	5,200	72,319.83 376,063,123	66,571.05 346,169,499	- -	1.29%
12	SABMILLER PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバ コ	50,736	6,516.06 330,598,950	6,686.19 339,230,992	- -	1.26%
13	MONSANTO CO アメリカ	株式 素材	32,600	10,229.95 333,496,652	10,316.50 336,317,900	- -	1.25%
14	UNION PACIFIC CORP アメリカ	株式 運輸	32,400	8,282.94 268,367,536	9,786.40 317,079,603	- -	1.18%
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	32,600	8,481.48 276,496,248	9,708.48 316,496,611	- -	1.18%
16	E*TRADE FINANCIAL アメリカ	株式 各種金融	109,800	3,162.99 347,296,851	2,871.06 315,242,388	- -	1.17%
17	NORTHROP GRUMMAN CORP アメリカ	株式 資本財	13,200	20,288.38 267,806,682	22,718.25 299,880,900	- -	1.12%
18	SEALED AIR CORP アメリカ	株式 素材	50,800	4,685.22 238,009,557	5,781.63 293,706,804	- -	1.09%
19	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC アメリカ	株式 資本財	46,179	5,900.15 272,463,488	6,248.06 288,529,509	- -	1.07%
20	JM SMUCKER CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバ コ	20,000	13,340.11 266,802,250	14,041.41 280,828,300	- -	1.05%
21	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	43,726	6,971.66 304,843,163	6,373.61 278,692,829	- -	1.04%
22	VEOLIA ENVIRONNEMENT フランス	株式 公益事業	102,962	2,674.16 275,337,417	2,638.17 271,631,321	- -	1.01%

23	NRG ENERGY INC アメリカ	株式 公益事業	164,200	1,138.10 186,877,251	1,644.05 269,953,831	- -	1.01%
24	AENA SA スペイン	株式 運輸	17,681	13,522.87 239,097,935	15,260.55 269,821,855	- -	1.00%
25	PULTE GROUP INC アメリカ	株式 耐久消費財・アパレル	126,400	1,901.96 240,408,692	2,105.00 266,072,632	- -	0.99%
26	BANK OF IRELAND アイルランド	株式 銀行	7,931,520	40.95 324,871,886	33.26 263,835,350	- -	0.98%
27	COMPASS GROUP PLC イギリス	株式 消費者サービス	132,146	1,808.65 239,005,928	1,982.33 261,957,825	- -	0.98%
28	EOG RESOURCES INC アメリカ	株式 エネルギー	28,100	7,904.88 222,127,213	9,274.97 260,626,727	- -	0.97%
29	TELECOM ITALIA-RNC イタリア	株式 電気通信サービス	3,081,728	112.90 347,946,258	84.27 259,720,269	- -	0.97%
30	UNILEVER NV オランダ	株式 家庭用品・パーソナル用品	52,260	4,919.68 257,102,691	4,944.94 258,422,606	- -	0.96%

(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	食品・飲料・タバコ	9.29
		ソフトウェア・サービス	8.36
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.58
		素材	6.90
		公益事業	6.02
		保険	5.59
		電気通信サービス	5.34
		エネルギー	5.12
		銀行	4.62
		資本財	4.49
		消費者サービス	4.17
		メディア	4.04
		耐久消費財・アパレル	3.77
		運輸	3.53
		小売	3.15
		ヘルスケア機器・サービス	2.83
		各種金融	2.44
		家庭用品・パーソナル用品	2.27
		不動産	1.52
		商業・専門サービス	1.35
食品・生活必需品小売り	0.55		
半導体・半導体製造装置	0.43		
	小計		93.37
投資証券	外国	投資証券	1.52
	小計		1.52
合 計（対純資産総額比）			94.88

（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/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28年4月28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	655,207,500	97.53 639,056,635	101.90 667,695,754	2.750000 2042/8/15	5.39%
2	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	502,686,000	125.95 633,173,231	126.00 633,429,601	4.750000 2023/8/1	5.11%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	498,265,000	104.77 522,047,188	107.65 536,392,237	2.750000 2024/2/15	4.33%
4	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	437,026,520	100.83 440,671,321	101.57 443,909,687	0.700000 2020/5/1	3.58%
5	UK TSY 3 1/4% 2044 イギリス	国債証券	312,580,800	113.35 354,332,217	116.40 363,850,302	3.250000 2044/1/22	2.94%
6	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	259,410,800	122.63 318,136,216	123.40 320,125,897	4.400000 2023/10/31	2.58%
7	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	298,012,120	102.20 304,595,207	103.15 307,426,322	1.150000 2020/7/30	2.48%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	298,629,750	98.31 293,612,770	101.57 303,342,127	2.000000 2025/2/15	2.45%
9	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	248,240,000	117.91 292,699,784	118.31 293,692,744	3.250000 2021/10/25	2.37%
10	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	284,234,800	97.17 276,202,324	100.22 284,865,801	0.500000 2025/5/25	2.30%
11	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	265,616,800	108.37 287,875,487	106.65 283,306,878	5.250000 2017/8/1	2.29%
12	EUROPEAN UNION 国際機関	特殊債券	249,481,200	107.97 269,377,325	107.00 266,954,863	3.250000 2018/4/4	2.15%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	238,157,500	98.27 234,054,046	99.79 237,664,513	1.000000 2019/8/31	1.92%
14	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券	191,144,800	119.66 228,731,513	119.75 228,907,366	3.500000 2021/9/15	1.85%
15	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	179,974,000	126.18 227,109,190	126.96 228,512,987	4.250000 2022/9/28	1.84%

16	NEW ZEALAND GOVERNMENT ニュージーランド	国債証券	189,750,870	115.09 218,391,866	119.23 226,247,552	5.500000 2023/4/15	1.83%
17	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	158,873,600	129.20 205,267,868	136.55 216,953,021	2.500000 2044/7/4	1.75%
18	UK TSY 2 3/4% 2024 イギリス	国債証券	186,591,600	108.05 201,623,419	109.64 204,586,493	2.750000 2024/9/7	1.65%
19	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	174,669,450	111.31 194,442,031	110.56 193,132,010	8.000000 2020/6/11	1.56%
20	EFSF 国際機関	特殊債券	168,803,200	113.29 191,240,521	114.39 193,104,108	2.250000 2022/9/5	1.56%
21	AUSTRALIAN GOVERNMENT オーストラリア	国債証券	152,788,800	119.45 182,512,333	119.92 183,238,079	5.500000 2023/4/21	1.48%
22	POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド	国債証券	174,394,560	103.84 181,103,518	104.79 182,762,010	3.250000 2019/7/25	1.48%
23	TSY 3 3/4% 2019 イギリス	国債証券	157,885,200	110.00 173,676,877	110.28 174,125,271	3.750000 2019/9/7	1.41%
24	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	116,672,800	143.49 167,421,967	142.96 166,804,768	4.750000 2044/9/1	1.35%
25	CANADIAN GOVERNMENT カナダ	国債証券	142,119,700	110.58 157,167,333	109.93 156,240,713	2.750000 2022/6/1	1.26%
26	TREASURY 5% 2020 アイルランド	国債証券	126,602,400	123.21 155,994,413	122.35 154,900,568	5.000000 2020/10/18	1.25%
27	KFW ドイツ	特殊債券	129,505,000	108.54 140,572,497	109.46 141,769,123	4.000000 2020/1/27	1.14%
28	UK TSY 1.75% 2022 イギリス	国債証券	135,558,000	101.57 137,690,327	103.37 140,127,660	1.750000 2022/9/7	1.13%
29	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	135,911,400	100.09 136,039,156	103.06 140,081,161	0.500000 2025/2/15	1.13%
30	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	85,642,800	155.93 133,547,956	161.62 138,424,457	4.500000 2041/4/25	1.12%

(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	70.84
		特殊債券	6.06
		社債券	6.49
	小計	83.38	
合 計 (対純資産総額比)			83.38

(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28年4月28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
第28計算期間末 (平成27年9月24日)	923,956,556	923,956,556	1.3922	1.3922
第29計算期間末 (平成28年3月22日)	914,192,515	914,192,515	1.3468	1.3468
平成27年4月末日	941,361,024	-	1.4898	-
5月末日	1,024,795,791	-	1.5397	-
6月末日	1,004,549,056	-	1.5057	-
7月末日	1,023,913,463	-	1.5284	-
8月末日	960,341,217	-	1.4470	-
9月末日	917,381,501	-	1.3741	-
10月末日	982,163,576	-	1.4600	-
11月末日	989,735,498	-	1.4789	-
12月末日	979,924,149	-	1.4569	-
平成28年1月末日	928,130,627	-	1.3823	-
2月末日	882,863,247	-	1.3055	-
3月末日	922,190,689	-	1.3511	-
4月末日	914,397,203	-	1.3429	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
--	--------------

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16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第16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
第28計算期間	0.0000
第29計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第28計算期間	5.8
第29計算期間	3.3

(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」

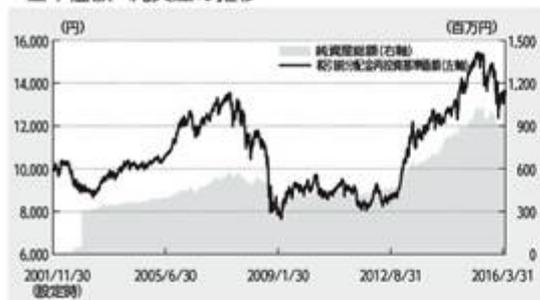
	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第10計算期間	45,566,691	17,672,761	386,334,844
第11計算期間	32,093,186	15,506,440	402,921,590
第12計算期間	80,863,942	51,594,790	432,190,742
第13計算期間	30,124,473	22,772,806	439,542,409
第14計算期間	54,103,635	34,148,906	459,497,138
第15計算期間	58,887,483	54,678,833	463,705,788
第16計算期間	32,881,333	48,940,728	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
第28計算期間	60,190,542	30,059,385	663,657,411
第29計算期間	31,192,171	16,053,185	678,796,397

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2016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。

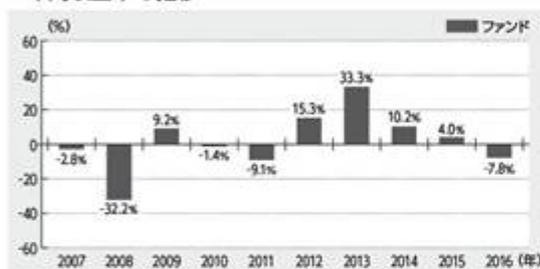
● 基準価額および純資産総額

基準価額	13,429円
純資産総額	914百万円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

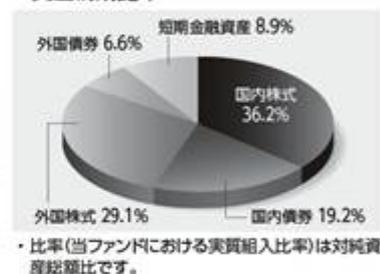
第25期	2014年3月	0円
第26期	2014年9月	0円
第27期	2015年3月	0円
第28期	2015年9月	0円
第29期	2016年3月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

● 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。
 ・2016年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

● 資産構成比率



● 各マザーファンドの組入上位銘柄(各マザーファンドの比率は対純資産総額比です)

1. ニッセイ国内株式マザーファンド

銘柄名	比率
1 トヨタ自動車	3.4%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.8%
3 ソニー	2.5%
4 日本電信電話	2.4%
5 東日本旅客鉄道	2.2%

2. ニッセイ国内債券マザーファンド

銘柄名	比率
1 第341回 利付国債(10年)	7.1%
2 第123回 利付国債(5年)	4.8%
3 第113回 利付国債(5年)	4.5%
4 第352回 利付国債(2年)	4.5%
5 第328回 利付国債(10年)	4.4%

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 アルファベット(C)	アメリカ	2.6%
2 エクセロン	アメリカ	1.6%
3 ノバルティス	スイス	1.6%
4 カルバイン	アメリカ	1.6%
5 インペリアル・ブランズ	イギリス	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	5.4%
2 イタリア国債	ユーロ	5.1%
3 アメリカ国債	米ドル	4.3%
4 イタリア国債	ユーロ	3.6%
5 イギリス国債	イギリスポンド	2.9%

■ 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29期計算期間（平成27年9月25日から平成28年3月22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28期 (平成27年9月24日現在)	第29期 (平成28年3月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	68,785,474
コール・ローン	38,755,317	-
親投資信託受益証券	892,491,628	851,955,359
流動資産合計	931,246,945	920,740,833
資産合計	931,246,945	920,740,833
負債の部		
流動負債		
未払解約金	158,933	-
未払受託者報酬	544,371	499,839
未払委託者報酬	6,532,861	5,998,571
その他未払費用	54,224	49,908
流動負債合計	7,290,389	6,548,318
負債合計	7,290,389	6,548,318
純資産の部		
元本等		
元本	663,657,411	678,796,397
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	260,299,145	235,396,118
純資産合計	923,956,556	914,192,515
負債純資産合計	931,246,945	920,740,833

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期 （自平成27年3月21日 至平成27年9月24日）	第29期 （自平成27年9月25日 至平成28年3月22日）
営業収益		
受取利息	11,731	15,497
有価証券売買等損益	49,901,368	24,086,269
営業収益合計	49,889,637	24,070,772
営業費用		
受託者報酬	544,371	499,839
委託者報酬	6,532,861	5,998,571
その他費用	54,224	49,908
営業費用合計	7,131,456	6,548,318
営業利益又は営業損失（ ）	57,021,093	30,619,090
経常利益又は経常損失（ ）	57,021,093	30,619,090
当期純利益又は当期純損失（ ）	57,021,093	30,619,090
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（ ）	33,940	133,317
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	302,298,916	260,299,145
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,347,213	12,154,838
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	29,347,213	12,154,838
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,359,831	6,305,458
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	14,359,831	6,305,458
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（ ）	260,299,145	235,396,118

(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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成27年9月25日から平成28年3月22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28期 (平成27年9月24日現在)	第29期 (平成28年3月22日現在)
1. 受益権総口数	663,657,411口	678,796,397口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3922円 (13,922円)	1.3468円 (13,468円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第28期 (自平成27年3月21日 至平成27年9月24日)	第29期 (自平成27年9月25日 至平成28年3月22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	791,617円	743,616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(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(257,674,767円)及び分配準備積立金(244,803,935円)より分配対象収益は502,478,702円(1口当たり0.757136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(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(274,918,042円)及び分配準備積立金(239,023,348円)より分配対象収益は513,941,390円(1口当たり0.757136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28期 (自平成27年3月21日 至平成27年9月24日)	第29期 (自平成27年9月25日 至平成28年3月22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28期 (平成27年9月24日現在)	第29期 (平成28年3月22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28期 (平成27年9月24日現在)	第29期 (平成28年3月22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	51,045,997	28,327,771
合計	51,045,997	28,327,771

(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28期 （平成27年9月24日現在）	第29期 （平成28年3月22日現在）
期首元本額	633,526,254円	663,657,411円
期中追加設定元本額	60,190,542円	31,192,171円
期中一部解約元本額	30,059,385円	16,053,185円

（４）【附属明細表】（平成28年3月22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	419,546,712	363,830,908	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	98,357,473	142,893,736	
	ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド	146,857,608	246,559,238	
	ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド	37,135,026	98,671,477	
親投資信託受益証券 合計		701,896,819	851,955,359	
合計		701,896,819	851,955,359	

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

「ニッセイ国内株式マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成27年9月24日現在）	（平成28年3月22日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	188,980,252
コール・ローン	458,776,667	-
株式	17,413,818,690	16,529,246,600
派生商品評価勘定	-	5,116,440
未収配当金	5,199,175	16,676,750
前払金	7,223,000	-
差入委託証拠金	27,900,000	9,240,000
流動資産合計	17,912,917,532	16,749,260,042
資産合計	17,912,917,532	16,749,260,042
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,934,740	-
前受金	-	504,000
未払解約金	11,644,928	17,248,816
流動負債合計	29,579,668	17,752,816
負債合計	29,579,668	17,752,816
純資産の部		
元本等		
元本	20,317,173,869	19,292,969,644
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,433,836,005	2,561,462,418
純資産合計	17,883,337,864	16,731,507,226
負債純資産合計	17,912,917,532	16,749,260,042

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27年9月24日現在）	（平成28年3月22日現在）
1. 受益権総口数	20,317,173,869口	19,292,969,644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2,433,836,005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2,561,462,418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）	0.8802円 (8,802円)	0.8672円 (8,672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27年3月21日 至平成27年9月24日）	（自平成27年9月25日 至平成28年3月22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27年9月24日現在)	(平成28年3月22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27年9月24日現在	平成28年3月22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	437,909,258	1,478,898,887
合計	437,909,258	1,478,898,887

（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27年9月24日 現在）				（平成28年3月22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	457,188,000	-	439,270,000	17,918,000	184,716,000	-	189,840,000	5,124,000
合計	457,188,000	-	439,270,000	17,918,000	184,716,000	-	189,840,000	5,124,000

（注） 1．時価の算定方法

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27年9月24日現在）	（平成28年3月22日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	22,184,634,799円	20,317,173,869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	2,723,254,921円	3,384,461,762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	4,590,715,851円	4,408,665,987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）	414,199,229円	421,841,362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）	345,884,747円	354,628,616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）	246,602,844円	239,457,942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）	96,103,991円	89,494,166円

ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型） S A（適格機関投資家限定）	1,493,181,599円	1,259,125,071円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）S A （適格機関投資家限定）	4,537,022,182円	3,690,662,922円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型） S A（適格機関投資家限定）	873,778,638円	892,545,222円
D Cニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視 型）	1,194,089,309円	1,321,480,614円
D Cニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準 型）	4,668,097,116円	4,975,054,426円
D Cニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視 型）	3,479,083,470円	3,599,437,805円
D Cニッセイ国内株式アクティブ	560,501,113円	548,940,772円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）S A （適格機関投資家限定）	2,021,571,014円	1,480,754,014円
D Cニッセイバランスアクティブ	387,058,617円	419,546,712円
計	20,317,173,869円	19,292,969,644円

附属明細表（平成28年3月22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	77,600	1,094.00	84,894,400	
大東建託	20,600	16,280.00	335,368,000	
大気社	68,100	2,864.00	195,038,400	
日本M&Aセンター	32,700	6,180.00	202,086,000	
江崎グリコ	26,300	5,650.00	148,595,000	
カルビー	45,900	4,550.00	208,845,000	
カカクコム	70,800	2,191.00	155,122,800	
エムスリー	104,100	2,741.00	285,338,100	
サントリー食品インターナショナル	31,700	4,800.00	152,160,000	
日本たばこ産業	36,700	4,592.00	168,526,400	
コスモス薬品	8,900	18,950.00	168,655,000	
セブン&アイ・ホールディングス	69,800	4,758.00	332,108,400	
T S Iホールディングス	224,500	751.00	168,599,500	
A i m i n g	80,800	613.00	49,530,400	
住友化学	397,000	519.00	206,043,000	
協和発酵キリン	118,200	1,771.00	209,332,200	
積水化学工業	169,800	1,372.00	232,965,600	
日立化成	118,000	2,037.00	240,366,000	
日本化薬	43,000	1,111.00	47,773,000	
アステラス製薬	88,400	1,545.00	136,578,000	

塩野義製薬	43,500	5,449.00	237,031,500	
日本新薬	26,800	4,065.00	108,942,000	
参天製薬	116,100	1,666.00	193,422,600	
大塚ホールディングス	37,000	4,070.00	150,590,000	
ラウンドワン	167,200	675.00	112,860,000	
日本碍子	81,000	2,068.00	167,508,000	
日立金属	94,800	1,202.00	113,949,600	
住友金属鉱山	196,000	1,249.00	244,804,000	
住友電気工業	166,200	1,370.50	227,777,100	
ユニプレス	90,300	1,982.00	178,974,600	
S M C	8,600	27,015.00	232,329,000	
日立建機	99,200	1,840.00	182,528,000	
クボタ	120,600	1,543.00	186,085,800	
荏原製作所	467,000	499.00	233,033,000	
椿本チエイン	164,000	744.00	122,016,000	
日立製作所	579,000	534.80	309,649,200	
日本電産	38,100	8,138.00	310,057,800	
ソニー	148,600	2,937.00	436,438,200	
O B A R A G R O U P	24,700	4,145.00	102,381,500	
イリソ電子工業	16,400	4,965.00	81,426,000	
カシオ計算機	138,100	2,264.00	312,658,400	
トヨタ自動車	97,900	6,098.00	596,994,200	
日野自動車	128,300	1,266.00	162,427,800	
本田技研工業	41,300	3,096.00	127,864,800	
スズキ	56,300	2,981.00	167,830,300	
富士重工業	65,400	3,953.00	258,526,200	
日本精機	70,000	2,070.00	144,900,000	
シークス	42,100	3,415.00	143,771,500	
ニコン	167,000	1,798.00	300,266,000	
朝日インテック	32,800	5,060.00	165,968,000	
バンダイナムコホールディングス	77,500	2,465.00	191,037,500	
エフピコ	19,600	4,955.00	97,118,000	
ビジョン	22,800	2,752.00	62,745,600	
任天堂	21,800	16,515.00	360,027,000	
三井物産	88,100	1,419.00	125,013,900	
三菱商事	137,300	2,050.00	281,465,000	
A O K I ホールディングス	85,900	1,396.00	119,916,400	
ケーズホールディングス	41,300	3,850.00	159,005,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	884,600	553.00	489,183,800	

三井住友トラスト・ホールディングス	501,000	341.90	171,291,900	
三井住友フィナンシャルグループ	45,300	3,609.00	163,487,700	
千葉銀行	193,000	559.00	107,887,000	
静岡銀行	175,000	854.00	149,450,000	
野村ホールディングス	358,500	521.10	186,814,350	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	66,500	3,171.00	210,871,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	41,500	3,035.00	125,952,500	
T & Dホールディングス	187,600	1,064.00	199,606,400	
住友不動産	92,000	3,272.00	301,024,000	
タカラレーベン	180,700	682.00	123,237,400	
東京急行電鉄	314,000	925.00	290,450,000	
東日本旅客鉄道	36,800	10,195.00	375,176,000	
トランコム	20,700	6,290.00	130,203,000	
山九	470,000	506.00	237,820,000	
日本航空	41,000	4,144.00	169,904,000	
日本電信電話	81,000	4,972.00	402,732,000	
K D D I	48,000	3,118.00	149,664,000	
N T T ドコモ	62,500	2,613.50	163,343,750	
関西電力	96,200	971.50	93,458,300	
東京瓦斯	461,000	513.00	236,493,000	
エイチ・アイ・エス	76,100	3,265.00	248,466,500	
共立メンテナンス	21,200	9,030.00	191,436,000	
ソフトバンクグループ	30,900	5,632.00	174,028,800	
合計	10,336,600		16,529,246,600	

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27年9月24日現在)	(平成28年3月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,048,279,888
コール・ローン	998,759,820	-
国債証券	21,090,125,063	19,365,508,311
派生商品評価勘定	2,503,800	5,753,520
未収入金	2,054,466,749	775,939,675
未収利息	16,224,157	12,520,615
前払費用	5,094,251	8,053,634
差入委託証拠金	2,700,000	4,320,000
流動資産合計	24,169,873,840	21,220,375,643
資産合計	24,169,873,840	21,220,375,643
負債の部		
流動負債		
前受金	2,160,000	5,700,000
未払金	2,094,471,730	771,384,468
未払解約金	15,475,106	18,929,131
流動負債合計	2,112,106,836	796,013,599
負債合計	2,112,106,836	796,013,599
純資産の部		
元本等		
元本	16,143,195,493	14,058,314,239
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,914,571,511	6,366,047,805
純資産合計	22,057,767,004	20,424,362,044
負債純資産合計	24,169,873,840	21,220,375,643

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27年9月24日現在）	（平成28年3月22日現在）
1. 受益権総口数	16,143,195,493口	14,058,314,239口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3664円 (13,664円)	1.4528円 (14,528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27年3月21日 至 平成27年9月24日）	（自 平成27年9月25日 至 平成28年3月22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27年9月24日現在）	（平成28年3月22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27年9月24日現在	平成28年3月22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	65,790,611	679,048,117

合計	65,790,611	679,048,117
----	------------	-------------

（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27年9月24日 現在）				（平成28年3月22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	887,400,000	-	889,920,000	2,520,000	904,560,000	-	910,320,000	5,760,000
合計	887,400,000	-	889,920,000	2,520,000	904,560,000	-	910,320,000	5,760,000

（注） 1．時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

- 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27年9月24日現在）	（平成28年3月22日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	18,173,238,025円	16,143,195,493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	2,005,554,080円	1,788,077,978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	4,035,596,612円	3,872,959,232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）	746,848,320円	670,297,236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）	264,104,465円	239,123,158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）	60,394,904円	51,860,216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）	73,364,172円	60,355,333円

ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型) S A (適格機関投資家限定)	2,691,262,748円	2,104,008,764円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型) S A (適格機関投資家限定)	3,462,625,078円	2,617,144,961円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型) S A (適格機関投資家限定)	214,003,560円	203,288,121円
D Cニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)	2,153,282,089円	2,100,625,177円
D Cニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)	3,564,861,662円	3,354,361,790円
D Cニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)	852,301,331円	779,910,154円
D Cニッセイ国内債券アクティブ	1,140,145,591円	1,253,910,017円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(成長型) S A (適格機関投資家限定)	713,686,678円	486,592,181円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(毎月分配型)	37,369,401円	29,743,272円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(成長重視型)	9,360,761円	8,736,386円
D Cニッセイバランスアクティブ	159,584,733円	98,357,473円
計	16,143,195,493円	14,058,314,239円

附属明細表(平成28年3月22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350回 利付国債(2年)	205,900,000	206,382,665	
	第351回 利付国債(2年)	481,000,000	482,505,530	
	第352回 利付国債(2年)	910,700,000	913,769,059	
	第355回 利付国債(2年)	1,400,300,000	1,406,069,236	
	第357回 利付国債(2年)	239,500,000	240,642,415	
	第359回 利付国債(2年)	144,000,000	144,799,200	
	第360回 利付国債(2年)	666,000,000	669,876,120	
	第107回 利付国債(5年)	38,300,000	38,574,611	
	第113回 利付国債(5年)	906,900,000	917,519,799	
	第116回 利付国債(5年)	150,700,000	152,466,204	
	第118回 利付国債(5年)	158,000,000	160,191,460	
	第119回 利付国債(5年)	171,400,000	173,218,554	
	第120回 利付国債(5年)	163,700,000	166,148,952	
	第123回 利付国債(5年)	951,700,000	964,148,236	
	第125回 利付国債(5年)	71,700,000	72,757,575	

第126回 利付国債(5年)	631,700,000	641,535,569	
第1回 利付国債(40年)	7,900,000	12,540,934	
第2回 利付国債(40年)	41,800,000	64,289,236	
第7回 利付国債(40年)	2,100,000	2,975,742	
第8回 利付国債(40年)	8,600,000	11,309,860	
第297回 利付国債(10年)	800,000	835,752	
第316回 利付国債(10年)	152,900,000	163,599,942	
第318回 利付国債(10年)	731,700,000	781,331,211	
第341回 利付国債(10年)	2,896,300,000	3,013,223,631	
第26回 利付国債(30年)	454,600,000	640,572,314	
第27回 利付国債(30年)	40,200,000	57,765,390	
第28回 利付国債(30年)	67,500,000	97,528,725	
第29回 利付国債(30年)	39,900,000	57,134,007	
第30回 利付国債(30年)	124,100,000	175,962,631	
第34回 利付国債(30年)	5,500,000	7,820,120	
第37回 利付国債(30年)	1,900,000	2,598,250	
第39回 利付国債(30年)	155,100,000	213,560,292	
第40回 利付国債(30年)	83,500,000	112,874,465	
第42回 利付国債(30年)	229,000,000	305,085,250	
第44回 利付国債(30年)	47,400,000	63,404,136	
第45回 利付国債(30年)	159,000,000	204,613,920	
第46回 利付国債(30年)	44,600,000	57,418,486	
第47回 利付国債(30年)	386,300,000	508,985,017	
第48回 利付国債(30年)	42,800,000	54,234,020	
第49回 利付国債(30年)	163,500,000	207,232,980	
第84回 利付国債(20年)	138,800,000	167,641,252	
第92回 利付国債(20年)	51,300,000	63,348,831	
第99回 利付国債(20年)	224,100,000	280,678,527	
第105回 利付国債(20年)	71,500,000	90,427,480	
第107回 利付国債(20年)	15,300,000	19,406,367	
第109回 利付国債(20年)	35,900,000	44,759,761	
第112回 利付国債(20年)	16,700,000	21,315,379	
第113回 利付国債(20年)	218,000,000	278,830,720	
第114回 利付国債(20年)	41,200,000	52,871,960	
第116回 利付国債(20年)	428,400,000	557,511,192	
第117回 利付国債(20年)	1,500,000	1,931,190	
第118回 利付国債(20年)	157,600,000	201,055,048	
第123回 利付国債(20年)	1,500,000	1,945,740	
第127回 利付国債(20年)	44,300,000	56,283,150	
第128回 利付国債(20年)	218,100,000	277,658,748	
第131回 利付国債(20年)	120,000,000	149,406,000	

第132回 利付国債(20年)	113,000,000	140,802,520	
第133回 利付国債(20年)	26,800,000	33,808,468	
第134回 利付国債(20年)	800,000	1,010,840	
第136回 利付国債(20年)	400,000	492,484	
第137回 利付国債(20年)	196,700,000	245,621,257	
第138回 利付国債(20年)	111,000,000	135,079,230	
第139回 利付国債(20年)	95,500,000	117,734,310	
第140回 利付国債(20年)	64,700,000	80,905,409	
第143回 利付国債(20年)	56,000,000	69,222,720	
第145回 利付国債(20年)	2,500,000	3,135,425	
第147回 利付国債(20年)	1,600,000	1,982,112	
第149回 利付国債(20年)	178,500,000	218,185,905	
第150回 利付国債(20年)	25,900,000	31,192,147	
第151回 利付国債(20年)	365,400,000	426,403,530	
第152回 利付国債(20年)	58,800,000	68,615,484	
第153回 利付国債(20年)	555,600,000	658,463,784	
第154回 利付国債(20年)	2,800,000	3,264,072	
第155回 利付国債(20年)	618,300,000	697,015,773	
国債証券 合計	17,437,000,000	19,365,508,311	
合計	17,437,000,000	19,365,508,311	

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27年9月24日現在)	(平成28年3月22日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,465,046,477	1,078,164,283
金銭信託	-	270,770,716
コール・ローン	335,208,772	-
株式	27,155,428,030	24,624,448,270
投資証券	344,685,571	418,300,984
派生商品評価勘定	86,513,188	172,992,822
未収入金	16,841,217	21,328,823
未収配当金	22,973,883	20,751,601
流動資産合計	29,426,697,138	26,606,757,499
資産合計	29,426,697,138	26,606,757,499
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	178,339,557	133,036,175
未払金	113,834,254	-
未払解約金	28,718,040	18,404,997
流動負債合計	320,891,851	151,441,172
負債合計	320,891,851	151,441,172
純資産の部		
元本等		
元本	15,712,558,557	15,757,359,310
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	13,393,246,730	10,697,957,017
純資産合計	29,105,805,287	26,455,316,327
負債純資産合計	29,426,697,138	26,606,757,499

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27年9月24日現在）	（平成28年3月22日現在）
1. 受益権総口数	15,712,558,557口	15,757,359,310口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8524円 (18,524円)	1.6789円 (16,789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27年3月21日 至 平成27年9月24日）	（自 平成27年9月25日 至 平成28年3月22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27年9月24日現在)	(平成28年3月22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27年9月24日現在	平成28年3月22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	779,147,702	350,765,387
投資証券	26,144,086	13,832,038
合計	753,003,616	364,597,425

(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27年9月24日 現在)			(平成28年3月22日 現在)				
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)	
市場取引以外の取引 為替予約取引 売 建	5,593,705,832	-	5,507,192,644	86,513,188	5,376,626,112	-	5,265,778,357	110,847,755

アメリカ・ドル	3,050,722,565	-	2,997,818,088	52,904,477	2,831,676,982	-	2,671,798,190	159,878,792
イギリス・ポンド	396,712,988	-	389,744,628	6,968,360	1,042,154,088	-	1,060,445,127	18,291,039
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	93,881,222	-	97,813,662	3,932,440
カナダ・ドル	-	-	-	-	82,472,205	-	84,318,082	1,845,877
シンガポール・ドル	18,575,960	-	17,278,624	1,297,336	17,453,384	-	16,840,696	612,688
スウェーデン・クローナ	153,564,816	-	152,706,912	857,904	84,997,920	-	88,172,385	3,174,465
ユーロ	1,901,444,167	-	1,877,656,166	23,788,001	1,223,990,311	-	1,246,390,215	22,399,904
香港・ドル	72,685,336	-	71,988,226	697,110	-	-	-	-
買 建	5,593,705,832	-	5,415,366,275	178,339,557	5,376,626,112	-	5,305,735,004	70,891,108
アメリカ・ドル	2,542,983,267	-	2,528,189,560	14,793,707	2,544,949,130	-	2,514,426,221	30,522,909
イスラエル・シェケル	88,468,660	-	83,235,204	5,233,456	84,180,011	-	79,404,524	4,775,487
オーストラリア・ドル	907,027,212	-	837,283,323	69,743,889	913,663,392	-	898,217,970	15,445,422
カナダ・ドル	1,095,058,513	-	1,025,201,711	69,856,802	1,045,278,236	-	1,031,480,668	13,797,568
シンガポール・ドル	-	-	-	-	157,506,721	-	156,259,707	1,247,014
スイス・フラン	212,678,347	-	206,750,635	5,927,712	233,777,723	-	235,747,816	1,970,093
デンマーク・クローネ	203,302,020	-	199,734,502	3,567,518	182,485,504	-	187,091,674	4,606,170
ノルウェー・クローネ	51,272,482	-	51,058,128	214,354	45,701,089	-	46,557,136	856,047
ユーロ	244,895,290	-	243,759,350	1,135,940	-	-	-	-
香港・ドル	248,020,041	-	240,153,862	7,866,179	169,084,306	-	156,549,288	12,535,018
合計	11,187,411,664	-	10,922,558,919	91,826,369	10,753,252,224	-	10,571,513,361	39,956,647

(注) 1. 時価の算定方法

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

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27年9月24日現在）	（平成28年3月22日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	16,284,490,304円	15,712,558,557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	2,002,233,962円	2,052,316,195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	2,574,165,709円	2,007,515,442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）	101,682,918円	107,098,910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）	113,155,288円	120,054,643円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	90,732,528円	91,157,139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）	31,437,196円	30,302,011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）	366,615,640円	329,281,076円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	1,484,980,085円	1,287,084,431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）	321,500,043円	349,975,194円
DCニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式	9,008,255,214円	9,103,918,862円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	293,084,902円	335,604,743円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	1,527,078,508円	1,684,219,071円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	1,279,881,592円	1,370,573,105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）	750,855,799円	586,314,657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）	44,936,301円	43,426,559円
ニッセイ/パトナム・バランスアップオープン	174,035,871円	171,491,301円
DCニッセイバランスアクティブ	124,326,672円	146,857,608円
計	15,712,558,557円	15,757,359,310円

附属明細表（平成28年3月22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	ADVANCE AUTO PARTS	14,900	158.61	2,363,289.00	
	ALPHABET INC-CL C	8,937	742.09	6,632,058.33	
	AMAG PHARMACEUTICALS INC	23,400	21.69	507,546.00	
	AMAZON.COM INC	5,200	553.98	2,880,696.00	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	45,600	43.47	1,982,232.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	57,668	53.57	3,089,274.76	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	31,100	48.61	1,511,771.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SPN ADR	17,200	120.76	2,077,072.00	
	ASSURED GUARANTY LTD	88,200	26.06	2,298,492.00	
	AXIALL CORP	42,700	22.11	944,097.00	
	BALL CORP	25,000	69.89	1,747,250.00	
	BANK OF AMERICA CORP	91,900	13.84	1,271,896.00	
	BARD (C.R.) INC	9,600	196.10	1,882,560.00	
	BECTON DICKINSON & CO	8,300	149.17	1,238,111.00	
	BIOGEN INC	5,900	256.05	1,510,695.00	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	26,600	62.70	1,667,820.00	
	BRUNSWICK CORP	36,325	47.22	1,715,266.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	80,500	21.79	1,754,095.00	
	CALATLANTIC GROUP INC	31,109	32.40	1,007,931.60	
	CALPINE CORP	249,300	14.66	3,654,738.00	
	CAPITAL SENIOR LIVING CORP	74,400	17.53	1,304,232.00	
	CARDINAL HEALTH INC	43,000	80.85	3,476,550.00	
	CELGENE CORP	15,900	101.14	1,608,126.00	
	CHARLES SCHWAB CORP	48,400	28.28	1,368,752.00	
	CHARTER COMMUNICATION-A	6,600	202.68	1,337,688.00	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,900	462.48	1,341,192.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	35,400	31.58	1,117,932.00		
COOPER COS INC/THE	13,000	150.56	1,957,280.00		
COTY INC-CL A	106,900	27.01	2,887,369.00		

DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	14,300	90.24	1,290,432.00	
E*TRADE FINANCIAL	109,800	25.22	2,769,156.00	
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	32,400	64.57	2,092,068.00	
EOG RESOURCES INC	20,500	75.96	1,557,180.00	
EXELON CORP	113,900	34.88	3,972,832.00	
EXXON MOBIL CORP	32,600	83.62	2,726,012.00	
FACEBOOK INC-A	17,700	111.85	1,979,745.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	46,179	54.61	2,521,835.19	
GRUBHUB INC	46,600	23.73	1,105,818.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	77,710	45.39	3,527,256.90	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	69,430	22.41	1,555,926.30	
HOME DEPOT INC	11,570	131.01	1,515,785.70	
IMPAX LABORATORIES INC	44,900	32.24	1,447,576.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,500	119.21	1,251,705.00	
JM SMUCKER CO	27,800	128.34	3,567,852.00	
KENNEDY-WILSON HOLDINGS INC	66,039	21.14	1,396,064.46	
KRAFT HEINZ CO/THE	16,800	76.59	1,286,712.00	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	12,398	118.79	1,472,758.42	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	28,400	51.98	1,476,232.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	35,900	38.10	1,367,790.00	
LIVE NATION INC	46,700	22.91	1,069,897.00	
LOWE'S COS INC	21,900	75.22	1,647,318.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	90,900	11.53	1,048,077.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	13,900	93.52	1,299,928.00	
MONSANTO CO	32,600	91.31	2,976,706.00	
NEWMONT MINING CORP	54,200	27.79	1,506,218.00	
NOMAD FOODS LTD	119,433	8.38	1,000,848.54	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,200	194.18	2,563,176.00	
NRG ENERGY INC	164,200	13.56	2,226,552.00	
NRG YIELD INC-CLASS C	115,800	14.15	1,638,570.00	
PERRIGO CO PLC	10,850	131.27	1,424,279.50	
PINNACLE FOODS INC	45,600	45.95	2,095,320.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,800	142.08	1,534,464.00	

	PULTE GROUP INC	126,400	18.30	2,313,120.00	
	RADIAN GROUP INC	73,980	12.49	924,010.20	
	RAYTHEON CO	17,500	123.56	2,162,300.00	
	RE/MAX HOLDINGS INC-CL A	61,016	34.22	2,087,967.52	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	20,700	98.43	2,037,501.00	
	SEALED AIR CORP	50,800	47.23	2,399,284.00	
	SERVICE CORP INTERNATIONAL	56,600	23.75	1,344,250.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,900	273.29	1,612,411.00	
	TILE SHOP HLDGS INC	74,868	14.26	1,067,617.68	
	TIVO INC	149,800	7.89	1,181,922.00	
	TREEHOUSE FOODS INC	15,400	85.99	1,324,246.00	
	UNION PACIFIC CORP	29,600	83.98	2,485,808.00	
	VISA INC-CLASS A SHARES	45,000	73.77	3,319,650.00	
	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	83,745	31.44	2,632,942.80	
	YAHOO! INC	74,300	35.47	2,635,421.00	
アメリカ・ドル	小計	3,707,057		149,576,554.40 (16,742,103,735)	
イギリス・ポンド	ADMIRAL GROUP PLC	62,733	19.18	1,203,218.94	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	43,961	34.11	1,499,509.71	
	ASTRAZENECA PLC	43,726	39.01	1,705,969.89	
	COMPASS GROUP PLC	132,146	12.25	1,618,788.50	
	IMPERIAL BRANDS PLC	66,709	37.95	2,531,606.55	
	INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	187,711	5.58	1,047,427.38	
	PRUDENTIAL PLC	84,513	13.70	1,158,250.66	
	REGUS PLC	355,572	2.98	1,062,449.13	
	SABMILLER PLC	50,736	42.34	2,148,415.92	
	ST JAMES'S PLACE PLC	90,814	9.40	854,105.67	
	WORLDPAY GROUP PLC-W/I	523,778	2.76	1,450,341.28	
イギリス・ポンド	小計	1,642,399		16,280,083.63 (2,619,465,456)	
スイス・フラン	DORMA+KABA HOLDING AG- REG B	2,746	598.00	1,642,108.00	
	NESTLE SA	17,481	71.45	1,249,017.45	
	NOVARTIS AG	51,564	71.20	3,671,356.80	
スイス・フラン	小計	71,791		6,562,482.25 (757,507,326)	

スウェーデン・クローナ	ASSA ABLOY AB	90,551	159.10	14,406,664.10	
	COM HEM HOLDING AB-W/I	200,849	71.95	14,451,085.55	
スウェーデン・クローナ 小計		291,400		28,857,749.65 (392,465,395)	
ユーロ	AENA SA	17,681	113.05	1,998,837.05	
	ATRESMEDIA CORPORACION DE MEDIOS DE COMUNICACION SA	150,272	10.14	1,523,758.08	
	BANK OF IRELAND	7,931,520	0.26	2,062,195.20	
	DALATA HOTEL GROUP LTD	379,552	4.28	1,626,380.32	
	EURAZEO	23,031	57.82	1,331,652.42	
	ING GROEP NV	114,616	11.31	1,296,306.96	
	KERRY GROUP PLC-A	22,848	80.42	1,837,436.16	
	LUXOTTICA GROUP SPA	40,267	48.88	1,968,250.96	
	MEDIASET SPA	391,490	3.74	1,464,172.60	
	NATIXIS	261,027	4.71	1,231,003.33	
	NH HOTELES GROUP SA	302,480	4.24	1,282,515.20	
	NUMERICABLE GROUP- W/I	45,411	37.25	1,691,559.75	
	PERMANENT TSB GROUP HOLDINGS	369,177	2.80	1,033,695.60	
	RIB SOFTWARE AG	106,125	9.61	1,020,179.62	
	ROYAL KPN NV	437,205	3.65	1,596,235.45	
	SYMRISE AG	32,322	58.05	1,876,292.10	
	TELECOM ITALIA-RNC	3,081,728	0.85	2,619,468.80	
UNILEVER NV	38,912	39.45	1,535,272.96		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	102,962	20.67	2,128,739.35		
ユーロ 小計		13,848,626		31,123,951.91 (3,915,393,150)	
香港・ドル	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	447,000	30.60	13,678,200.00	
香港・ドル 小計		447,000		13,678,200.00 (197,513,208)	
合計		20,008,273		24,624,448,270 (24,624,448,270)	

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	イギリス・ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	123,720.00	994,708.80	
	イギリス・ポンド	小計	123,720.00	994,708.80 (160,048,646)	
	ユーロ	HIBERNIA REIT PLC-W/I	1,543,519.00	2,052,880.27	

	ユーロ 小計	1,543,519.00	2,052,880.27 (258,252,338)	
投資証券	合計		418,300,984 (418,300,984)	
合計			418,300,984 (418,300,984)	

(注) 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

1.

(注) 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。

2.

(注) 外貨建有価証券の内訳

3.

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 77銘柄	63.28%	-%	66.85%
イギリス・ポンド	株式 11銘柄	9.90%	-%	11.10%
	投資証券 1銘柄	-%	0.60%	
スイス・フラン	株式 3銘柄	2.86%	-%	3.02%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	1.48%	-%	1.57%
ユーロ	株式 19銘柄	14.80%	-%	16.67%
	投資証券 1銘柄	-%	0.98%	
香港・ドル	株式 1銘柄	0.75%	-%	0.79%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成27年9月24日現在)	(平成28年3月22日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,125,457,418	1,806,363,466
金銭信託	-	97,792,640
コール・ローン	29,460,653	-
国債証券	8,861,391,560	8,947,515,333
特殊債券	822,748,850	764,691,959
社債券	904,470,647	811,835,199
派生商品評価勘定	90,644,080	64,875,007
未収入金	27,212,770	6,541,120
未収利息	97,369,643	95,545,523
前払費用	7,619,811	1,661,874
流動資産合計	13,966,375,432	12,596,822,121
資産合計	13,966,375,432	12,596,822,121
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	82,042,396	99,181,226
未払金	2,733,229	-
未払解約金	7,583,846	7,601,704
流動負債合計	92,359,471	106,782,930
負債合計	92,359,471	106,782,930
純資産の部		
元本等		
元本	4,980,594,802	4,700,556,847
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	8,893,421,159	7,789,482,344
純資産合計	13,874,015,961	12,490,039,191
負債純資産合計	13,966,375,432	12,596,822,121

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27年9月24日現在）	（平成28年3月22日現在）
1. 受益権総口数	4,980,594,802口	4,700,556,847口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.7856円 (27,856円)	2.6571円 (26,571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27年3月21日 至平成27年9月24日）	（自平成27年9月25日 至平成28年3月22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	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27年9月24日現在）	（平成28年3月22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ぬ。	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27年9月24日現在	平成28年3月22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	133,280,062	185,934,901

特殊債券	6,934,875	2,877,673
社債券	54,418,812	12,406,700
合計	194,633,749	176,405,874

(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27年9月24日 現在)				(平成28年3月22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	2,488,511,853	-	2,398,732,396	89,779,457	2,859,283,304	-	2,826,032,531	33,250,773
アメリカ カ・ドル	1,364,984,586	-	1,348,832,844	16,151,742	1,151,737,410	-	1,116,352,308	35,385,102
イギリ ス・ボン ド	-	-	-	-	93,758,518	-	95,435,085	1,676,567
オースト ラリア・ ドル	262,367,341	-	242,224,878	20,142,463	170,427,912	-	173,563,011	3,135,099
カナダ・ ドル	348,559,847	-	328,055,174	20,504,673	300,343,548	-	300,020,666	322,882
シンガ ポール・ ドル	-	-	-	-	23,403,648	-	23,196,912	206,736
スイス・ フラン	22,329,902	-	21,835,618	494,284	20,038,060	-	20,543,012	504,952
スウェー デン・ク ローナ	34,477,867	-	34,502,096	24,229	17,849,760	-	18,516,405	666,645
ニュー ジーラン ド・ドル	224,832,060	-	203,905,998	20,926,062	341,924,467	-	327,732,286	14,192,181
ノル ウェー・ クローネ	-	-	-	-	23,624,581	-	23,571,172	53,409
ポーラン ド・ズロ チ	126,461,258	-	124,690,643	1,770,615	113,313,266	-	118,509,644	5,196,378
メキシ コ・ペソ	20,120,828	-	19,192,443	928,385	143,866,203	-	144,021,120	154,917
ユーロ	26,791,124	-	26,303,772	487,352	410,717,919	-	419,333,544	8,615,625

南アフリ カ・ラン ド	57,587,040	-	49,188,930	8,398,110	48,278,012	-	45,237,366	3,040,646
買 建	2,353,431,853	-	2,272,254,080	81,177,773	2,859,283,304	-	2,791,726,312	67,556,992
アメリ カ・ドル	1,123,527,267	-	1,092,567,741	30,959,526	1,707,545,894	-	1,647,992,403	59,553,491
イギリ ス・ボン ド	62,367,404	-	61,549,215	818,189	69,583,070	-	70,231,875	648,805
オースト ラリア・ ドル	293,600,882	-	270,442,152	23,158,730	159,274,832	-	160,023,354	748,522
カナダ・ ドル	199,100,524	-	189,714,637	9,385,887	130,301,193	-	132,486,420	2,185,227
シンガ ポール・ ドル	57,775,604	-	54,037,720	3,737,884	71,334,214	-	69,426,916	1,907,298
スウェー デン・ク ローナ	15,086,019	-	14,964,816	121,203	46,366,461	-	47,253,920	887,459
デンマー ク・ク ローネ	16,846,816	-	16,551,190	295,626	5,212,837	-	5,344,416	131,579
ニュー ジーラン ド・ドル	52,284,615	-	50,731,547	1,553,068	470,410,524	-	460,813,607	9,596,917
ノル ウェー・ クローネ	14,181,440	-	14,122,152	59,288	34,925,644	-	35,579,852	654,208
メキシ コ・ペソ	41,132,543	-	37,839,666	3,292,877	69,941,564	-	68,595,840	1,345,724
ユーロ	477,528,739	-	469,733,244	7,795,495	94,387,071	-	93,977,709	409,362
合計	4,841,943,706	-	4,670,986,476	8,601,684	5,718,566,608	-	5,617,758,843	34,306,219

(注) 1. 時価の算定方法

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

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27年9月24日現在)	(平成28年3月22日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	5,596,863,056円	4,980,594,802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	412,706,959円	382,659,393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	1,028,975,213円	662,697,348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）	65,581,267円	65,274,825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）	36,439,789円	36,596,677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）	19,437,581円	18,512,219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）	10,120,144円	9,236,684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）	236,330,136円	206,574,591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）	477,664,672円	403,787,558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）	68,877,822円	73,193,839円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	189,104,799円	204,596,037円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	491,897,990円	513,372,957円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	274,323,881円	278,459,455円
DCニッセイ/パトナム・グローバル債券	1,464,909,048円	1,464,082,837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）	172,253,597円	131,362,968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）	1,436,519,050円	1,258,371,174円
DCニッセイバランスアクティブ	37,135,026円	37,135,026円
計	4,980,594,802円	4,700,556,847円

附属明細表（平成28年3月22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 0.625 2017/09/30	80,000.00	79,759.20		
		US TREASURY N/B 0.625 2018/04/30	780,000.00	775,242.00		
		US TREASURY N/B 1 2019/08/31	2,170,000.00	2,159,822.70		
		US TREASURY N/B 2 2025/02/15	2,721,000.00	2,745,869.94		
		US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	4,540,000.00	4,861,659.00		
		US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	5,970,000.00	6,037,162.50		
		アメリカ・ドル 小計		16,261,000.00	16,659,515.34 (1,864,699,552)	
	イギリス・ポンド	TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	990,000.00	1,097,910.00		
		TSY 4% 2060 4 2060/01/22	230,000.00	348,910.00		
		UK TSY 1% 2017 1 2017/09/07	840,000.00	846,871.20		
		UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	850,000.00	885,071.00		
		UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	1,170,000.00	1,296,933.30		
		UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	1,960,000.00	2,330,106.80		
		イギリス・ポンド 小計		6,040,000.00	6,805,802.30 (1,095,053,590)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	1,832,000.00	2,206,295.92		
		オーストラリア・ドル 小計		1,832,000.00	2,206,295.92 (187,049,768)	
	カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2018/09/01	310,000.00	315,142.90		
		CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	1,630,000.00	1,807,295.10		

	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	460,000.00	600,760.00	
カナダ・ドル 小計		2,400,000.00	2,723,198.00 (232,860,661)	
スイス・フラン	SWITZERLAND 2 2022/05/25	450,000.00	526,783.50	
スイス・フラン 小計		450,000.00	526,783.50 (60,806,619)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	4,860,000.00	5,857,369.20	
スウェーデン・クローナ 小計		4,860,000.00	5,857,369.20 (79,660,221)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	3,070,000.00	3,436,558.00	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	690,000.00	1,186,703.40	
デンマーク・クローネ 小計		3,760,000.00	4,623,261.40 (77,994,420)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT 5.5 2023/04/15	2,501,000.00	2,967,936.70	
ニュージーランド・ドル 小計		2,501,000.00	2,967,936.70 (224,643,129)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	1,510,000.00	1,736,213.10	
ノルウェー・クローネ 小計		1,510,000.00	1,736,213.10 (23,056,910)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2019/07/25	6,158,000.00	6,484,250.84	
ポーランド・ズロチ 小計		6,158,000.00	6,484,250.84 (191,479,927)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	27,507,000.00	30,386,982.90	
メキシコ・ペソ 小計		27,507,000.00	30,386,982.90 (195,388,300)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	1,450,000.00	1,852,027.00	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	400,000.00	644,656.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.15 2020/07/30	2,401,000.00	2,482,513.95	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4 2020/04/30	600,000.00	689,754.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	2,090,000.00	2,590,471.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	350,000.00	449,071.00	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	420,000.00	631,608.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2017/07/30	930,000.00	999,675.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	1,095,000.00	1,134,693.75	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	1,280,000.00	1,789,376.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 0.7 2020/05/01	3,521,000.00	3,595,257.89	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	640,000.00	712,499.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	4,050,000.00	5,179,464.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	940,000.00	1,405,384.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2017/08/01	2,140,000.00	2,293,759.00	
		FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	2,290,000.00	2,310,174.90	
		FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	2,000,000.00	2,374,620.00	
		FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	280,000.00	473,788.00	
		FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	690,000.00	1,151,679.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	310,000.00	507,339.80	
		Netherlands Government Bond 2.25 2022/07/15	297,000.00	341,169.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	1,540,000.00	1,850,679.60	
		TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	1,020,000.00	1,251,580.80	
	ユーロ 小計		30,734,000.00	36,711,243.93 (4,618,274,486)	
	南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2018/12/21	13,330,000.00	13,153,644.10	
	南アフリカ・ランド 小計		13,330,000.00	13,153,644.10 (96,547,748)	
	国債証券 合計			8,947,515,333 (8,947,515,333)	
特殊債券	アメリカ・ドル	FHLMC GOLD A17598 6.5 2034/01/01	6,417.12	7,310.44	
		FHLMC GOLD A20871 6.5 2034/04/01	30,277.02	34,713.20	

		FHLMC GOLD G08008 6.5 2034/07/01	12,442.59	14,979.00	
		FNMA 545477 7 2032/03/01	14,548.75	16,982.31	
		FNMA 555571 6.5 2033/03/01	5,544.43	6,343.99	
		FNMA 602285 6.5 2031/08/01	4,890.83	5,711.90	
		FNMA 609480 7 2031/10/01	2,687.01	3,012.56	
		FNMA 797553 5 2020/04/01	2,126.69	2,227.43	
		FNMA 813915 4.5 2020/11/01	6,546.50	6,794.54	
		FNW 2003-W1 2A 6.36059 2042/12/01	357,111.39	418,598.82	
		FNW 2003-W3 1A1 6.5 2042/08/01	5,829.28	6,815.88	
		GNMA 781542 6 2033/01/01	12,741.16	14,660.74	
		KFW 4 2020/01/27	1,180,000.00	1,287,757.60	
	アメリカ・ドル	小計	1,641,162.77	1,825,908.41 (204,373,928)	
	ユーロ	EFSF 2.25 2022/09/05	1,360,000.00	1,561,579.20	
		ELECTRICITE DE FRANCE 5 2018/02/05	400,000.00	437,396.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.125 2024/04/15	225,000.00	297,589.50	
		EUROPEAN UNION 3.25 2018/04/04	2,010,000.00	2,157,473.70	
	ユーロ	小計	3,995,000.00	4,454,038.40 (560,318,031)	
	特殊債券	合計		764,691,959 (764,691,959)	
社債券	アメリカ・ドル	APPLE INC 3.45 2024/05/06	330,000.00	347,341.50	
		BACM 2005-1 AJ 5.3386 2042/11/10	188,742.55	188,629.30	
		BERKSHIRE HATHAWAY FIN 4.3 2043/05/15	95,000.00	98,082.75	
		CGCMT 2007-C6 A4 5.70469 2049/12/01	200,000.00	206,230.00	
		CGCMT 2014-GC19 XA 1.30128 2047/03/01	1,362,147.86	91,795.14	
		CGCMT 2014-GC21 AS 4.026 2047/05/01	355,000.00	374,138.05	

COMM 2005-LP5 D 4.67452 2043/05/01	89,245.16	89,196.96	
COMM 2012-CR1 XA 2.07513 2045/05/01	1,588,827.77	132,524.12	
COMM 2012-CR3 XA 1.94528 2045/10/01	740,371.19	65,086.01	
DBRR 2013-EZ3 A 1.636 2049/12/15	49,436.43	49,351.39	
GSMS 2013-GC10 XA 1.61111 2046/02/01	3,099,018.84	249,192.09	
JPMBB 2013-C12 XA 0.84586 2045/07/01	17,873,246.55	554,428.10	
JPMBB 2013-C15 B 4.9267 2045/11/01	150,000.00	163,765.50	
JPMBB 2013-C17 AS 4.4584 2047/01/01	166,000.00	181,023.00	
JPMBB 2013-C17 XA 1.04596 2047/01/01	2,338,405.96	119,749.76	
JPMCC 2003-CB6 E 5.86267 2037/07/01	120,000.00	122,368.80	
JPMCC 2004-LN2 A2 5.115 2041/07/01	16,996.77	17,014.94	
JPMCC 2007-LD12 A3 5.93522 2051/02/01	24,819.50	24,794.42	
JPMCC 2012-C6 D 5.19216 2045/05/01	190,000.00	194,292.10	
JPMCC 2012-LC9 XA 1.86295 2047/12/01	1,731,580.47	129,020.06	
JPMCC 2013-C16 XA 1.15056 2046/12/01	5,638,294.13	303,452.98	
JPMCC 2013-LC11 C 3.9582 2046/04/01	355,000.00	336,209.85	
MLCFC 2006-2 AM 5.95358 2046/06/01	240,000.00	240,312.00	
MLMT 2007-C1 A3 5.83748 2050/06/01	13,070.40	13,060.98	
MSBAM 2013-C11 C 4.41353 2046/08/01	184,000.00	183,622.80	
MSBAM 2014-C17 XA 1.42725 2047/08/01	1,412,984.67	90,671.22	
MSC 2007-IQ14 A2 5.61 2049/04/01	105,376.69	105,406.19	
MSRR 2010-C30 A3B 5.246 2043/12/01	521,187.27	520,796.36	
UBSBB 2012-C4 XA 1.80664 2045/12/01	1,883,017.04	158,625.35	
WFRBS 2012-C10 XA 1.73636 2045/12/01	2,897,312.77	232,190.63	

	WFRBS 2013-C12 XA 1.4066 2048/03/01	2,506,173.21	160,971.50	
	WFRBS 2013-C14 XA 0.88607 2046/06/01	7,643,633.03	326,077.36	
	WFRBS 2013-C17 XA 1.54995 2046/12/01	3,021,059.28	200,205.59	
	WFRBS 2013-C18 AS 4.387 2046/12/01	339,000.00	370,981.26	
	WFRBS 2013-UBS1 AS 4.306 2046/03/01	204,000.00	222,007.08	
	WFRBS 2014-C19 C 4.646 2047/03/01	205,000.00	202,164.85	
	アメリカ・ドル 小計	57,877,947.54	7,064,779.99 (790,760,824)	
	ユーロ GE CAPITAL TRUST IV 4.625 2066/09/15	165,000.00	167,522.85	
	ユーロ 小計	165,000.00	167,522.85 (21,074,375)	
社債券 合計			811,835,199 (811,835,199)	
合計			10,524,042,491 (10,524,042,491)	

(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 6銘柄	14.93%	27.17%
	特殊債券 13銘柄	1.64%	
	社債券 36銘柄	6.33%	
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	8.77%	10.41%
オーストラリア・ドル	国債証券 1銘柄	1.50%	1.78%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	1.86%	2.21%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.49%	0.58%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	0.64%	0.76%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	0.62%	0.74%
ニュージーランド・ドル	国債証券 1銘柄	1.80%	2.13%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	0.18%	0.22%
ポーランド・ズロチ	国債証券 1銘柄	1.53%	1.82%
メキシコ・ペソ	国債証券 1銘柄	1.56%	1.86%

ユーロ	国債証券	23銘柄	36.98%	49.41%
	特殊債券	4銘柄	4.49%	
	社債券	1銘柄	0.17%	
南アフリカ・ランド	国債証券	1銘柄	0.77%	0.92%

(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28年4月28日現在)

資産総額	915,705,162円
負債総額	1,307,959円
純資産総額(-)	914,397,203円
発行済数量	680,937,180口
1口当たり純資産額(/)	1.3429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28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28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	292	47,119
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	47	8,852
単位型公社債投資信託	4	200
合計	343	56,172

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20期事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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21期事業年度に係る中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,509,845		3,488,730
有価証券		7,325,806		5,209,385
前払費用		207,351		499,710
未収委託者報酬		1,897,225		2,778,650
未収運用受託報酬		1,419,102		1,519,030
未収投資助言報酬		190,027		216,814
繰延税金資産		406,503		417,418
その他		26,376		52,788
流動資産合計		12,982,239		14,182,529
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	102,335	1	88,529
車両	1	1,009	1	588
器具備品	1	105,718	1	90,111
有形固定資産合計		209,063		179,229
無形固定資産				
ソフトウェア		949,954		854,449
ソフトウェア仮勘定		28,053		17,421
その他		8,107		8,075
無形固定資産合計		986,115		879,946
投資その他の資産				
投資有価証券		31,159,584		35,677,217
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		-		175,262
差入保証金		284,888		284,888
繰延税金資産		160,839		-
その他		17		17
投資その他の資産合計		31,671,552		36,203,608

固定資産合計	32,866,731	37,262,784
資産合計	45,848,971	51,445,314
負債の部		
流動負債		
預り金	29,930	33,209
未払償還金	137,842	137,094
未払手数料	711,826	995,185
未払運用委託報酬	508,934	655,766
未払投資助言報酬	310,490	410,223
その他未払金	248,117	324,326
未払費用	79,355	97,490
未払法人税等	1,283,286	1,556,244
賞与引当金	769,569	787,638
その他	168,940	498,615
流動負債合計	4,248,293	5,495,794
固定負債		
退職給付引当金	1,106,561	1,253,790
役員退職慰労引当金	19,950	25,400
繰延税金負債	-	13,483
固定負債合計	1,126,511	1,292,673
負債合計	5,374,805	6,788,467
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	20,276,469	23,998,814
利益剰余金合計	20,956,276	24,678,621
株主資本合計	39,238,116	42,960,461
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,236,049	1,696,385
評価・換算差額等合計	1,236,049	1,696,385
純資産合計	40,474,166	44,656,846
負債・純資産合計	45,848,971	51,445,314

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	12,436,743	15,670,934
運用受託報酬	6,674,387	7,825,480
投資助言報酬	791,350	872,448
業務受託料	47,100	47,100
営業収益計	19,949,580	24,415,963
営業費用		
支払手数料	5,367,041	6,834,391
広告宣伝費	13,397	28,551
公告費	161	-
調査費	3,767,832	4,581,959
支払運用委託報酬	1,587,647	1,811,448
支払投資助言報酬	1,228,668	1,722,179
委託調査費	66,025	80,518
調査費	885,490	967,812
委託計算費	128,890	148,832
営業雑経費	538,997	581,870
通信費	55,199	53,825
印刷費	147,275	170,610
協会費	20,172	21,379
その他営業雑経費	316,349	336,053

営業費用計		9,816,320		12,175,604
一般管理費				
役員報酬	1	63,866	1	62,272
給料・手当		2,906,149		2,905,979
賞与引当金繰入額		766,843		782,365
賞与		248,914		237,611
福利厚生費		569,577		532,618
退職給付費用		241,558		283,064
役員退職慰労引当金繰入額		7,300		7,250
その他人件費		97,103		101,498
不動産賃借料		574,467		544,587
その他不動産経費		26,330		25,737
交際費		14,005		20,059
旅費交通費		79,754		100,791
固定資産減価償却費		511,498		440,227
租税公課		93,822		104,874
業務委託費		208,262		194,856
器具備品費		143,717		156,991
保守料		83,044		-
保険料		59,043		56,700
諸経費		48,305		135,187
一般管理費計		6,743,562		6,692,676
営業利益		3,389,697		5,547,682
営業外収益				
受取利息		166		274
有価証券利息		76,250		70,792
受取配当金	4	81,042	4	177,354
為替差益		20,176		31,164
その他営業外収益		13,559		6,906
営業外収益計		191,194		286,492
営業外費用				
控除対象外消費税		4,451		19,444
その他営業外費用		1,182		6,244
営業外費用計		5,634		25,689
経常利益		3,575,257		5,808,485
特別利益				
投資有価証券売却益		1,377		366,068
投資有価証券償還益		102,298		15,343

特別利益計		103,675		381,411
特別損失				
投資有価証券償還損		6,903		-
固定資産除却損	3	8,924	3	8,042
事故損失賠償金	2	2,387	2	25,550
寄付金		142,550		-
特別損失計		160,764		33,593
税引前当期純利益		3,518,168		6,156,304
法人税、住民税及び事業税		1,474,066		2,284,237
法人税等調整額		95,320		14,162
法人税等合計		1,378,745		2,298,400
当期純利益		2,139,422		3,857,904

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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	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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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	20,276,469	20,956,276	39,238,116
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,857,904	3,857,904	3,857,904
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,722,344	3,722,344	3,722,344
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	3,857,904

株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	460,336	460,336	460,336
当期変動額合計	460,336	460,336	4,182,680
当期末残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846

注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31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 ...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。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。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、内規に基づく期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、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。
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。

(貸借対照表関係)

1. 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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	254,648千円	272,378千円
車両	6,004	6,425
器具備品	520,399	481,704
計	781,053	760,508

(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25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
器具備品	8,924千円	4,128千円
その他	-	3,914
計	8,924	8,042
4. 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。		
	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
関係会社からの受取配当金	-	41,126千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 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

平成26年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26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27年6月25日開催の定時株主総会において、次のとおり決議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27年3月31日
効力発生日	平成27年6月25日

（リース取引関係）

1．ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。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期末残高相当額（単位：千円）

	前事業年度（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

（単位：千円）

	当事業年度（平成27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	-	-	-

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26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
1年内	107	-
1年超	-	-
合計	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25年4月1日 至 平成26年3月31日）	当事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）
支払リース料	186	108
減価償却費相当額	172	100
支払利息相当額	6	1

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次表に含まれておりません(注2)を参照下さい)。

前事業年度(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	23,299,720	72,529
その他有価証券	7,864,894	7,864,894	-

当事業年度(平成27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	3,488,730	3,488,730	-
有価証券			
満期保有目的の債券	5,209,385	5,215,010	5,624
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,414,879	22,498,520	83,640
その他有価証券	13,194,837	13,194,837	-

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27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等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(平成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	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 其他(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。

当事業年度(平成27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	3,488,730	-	-	-
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	5,200,000	22,400,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 其他(注)	990,647	9,384,052	1,683,297	3,372
合計	9,679,377	31,784,052	1,683,297	3,372

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

(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

当事業年度（平成27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	26,620,113	26,710,130	90,016
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,620,113	26,710,130	90,016
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	1,004,151	1,003,400	751
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,004,151	1,003,400	751
合計		27,624,265	27,713,530	89,264

2. その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または償却原価 (千円)	差額 (千円)
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	1,799,820	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または償却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

当事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または償却原価 (千円)	差額 (千円)
--	----	------------------	---------------------	------------

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	3,113,940	3,105,255	8,684
	国債・地方債等	3,113,940	3,105,255	8,684
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
(3)その他（注1）	7,809,441	5,421,939	2,387,501	
	小計	10,923,381	8,527,195	2,396,186
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	1,900,070	1,902,293	2,223
	国債・地方債等	1,900,070	1,902,293	2,223
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
(3)その他（注1）	371,386	376,170	4,783	
	小計	2,271,456	2,278,463	7,006
	合計	13,194,837	10,805,658	2,389,179

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式（当事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は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（当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、前事業年度の貸借対照表計上額は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。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（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	-

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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	1,249,329	366,068	-
合計	1,249,329	366,068	-

（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、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

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。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

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	1,106,561 千円
退職給付費用	215,268
退職給付の支払額	68,039
退職給付引当金の期末残高	1,253,790

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	215,268 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、44,254千円であります。

（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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	274,274 千円	260,708 千円
未払事業税	98,319	120,645
その他	33,928	36,064
繰延税金資産合計	406,523	417,418
繰延税金負債		
有価証券評価差額	19	-
繰延税金負債合計	19	-
繰延税金資産の純額	406,503	417,418
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	394,378	405,952
税務上の繰延資産償却超過額	7,110	4,573
役員退職慰労引当金	3,835	8,214
投資有価証券評価損	486,598	406,043
投資有価証券評価差額	4,898	2,266
その他	2,461	1,703
小計	899,283	828,753
評価性引当額	97,929	90,623
繰延税金資産合計	801,354	738,130
繰延税金負債		
特別分配金否認	92,089	56,555
投資有価証券評価差額	548,424	695,058

繰延税金負債合計	640,514	751,613
繰延税金資産(は負債)の純額	160,839	13,483

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	38.01 %	法定実効税率	35.64 %
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.15	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.09
住民税均等割	0.17	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.26
税率変更に伴う影響	0.98	住民税均等割	0.09
特定外国子会社留保金課税	0.67	税率変更に伴う影響	1.63
所得拡大促進税制による特別控除額	0.60	特定外国子会社留保金課税	0.44
その他	0.20	所得拡大促進税制による特別控除額	0.37
税効果会計適用後の法人税等の負担率	39.19	その他	0.06
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.33

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27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。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、前事業年度の35.64%から平成27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は33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%に、それぞれ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32,758千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が100,766千円、その他有価証券評価差額金が68,007千円、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

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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	4,553,051

[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	-	-

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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	200,000	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	3,829,599	未収運用 受託報酬	767,087
								投資助言報酬 の受取	676,352	未収投資 助言報酬	158,782
								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、協議の上決定しております。

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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	373,212円65銭	411,781円19銭
1株当たり当期純利益金額	19,727円63銭	35,573円77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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
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21期中間会計期間末
(平成27年9月30日現在)

資産の部

流動資産

現金・預金		4,317,001
有価証券		6,604,052
前払費用		575,114
未収委託者報酬		3,182,655
未収運用受託報酬		1,977,949
未収投資助言報酬		213,262
繰延税金資産		285,665
その他		70,176
流動資産合計		17,225,876

固定資産

有形固定資産	1	180,828
無形固定資産		847,760
投資その他の資産		
投資有価証券		35,274,476
関係会社株式		66,222
長期前払費用		25,037
差入保証金		285,623
繰延税金資産		225,874
その他		1,283
投資その他の資産合計		35,878,518
固定資産合計		36,907,107
資産合計		54,132,984

負債の部

流動負債

預り金		31,701
未払収益分配金		241
未払償還金		134,963
未払手数料		1,143,638
未払運用委託報酬		776,102
未払投資助言報酬		492,881
その他未払金		208,263
未払費用		154,443
未払法人税等		1,562,061
前受投資助言報酬		47,034
賞与引当金		443,027
その他	2	290,439
流動負債合計		<u>5,284,799</u>

固定負債

退職給付引当金		1,340,851
役員退職慰労引当金		24,275
固定負債合計		<u>1,365,126</u>

負債合計

6,649,926

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		27,810,746
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	27,270,746
利益剰余金合計	<u>27,950,553</u>
株主資本合計	<u>46,232,393</u>
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,250,664
評価・換算差額等合計	<u>1,250,664</u>
純資産合計	<u>47,483,058</u>
負債・純資産合計	<u>54,132,984</u>

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第21期中間会計期間	
(自平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	11,359,993
運用受託報酬	4,591,997
投資助言報酬	445,992
営業収益計	16,397,983
営業費用	8,169,317
一般管理費	1 3,442,615
営業利益	4,786,050
営業外収益	2 181,075
営業外費用	3 15,447
経常利益	4,951,678
特別利益	4 79,133
特別損失	5 6,385
税引前中間純利益	5,024,426
法人税、住民税及び事業税	1,506,995
法人税等調整額	109,937
法人税等合計	1,616,933
中間純利益	3,407,492

(3)中間株主資本等変動計算書

第21期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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	23,998,814	24,678,621	42,960,46
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,56
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,407,492	3,407,492	3,407,49
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	-	-	-	-	-	-	-	3,271,932	3,271,932	3,271,93
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	27,270,746	27,950,553	46,232,39

	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	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	3,407,492
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	445,720	445,720	445,720
当中間期変動額合計	445,720	445,720	2,826,211
当中間期末残高	1,250,664	1,250,664	47,483,058

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第21期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27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	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（中間貸借対照表関係）

第21期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）	
1．有形固定資産の減価償却累計額	726,224千円
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21期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
1．減価償却の実施額	
有形固定資産	21,451千円
無形固定資産	169,933千円
2．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	139,966千円
有価証券利息	33,571千円
受取利息	267千円
3．営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	8,471千円
控除対象外消費税	6,477千円
4．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	66,441千円
投資有価証券償還益	7,081千円
事故受取保険金	5,609千円
5．特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	6,192千円
投資有価証券売却損	193千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第21期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27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27年6月25日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成27年3月31日	平成27年6月25 日

（金融商品関係）

第21期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成27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	4,317,001	4,317,001	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,604,052	6,618,590	14,537
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,416,134	22,498,420	82,285
其他有価証券	12,790,842	12,790,842	-

（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

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

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

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 其他有価証券」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21期中間会計期間末（平成27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	29,020,186	29,117,010	96,823
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,020,186	29,117,010	96,823
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,020,186	29,117,010	96,823

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	5,810,267	5,829,720	19,452
	国債・地方債等	5,810,267	5,829,720	19,452
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	4,312,989	6,138,058	1,825,069
	小計	10,123,256	11,967,778	1,844,522
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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	941,670	823,064	118,606
	小計	941,670	823,064	118,606
合計		11,064,926	12,790,842	1,725,916

（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21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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	2,076,382

[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21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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21期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

該当事項はありません。

（ 1株当たり情報 ）

	第21期中間会計期間 （自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）
1株当たり純資産額	437,841円71銭
1株当たり中間純利益金額	31,420円52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おりません。

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	3,407,492千円
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	3,407,492千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

該当事項はありません。

5【その他】

<訂正前>

定款の変更等

平成27年6月25日に開催された定時株主総会において、定款の「監査役の実任免除」にかかる条項の追加が決議されました。

訴訟その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

<訂正後>

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

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27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27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27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	1,300,000百万円	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・カンパニー・エルエルシー

b. 資本金の額

平成27年9月末現在、204,000米ドル（約24百万円。1米ドル = 119.96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27年6月5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27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28年5月12日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

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27年9月25日から平成28年3月22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28年3月22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27年11月30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	牧野あや子	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27年4月1日から平成28年3月31日までの第21期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27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。