

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2017年6月20日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 赤林 富二
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】</b>	DCニッセイバランスアクティブ
<b>【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 上限1兆円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

**【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

2016年12月20日をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、有価証券報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

**【訂正の内容】**

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第一部【証券情報】

### （ 7 ）【申込期間】

< 訂正前 >

継続申込期間：平成28年12月21日（水）～ 平成29年12月20日（水）

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

< 訂正後 >

継続申込期間：2016年12月21日（水）～ 2017年12月20日（水）

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

## 第二部【ファンド情報】

### 第 1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### （ 1 ）【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

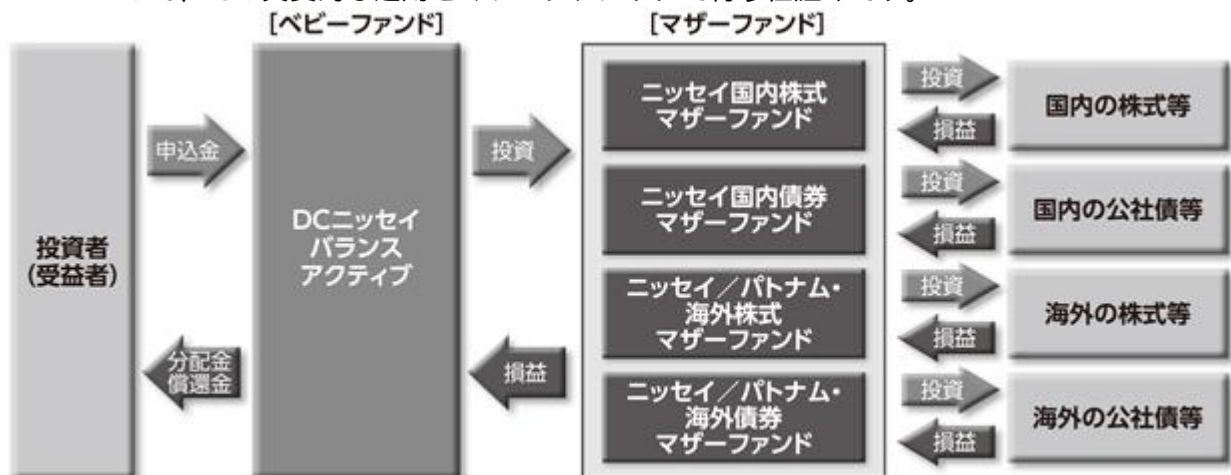
###### 基本方針

ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度向けのファンドとして、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

###### ファンドの特色

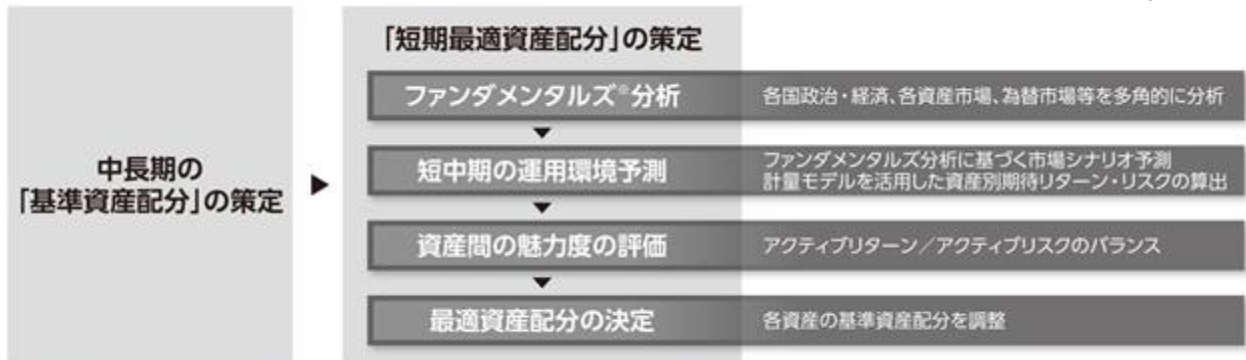
マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式および公社債に分散投資を行います。

- ・ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。ファミリーファンド方式とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



❗ マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にもない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

運用収益の追求と安定を図るため、中長期的な資産配分方針として「基準資産配分」を設定し、その「基準資産配分」を中心に市場環境の変化等に応じて配分比を機動的に変動させる「短期最適資産配分」戦略を行うことにより、資産配分によるリスクをコントロールしつつ付加価値の向上を図ります。



※ファンダメンタルズとは、経済活動の状況を示す基礎的な要因のことで、経済の基礎的要因と訳されます。

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。

ニッセイ国内株式マザーファンド（運用：ニッセイアセットマネジメント）

- ・アナリストチームが徹底した企業調査・分析に基づき、組入候補銘柄を厳選します。
- ・ポートフォリオ・マネジャーが投資環境分析等に基づき運用戦略を決定し、ポートフォリオを構築します。
- ・グロース投資（成長株投資）、バリュー投資（割安株投資）などの投資スタイルをあらかじめ限定せず、運用環境から最も効率的と考えられる運用戦略を決定します。

ニッセイ国内債券マザーファンド（運用：ニッセイアセットマネジメント）

- ・投資環境分析、期間別金利水準の動向、個別債券銘柄の分析等に基づき、債券の利回り変化に対する価格変動性のコントロールを行うとともに、長期・中期・短期債のウエイト、投資銘柄を決定し、ポートフォリオを構築します。
- ・原則として、投資適格債への投資により、信用リスクを抑制します。

投資適格債とは、債券格付（債券の元本、利息支払いの確実性の度合いを示す尺度）がBBB格相当以上の債券です。

ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド（運用：ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシー）

- ・グローバルな視点に立った企業調査分析・投資環境分析を徹底し、世界各国の優良銘柄に分散投資します。
- ・アナリストとポートフォリオ・マネジャーが投資哲学と情報を共有しつつ、国・セクター（業種等）・銘柄固有要素の3つの側面を統合した銘柄選択とポートフォリオ構築を行います。
- ・外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド（運用：ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシー）

- ・各国の経済・政治情勢や金融政策等の環境分析に基づき、国別配分を決定します。
- ・投資環境分析に基づく国別の金利・為替見通しにより、債券の利回り変化に対する価格変動性のコントロールを行うとともに為替戦略を決定し、ポートフォリオを構築します。
- ・外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシーは、パトナム・インベストメンツのグループ会社です。

パトナム・インベストメンツの概要

（平成28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1,458億ドル(約16兆円)、投信残高は約730億ドル(約8兆円)の規模を誇ります。  
 設定済み投信は80本以上、投資家数は400万人以上にのぼります。  
 ファンドマネージャー、アナリストなどの運用担当専門職を185名有しています。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限  
 5,000億円とします。ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの分類  
 追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。  
 課税上は株式投資信託として取扱われます。

ファンドの商品分類表・属性区分表は以下の通りです(該当区分を網掛け表示していません)。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型 追 加 型	国 内 海 外 内 外	株 式 債 券 不動産投信 その他資産 ( ) 資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ

株式 一般 大型株 中小型株		グローバル (日本含む)		
債券 一般	年1回	日本		
公債	年2回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
社債	年4回	欧州		
その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	アジア		
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分変更型))	日々	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし
	その他 ( )	アフリカ		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマー ジング		

## 商品分類表

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## 属性区分表

その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分変更型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年2回	目論見書または約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

< 訂正後 >

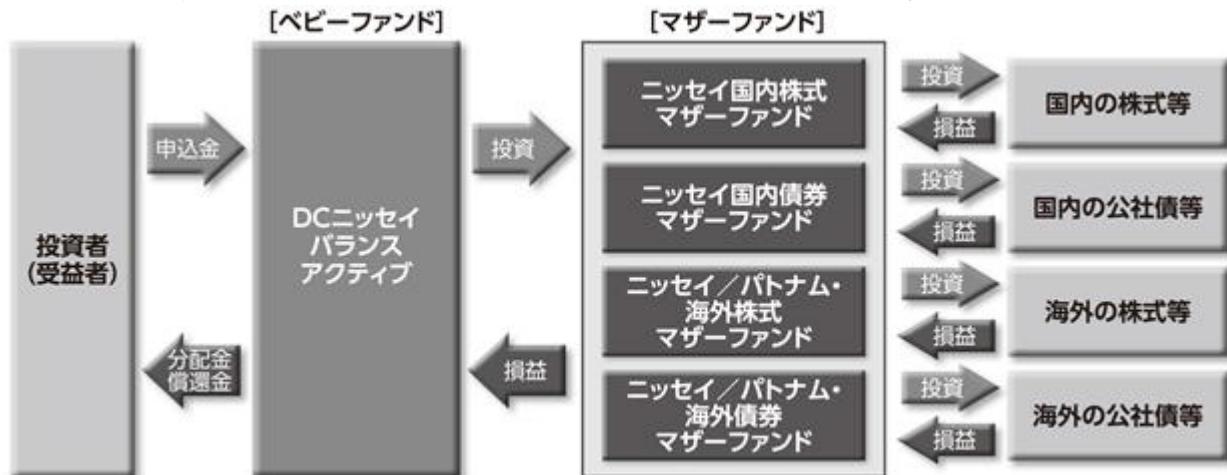
基本方針

ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度向けのファンドとして、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

### ファンドの特色

マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式および公社債に分散投資を行います。

- ・ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。ファミリーファンド方式とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



■ マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にとまいない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

運用収益の追求と安定を図るため、中長期的な資産配分方針として「基準資産配分」を設定し、その「基準資産配分」を中心に市場環境の変化等に応じて配分比を機動的に変動させる「短期最適資産配分」戦略を行うことにより、資産配分によるリスクをコントロールしつつ付加価値の向上を図ります。



※ファンダメンタルズとは、経済活動の状況を示す基礎的な要因のことで、経済の基礎的要件と訳されます。

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

#### ニッセイ国内株式マザーファンド（運用：ニッセイアセットマネジメント）

- ・アナリストチームが徹底した企業調査・分析に基づき、組入候補銘柄を厳選します。
- ・ポートフォリオ・マネジャーが投資環境分析等に基づき運用戦略を決定し、ポートフォリオを構築します。
- ・グロース投資（成長株投資）、バリュー投資（割安株投資）などの投資スタイルをあらかじめ限定せず、運用環境から最も効率的と考えられる運用戦略を決定します。

#### ニッセイ国内債券マザーファンド（運用：ニッセイアセットマネジメント）

- ・投資環境分析、期間別金利水準の動向、個別債券銘柄の分析等に基づき、債券の利回り変化に対する価格変動性のコントロールを行うとともに、長期・中期・短期債のウェイト、投資銘柄を決定し、ポートフォリオを構築します。

- ・原則として、投資適格債への投資により、信用リスクを抑制します。  
投資適格債とは、債券格付（債券の元本、利息支払いの確実性の度合いを示す尺度）がBBB格相当以上の債券です。
- ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド（運用：ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシー）
- ・グローバルな視点に立った企業調査分析・投資環境分析を徹底し、世界各国の優良銘柄に分散投資します。
  - ・アナリストとポートフォリオ・マネジャーが投資哲学と情報を共有しつつ、国・セクター（業種等）・銘柄固有要素の3つの側面を統合した銘柄選択とポートフォリオ構築を行います。
  - ・外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。
- ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド（運用：ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシー）
- ・各国の経済・政治情勢や金融政策等の環境分析に基づき、国別配分を決定します。
  - ・投資環境分析に基づく国別の金利・為替見通しにより、債券の利回り変化に対する価格変動性のコントロールを行うとともに為替戦略を決定し、ポートフォリオを構築します。
  - ・外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシーは、パトナム・インベストメンツのグループ会社です。

#### パトナム・インベストメンツの概要

（2016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1,538億ドル(約16兆円)、投信残高は約724億ドル(約7兆円)の規模を誇ります。  
設定済み投信は80本以上、投資家数は400万人以上にのぼります。  
ファンドマネージャー、アナリストなどの運用担当専門職を185名有しています。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

#### 信託金の上限

5,000億円とします。ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

#### ファンドの分類

追加型投信/内外/資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

ファンドの商品分類表・属性区分表は以下の通りです（該当区分を網掛け表示していません）。

#### 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式 債券
追加型	海外	不動産投信 その他資産 ( )
	内外	資産複合



## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株		グローバル (日本含む)		
債券 一般	年1回	日本		
公債	年2回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
社債	年4回	欧州		
その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	アジア		
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分変更型))	日々	中南米 アフリカ	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	その他 ( )	中近東 (中東)  エマー ジング		

## 商品分類表

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## 属性区分表

その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分変更型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年2回	目論見書または約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

(2) 【ファンドの沿革】  
<訂正前>

平成13年11月30日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

平成23年12月21日 主要投資対象を「ニッセイバランスアクティブマザーファンド」から、「ニッセイ国内株式マザーファンド」、「ニッセイ国内債券マザーファンド」、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」および「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」に変更

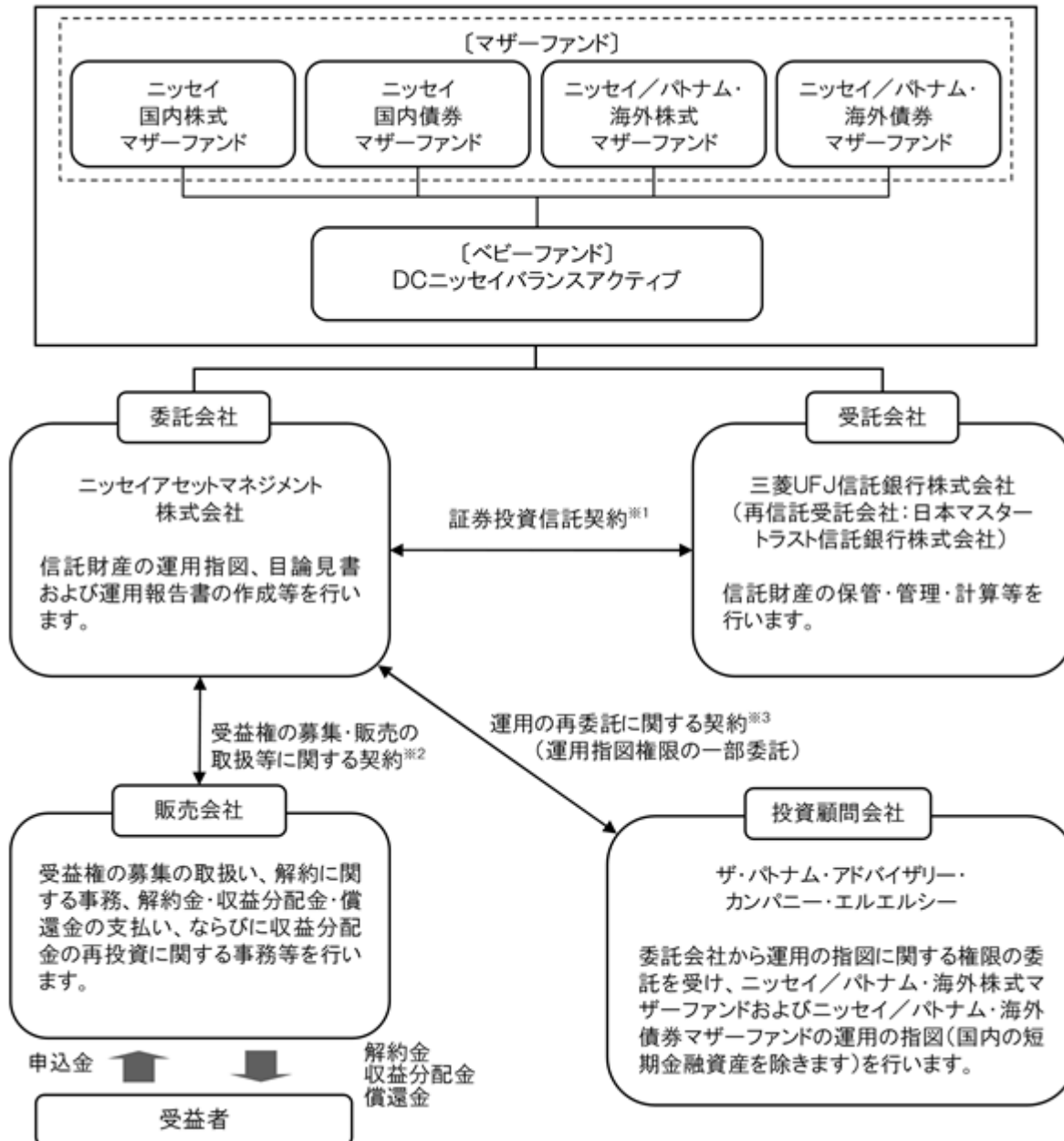
< 訂正後 >

2001年11月30日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

2011年12月21日 主要投資対象を「ニッセイバランスアクティブマザーファンド」から、「ニッセイ国内株式マザーファンド」、「ニッセイ国内債券マザーファンド」、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」および「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」に変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

&lt;訂正前&gt;



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資顧問会社との間で結ばれ、委託会社が投資顧問会社へ運用指図権限の一部を委託するにあたり委託する業務の内容、業務を遂行する際の両者間の取決めの内容を定めた契約です。

## 委託会社の概況（平成28年10月末現在）

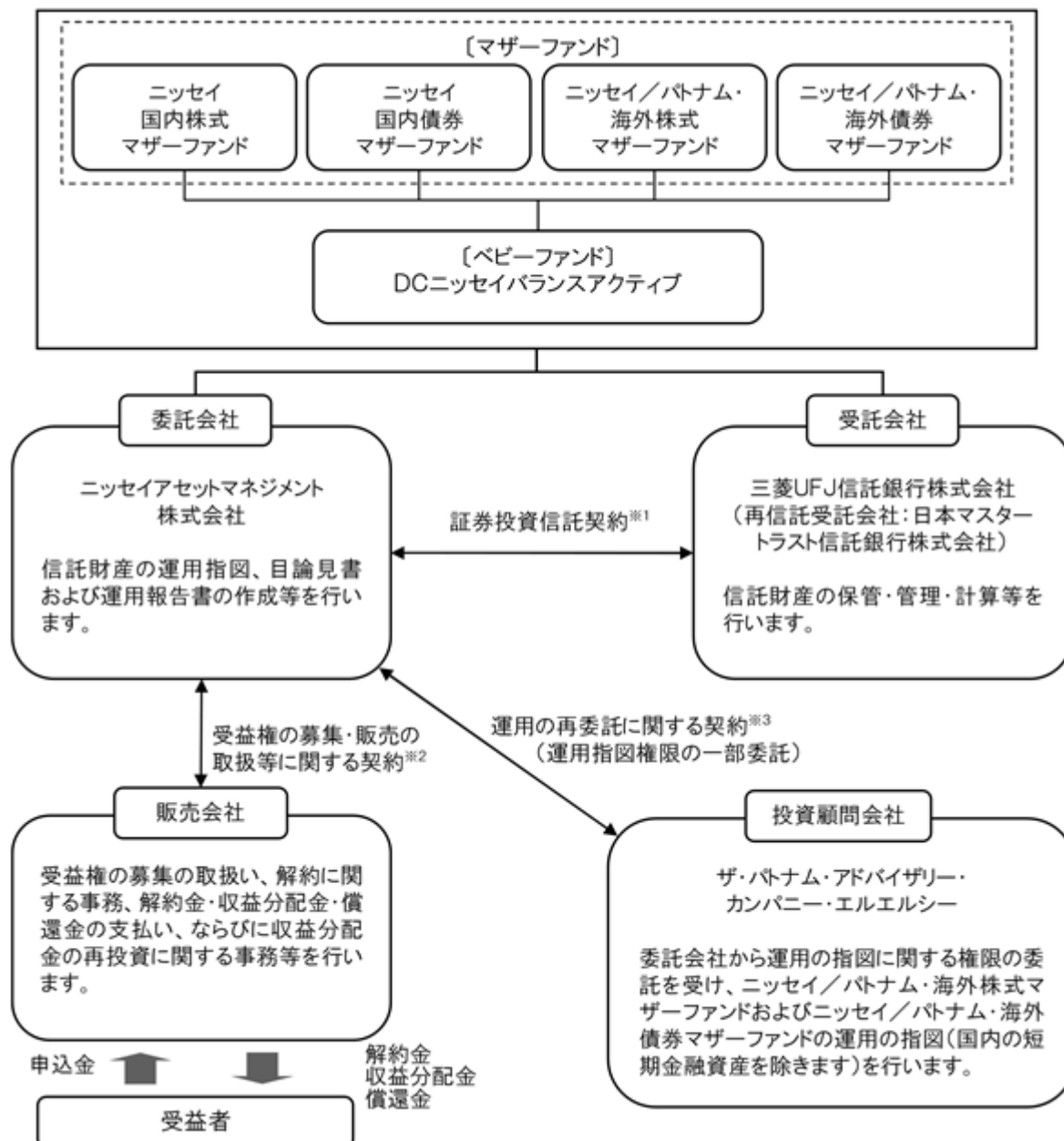
1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 赤林 富二
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 平成7年4月4日
7. 沿革

昭和60年7月1日	ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
平成7年4月4日	ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
平成10年7月1日	ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
平成12年5月8日	定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

## 8. 大株主の状況

名 称	住 所	保有株数	比 率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号	97,604株	90.00%
パトナム・ユーエス・ホールディングス・エルエルシー	アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市ワン・ポスト・オフィス・スクエア	10,844株	10.00%

&lt; 訂正後 &gt;



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資顧問会社との間で結ばれ、委託会社が投資顧問会社へ運用指図権限の一部を委託するにあたり委託する業務の内容、業務を遂行する際の両者間の取決めの内容を定めた契約です。

#### 委託会社の概況（2017年3月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 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
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 赤林 富二
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 1995年4月4日
7. 沿革
  - 1985年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
  - 1995年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
  - 1998年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
  - 2000年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

#### 8. 大株主の状況

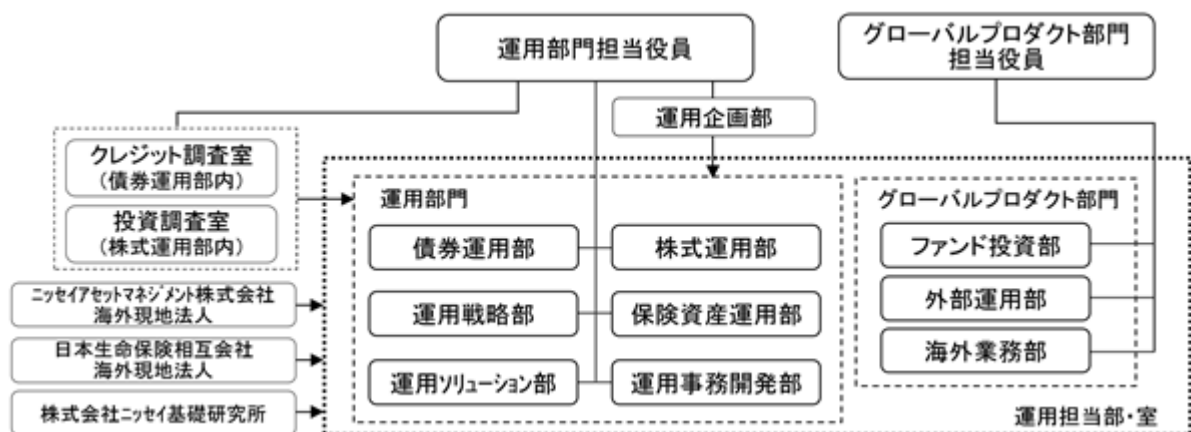
名 称	住 所	保有株数	比 率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号	97,604株	90.00%
パトナム・ユーエス・ホールディングス・エルエルシー	アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市ワン・ポスト・オフィス・スクエア	10,844株	10.00%

## 2【投資方針】

### （3）【運用体制】

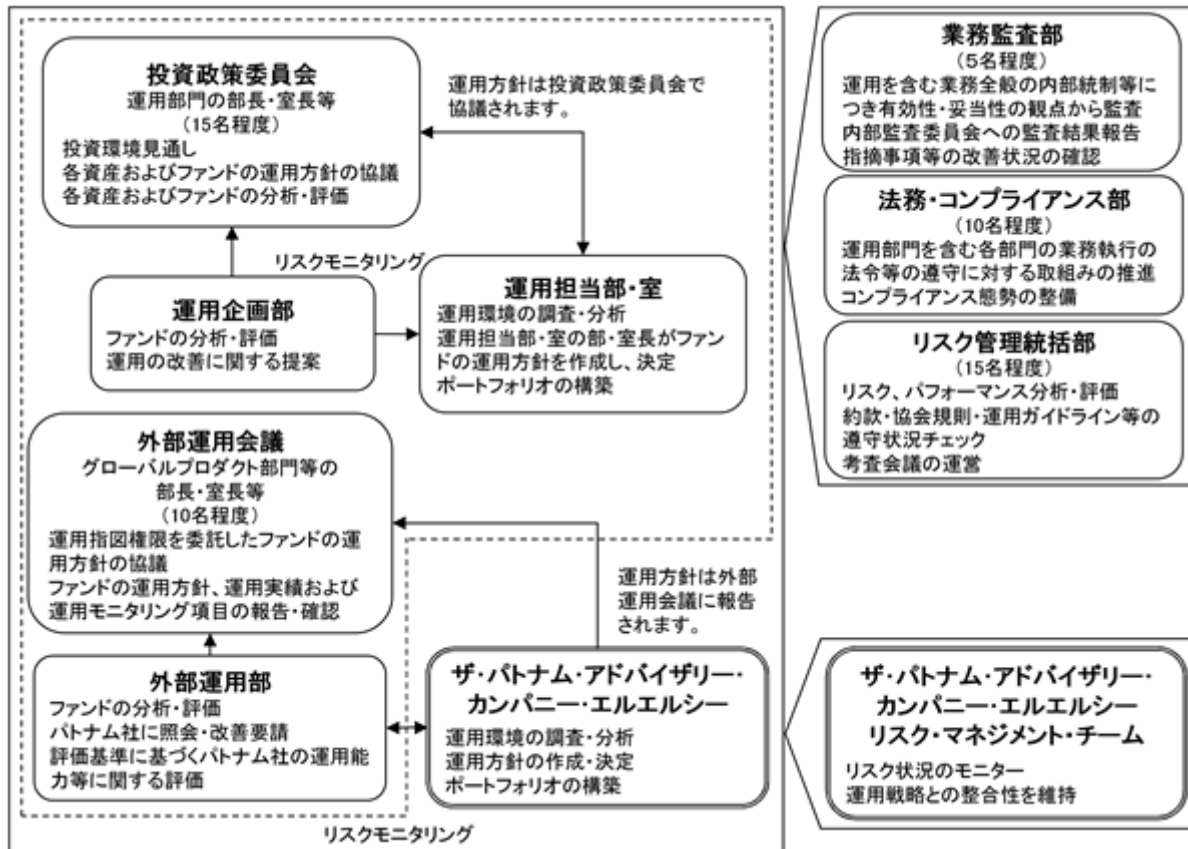
< 訂正前 >

委託会社の組織体制



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

## 内部管理体制および意思決定を監督する組織



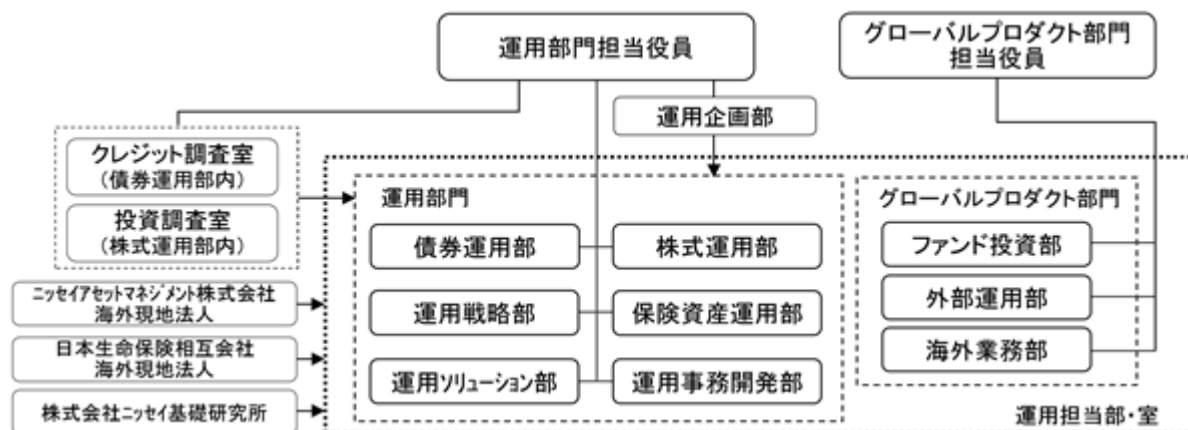
## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性について、監査人による報告書を定期的に受託会社より受取っています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

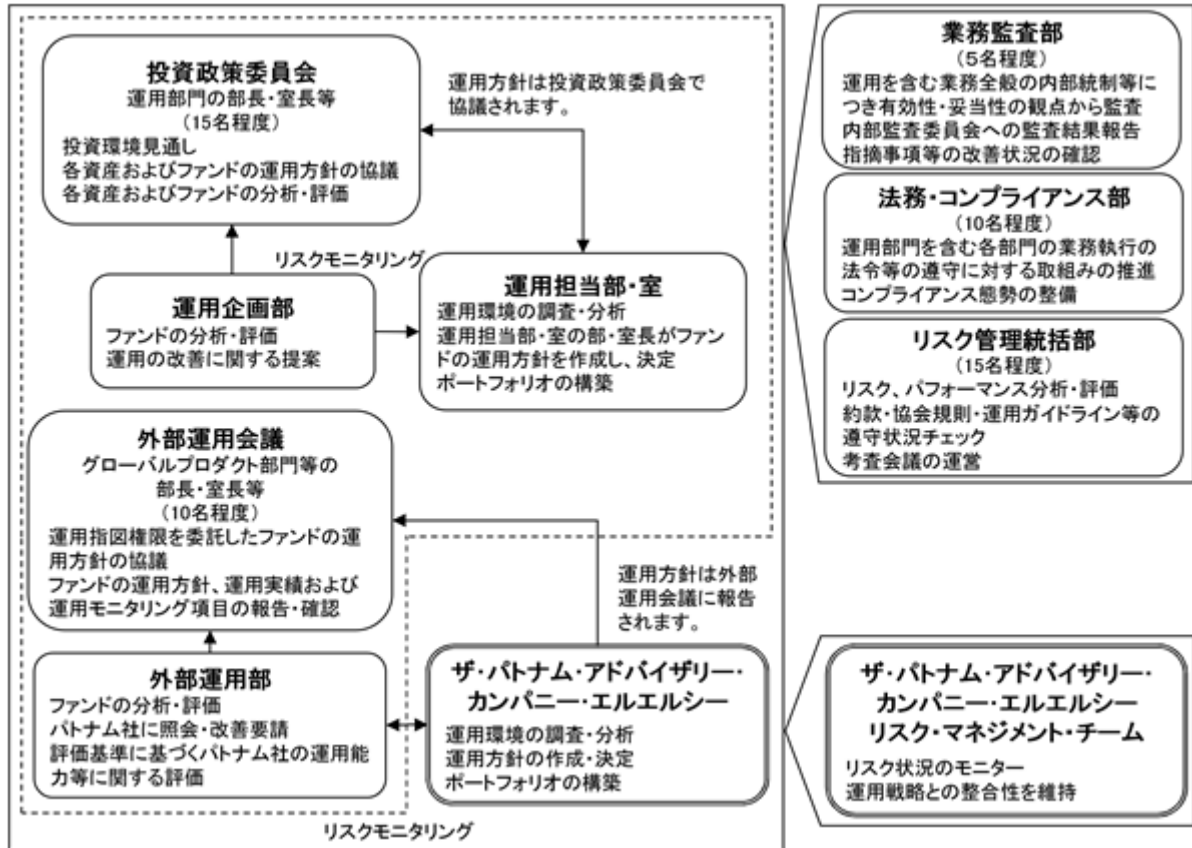
## &lt; 訂正後 &gt;

## 委託会社の組織体制



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

## 内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性について、監査人による報告書を定期的に受託会社より受取っています。

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

### 3【投資リスク】

<訂正前>

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。

ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の6の規定）の適用はありません。

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

株式は国内および国際的な景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、また業績悪化（倒産に至る場合も含む）等により、価格が下落することがあります。

##### ・債券投資リスク

###### 金利変動リスク

金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。

###### 信用リスク

債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。

##### ・為替変動リスク

原則として対円での為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、為替変動の影響を直接的に受けます。一般に円高局面ではファンドの資産価値が減少します。

##### ・資産配分リスク

ファンドは、投資対象資産の配分比率を機動的に変更する運用を行います。この資産配分がファンドの収益の源泉となる場合もありますが、投資対象資産が予期しない値動きをした場合、損失を被る可能性があります。

##### ・流動性リスク

市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

##### ・収益分配金に関する留意点

収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

##### ・短期金融資産の運用に関する留意点

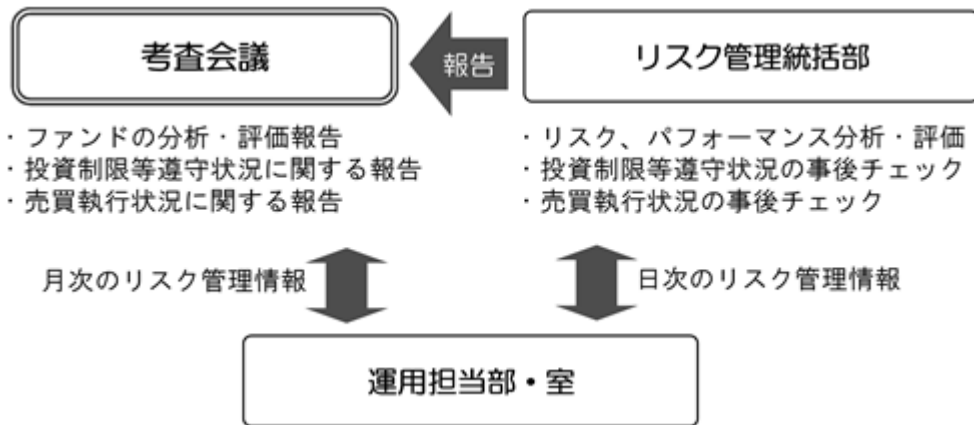
コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。

##### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。



## ( 2 ) 投資リスク管理体制

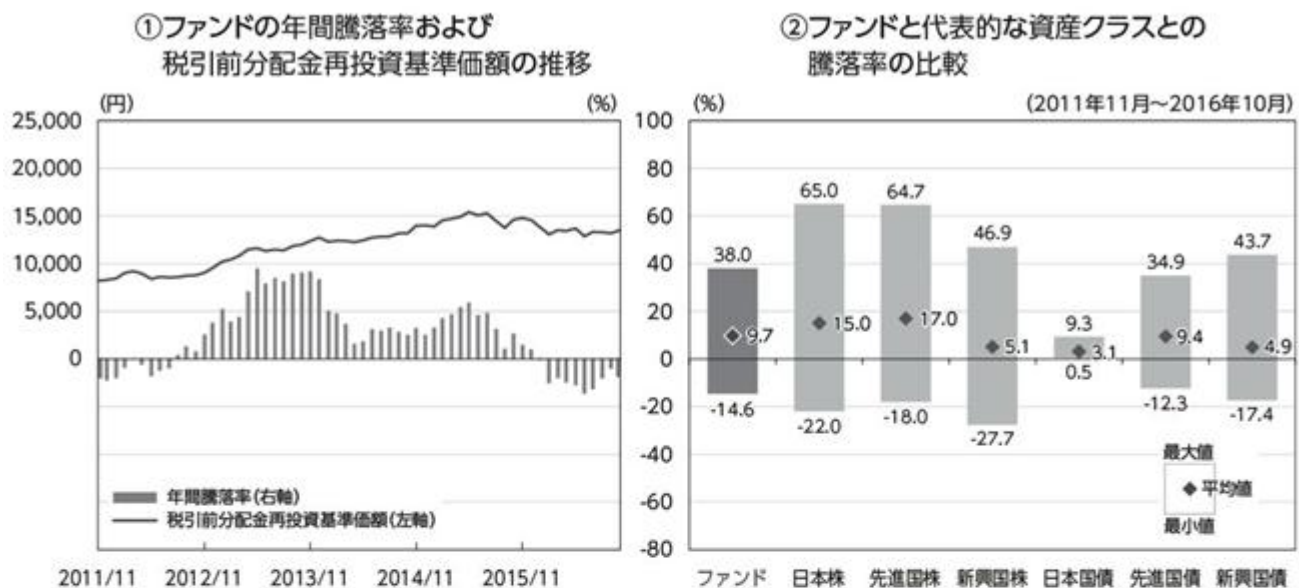


1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
  - ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
  - ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

上記投資リスク管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (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年間に於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。

<訂正後>

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。

ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の6の規定）の適用はありません。

## （１）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

### ・株式投資リスク

株式は国内および国際的な景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、また業績悪化（倒産に至る場合も含む）等により、価格が下落することがあります。

### ・債券投資リスク

#### 金利変動リスク

金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。

#### 信用リスク

債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。

### ・為替変動リスク

原則として対円での為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、為替変動の影響を直接的に受けます。一般に円高局面ではファンドの資産価値が減少します。

### ・資産配分リスク

ファンドは、投資対象資産の配分比率を機動的に変更する運用を行います。この資産配分がファンドの収益の源泉となる場合もありますが、投資対象資産が予期しない値動きをした場合、損失を被る可能性があります。

### ・流動性リスク

市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

### ・収益分配金に関する留意点

収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

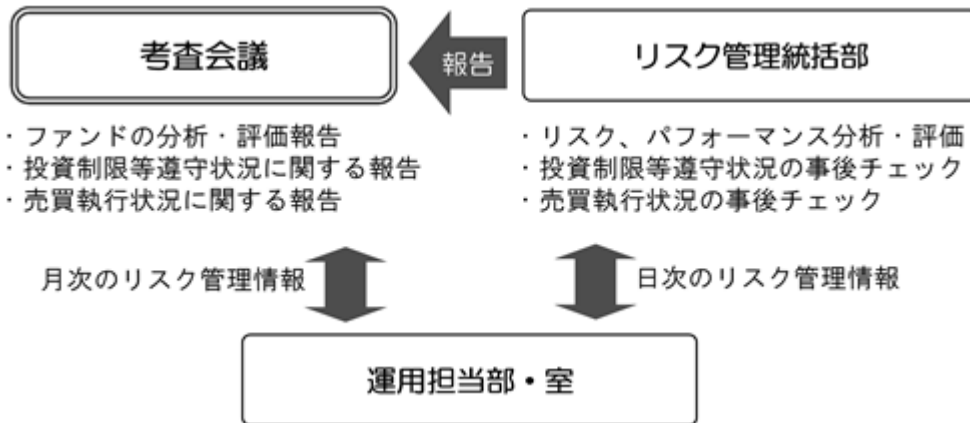
### ・短期金融資産の運用に関する留意点

コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。

### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

## （２）投資リスク管理体制



1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
  - ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
  - ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

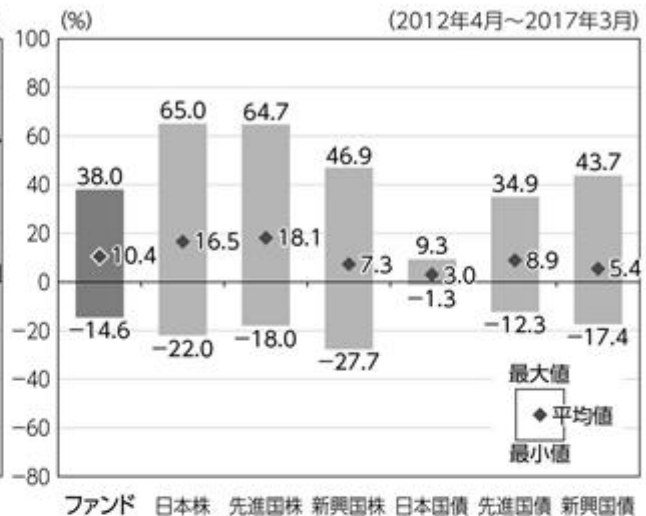
上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

**(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。

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIE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 … JPMオルガン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(以下「東証」といいます)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・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の商標または標章に関するすべての権利は東証が有しています。
- ・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。
- ・MSCIE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。
- ・JPMオルガン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」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

「DCニッセイバランスアクティブ」

(2017年3月31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	957,834,750	93.43
内 日本	957,834,750	93.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	67,364,963	6.57
純資産総額	1,025,199,713	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」

(2017年3月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	15,217,721,620	97.26
内 日本	15,217,721,620	97.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	429,337,024	2.74
純資産総額	15,647,058,644	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)	393,250,000	2.51
内 日本	393,250,000	2.51

(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」

(2017年3月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	18,394,371,312	96.52
内 日本	18,394,371,312	96.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	663,935,553	3.48
純資産総額	19,058,306,865	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)	450,840,000	2.37
内 日本	450,840,000	2.37

(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」

(2017年3月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	26,130,503,228	94.03
内 アメリカ	16,193,947,050	58.27
内 イギリス	2,329,124,131	8.38
内 アイルランド	1,348,930,745	4.85
内 カナダ	1,315,083,925	4.73
内 ドイツ	778,371,132	2.80
内 フランス	745,980,086	2.68
内 スペイン	565,404,852	2.03
内 イタリア	496,259,828	1.79
内 オランダ	469,281,353	1.69
内 スウェーデン	466,177,283	1.68
内 バミューダ	461,802,648	1.66
内 イギリス領バージン諸島	237,176,974	0.85
内 香港	220,910,340	0.79
内 スイス	190,657,929	0.69
内 ノルウェー	178,088,999	0.64
内 シンガポール	133,305,953	0.48
投資証券	380,515,042	1.37
内 アイルランド	217,510,201	0.78
内 イギリス	163,004,841	0.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,279,474,200	4.60
純資産総額	27,790,492,470	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」

(2017年3月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	9,584,587,248	85.81
内 アメリカ	3,457,120,204	30.95
内 イタリア	1,495,515,499	13.39
内 フランス	989,008,410	8.85
内 イギリス	810,046,581	7.25
内 スペイン	658,650,530	5.90
内 ドイツ	342,615,043	3.07
内 オランダ	265,113,046	2.37
内 ベルギー	254,445,447	2.28
内 オーストラリア	220,795,415	1.98
内 オーストリア	216,206,575	1.94
内 カナダ	198,388,080	1.78
内 ニュージーランド	112,782,340	1.01
内 アイルランド	101,155,119	0.91
内 メキシコ	99,565,317	0.89
内 南アフリカ	96,537,509	0.86
内 ポーランド	71,042,589	0.64
内 デンマーク	57,614,139	0.52
内 スイス	57,274,045	0.51
内 スウェーデン	56,357,456	0.50
内 ノルウェー	24,353,904	0.22
特殊債券	596,120,520	5.34
内 国際機関	355,296,527	3.18
内 ドイツ	140,601,287	1.26
内 アメリカ	50,247,756	0.45
内 フランス	49,974,950	0.45
社債券	581,239,182	5.20
内 アメリカ	581,239,182	5.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	407,142,013	3.65
純資産総額	11,169,088,963	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】

(2017年3月31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	351,747,419	1.0447 367,470,529	1.0216 359,345,163	- -	35.05%
2	ニッセイ/パトナム・海外株式マ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	142,765,894	1.9170 273,696,495	1.9043 271,869,091	- -	26.52%
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	171,681,620	1.4230 244,320,113	1.4225 244,217,104	- -	23.82%
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	31,904,674	2.5807 82,339,582	2.5828 82,403,392	- -	8.04%

(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	93.43
	小計		93.43
合計(対純資産総額比)			93.43

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

(2017年3月31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	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	861,600	749.00 645,338,400	699.70 602,861,520	- -	3.85%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	139,600	3,362.00 469,335,200	3,766.00 525,733,600	- -	3.36%
3	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	79,400	7,131.00 566,201,400	6,042.00 479,734,800	- -	3.07%
4	日本航空 日本	株式 空運業	113,600	3,544.00 402,598,400	3,526.00 400,553,600	- -	2.56%
5	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	110,600	3,782.97 418,396,516	3,618.00 400,150,800	- -	2.56%
6	エイチ・アイ・エス 日本	株式 サービス業	129,200	3,007.26 388,538,964	2,600.00 335,920,000	- -	2.15%
7	日本碍子 日本	株式 ガラス・土石 製品	133,100	2,358.00 313,849,800	2,520.00 335,412,000	- -	2.14%
8	ダイセル 日本	株式 化学	249,100	1,338.30 333,372,541	1,341.00 334,043,100	- -	2.13%
9	積水化学工業 日本	株式 化学	177,100	1,822.00 322,676,200	1,871.00 331,354,100	- -	2.12%
10	日本電産 日本	株式 電気機器	30,700	10,160.00 311,912,000	10,595.00 325,266,500	- -	2.08%
11	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	65,900	4,949.00 326,139,100	4,752.00 313,156,800	- -	2.00%
12	S M C 日本	株式 機械	9,500	28,580.00 271,510,000	32,920.00 312,740,000	- -	2.00%
13	参天製薬 日本	株式 医薬品	191,900	1,413.00 271,154,700	1,612.00 309,342,800	- -	1.98%
14	S O M P Oホールディングス 日本	株式 保険業	75,700	4,043.00 306,055,100	4,079.00 308,780,300	- -	1.97%
15	ラウンドワン 日本	株式 サービス業	339,100	793.00 268,906,300	885.00 300,103,500	- -	1.92%
16	日立金属 日本	株式 鉄鋼	182,400	1,602.20 292,242,482	1,562.00 284,908,800	- -	1.82%
17	マブチモーター 日本	株式 電気機器	45,400	6,340.00 287,836,000	6,270.00 284,658,000	- -	1.82%
18	日立製作所 日本	株式 電気機器	468,000	646.50 302,562,000	602.50 281,970,000	- -	1.80%
19	東京瓦斯 日本	株式 電気・ガス業	544,000	555.20 302,028,800	506.60 275,590,400	- -	1.76%
20	住友不動産 日本	株式 不動産業	94,000	3,161.00 297,134,000	2,886.00 271,284,000	- -	1.73%
21	日機装 日本	株式 精密機器	211,700	1,062.00 224,825,400	1,275.00 269,917,500	- -	1.73%
22	日野自動車 日本	株式 輸送用機器	199,800	1,249.18 249,587,023	1,347.00 269,130,600	- -	1.72%

23	東レ 日本	株式 繊維製品	272,000	970.13 263,875,522	987.00 268,464,000	- -	1.72%
24	住友電気工業 日本	株式 非鉄金属	145,400	1,688.50 245,507,900	1,846.00 268,408,400	- -	1.72%
25	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	65,700	4,842.00 318,119,400	4,083.00 268,253,100	- -	1.71%
26	エムスリー 日本	株式 サービス業	94,700	2,882.00 272,925,400	2,763.00 261,656,100	- -	1.67%
27	ユニプレス 日本	株式 輸送用機器	93,700	2,355.00 220,663,500	2,319.00 217,290,300	- -	1.39%
28	日揮 日本	株式 建設業	110,900	2,103.38 233,264,909	1,935.00 214,591,500	- -	1.37%
29	グローリー 日本	株式 機械	57,600	3,832.54 220,754,757	3,650.00 210,240,000	- -	1.34%
30	大塚商会 日本	株式 情報・通信業	34,000	5,650.00 192,100,000	6,040.00 205,360,000	- -	1.31%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	11.51
		輸送用機器	9.79
		銀行業	7.82
		情報・通信業	7.60
		サービス業	6.97
		医薬品	5.80
		化学	5.08
		機械	4.62
		食料品	4.21
		繊維製品	3.02
		保険業	2.99
		小売業	2.96
		陸運業	2.88
		精密機器	2.74
		不動産業	2.65
		非鉄金属	2.58
		空運業	2.56
		建設業	2.35
		ガラス・土石製品	2.14
		鉄鋼	1.82
		電気・ガス業	1.76
その他製品	1.13		
その他金融業	0.91		
卸売業	0.69		
倉庫・運輸関連業	0.68		
	小計		97.26
合計（対純資産総額比）			97.26

（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 2906月	買建	26	398,504,040	393,250,000	2.51%

(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

(2017年3月31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374回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	1,933,400,000	100.70 1,947,091,587	100.63 1,945,657,756	0.100000 2019/3/15	10.21%
2	第323回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	1,085,700,000	105.40 1,144,435,618	105.29 1,143,166,101	0.900000 2022/6/20	6.00%
3	第373回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	1,121,500,000	100.66 1,128,967,616	100.61 1,128,442,085	0.100000 2019/2/15	5.92%
4	第160回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	1,051,100,000	101.21 1,063,870,888	101.24 1,064,144,151	0.700000 2037/3/20	5.58%
5	第126回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	798,300,000	101.02 806,450,643	100.95 805,899,816	0.100000 2020/12/20	4.23%
6	第346回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	752,100,000	100.33 754,620,977	100.34 754,702,266	0.100000 2027/3/20	3.96%
7	第21回 物価連動国債 (10年) 日本	国債証券	540,000,000	105.41 569,223,450	104.80 565,934,512	0.100000 2026/3/10	2.97%
8	第132回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	418,900,000	120.04 502,849,777	119.72 501,532,214	1.700000 2031/12/20	2.63%
9	第158回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	496,000,000	97.23 482,283,710	97.91 485,658,400	0.500000 2036/9/20	2.55%
10	第129回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	414,400,000	100.85 417,922,400	101.07 418,863,088	0.100000 2021/9/20	2.20%
11	第128回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	327,600,000	122.12 400,087,704	122.30 400,677,732	1.900000 2031/6/20	2.10%
12	第34回 利付国債(3 0年) 日本	国債証券	292,100,000	133.13 388,878,875	132.26 386,357,749	2.200000 2041/3/20	2.03%
13	第123回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	359,600,000	100.73 362,225,080	100.83 362,591,872	0.100000 2020/3/20	1.90%
14	第370回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	338,200,000	100.60 340,229,200	100.55 340,090,538	0.100000 2018/11/15	1.78%
15	第146回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	274,800,000	120.82 332,018,008	120.17 330,232,656	1.700000 2033/9/20	1.73%

16	第125回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	250,700,000	126.21 316,429,784	126.30 316,636,607	2.200000 2031/3/20	1.66%
17	第330回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	288,300,000	105.82 305,099,241	105.68 304,681,206	0.800000 2023/9/20	1.60%
18	第127回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	245,600,000	121.79 299,123,769	122.17 300,056,888	1.900000 2031/3/20	1.57%
19	第157回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	307,700,000	92.02 283,175,030	92.79 285,514,830	0.200000 2036/6/20	1.50%
20	第118回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	220,200,000	123.64 272,255,280	122.93 270,691,860	2.000000 2030/6/20	1.42%
21	第116回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	211,600,000	126.04 266,700,640	125.26 265,056,508	2.200000 2030/3/20	1.39%
22	第53回 利付国債(3 0年) 日本	国債証券	271,000,000	93.87 254,395,460	93.84 254,325,370	0.600000 2046/12/20	1.33%
23	第140回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	202,600,000	120.75 244,644,082	119.97 243,077,454	1.700000 2032/9/20	1.28%
24	第340回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	226,200,000	103.31 233,690,160	103.29 233,657,814	0.400000 2025/9/20	1.23%
25	第344回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	214,900,000	100.38 215,716,620	100.51 216,013,182	0.100000 2026/9/20	1.13%
26	第153回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	190,300,000	112.06 213,261,569	113.16 215,351,092	1.300000 2035/6/20	1.13%
27	第144回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	180,600,000	117.10 211,497,048	117.02 211,352,568	1.500000 2033/3/20	1.11%
28	第113回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	196,600,000	100.78 198,133,480	100.66 197,899,526	0.300000 2018/6/20	1.04%
29	第17回 物価連動国債 (10年) 日本	国債証券	180,000,000	107.72 193,909,860	106.96 192,536,190	0.100000 2023/9/10	1.01%
30	第42回 利付国債(3 0年) 日本	国債証券	157,000,000	126.19 198,118,300	122.26 191,952,910	1.700000 2044/3/20	1.01%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	国内	国債証券	96.52
	小計		96.52
合計(対純資産総額比)			96.52

(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 2906月	買建	3	450,813,240	450,840,000	2.37%

(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

(2017年3月31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	9,037	89,101.29 805,208,430	93,285.98 843,025,446	- -	3.03%
2	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	5,700	86,288.02 491,841,732	98,316.58 560,404,532	- -	2.02%
3	NORFOLK SOUTHERN CORP アメリカ	株式 運輸	37,100	12,861.76 477,171,463	12,817.70 475,536,948	- -	1.71%
4	MICRON TECHNOLOGY INC アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	144,000	2,283.06 328,761,576	3,250.14 468,020,779	- -	1.68%
5	ASSURED GUARANTY LTD バミューダ	株式 保険	111,100	4,323.80 480,374,468	4,156.63 461,802,648	- -	1.66%
6	SUNCOR ENERGY INC カナダ	株式 エネルギー	129,782	3,633.37 471,546,916	3,462.01 449,307,814	- -	1.62%
7	E*TRADE FINANCIAL アメリカ	株式 各種金融	108,100	3,903.09 421,924,039	3,913.18 423,015,536	- -	1.52%
8	EXELON CORP アメリカ	株式 公益事業	100,800	4,010.79 404,287,884	4,005.18 403,722,446	- -	1.45%
9	IMPERIAL BRANDS PLC イギリス	株式 食品・飲料・タ バコ	72,247	4,977.04 359,576,382	5,381.17 388,773,619	- -	1.40%
10	WIX.COM LTD アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	50,900	4,874.65 248,119,964	7,387.71 376,034,515	- -	1.35%
11	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	35,600	8,762.03 311,928,588	9,986.03 355,502,735	- -	1.28%
12	NRG ENERGY INC アメリカ	株式 公益事業	172,100	1,441.64 248,106,502	2,060.93 354,686,104	- -	1.28%
13	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP アメリカ	株式 保険	49,068	7,465.12 366,298,635	7,019.72 344,444,028	- -	1.24%

14	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	135,948	2,185.24 297,080,095	2,363.14 321,265,461	- -	1.16%
15	RADIAN GROUP INC アメリカ	株式 銀行	157,880	1,982.39 312,980,885	2,008.20 317,054,773	- -	1.14%
16	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC アメリカ	株式 素材	95,000	3,173.85 301,516,234	3,328.67 316,224,343	- -	1.14%
17	SEALED AIR CORP アメリカ	株式 素材	63,700	5,286.39 336,743,221	4,857.82 309,443,579	- -	1.11%
18	CALPINE CORP アメリカ	株式 公益事業	245,600	1,309.25 321,553,592	1,215.01 298,408,347	- -	1.07%
19	BARD (C.R.) INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	10,700	24,718.82 264,491,402	27,883.70 298,355,617	- -	1.07%
20	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD カナダ	株式 保険	5,700	50,889.36 290,069,403	52,112.68 297,042,281	- -	1.07%
21	UNILEVER NV オランダ	株式 家庭用品・パーソナル用品	52,665	4,664.02 245,630,806	5,597.18 294,775,892	- -	1.06%
22	ASSA ABLOY AB スウェーデン	株式 資本財	125,803	2,162.36 272,032,004	2,310.45 290,662,170	- -	1.05%
23	KRAFT HEINZ CO/THE アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	28,300	9,716.41 274,974,565	10,220.50 289,240,404	- -	1.04%
24	COMPASS GROUP PLC イギリス	株式 消費者サービス	132,995	2,005.73 266,753,009	2,113.80 281,125,788	- -	1.01%
25	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバコ	76,089	3,786.52 288,113,147	3,635.07 276,589,297	- -	1.00%
26	COMPUTER SCIENCES CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	34,000	6,834.61 232,376,903	7,982.31 271,398,829	- -	0.98%
27	BANK OF IRELAND アイルランド	株式 銀行	9,538,469	28.19 268,979,023	28.15 268,514,101	- -	0.97%
28	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC アメリカ	株式 保険	49,810	5,366.04 267,282,835	5,363.80 267,171,072	- -	0.96%
29	EURAZEO フランス	株式 各種金融	34,931	6,520.16 227,756,047	7,295.21 254,829,015	- -	0.92%
30	RE/MAX HOLDINGS INC-CL A アメリカ	株式 不動産	38,816	6,170.44 239,512,187	6,490.19 251,923,273	- -	0.91%

(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	ソフトウェア・サービス	10.33
		保険	7.96
		素材	7.92
		食品・飲料・タバコ	7.86
		エネルギー	7.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.82
		電気通信サービス	4.71
		資本財	4.39
		公益事業	4.33
		小売	4.19
		半導体・半導体製造装置	3.62
		銀行	3.38
		消費者サービス	3.25
		ヘルスケア機器・サービス	3.20
		各種金融	3.06
		耐久消費財・アパレル	3.05
		運輸	2.46
		メディア	2.13
		食品・生活必需品小売り	1.59
		不動産	1.47
		家庭用品・パーソナル用品	1.06
		自動車・自動車部品	0.87
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.71
		商業・専門サービス	0.52
その他	0.13		
	小計		94.03
投資証券	外国	投資証券	1.37
	小計		1.37
合 計（対純資産総額比）			95.40

（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。

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。



(参考情報)

「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

(2017年3月31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	973,809,200	100.54 979,096,983	101.06 984,228,958	2.125000 2021/6/30	8.81%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	807,768,000	98.79 798,042,473	99.05 800,126,514	1.000000 2019/8/31	7.16%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	729,235,000	93.45 681,538,204	95.19 694,224,427	2.750000 2042/8/15	6.22%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	509,342,600	102.43 521,755,279	103.28 526,054,130	2.750000 2024/2/15	4.71%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	463,793,460	97.12 450,451,472	97.56 452,486,175	2.000000 2025/2/15	4.05%
6	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	392,911,200	117.06 459,969,354	115.06 452,103,272	3.250000 2021/10/25	4.05%
7	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	421,780,590	101.70 428,955,077	100.97 425,880,297	0.700000 2020/5/1	3.81%
8	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	285,100,200	123.50 352,104,449	120.05 342,277,045	4.750000 2023/8/1	3.06%
9	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	293,485,500	100.73 295,648,488	100.59 295,231,738	0.300000 2018/10/15	2.64%
10	UK TSY 3 1/4% 2044 イギリス	国債証券	221,326,400	124.60 275,794,827	131.45 290,949,045	3.250000 2044/1/22	2.60%
11	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	274,319,100	100.65 276,107,660	98.62 270,536,239	0.500000 2025/5/25	2.42%
12	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	155,727,000	144.91 225,676,453	139.04 216,527,492	6.500000 2027/11/1	1.94%
13	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券	184,476,600	118.41 218,447,965	117.19 216,206,575	3.500000 2021/9/15	1.94%
14	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券	182,080,800	113.24 206,201,169	113.28 206,272,055	2.250000 2022/7/15	1.85%
15	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	160,518,600	124.07 199,168,268	122.43 196,535,763	4.400000 2023/10/31	1.76%
16	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	141,352,200	137.67 194,603,814	133.61 188,871,982	2.500000 2044/7/4	1.69%
17	AUSTRALIAN GOVERNMENT オーストラリア	国債証券	157,945,600	117.51 185,608,192	117.78 186,044,122	5.500000 2023/4/21	1.67%
18	EFSF 国際機関	特殊債券	162,914,400	113.59 185,065,870	112.13 182,685,691	2.250000 2022/9/5	1.64%
19	UK TSY 2 3/4% 2024 イギリス	国債証券	128,873,600	112.03 144,389,981	114.18 147,158,186	2.750000 2024/9/7	1.32%
20	KFW ドイツ	特殊債券	132,384,200	106.34 140,790,596	106.20 140,601,287	4.000000 2020/1/27	1.26%
21	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	131,769,000	106.97 140,961,205	105.77 139,376,024	4.100000 2018/7/30	1.25%
22	EUROPEAN UNION 国際機関	特殊債券	132,966,900	104.83 139,393,190	103.82 138,056,872	3.250000 2018/4/4	1.24%
23	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	103,019,400	135.97 140,080,629	126.66 130,487,462	4.750000 2044/9/1	1.17%
24	UK TSY 1.75% 2022 イギリス	国債証券	119,068,000	105.24 125,309,544	106.65 126,989,594	1.750000 2022/9/7	1.14%

25	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	82,655,100	161.94 133,859,934	152.84 126,338,320	4.500000 2041/4/25	1.13%
26	CANADIAN GOVERNMENT カナダ	国債証券	115,148,500	107.42 123,702,882	107.94 124,298,199	2.750000 2022/6/1	1.11%
27	TSY 3 3/4% 2019 イギリス	国債証券	110,663,200	109.70 121,399,743	108.87 120,480,132	3.750000 2019/9/7	1.08%
28	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	83,853,000	137.92 115,650,896	135.04 113,235,929	5.150000 2028/10/31	1.01%
29	NEW ZEALAND GOVERNMENT ニュージーランド	国債証券	98,037,500	114.31 112,069,607	115.04 112,782,340	5.500000 2023/4/15	1.01%
30	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	81,457,200	125.97 102,617,336	123.91 100,940,133	4.250000 2022/9/28	0.90%

(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	85.81
		特殊債券	5.34
		社債券	5.20
	小計	96.35	
合計(対純資産総額比)			96.35

(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】

2017年3月31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12計算期間末 (2007年9月20日)	548,987,708	548,987,708	1.2702	1.2702
第13計算期間末 (2008年3月21日)	473,348,432	473,348,432	1.0769	1.0769
第14計算期間末 (2008年9月22日)	486,614,230	486,614,230	1.0590	1.0590
第15計算期間末 (2009年3月23日)	377,995,817	377,995,817	0.8152	0.8152
第16計算期間末 (2009年9月24日)	414,915,163	414,915,163	0.9269	0.9269
第17計算期間末 (2010年3月23日)	423,144,417	423,144,417	0.9327	0.9327
第18計算期間末 (2010年9月21日)	419,602,211	419,602,211	0.8907	0.8907
第19計算期間末 (2011年3月22日)	435,154,538	435,154,538	0.9034	0.9034
第20計算期間末 (2011年9月20日)	417,148,183	417,148,183	0.8297	0.8297
第21計算期間末 (2012年3月21日)	478,472,469	478,472,469	0.9218	0.9218
第22計算期間末 (2012年9月20日)	471,218,750	471,218,750	0.8811	0.8811
第23計算期間末 (2013年3月21日)	594,834,162	594,834,162	1.0955	1.0955
第24計算期間末 (2013年9月20日)	660,108,706	660,108,706	1.2013	1.2013
第25計算期間末 (2014年3月20日)	686,313,375	686,313,375	1.2187	1.2187
第26計算期間末 (2014年9月22日)	858,448,206	858,448,206	1.3214	1.3214
第27計算期間末 (2015年3月20日)	935,825,170	935,825,170	1.4772	1.4772
第28計算期間末 (2015年9月24日)	923,956,556	923,956,556	1.3922	1.3922
第29計算期間末 (2016年3月22日)	914,192,515	914,192,515	1.3468	1.3468
第30計算期間末 (2016年9月20日)	936,401,106	936,401,106	1.3117	1.3117
第31計算期間末 (2017年3月21日)	1,030,749,562	1,030,749,562	1.4660	1.4660
2016年3月末日	922,190,689	-	1.3511	-
4月末日	914,397,203	-	1.3429	-
5月末日	977,532,670	-	1.3693	-
6月末日	915,584,504	-	1.2857	-
7月末日	948,879,544	-	1.3332	-
8月末日	951,127,856	-	1.3279	-
9月末日	941,207,788	-	1.3192	-

10月末日	962,471,063	-	1.3507	-
11月末日	1,003,062,249	-	1.4027	-
12月末日	1,029,734,831	-	1.4441	-
2017年1月末日	1,035,108,405	-	1.4416	-
2月末日	1,027,225,166	-	1.4552	-
3月末日	1,025,199,713	-	1.4502	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
第25計算期間	0.0000
第26計算期間	0.0000
第27計算期間	0.0000
第28計算期間	0.0000
第29計算期間	0.0000
第30計算期間	0.0000
第31計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第30計算期間	2.6
第31計算期間	11.8

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

## 「DCニッセイバランスアクティブ」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第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
第30計算期間	55,479,803	20,389,661	713,886,539
第31計算期間	35,319,541	46,090,522	703,115,558

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt; 参考情報 &gt;



### 3.運用実績

2017年3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	14,502円
純資産総額	10億円

#### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

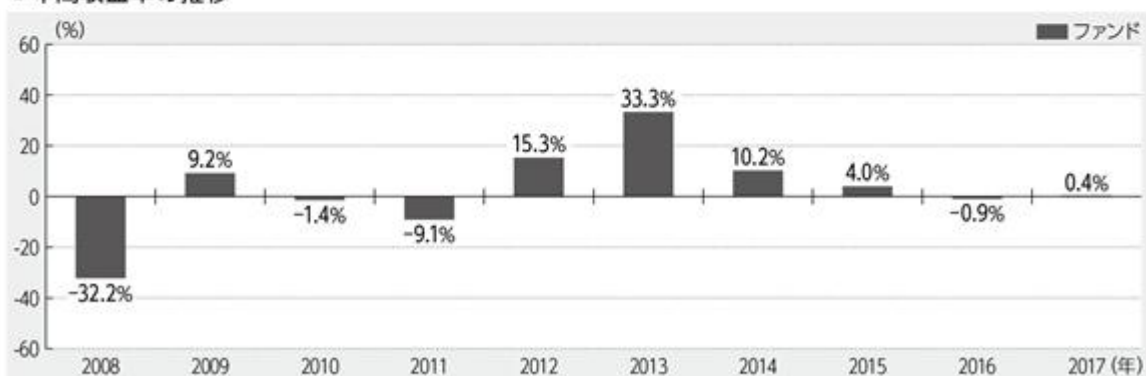
2015年 3月	0円
2015年 9月	0円
2016年 3月	0円
2016年 9月	0円
2017年 3月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

#### ● 資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

#### ● 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。

・2017年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

■ 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。

2017年3月末現在

## 3.運用実績

## ●マザーファンドの状況

## 1. ニッセイ国内株式マザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	4.0%
2	ソニー	3.5%
3	トヨタ自動車	3.2%
4	日本航空	2.6%
5	日本たばこ産業	2.6%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2. ニッセイ国内債券マザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第374回 利付国債(2年)	2019/03/15	0.100%	10.3%
2	第323回 利付国債(10年)	2022/06/20	0.900%	6.1%
3	第373回 利付国債(2年)	2019/02/15	0.100%	6.0%
4	第160回 利付国債(20年)	2037/03/20	0.700%	5.6%
5	第126回 利付国債(5年)	2020/12/20	0.100%	4.3%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 3. ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	業種	比率
1	アルファベット(C)	アメリカ	情報技術	3.2%
2	アマゾン・ドット・コム	アメリカ	一般消費財・サービス	2.1%
3	ノーフォーク・サザン	アメリカ	資本財・サービス	1.8%
4	マイクロン・テクノロジー	アメリカ	情報技術	1.8%
5	アシュアード・ギャランティー	アメリカ	金融	1.7%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&amp;PおよびMSCI Inc.に帰属します。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 4. ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	アメリカ	2021/06/30	2.125%	8.8%
2	アメリカ国債	アメリカ	2019/08/31	1.000%	7.2%
3	アメリカ国債	アメリカ	2042/08/15	2.750%	6.2%
4	アメリカ国債	アメリカ	2024/02/15	2.750%	4.7%
5	アメリカ国債	アメリカ	2025/02/15	2.000%	4.1%

・比率は対純資産総額比です。

## 組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	11.8%
2	輸送用機器	10.1%
3	銀行業	8.0%
4	情報・通信業	7.8%
5	サービス業	7.2%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 組入債券種別

	種別	比率
	日本国債	100.0%
	その他	-

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	64.4%
2	イギリス	10.3%
3	カナダ	4.9%
4	アイルランド	4.0%
5	ドイツ	3.0%

・国・地域はパトナム社の分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	36.6%
2	イタリア	13.4%
3	フランス	9.3%
4	イギリス	7.3%
5	スペイン	5.9%

・比率は対純資産総額比です。

■ 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」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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31期計算期間（2016年9月21日から2017年3月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイバランスアクティブ】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第30期 (2016年9月20日現在)	第31期 (2017年3月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	762,425	487,514
コール・ローン	42,983,175	37,906,953
親投資信託受益証券	888,553,093	999,432,809
未収入金	10,670,000	-
流動資産合計	942,968,693	1,037,827,276
資産合計	942,968,693	1,037,827,276
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	501,302	540,276
未払委託者報酬	6,016,214	6,483,680
その他未払費用	50,071	53,758
流動負債合計	6,567,587	7,077,714
負債合計	6,567,587	7,077,714
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	713,886,539	703,115,558
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	222,514,567	327,634,004
純資産合計	936,401,106	1,030,749,562
負債純資産合計	942,968,693	1,037,827,276

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第30期 (自2016年3月23日 至2016年9月20日)	第31期 (自2016年9月21日 至2017年3月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	211	441
有価証券売買等損益	17,292,266	116,949,716
営業収益合計	17,292,055	116,950,157
<b>営業費用</b>		
支払利息	13,500	14,512
受託者報酬	501,302	540,276
委託者報酬	6,016,214	6,483,680
その他費用	51,166	54,461
営業費用合計	6,582,182	7,092,929
営業利益又は営業損失( )	23,874,237	109,857,228
経常利益又は経常損失( )	23,874,237	109,857,228
当期純利益又は当期純損失( )	23,874,237	109,857,228
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( )	452,222	5,152,314
期首剰余金又は期首欠損金( )	235,396,118	222,514,567
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,584,652	14,898,145
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	17,584,652	14,898,145
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,044,188	14,483,622
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,044,188	14,483,622
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( )	222,514,567	327,634,004

## (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、当計算期間末日が休業日のため、2016年9月21日から2017年3月21日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第30期 (2016年9月20日現在)	第31期 (2017年3月21日現在)
1. 受益権総口数	713,886,539口	703,115,558口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3117円 (13,117円)	1.4660円 (14,660円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第30期 (自2016年3月23日 至2016年9月20日)	第31期 (自2016年9月21日 至2017年3月21日)
1. 投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用	713,069円	753,060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(308,316,378円)及び分配準備積立金(232,191,957円)より分配対象収益は540,508,335円(1口当たり0.757135円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	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(4,113,735円)、収益調整金(314,743,820円)及び分配準備積立金(217,608,986円)より分配対象収益は536,466,541円(1口当たり0.762985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30期 (自2016年3月23日 至2016年9月20日)	第31期 (自2016年9月21日 至2017年3月21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30期 (2016年9月20日現在)	第31期 (2017年3月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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30期 (2016年9月20日現在)	第31期 (2017年3月21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	14,038,357	104,007,430
合計	14,038,357	104,007,430

(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30期 (2016年9月20日現在)	第31期 (2017年3月21日現在)
期首元本額	678,796,397円	713,886,539円
期中追加設定元本額	55,479,803円	35,319,541円
期中一部解約元本額	20,389,661円	46,090,522円

## ( 4 ) 【附属明細表】（2017年3月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	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	382,001,167	399,076,619	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	171,681,620	244,320,113	
	ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド	142,765,894	273,696,495	
	ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド	31,904,674	82,339,582	
親投資信託受益証券 合計		728,353,355	999,432,809	
合計		728,353,355	999,432,809	

## 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）

	（2016年9月20日現在）	（2017年3月21日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,560,524	1,930,012
コール・ローン	257,108,463	150,069,393
株式	15,360,200,340	15,686,096,120
未収入金	187,976,957	-
未収配当金	3,409,500	22,082,250
前払金	7,055,000	945,000
差入委託証拠金	10,200,000	5,400,000
流動資産合計	15,830,510,784	15,866,522,775
資産合計	15,830,510,784	15,866,522,775
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,214,180	859,860
未払金	186,992,536	-
未払解約金	24,730,754	17,610,241
その他未払費用	425	470
流動負債合計	217,937,895	18,470,571
負債合計	217,937,895	18,470,571
純資産の部		
元本等		
元本	18,162,724,636	15,169,665,478
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,550,151,747	678,386,726
純資産合計	15,612,572,889	15,848,052,204
負債純資産合計	15,830,510,784	15,866,522,775



## 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>
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>
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>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2016年9月20日現在）	（2017年3月21日現在）
1. 受益権総口数	18,162,724,636口	15,169,665,478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	2,550,151,747円	
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8596円 (8,596円)	1.0447円 (10,447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 2016年3月23日 至 2016年9月20日）	（自 2016年9月21日 至 2017年3月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	1,363,559,276	323,600,365
合計	1,363,559,276	323,600,365

## (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	(2016年9月20日 現在)				(2017年3月21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	227,630,000	-	221,425,000	6,205,000	140,265,000	-	139,410,000	855,000
合計	227,630,000	-	221,425,000	6,205,000	140,265,000	-	139,410,000	855,000

## (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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	19,292,969,644円	18,162,724,636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	2,470,744,641円	975,505,780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	3,600,989,649円	3,968,564,938円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(債券重視型)	397,050,817円	293,404,940円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(標準型)	339,310,798円	279,230,970円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(株式重視型)	228,047,013円	194,532,221円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(標準型)VA(適格機関投資家専用)	82,217,422円	58,793,980円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	1,079,513,003円	769,811,080円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,165,127,832円	2,307,112,150円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(株式重視型)SA(適格機関投資家限定)	881,938,474円	823,138,736円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(債券重視型)	1,335,357,044円	1,146,256,099円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(標準型)	4,962,907,855円	4,430,422,894円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(株式重視型)	3,578,267,391円	3,347,985,912円
DCニッセイ国内株式アクティブ	544,830,274円	519,936,781円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	1,172,518,319円	617,038,548円
DCニッセイバランスアクティブ	395,638,394円	382,001,167円
計	18,162,724,636円	15,169,665,478円

## 附属明細表(2017年3月21日現在)

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日揮	110,900	2,075.00	230,117,500	
大気社	56,000	2,911.00	163,016,000	
日本M&Aセンター	53,200	3,650.00	194,180,000	
江崎グリコ	29,000	5,600.00	162,400,000	
エムスリー	94,700	2,785.00	263,739,500	
サントリー食品インターナショナル	21,700	4,715.00	102,315,500	
日本たばこ産業	110,600	3,856.00	426,473,600	
コスモス薬品	8,200	22,170.00	181,794,000	
セブン&アイ・ホールディングス	29,200	4,421.00	129,093,200	
東レ	272,000	1,001.00	272,272,000	
T S Iホールディングス	254,200	797.00	202,597,400	
オプティム	7,500	5,820.00	43,650,000	
GMOペイメントゲートウェイ	31,200	5,660.00	176,592,000	
住友化学	207,000	656.00	135,792,000	
協和発酵キリン	114,000	1,717.00	195,738,000	
ダイセル	249,100	1,360.00	338,776,000	
積水化学工業	177,100	1,964.00	347,824,400	
アステラス製薬	49,600	1,517.00	75,243,200	
塩野義製薬	35,200	5,635.00	198,352,000	
日本新薬	21,700	5,860.00	127,162,000	
参天製薬	191,900	1,678.00	322,008,200	
ラウンドワン	339,100	861.00	291,965,100	
大塚商会	34,000	5,900.00	200,600,000	
日本碍子	133,100	2,509.00	333,947,900	
日立金属	182,400	1,588.00	289,651,200	
UACJ 新	462,000	289.00	133,518,000	
住友電気工業	145,400	1,887.50	274,442,500	
ユニプレス	93,700	2,432.00	227,878,400	
S M C	9,500	33,270.00	316,065,000	
クボタ	119,500	1,769.00	211,395,500	
日機装	211,700	1,236.00	261,661,200	
グローリー	57,600	3,950.00	227,520,000	
日立製作所	468,000	627.90	293,857,200	
マブチモーター	45,400	6,440.00	292,376,000	
日本電産	30,700	10,735.00	329,564,500	
ソニー	139,600	3,627.00	506,329,200	
イリソ電子工業	25,500	7,040.00	179,520,000	
カシオ計算機	130,000	1,636.00	212,680,000	
トヨタ自動車	79,400	6,373.00	506,016,200	
日野自動車	199,800	1,414.00	282,517,200	
スズキ	35,800	4,781.00	171,159,800	
富士重工業	65,700	4,312.00	283,298,400	
日本精機	55,000	2,456.00	135,080,000	
ユナイテッドアローズ	46,700	3,390.00	158,313,000	
シークス	20,500	4,440.00	91,020,000	
朝日インテック	34,200	4,460.00	152,532,000	
バンダイナムコホールディングス	53,000	3,530.00	187,090,000	
三菱商事	6,800	2,491.00	16,938,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	861,600	745.70	642,495,120	
三井住友トラスト・ホールディングス	40,700	3,999.00	162,759,300	
三井住友フィナンシャルグループ	36,700	4,266.00	156,562,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	237,000	491.00	116,367,000	
静岡銀行	222,000	953.00	211,566,000	
三菱UFJリース	256,800	591.00	151,768,800	

SOMPOホールディングス	75,700	4,358.00	329,900,600	
T&Dホールディングス	98,200	1,772.00	174,010,400	
住友不動産	94,000	3,015.00	283,410,000	
タカラレーベン	290,000	535.00	155,150,000	
東日本旅客鉄道	19,500	9,913.00	193,303,500	
西武ホールディングス	58,300	1,914.00	111,586,200	
トランコム	18,500	5,560.00	102,860,000	
山九	230,000	730.00	167,900,000	
日本航空	113,600	3,701.00	420,433,600	
日本電信電話	65,900	4,946.00	325,941,400	
KDDI	39,200	3,040.00	119,168,000	
東京瓦斯	544,000	513.40	279,289,600	
エイチ・アイ・エス	129,200	2,779.00	359,046,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	50,200	3,510.00	176,202,000	
ソフトバンクグループ	23,000	8,274.00	190,302,000	
合計	8,852,200		15,686,096,120	

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)

	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	13,056,002	8,095,191
コール・ローン	736,057,657	629,446,928
国債証券	18,493,036,270	18,743,607,066
派生商品評価勘定	1,475,680	-
未収入金	1,098,221,315	2,432,495,438
未収利息	11,243,784	10,299,631
前払金	-	420,000
前払費用	1,167,348	5,633,056
差入委託証拠金	4,080,000	2,070,000
流動資産合計	20,358,338,056	21,832,067,310
<b>資産合計</b>	<b>20,358,338,056</b>	<b>21,832,067,310</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	-	3,240
前受金	560,000	-
未払金	1,098,792,889	2,435,368,764
未払解約金	22,347,985	16,483,437
その他未払費用	1,100	1,970
流動負債合計	1,121,701,974	2,451,857,411
<b>負債合計</b>	<b>1,121,701,974</b>	<b>2,451,857,411</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	13,305,961,371	13,618,586,113
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,930,674,711	5,761,623,786
<b>純資産合計</b>	<b>19,236,636,082</b>	<b>19,380,209,899</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>20,358,338,056</b>	<b>21,832,067,310</b>

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2016年9月20日現在）	（2017年3月21日現在）
1. 受益権総口数	13,305,961,371口	13,618,586,113口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4457円 (14,457円)	1.4231円 (14,231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 2016年3月23日 至 2016年9月20日）	（自 2016年9月21日 至 2017年3月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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、債券先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、市場金利の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21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	281,060,683	25,431,726
合計	281,060,683	25,431,726

## (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	(2016年9月20日 現在)				(2017年3月21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	606,240,000	-	607,720,000	1,480,000	450,810,000	-	450,810,000	-
合計	606,240,000	-	607,720,000	1,480,000	450,810,000	-	450,810,000	-

## (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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	14,058,314,239円	13,305,961,371円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	1,687,196,794円	2,163,013,002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	2,439,549,662円	1,850,388,260円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	638,248,296円	596,889,525円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	231,341,189円	241,002,701円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	49,992,678円	53,969,898円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	56,055,389円	50,765,280円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,734,927,090円	1,552,901,304円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	2,158,033,918円	1,974,574,797円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	193,340,025円	226,449,683円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）	2,146,663,132円	2,332,028,669円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）	3,384,770,360円	3,823,762,818円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）	784,486,742円	928,754,393円
DCニッセイ国内債券アクティブ	1,356,496,370円	1,386,552,873円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	370,239,102円	244,644,327円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	28,116,649円	27,363,847円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	8,435,615円	7,244,378円
DCニッセイバランスアクティブ	164,814,816円	171,681,620円
計	13,305,961,371円	13,618,586,113円

## 附属明細表(2017年3月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
国債証券	第369回 利付国債(2年)	56,400,000	56,740,656	
	第370回 利付国債(2年)	338,200,000	340,354,334	
	第372回 利付国債(2年)	256,300,000	258,099,226	
	第374回 利付国債(2年)	690,500,000	695,506,125	
	第113回 利付国債(5年)	196,600,000	198,058,772	
	第116回 利付国債(5年)	150,700,000	151,967,387	
	第118回 利付国債(5年)	158,000,000	159,531,020	
	第119回 利付国債(5年)	171,400,000	172,675,216	
	第120回 利付国債(5年)	163,700,000	165,425,398	
	第123回 利付国債(5年)	359,600,000	362,843,592	
	第125回 利付国債(5年)	71,700,000	72,418,434	
	第126回 利付国債(5年)	798,300,000	806,722,065	
	第129回 利付国債(5年)	414,400,000	419,277,488	
	第1回 利付国債(40年)	7,900,000	11,234,353	
	第2回 利付国債(40年)	41,800,000	57,437,798	
	第7回 利付国債(40年)	2,100,000	2,613,366	
	第8回 利付国債(40年)	9,300,000	10,692,117	
	第9回 利付国債(40年)	90,000,000	74,123,100	
	第297回 利付国債(10年)	800,000	823,424	
	第323回 利付国債(10年)	1,446,700,000	1,525,371,546	
	第328回 利付国債(10年)	178,300,000	185,877,750	
	第333回 利付国債(10年)	1,715,600,000	1,795,718,520	
	第335回 利付国債(10年)	9,700,000	10,086,157	
	第339回 利付国債(10年)	132,700,000	137,075,119	
	第340回 利付国債(10年)	226,200,000	233,687,220	
	第343回 利付国債(10年)	144,000,000	144,928,800	
	第344回 利付国債(10年)	214,900,000	216,118,483	
	第345回 利付国債(10年)	1,156,700,000	1,162,298,428	
	第346回 利付国債(10年)	672,100,000	674,768,237	
	第26回 利付国債(30年)	76,600,000	101,756,972	
	第27回 利付国債(30年)	40,200,000	54,338,742	
	第28回 利付国債(30年)	67,500,000	91,580,625	
	第29回 利付国債(30年)	103,600,000	138,973,184	
	第30回 利付国債(30年)	9,600,000	12,733,536	
	第34回 利付国債(30年)	292,100,000	385,668,393	
	第37回 利付国債(30年)	1,900,000	2,401,049	
	第39回 利付国債(30年)	141,300,000	179,090,685	
	第40回 利付国債(30年)	83,500,000	103,912,410	
	第42回 利付国債(30年)	157,000,000	191,770,790	
	第53回 利付国債(30年)	386,300,000	362,936,576	
	第54回 利付国債(30年)	445,800,000	442,055,280	
	第84回 利付国債(20年)	32,100,000	37,664,856	
	第92回 利付国債(20年)	51,300,000	61,528,194	
	第99回 利付国債(20年)	108,100,000	131,292,855	
	第102回 利付国債(20年)	49,600,000	62,249,488	
	第105回 利付国債(20年)	71,500,000	87,553,180	
	第107回 利付国債(20年)	15,300,000	18,776,007	
	第109回 利付国債(20年)	35,900,000	43,325,915	
	第112回 利付国債(20年)	16,700,000	20,590,432	
	第113回 利付国債(20年)	20,000,000	24,723,000	
	第114回 利付国債(20年)	41,200,000	51,023,728	

第116回	利付国債(20年)	231,600,000	290,252,700	
第117回	利付国債(20年)	1,500,000	1,860,885	
第118回	利付国債(20年)	220,200,000	270,812,970	
第123回	利付国債(20年)	97,400,000	121,505,526	
第125回	利付国債(20年)	250,700,000	316,787,027	
第127回	利付国債(20年)	245,600,000	300,179,688	
第128回	利付国債(20年)	327,600,000	400,841,532	
第130回	利付国債(20年)	124,200,000	150,392,538	
第131回	利付国債(20年)	120,000,000	143,636,400	
第132回	利付国債(20年)	296,700,000	355,351,656	
第133回	利付国債(20年)	26,800,000	32,476,240	
第134回	利付国債(20年)	800,000	970,064	
第136回	利付国債(20年)	400,000	473,580	
第138回	利付国債(20年)	69,100,000	80,833,871	
第139回	利付国債(20年)	95,500,000	113,102,560	
第140回	利付国債(20年)	202,600,000	243,158,494	
第143回	利付国債(20年)	85,900,000	101,852,489	
第144回	利付国債(20年)	180,600,000	211,251,432	
第145回	利付国債(20年)	2,500,000	3,002,575	
第146回	利付国債(20年)	164,600,000	197,712,582	
第147回	利付国債(20年)	1,600,000	1,896,848	
第149回	利付国債(20年)	312,000,000	364,712,400	
第152回	利付国債(20年)	58,800,000	65,539,656	
第153回	利付国債(20年)	190,300,000	215,033,291	
第155回	利付国債(20年)	1,100,000	1,182,104	
第156回	利付国債(20年)	28,800,000	27,770,400	
第157回	利付国債(20年)	307,700,000	284,745,580	
第158回	利付国債(20年)	496,000,000	484,800,320	
第159回	利付国債(20年)	329,600,000	327,286,208	
第160回	利付国債(20年)	160,400,000	161,960,692	
第17回	物価連動国債(10年)	180,000,000	193,740,120	
第21回	物価連動国債(10年)	540,000,000	570,064,610	
国債証券 合計		17,472,300,000	18,743,607,066	
合計		17,472,300,000	18,743,607,066	

## 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)

	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,402,713,604	977,525,786
金銭信託	3,368,400	2,309,103
コール・ローン	189,900,115	179,545,852
株式	22,989,821,988	26,284,786,401
投資証券	412,340,519	385,884,639
派生商品評価勘定	58,319,984	109,081,942
未収入金	192,323,655	-
未収配当金	21,254,037	26,788,068
流動資産合計	25,270,042,302	27,965,921,791
資産合計	25,270,042,302	27,965,921,791
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	60,517,085	74,859,307
未払金	53,671,178	85,160,988
未払解約金	29,589,844	20,422,695
その他未払費用	325	845
流動負債合計	143,778,432	180,443,835
負債合計	143,778,432	180,443,835
純資産の部		
元本等		
元本	15,604,806,502	14,493,725,370
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,521,457,368	13,291,752,586
純資産合計	25,126,263,870	27,785,477,956
負債純資産合計	25,270,042,302	27,965,921,791

## 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 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 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 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 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 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	（2016年9月20日現在）	（2017年3月21日現在）
1. 受益権総口数	15,604,806,502口	14,493,725,370口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6102円 (16,102円)	1.9171円 (19,171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 2016年3月23日 至 2016年9月20日）	（自 2016年9月21日 至 2017年3月21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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21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	749,909,900	1,430,196,169
投資証券	16,400,124	18,423,919
合計	733,509,776	1,448,620,088

## (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	(2016年9月20日 現在)				(2017年3月21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	4,558,058,143	-	4,502,740,423	55,317,720	5,308,461,524	-	5,250,743,464	57,718,060
アメリカ ドル	2,384,671,248	-	2,356,986,346	27,684,902	2,758,466,743	-	2,696,738,840	61,727,903
イギリ ス・ポ ンド	655,543,144	-	641,506,854	14,036,290	705,487,560	-	699,193,060	6,294,500
イスラ エル・ シユ ケル	144,868,596	-	146,552,283	1,683,687	333,186,220	-	339,524,110	6,337,890
カナダ ドル	65,443,140	-	64,440,180	1,002,960	155,470,343	-	153,132,800	2,337,543
スウェ デン・ ク ローナ	77,936,355	-	77,094,150	842,205	102,858,471	-	105,078,438	2,219,967

ノル ウェー・ クローネ ユーロ	61,763,820	-	61,115,250	648,570	243,158,980	-	238,829,740	4,329,240
買 建	1,167,831,840	-	1,155,045,360	12,786,480	1,009,833,207	-	1,018,246,476	8,413,269
	4,558,058,143	-	4,500,543,322	57,514,821	5,308,461,524	-	5,284,966,099	23,495,425
アメリ カ・ドル	2,173,386,895	-	2,153,905,253	19,481,642	2,549,994,781	-	2,510,798,243	39,196,538
イギリ ス・ポン ド	61,777,027	-	60,438,240	1,338,787	-	-	-	-
オースト ラリア・ ドル	724,162,376	-	724,878,396	716,020	792,751,730	-	820,658,124	27,906,394
カナダ・ ドル	639,454,988	-	617,455,350	21,999,638	190,197,591	-	184,861,350	5,336,241
シンガ ポール・ ドル	129,911,454	-	126,976,660	2,934,794	136,259,771	-	136,678,630	418,859
スイス・ フラン	513,732,951	-	505,103,763	8,629,188	967,972,973	-	963,003,130	4,969,843
デンマー ク・ク ローネ ユーロ	172,104,885	-	169,458,256	2,646,629	178,758,453	-	180,659,358	1,900,905
ユーロ	-	-	-	-	334,151,722	-	331,432,284	2,719,438
香港・ド ル	143,527,567	-	142,327,404	1,200,163	158,374,503	-	156,874,980	1,499,523
合計	9,116,116,286	-	9,003,283,745	2,197,101	10,616,923,048	-	10,535,709,563	34,222,635

## (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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	15,757,359,310円	15,604,806,502円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	1,444,599,911円	1,197,366,476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	1,597,152,719円	2,308,447,608円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(債券重視型)	105,504,333円	79,908,286円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(標準型)	120,223,866円	101,410,903円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(株式重視型)	90,913,346円	79,488,754円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(標準型)VA(適格機関投資家専用)	29,133,085円	21,352,904円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	286,846,668円	209,181,447円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	1,121,454,624円	835,890,827円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(株式重視型)SA(適格機関投資家限定)	351,584,285円	335,512,907円
DCニッセイノパトナム・グローバル・コア株式	9,163,225,291円	8,979,658,629円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(債券重視型)	354,836,817円	312,227,294円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(標準型)	1,758,460,653円	1,609,122,262円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(株式重視型)	1,426,468,542円	1,368,059,726円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	471,633,870円	253,742,262円
ニッセイノパトナム・グローバル・コア株式SA(適格機関投資家限定)	42,269,486円	37,903,648円
ニッセイノパトナム・バランスアップオープン	154,152,240円	127,499,627円
DCニッセイバランスアクティブ	128,099,396円	142,765,894円
計	15,604,806,502円	14,493,725,370円

## 附属明細表（2017年3月21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	ADOBE SYSTEMS INC	15,400	126.31	1,945,174.00	
	ALKERMES PLC	29,600	59.68	1,766,528.00	
	ALPHABET INC-CL C	9,037	848.40	7,666,990.80	
	AMAZON.COM INC	5,700	856.97	4,884,729.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	56,868	62.37	3,546,857.16	
	ASSURED GUARANTY LTD	111,100	37.78	4,197,358.00	
	BALL CORP	28,900	75.31	2,176,459.00	
	BANK OF AMERICA CORP	86,100	24.44	2,104,284.00	
	BARD (C.R.) INC	10,700	250.68	2,682,276.00	
	BECTON DICKINSON & CO	7,700	182.63	1,406,251.00	
	BIOGEN INC	4,600	274.80	1,264,080.00	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	87,900	24.39	2,143,881.00	
	BROADCOM LTD	5,400	221.24	1,194,696.00	
	BRUNSWICK CORP	34,925	60.73	2,120,995.25	
	CALATLANTIC GROUP INC	33,309	37.47	1,248,088.23	
	CALPINE CORP	245,600	10.65	2,615,640.00	
	CELGENE CORP	18,900	126.51	2,391,039.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	95,000	30.39	2,887,050.00	
	CHUBB LTD	12,400	137.14	1,700,536.00	
	COMPUTER SCIENCES CORP	34,000	66.75	2,269,500.00	
	CONOCOPHILLIPS	38,600	45.86	1,770,196.00	
	DOW CHEMICAL CO	28,400	64.50	1,831,800.00	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	22,000	96.15	2,115,300.00	
	E*TRADE FINANCIAL	108,100	34.91	3,773,771.00	
	EOG RESOURCES INC	22,500	96.22	2,164,950.00	
	EXELON CORP	100,800	35.57	3,585,456.00	
	EXPEDIA INC	12,100	129.87	1,571,427.00	
	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	32,779	60.94	1,997,552.26	
	GODADDY INC - CLASS A	35,000	37.15	1,300,250.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	6,700	242.14	1,622,338.00	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	60,000	36.50	2,190,000.00	
	HAMILTON LANE INC-CLASS A	13,328	19.25	256,564.00	
	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	49,810	48.26	2,403,830.60	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	29,410	57.50	1,691,075.00	
	HOME DEPOT INC	10,870	147.80	1,606,586.00	
	INSTRUCTURE INC	59,100	25.05	1,480,455.00	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,200	144.08	1,469,616.00	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	32,500	42.27	1,373,775.00	
	KEANE GROUP INC	76,300	16.16	1,233,008.00	
	KENNEDY-WILSON HOLDINGS INC	63,939	21.75	1,390,673.25	
KRAFT HEINZ CO/THE	28,300	92.36	2,613,788.00		
LIVE NATION INC	63,600	29.06	1,848,216.00		
LOWE'S COS INC	27,100	82.35	2,231,685.00		

METLIFE INC	22,400	53.13	1,190,112.00		
MICRON TECHNOLOGY INC	144,000	26.21	3,774,240.00		
MOLSON COORS BREWING CO -B	13,900	98.64	1,371,096.00		
MONSANTO CO	10,600	113.81	1,206,386.00		
NEWMONT MINING CORP	45,200	33.56	1,516,912.00		
NOMAD FOODS LTD	182,247	11.33	2,064,858.51		
NORFOLK SOUTHERN CORP	37,100	114.84	4,260,564.00		
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,900	242.99	1,919,621.00		
NRG ENERGY INC	172,100	18.33	3,154,593.00		
NUCOR CORP	36,000	64.67	2,328,120.00		
PACIRA PHARMACEUTICALS INC	29,700	48.65	1,444,905.00		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,000	183.99	1,471,920.00		
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	50,900	31.19	1,587,571.00		
PULTE GROUP INC	92,000	23.74	2,184,080.00		
QORVO INC	31,400	67.58	2,122,012.00		
QUANTA SERVICES INC	34,000	37.10	1,261,400.00		
RADIAN GROUP INC	157,880	18.42	2,908,149.60		
RAYTHEON CO	11,500	155.92	1,793,080.00		
RE/MAX HOLDINGS INC-CL A	38,816	56.75	2,202,808.00		
REALPAGE INC	34,900	36.45	1,272,105.00		
SEALED AIR CORP	63,700	46.20	2,942,940.00		
SERVICE CORP INTERNATIONAL	61,170	30.87	1,888,317.90		
SERVICENOW INC	21,900	88.11	1,929,609.00		
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,500	312.13	1,716,715.00		
STERICYCLE INC	15,700	83.51	1,311,107.00		
TEXAS INSTRUMENTS INC	17,600	81.59	1,435,984.00		
VISA INC-CLASS A SHARES	35,600	89.18	3,174,808.00		
VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	77,545	26.48	2,053,391.60		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	20,900	84.63	1,768,767.00		
WALT DISNEY CO	14,200	112.71	1,600,482.00		
WIX.COM LTD	50,900	68.95	3,509,555.00		
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	47,600	33.66	1,602,216.00		
アメリカ・ドル 小計	3,457,433		161,703,150.16 (18,175,434,078)		
イギリス・ポ ンド	ADMIRAL GROUP PLC	70,884	19.77	1,401,376.68	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	76,089	26.59	2,023,206.51	
	ASTRAZENECA PLC	31,269	49.00	1,532,181.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	27,291	51.88	1,415,857.08	
	COMPASS GROUP PLC	132,995	15.15	2,014,874.25	
	IMPERIAL BRANDS PLC	72,247	38.88	2,808,963.36	
	PRUDENTIAL PLC	135,948	17.68	2,404,240.38	
	RPC GROUP PLC	166,651	9.21	1,534,855.71	
イギリス・ポンド 小計	713,374		15,135,554.97 (2,105,052,985)		
カナダ・ドル	ENCANA CORP	171,065	14.45	2,471,889.25	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5,700	624.97	3,562,329.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	83,400	23.22	1,936,548.00	

	SUNCOR ENERGY INC	117,682	41.07	4,833,199.74	
カナダ・ドル	小計	377,847		12,803,965.99 (1,080,014,531)	
スウェーデン・ クローナ	ASSA ABLOY AB	125,803	178.30	22,430,674.90	
	COM HEM HOLDING AB-W/I	138,468	99.80	13,819,106.40	
スウェーデン・クローナ	小計	264,271		36,249,781.30 (462,909,707)	
ノルウェー・ク ローネ	ORKLA ASA	177,959	78.10	13,898,597.90	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,241	325.50	9,192,445.50	
ノルウェー・クローネ	小計	206,200		23,091,043.40 (306,649,056)	
ユーロ	AENA SA	11,772	139.50	1,642,194.00	
	ATRESMEDIA CORPORACION DE MEDIOS DE COMUNICACION SA	141,072	11.06	1,560,256.32	
	BANK OF IRELAND	9,538,469	0.24	2,308,309.49	
	BAYER AG	19,570	106.21	2,078,588.41	
	COMPUGROUP MEDICAL SE	38,548	40.38	1,556,683.88	
	DALATA HOTEL GROUP LTD	409,615	4.55	1,867,025.17	
	EURAZEO	34,931	61.51	2,148,605.81	
	EUSKALTEL SA	136,892	9.54	1,305,949.68	
	KERRY GROUP PLC-A	25,188	76.67	1,931,163.96	
	NOKIA OYJ	332,897	5.15	1,714,752.44	
	PERMANENT TSB GROUP HOLDINGS	424,157	2.48	1,051,909.36	
	RIB SOFTWARE AG	102,808	11.85	1,219,097.26	
	ROYAL KPN NV	520,830	2.80	1,461,448.98	
	SFR GROUP SA	41,182	28.45	1,171,627.90	
	SYMRISE AG	25,140	61.28	1,540,679.76	
	TELECOM ITALIA-RNC	3,035,157	0.66	2,009,273.93	
	UNILEVER NV	52,665	46.55	2,451,555.75	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	71,320	16.32	1,164,299.00		
YOOX NET-A-PORTER GROUP	93,643	22.58	2,114,458.94		
ユーロ	小計	15,055,856		32,297,880.04 (3,909,012,422)	
香港・ドル	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	529,000	32.10	16,980,900.00	
香港・ドル	小計	529,000		16,980,900.00 (245,713,623)	
合計		20,603,981		26,284,786,402 (26,284,786,402)	

## 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	162,749.00	1,168,537.82	
	イギリス・ポンド	小計	162,749.00	1,168,537.82 (162,520,240)	
	ユーロ	HIBERNIA REIT PLC-W/I	1,488,330.00	1,845,529.20	
	ユーロ	小計	1,488,330.00	1,845,529.20 (223,364,399)	
投資証券 合計				385,884,639 (385,884,639)	
合計				385,884,639 (385,884,639)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注) 2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式 75銘柄	65.41%	-%	68.15%
イギリス・ポンド	株式 8銘柄	7.58%	-%	8.50%
	投資証券 1銘柄	-%	0.58%	
カナダ・ドル	株式 4銘柄	3.89%	-%	4.05%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	1.67%	-%	1.74%
ノルウェー・クローネ	株式 2銘柄	1.10%	-%	1.15%
ユーロ	株式 19銘柄	14.07%	-%	15.49%
	投資証券 1銘柄	-%	0.80%	
香港・ドル	株式 1銘柄	0.88%	-%	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。



## 「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)

	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	387,444,442	293,923,686
金銭信託	1,146,782	390,349
コール・ローン	64,652,051	30,351,867
国債証券	9,531,445,673	9,647,423,032
特殊債券	685,666,228	600,648,442
社債券	744,431,349	587,370,310
派生商品評価勘定	61,154,488	57,455,132
未収入金	16,034,752	-
未収利息	75,668,279	86,038,158
前払費用	7,839,394	559,676
流動資産合計	11,575,483,438	11,304,160,652
資産合計	11,575,483,438	11,304,160,652
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	58,128,867	71,542,614
未払金	15,419,946	-
未払解約金	8,537,464	10,367,871
その他未払費用	134	233
流動負債合計	82,086,411	81,910,718
負債合計	82,086,411	81,910,718
純資産の部		
元本等		
元本	4,657,952,199	4,348,316,884
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,835,444,828	6,873,933,050
純資産合計	11,493,397,027	11,222,249,934
負債純資産合計	11,575,483,438	11,304,160,652

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価して おります。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で 評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準  外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に 換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令 第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
1. 受益権総口数	4,657,952,199口	4,348,316,884口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4675円 (24,675円)	2.5808円 (25,808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 2016年3月23日 至 2016年9月20日）	（自 2016年9月21日 至 2017年3月21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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21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	321,444,924	107,517,271
特殊債券	1,118,405	5,838,953
社債券	16,210,550	2,582,093
合計	304,115,969	115,938,317

## (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	(2016年9月20日 現在)				(2017年3月21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	3,345,398,813	-	3,296,799,505	48,599,308	3,929,688,050	-	3,900,292,582	29,395,468
アメリカ・ドル	1,560,640,755	-	1,543,823,414	16,817,341	1,822,098,114	-	1,792,423,528	29,674,586
イギリス・ポンド	290,007,461	-	283,092,186	6,915,275	162,677,808	-	161,204,850	1,472,958
オーストラリア・ドル	252,382,632	-	246,504,915	5,877,717	169,487,412	-	171,850,549	2,363,137
カナダ・ドル	308,496,657	-	302,062,380	6,434,277	446,065,328	-	438,293,775	7,771,553
スイス・フラン	27,247,824	-	27,021,798	226,026	35,512,080	-	35,676,400	164,320
スウェーデン・クローナ	87,541,884	-	86,236,920	1,304,964	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	325,311,287	-	327,586,298	2,275,011	222,232,312	-	216,619,002	5,613,310
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	25,387,280	-	24,806,464	580,816
ポーランド・ズロチ	17,087,270	-	17,029,040	58,230	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	111,535,071	-	101,500,812	10,034,259	-	-	-	-
ユーロ	299,196,492	-	295,920,618	3,275,874	1,011,276,987	-	1,023,428,700	12,151,713
南アフリカ・ランド	65,951,480	-	66,021,124	69,644	34,950,729	-	35,989,314	1,038,585
買 建	3,345,398,813	-	3,299,825,126	45,573,687	3,822,518,050	-	3,779,035,100	43,482,950
アメリカ・ドル	1,784,758,058	-	1,760,762,464	23,995,594	2,107,589,936	-	2,070,397,891	37,192,045
イギリス・ポンド	11,851,144	-	11,557,488	293,656	50,796,778	-	50,152,620	644,158
オーストラリア・ドル	496,986,368	-	495,499,005	1,487,363	388,001,413	-	390,238,355	2,236,942
カナダ・ドル	326,758,100	-	318,237,960	8,520,140	411,308,890	-	399,336,575	11,972,315
シンガポール・ドル	43,077,389	-	42,104,240	973,149	45,182,430	-	45,321,320	138,890

スウェーデン・クローナ	87,206,202	-	85,779,960	1,426,242	625,334,399	-	633,024,072	7,689,673
デンマーク・クローネ	21,352,407	-	21,003,888	348,519	10,481,923	-	10,593,387	111,464
ニュージーランド・ドル	227,491,042	-	228,481,818	990,776	117,935,583	-	114,812,343	3,123,240
ノルウェー・クローネ	8,896,478	-	8,831,025	65,453	35,857,907	-	35,266,064	591,843
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	3,569,379	-	3,641,911	72,532
メキシコ・ペソ	110,177,706	-	102,405,876	7,771,830	970,918	-	1,029,598	58,680
ユーロ	186,469,937	-	183,842,064	2,627,873	25,488,494	-	25,220,964	267,530
南アフリカ・ランド	40,373,982	-	41,319,338	945,356	-	-	-	-
合計	6,690,797,626	-	6,596,624,631	3,025,621	7,752,206,100	-	7,679,327,682	14,087,482

## (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	(2016年9月20日現在)	(2017年3月21日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	4,700,556,847円	4,657,952,199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	427,840,914円	325,778,008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	470,445,562円	635,413,323円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(債券重視型)	68,312,303円	59,413,912円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(標準型)	38,916,808円	37,696,752円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(株式重視型)	19,620,799円	19,696,775円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン(標準型)VA(適格機関投資家専用)	9,430,330円	7,941,138円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	185,713,517円	154,676,828円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	363,029,731円	309,049,684円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(株式重視型)SA(適格機関投資家限定)	75,876,101円	82,697,125円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(債券重視型)	229,745,347円	232,091,795円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(標準型)	569,281,608円	598,067,508円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(株式重視型)	307,862,207円	338,975,647円
DCニッセイノパトナム・グローバル債券	1,490,977,974円	1,420,217,560円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	109,032,589円	67,013,800円
ニッセイノパトナム・グローバル債券SA(適格機関投資家限定)	1,148,035,801円	988,873,686円
DCニッセイバランスアクティブ	42,117,084円	31,904,674円
計	4,657,952,199円	4,348,316,884円

## 附属明細表（2017年3月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 1 2019/08/31	7,870,000.00	7,789,411.20	
		US TREASURY N/B 2 2025/02/15	1,731,000.00	1,683,397.50	
		US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	9,490,000.00	9,574,461.00	
		US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	4,540,000.00	4,678,833.20	
		US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	6,450,000.00	6,068,998.50	
	アメリカ・ドル 小計		30,081,000.00	29,795,101.40 (3,348,969,397)	
イギリス・ポンド		TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	790,000.00	861,479.20	
		TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	300,000.00	426,918.00	
		TSY 4% 2060 4 2060/01/22	260,000.00	446,297.80	
		UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	850,000.00	904,952.50	
		UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	920,000.00	1,045,662.80	
		UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	1,580,000.00	2,039,227.00	
	イギリス・ポンド 小計		4,700,000.00	5,724,537.30 (796,168,648)	
オーストラリア・ドル		AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	240,000.00	251,191.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	140,000.00	149,378.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	1,840,000.00	2,156,351.20	
	オーストラリア・ドル 小計		2,220,000.00	2,556,921.00 (222,170,866)	
カナダ・ドル		CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2018/09/01	310,000.00	312,241.30	
		CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	1,370,000.00	1,473,421.30	
		CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	460,000.00	560,229.40	
	カナダ・ドル 小計		2,140,000.00	2,345,892.00 (197,875,990)	
スイス・フラン		SWITZERLAND 2 2022/05/25	450,000.00	509,841.00	
	スイス・フラン 小計		450,000.00	509,841.00 (57,474,376)	
スウェーデン・クローナ		SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	3,450,000.00	4,062,030.00	
		SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	300,000.00	397,236.00	
	スウェーデン・クローナ 小計		3,750,000.00	4,459,266.00 (56,944,827)	



デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	1,860,000.00	2,073,546.60	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	880,000.00	1,466,669.60	
デンマーク・クローネ 小計		2,740,000.00	3,540,216.20 (57,634,720)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT 5.5 2023/04/15	1,250,000.00	1,437,050.00	
ニュージーランド・ドル 小計		1,250,000.00	1,437,050.00 (113,958,065)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	1,670,000.00	1,845,283.20	
ノルウェー・クローネ 小計		1,670,000.00	1,845,283.20 (24,505,361)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 1.75 2021/07/25	2,600,000.00	2,486,120.00	
ポーランド・ズロチ 小計		2,600,000.00	2,486,120.00 (70,481,502)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	14,120,000.00	16,430,738.00	
メキシコ・ペソ 小計		14,120,000.00	16,430,738.00 (97,269,969)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	650,000.00	662,707.50	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	680,000.00	839,222.00	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	400,000.00	604,248.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.15 2020/07/30	2,401,000.00	2,488,948.63	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4 2020/04/30	600,000.00	674,160.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.1 2018/07/30	1,100,000.00	1,165,285.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	20,000.00	24,592.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	1,340,000.00	1,627,081.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	350,000.00	434,465.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	700,000.00	927,458.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	420,000.00	586,341.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	1,095,000.00	1,129,667.70	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	500,000.00	510,635.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	1,180,000.00	1,550,413.80	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 0.3 2018/10/15	2,450,000.00	2,462,470.50	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 0.7 2020/05/01	3,521,000.00	3,541,140.12	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	640,000.00	658,547.20	

		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	40,000.00	38,724.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	2,380,000.00	2,821,870.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	860,000.00	1,046,731.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	1,300,000.00	1,774,357.00	
		FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	2,290,000.00	2,229,040.20	
		FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	640,000.00	738,016.00	
		FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	3,280,000.00	3,756,190.40	
		FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	280,000.00	407,150.80	
		FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	690,000.00	1,031,356.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	297,000.00	335,972.34	
		NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	310,000.00	483,658.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	1,540,000.00	1,800,491.00	
		TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	310,000.00	367,167.10	
		TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	350,000.00	471,362.50	
	ユーロ	小計	32,614,000.00	37,189,473.79 (4,501,042,013)	
	南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	11,700,000.00	11,564,865.00	
	南アフリカ・ランド	小計	11,700,000.00	11,564,865.00 (102,927,299)	
国債証券 合計				9,647,423,032 (9,647,423,032)	
特殊債券	アメリカ・ドル	FHLMC GOLD A17598 6.5 2034/01/01	6,215.40	6,924.70	
		FHLMC GOLD A20871 6.5 2034/04/01	26,209.72	29,200.77	
		FHLMC GOLD G08008 6.5 2034/07/01	11,005.56	12,857.56	
		FNMA 545477 7 2032/03/01	12,418.37	14,517.44	
		FNMA 555571 6.5 2033/03/01	4,835.74	5,504.57	
		FNMA 602285 6.5 2031/08/01	3,464.82	3,857.66	
		FNMA 609480 7 2031/10/01	1,544.33	1,640.68	
		FNMA 797553 5 2020/04/01	1,554.83	1,604.41	
		FNMA 813915 4.5 2020/11/01	4,428.11	4,555.24	
		FNW 2003-W1 2A 6.18664 2042/12/01	317,693.87	354,438.34	
		FNW 2003-W3 1A1 6.5 2042/08/01	5,211.40	6,059.45	
		GNMA 781542 6 2033/01/01	10,749.71	12,392.91	

		KFW 4 2020/01/27	1,180,000.00	1,252,251.40	
	アメリカ・ドル	小計	1,585,331.86	1,705,805.13 (191,732,497)	
	ユーロ	EFSF 2.25 2022/09/05	1,360,000.00	1,519,759.20	
		ELECTRICITE DE FRANCE 5 2018/02/05	400,000.00	418,132.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.125 2024/04/15	225,000.00	287,174.25	
		EUROPEAN UNION 3.25 2018/04/04	1,110,000.00	1,153,567.50	
	ユーロ	小計	3,095,000.00	3,378,632.95 (408,915,946)	
特殊債券 合計				600,648,442 (600,648,442)	
社債券	アメリカ・ドル	APPLE INC 3.45 2024/05/06	330,000.00	339,362.10	
		BACM 2005-1 AJ 5.28023 2042/11/10	29,911.55	29,891.80	
		BERKSHIRE HATHAWAY FIN 4.3 2043/05/15	95,000.00	97,193.55	
		CGCMT 2007-C6 A4 5.77879 2049/12/01	117,127.23	117,366.16	
		CGCMT 2014-GC19 XA 1.23042 2047/03/01	1,321,408.56	78,716.30	
		CGCMT 2014-GC21 AS 4.026 2047/05/01	355,000.00	370,399.90	
		COMM 2012-CR1 XA 1.90954 2045/05/01	1,334,329.47	103,930.92	
		COMM 2012-CR3 XA 2.07235 2045/10/01	723,620.93	53,613.06	
		COMM 2013-CR13 AM 4.449 2023/12/01	142,000.00	152,023.78	
		COMM 2013-LC13 AM 4.557 2046/08/01	168,000.00	180,349.68	
		DBRR 2013-EZ3 A 1.636 2049/12/15	5,271.22	5,271.22	
		GSMS 2013-GC10 XA 1.59047 2046/02/01	2,136,412.20	150,275.22	
		JPMBB 2013-C12 XA 0.69736 2045/07/01	10,904,966.80	263,027.79	
		JPMBB 2013-C15 B 4.9267 2045/11/01	150,000.00	161,985.00	
		JPMBB 2013-C17 AS 4.4584 2047/01/01	166,000.00	177,253.14	
		JPMBB 2013-C17 XA 0.95394 2047/01/01	2,262,445.65	99,253.49	
		JPMCC 2004-LN2 A2 5.115 2041/07/01	8,388.27	8,376.34	
		JPMCC 2012-C6 D 5.15251 2045/05/01	190,000.00	198,605.10	
		JPMCC 2012-LC9 XA 1.80809 2047/12/01	1,670,351.02	107,537.19	
		JPMCC 2013-C13 C 4.05313 2046/01/01	310,000.00	308,195.80	
		JPMCC 2013-C16 XA 1.12102 2046/12/01	5,549,062.87	252,537.84	
		JPMCC 2013-LC11 C 3.9582 2046/04/01	355,000.00	350,892.65	
		JPMCC 2013-LC11 XA 1.42665 2046/04/01	1,932,828.23	111,466.20	

	MSBAM 2012-C5 AS 3.792 2045/08/01	163,000.00	169,415.68	
	MSBAM 2013-C11 C 4.37049 2046/08/01	184,000.00	182,881.28	
	MSBAM 2014-C17 XA 1.24993 2047/08/01	1,398,160.93	76,283.66	
	WFCM 2013-LC12 AS 4.29614 2046/07/01	115,000.00	122,706.15	
	WFRBS 2013-C11 AS 3.311 2045/03/01	109,000.00	110,400.65	
	WFRBS 2013-C12 XA 1.37627 2048/03/01	1,731,944.68	92,936.15	
	WFRBS 2013-C17 XA 1.50978 2046/12/01	2,977,258.26	161,546.02	
	WFRBS 2013-C18 AS 4.387 2046/12/01	352,000.00	375,488.96	
	WFRBS 2013-UBS1 AS 4.306 2046/03/01	204,000.00	216,531.72	
	アメリカ・ドル 小計	37,491,487.87	5,225,714.50 (587,370,310)	
社債券 合計			587,370,310 (587,370,310)	
合計			10,835,441,784 (10,835,441,784)	

(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 5銘柄	29.84%	38.10%
	特殊債券 13銘柄	1.71%	
	社債券 32銘柄	5.23%	
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	7.09%	7.35%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	1.98%	2.05%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	1.76%	1.83%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.51%	0.53%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.51%	0.53%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	0.51%	0.53%
ニュージーランド・ドル	国債証券 1銘柄	1.02%	1.05%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	0.22%	0.23%
ポーランド・ズロチ	国債証券 1銘柄	0.63%	0.65%
メキシコ・ペソ	国債証券 1銘柄	0.87%	0.90%
ユーロ	国債証券 31銘柄	40.11%	45.31%
	特殊債券 4銘柄	3.64%	
南アフリカ・ランド	国債証券 1銘柄	0.92%	0.95%

(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」

(2017年3月31日現在)

資産総額	1,026,036,179円
負債総額	836,466円
純資産総額( - )	1,025,199,713円
発行済数量	706,937,360口
1口当たり純資産額( / )	1.4502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】

<訂正前>

##### (1) 資本金の額

平成28年10月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

<訂正後>

##### (1) 資本金の額

2017年3月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

<訂正前>

「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10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	310	49,225
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	51	10,005
単位型公社債投資信託	3	148
合計	364	59,380

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。

<訂正後>

「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。

2017年3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	325	53,152
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	57	10,829
単位型公社債投資信託	3	112
合計	385	64,093

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」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### 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21期事業年度（自平成27年4月1日至平成28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22期事業年度に係る中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		3,488,730		9,619,679
有価証券		5,209,385		7,602,477
前払費用		499,710		390,202
未収委託者報酬		2,778,650		3,426,935
未収運用受託報酬		1,519,030		1,649,081
未収投資助言報酬		216,814		208,775
繰延税金資産		417,418		480,820
その他		52,788		19,980
流動資産合計		14,182,529		23,397,951
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	88,529	1	80,574
車両	1	588	1	294
器具備品	1	90,111	1	114,079
有形固定資産合計		179,229		194,948
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		854,449		742,019
ソフトウェア仮勘定		17,421		88,417
その他		8,075		8,043
無形固定資産合計		879,946		838,479
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		35,677,217		35,476,609
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		285,819
繰延税金資産		-		170,956
その他		17		793
投資その他の資産合計		36,203,608		36,000,401
固定資産合計		37,262,784		37,033,830
資産合計		51,445,314		60,431,781

## 負債の部

## 流動負債

預り金	33,209	34,054
未払収益分配金	-	1,531
未払償還金	137,094	118,764
未払手数料	995,185	1,204,424
未払運用委託報酬	655,766	746,912
未払投資助言報酬	410,223	624,770
その他未払金	324,326	447,074
未払費用	97,490	110,997
未払法人税等	1,556,244	2,793,014
賞与引当金	787,638	864,968
その他	498,615	505,003
流動負債合計	5,495,794	7,451,515

## 固定負債

退職給付引当金	1,253,790	1,404,058
役員退職慰労引当金	25,400	26,800
繰延税金負債	13,483	-
固定負債合計	1,292,673	1,430,858

## 負債合計

負債合計	6,788,467	8,882,374
------	-----------	-----------

## 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	23,998,814	31,277,901

利益剰余金合計	24,678,621	31,957,708
---------	------------	------------

株主資本合計	42,960,461	50,239,548
--------	------------	------------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	1,696,385	1,309,858
評価・換算差額等合計	1,696,385	1,309,858

純資産合計	44,656,846	51,549,407
-------	------------	------------

負債・純資産合計	51,445,314	60,431,781
----------	------------	------------

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		15,670,934		23,796,732
運用受託報酬		7,825,480		10,253,108
投資助言報酬		872,448		887,392
業務受託料		47,100		-
営業収益計		24,415,963		34,937,233
営業費用				
支払手数料		6,834,391		10,915,789
広告宣伝費		28,551		59,346
調査費		4,581,959		5,358,400
支払運用委託報酬		1,811,448		2,043,036
支払投資助言報酬		1,722,179		2,189,966
委託調査費		80,518		90,937
調査費		967,812		1,034,460
委託計算費		148,832		189,969
営業雑経費		581,870		712,706
通信費		53,825		47,397
印刷費		170,610		207,694
協会費		21,379		22,682
その他営業雑経費		336,053		434,931
営業費用計		12,175,604		17,236,212
一般管理費				
役員報酬	1	62,272	1	69,958
給料・手当		2,905,979		2,984,319
賞与引当金繰入額		782,365		864,968
賞与		237,611		245,495
福利厚生費		532,618		581,952
退職給付費用		283,064		298,054
役員退職慰労引当金繰入額		7,250		7,450
役員退職慰労金		-		100
その他人件費		101,498		134,593
不動産賃借料		544,587		544,913
その他不動産経費		25,737		25,766
交際費		20,059		24,568
旅費交通費		100,791		114,715
固定資産減価償却費		440,227		401,740
租税公課		104,874		183,280
業務委託費		194,856		225,301
器具備品費		156,991		173,657
保険料		56,700		57,047
諸経費		135,187		146,268
一般管理費計		6,692,676		7,084,153
営業利益		5,547,682		10,616,866
営業外収益				
受取利息		274		747
有価証券利息		70,792		66,047
受取配当金	4	177,354	4	214,632
為替差益		31,164		-

その他営業外収益		6,906		32,180
営業外収益計		286,492		313,608
営業外費用				
為替差損		-		18,136
控除対象外消費税		19,444		10,447
その他営業外費用		6,244		499
営業外費用計		25,689		29,083
経常利益		5,808,485		10,901,391
特別利益				
投資有価証券売却益		366,068		100,523
投資有価証券償還益		15,343		17,323
事故受取保険金		-	5	5,609
特別利益計		381,411		123,456
特別損失				
投資有価証券売却損		-		726
固定資産除却損	3	8,042	3	6,419
事故損失賠償金	2	25,550		-
特別損失計		33,593		7,145
税引前当期純利益		6,156,304		11,017,702
法人税、住民税及び事業税		2,284,237		3,740,258
法人税等調整額		14,162		137,203
法人税等合計		2,298,400		3,603,055
当期純利益		3,857,904		7,414,647

## （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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									
	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	株主資本 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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	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	株主資本 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	42,960,461
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,279,087	7,279,087	7,279,087
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	386,526	386,526	386,526
当期変動額合計	386,526	386,526	6,892,580
当期末残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28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	<p>外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
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>



## （貸借対照表関係）

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
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。		
建物	272,378千円	287,659千円
車両	6,425	6,720
器具備品	481,704	453,566
計	760,508	747,946

## （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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	4,128千円	6,419千円
その他	3,914	-
計	8,042	6,419
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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
関係会社からの受取配当金	41,126千円	51,062千円
5. 事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。		

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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27年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月25日

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

平成28年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

## （リース取引関係）

## 1．ファイナンス・リース取引

## 所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

該当するものではありません。

未経過リース料期末残高相当額等

該当するものではありません。

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26年4月1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
支払リース料	108	-
減価償却費相当額	100	-
支払利息相当額	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資金運用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
其他有価証券	13,194,837	13,194,837	-

当事業年度(平成28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	9,619,679	9,619,679	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,602,477	7,619,170	16,692
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,118,488	22,356,870	238,381
其他有価証券	13,290,620	13,290,620	-

(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

預金はすべて短期であるため、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

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28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	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(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。

当事業年度(平成28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	9,619,679	-	-	-
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	7,600,000	22,100,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	995,984	11,352,737	851,097	1,017
合計	18,215,663	33,452,737	851,097	1,017

(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

当事業年度（平成28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	29,720,965	29,976,040	255,074
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,720,965	29,976,040	255,074
時価が貸借対照 表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,720,965	29,976,040	255,074

## 2. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成28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	5,882,680	5,808,946	73,733
	国債・地方債等	5,882,680	5,808,946	73,733
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,418,711	4,470,989	1,947,721
	小計	12,301,391	10,279,936	2,021,454
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）	989,229	1,118,670	129,440
	小計	989,229	1,118,670	129,440
	合計	13,290,620	11,398,606	1,892,014

（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	-

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	2,120,246	100,523	726
合計	2,120,246	100,523	726

（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す。

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

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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	1,253,790 千円
退職給付費用	220,314
退職給付の支払額	70,046
退職給付引当金の期末残高	1,404,058

#### （2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 220,314 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、46,819千円であります。

## (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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	260,708 千円	266,903 千円
未払事業税	120,645	179,194
その他	36,064	34,722
繰延税金資産合計	417,418	480,820
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	405,952	430,318
税務上の繰延資産償却超過額	4,573	2,980
役員退職慰労引当金	8,214	8,207
投資有価証券評価損	97,089	36,550
投資有価証券評価差額	2,266	39,867
その他	1,703	2,207
小計	519,799	520,132
評価性引当額	90,623	8,246
繰延税金資産合計	429,176	511,885
繰延税金負債		
特別分配金否認	56,555	68,623
投資有価証券評価差額	386,104	272,306
繰延税金負債合計	442,659	340,929
繰延税金資産(は負債)の純額	13,483	170,956

## 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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率 (調整)	35.64 %	法定実効税率 (調整) 33.06 %
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.09	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.07
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.26	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.15
住民税均等割	0.09	住民税均等割 0.05
税率変更に伴う影響	1.63	税率変更に伴う影響 0.71
特定外国子会社留保金課税	0.44	特定外国子会社留保金課税 0.16
所得拡大促進税制による特別控除額	0.37	所得拡大促進税制による特別控除額 0.35
評価性引当額の増加	0.03	評価性引当額の増減 0.76
その他	0.03	外国税額控除 0.08
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.33	その他 0.00
		税効果会計適用後の法人税等の負担率 32.70

### 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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28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32.34%から平成28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30.86%に、平成30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30.63%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33,334千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,097千円、その他有価証券評価差額金が29,763千円、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

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28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	4,199,085

[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	-	-

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28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	3,566,369	未収運用受託報酬	600,637
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,284

(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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	411,781円19銭	475,337円55銭
1株当たり当期純利益金額	35,573円77銭	68,370円53銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
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。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第22期中間会計期間末
		(平成28年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		15,063,257
有価証券		6,100,434
前払費用		332,057
未収委託者報酬		3,387,820
未収運用受託報酬		1,987,018
未収投資助言報酬		77,619
繰延税金資産		235,224
その他		12,300
流動資産合計		27,195,731
固定資産		
有形固定資産	1	177,912
無形固定資産		939,013
投資その他の資産		
投資有価証券		32,061,699
関係会社株式		66,222
差入保証金		285,884
繰延税金資産		358,138
その他		56
投資その他の資産合計		32,772,001
固定資産合計		33,888,927
資産合計		61,084,658

## 負債の部

## 流動負債

預り金		34,656
未払収益分配金		2,498
未払償還金		83,820
未払手数料		1,148,447
未払運用委託報酬		732,230
未払投資助言報酬		460,615
その他未払金		205,555
未払費用		162,124
未払法人税等		1,392,159
前受投資助言報酬		46,905
賞与引当金		412,947
その他	2	203,375
流動負債合計		<u>4,885,336</u>

## 固定負債

退職給付引当金		1,473,953
役員退職慰労引当金		20,525
固定負債合計		<u>1,494,478</u>

## 負債合計

6,379,815

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		<u>8,281,840</u>

## 利益剰余金

利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		34,819,634
利益剰余金合計		<u>35,499,441</u>

## 株主資本合計

53,781,281

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		923,561
評価・換算差額等合計		<u>923,561</u>

## 純資産合計

54,704,843

## 負債・純資産合計

61,084,658



## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第22期中間会計期間	
(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	12,190,330
運用受託報酬	4,378,762
投資助言報酬	282,418
営業収益計	16,851,511
営業費用	8,389,290
一般管理費	1 3,636,282
営業利益	4,825,938
営業外収益	2 156,270
営業外費用	3 17,987
経常利益	4,964,221
特別利益	4 277,431
特別損失	5 7,077
税引前中間純利益	5,234,575
法人税、住民税及び事業税	1,327,094
法人税等調整額	238,395
法人税等合計	1,565,490
中間純利益	3,669,085

## (3)中間株主資本等変動計算書

第22期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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	31,277,901	31,957,708	50,239,548
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	8,207	8,207	8,207
遡及処理後当期首残 高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,286,108	31,965,915	50,247,755
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,669,085	3,669,085	3,669,085
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	-	-	-	-	-	-	-	3,533,525	3,533,525	3,533,525
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	34,819,634	35,499,441	53,781,281

	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	1,309,858	1,309,858	51,549,407
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	8,207
遡及処理後当期首残 高	1,309,858	1,309,858	51,557,614
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	3,669,085
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	386,296	386,296	386,296
当中間期変動額合計	386,296	386,296	3,147,228
当中間期末残高	923,561	923,561	54,704,843

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	第22期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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（ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備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>

（会計方針の変更）

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日。以下「回収可能性適用指針」という。）を当中間会計期間から適用し、繰延税金資産の回収可能性に関する会計処理の方法の一部を見直しております。

回収可能性適用指針の適用については、回収可能性適用指針第49項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点において回収可能性適用指針第49項(3) から に該当する定めを適用した場合の繰延税金資産の額と、前事業年度末の繰延税金資産の額との差額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加算しております。

この結果、当中間会計期間の期首において、繰延税金資産（投資その他の資産）が8,207千円、繰越利益剰余金が8,207千円増加しております。

当中間会計期間の期首の純資産に影響額が反映されたことにより、中間株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は8,207千円増加しております。

（平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ74千円増加しております。

## ( 中間貸借対照表関係 )

第22期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	767,987千円
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22期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1.減価償却の実施額	
有形固定資産	24,369千円
無形固定資産	155,387千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	90,866千円
時効成立収益分配金・償還金	34,943千円
有価証券利息	28,471千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	11,944千円
為替差損	5,980千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	195,321千円
投資有価証券売却益	82,110千円
5.特別損失のうち主要なもの	
事故損失賠償金	4,746千円
投資有価証券売却損	2,080千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第22期中間会計期間  
(自 平成28年4月1日  
至 平成28年9月30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28年6月24日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成28年3月31日	平成28年6月24日

## (金融商品関係)

第22期中間会計期間末(平成28年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28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	15,063,257	15,063,257	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,100,434	6,120,410	19,975
投資有価証券			
満期保有目的の債券	19,015,969	19,219,090	203,120
その他有価証券	12,978,229	12,978,229	-

## (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等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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22期中間会計期間末（平成28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	25,116,403	25,339,500	223,096
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	25,116,403	25,339,500	223,096
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		25,116,403	25,339,500	223,096

## 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	5,807,626	5,876,090	68,463
	国債・地方債等	5,807,626	5,876,090	68,463
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	2,505,459	4,016,701	1,511,241
小計		8,313,086	9,892,791	1,579,705
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)	3,331,200	3,085,438	245,761
小計		3,331,200	3,085,438	245,761
合計		11,644,286	12,978,229	1,333,943



（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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1．サービスごとの情報

当社のサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の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

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

[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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

## （ 1 株当たり情報）

	第22期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）
1株当たり純資産額	504,433円86銭
1株当たり中間純利益金額	33,832円67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	3,669,085千円
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	<u>3,669,085千円</u>
期中平均株式数	108千株

## （重要な後発事象）

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

<訂正前>

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (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28年3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28年3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28年3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・アドバイザーズ・カンパニー・エルエルシー

##### b. 資本金の額

平成28年3月末現在、204,000米ドル（約22百万円。1米ドル=112.68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。

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

#### (2) 販売会社

証券投資信託の募集の取扱いおよび販売を行い、一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を代行します。

#### (3) 投資顧問会社

委託会社との契約に基づいて、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」および「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」の運用指図(国内の短期金融資産を除きます)を行います。

### 3【資本関係】

日本生命保険相互会社(販売会社)は、委託会社の株式を97,604株(持株比率90.00%)保有しています。

委託会社が所有する関係法人の株式または関係法人が所有する委託会社の株式のうち、持株比率が5%以上のものを記しています。

<訂正後>

#### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

##### (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  
2016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  
2016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

(2016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  
2016年9月末現在、204,000米ドル(約20百万円。1米ドル=101.12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。

#### 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

## (2) 販売会社

証券投資信託の募集の取扱いおよび販売を行い、一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を代行します。

## (3) 投資顧問会社

委託会社との契約に基づいて、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」および「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」の運用指図(国内の短期金融資産を除きます)を行います。

## 3【資本関係】

日本生命保険相互会社(販売会社)は、委託会社の株式を97,604株(持株比率90.00%)保有しています。

委託会社が所有する関係法人の株式または関係法人が所有する委託会社の株式のうち、持株比率が5%以上のものを記しています。

# 独立監査人の監査報告書

2017年4月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

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2016年9月21日から2017年3月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイバランスアクティブの2017年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は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. XBR 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6月3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28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. XBR 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28年11月29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28年4月1日から平成29年3月31日までの第22期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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。