

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成26年3月20日提出

【計算期間】 第13期（自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日）

【ファンド名】 D C ニッセイ / パトナム・グローバルバランス（債券重視型）
D C ニッセイ / パトナム・グローバルバランス（標準型）
D C ニッセイ / パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

【発行者名】 ニッセイアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 宇治原 潔

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目 6 番 6 号

【事務連絡者氏名】 投資信託企画部 茶木 健

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目 6 番 6 号

【電話番号】 0 3 - 5 5 3 3 - 4 6 0 8

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【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】

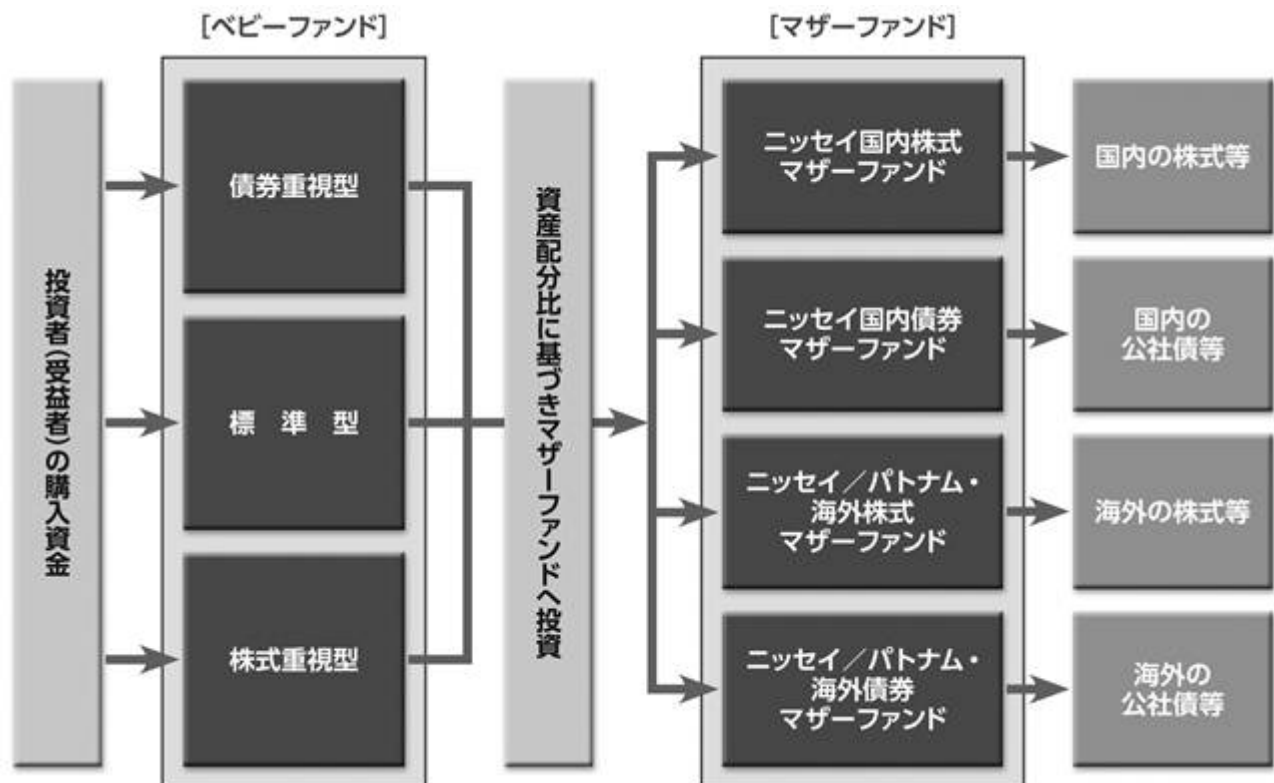
基本方針

各ファンドは、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います。

ファンドの特色

マザーファンドへの投資を通じて、国内株式・国内債券・海外株式・海外債券に分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざします。

- ・各ファンドは「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。



投資資金の目的や投資可能期間などによって3つのファンドからご選択いただけます。

- ・株式や外貨建資産の組入比率が高くなるほど、ファンドのリスク（価格の変動）が大きくなる傾向があります。
- ・各ファンドの資産配分比は、原則としてその変動幅を±5%以内（国内債券は±10%以内）に抑制します。
- ・外貨建資産には、原則として為替ヘッジを行いません。

DCニッセイ／パトナム・
グローバルバランス（債券重視型）

収益性よりも安定性を重視し、債券へ重点的に投資するファンドです。株式の実質組入比率を30％程度に、外貨建資産の実質組入比率を20％程度にそれぞれ抑制し、比較的安定した収益の獲得をめざします。

DCニッセイ／パトナム・
グローバルバランス（標準型）

安定性と収益性を共に追求し、株式・債券へ概ね50％ずつ投資するファンドです。株式の実質組入比率を50％程度に、外貨建資産の実質組入比率を30％程度に保ち、中位のリスク・リターンをめざします。

DCニッセイ／パトナム・
グローバルバランス（株式重視型）

より積極的に収益を追求し、株式へ重点的に投資するファンドです。株式の実質組入比率を70％程度に、外貨建資産の実質組入比率を40％程度に保ち、積極的な運用で値上り益を追求します。



・上記の各資産の組入比率は、各マザーファンドへの基準資産配分比を表しています。

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・インベストメント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25年9月末現在）

- パトナム・インベストメンツは1937年創立の米国で最も古い資産運用会社の1つです。
- 運用資産は約1,408億ドル(約14兆円)、投信残高は約705億ドル（約7兆円）の規模を誇ります。
- 設定済み投信は80本以上、投資家数は400万人以上にのぼります。
- ファンドマネージャー、アナリストなどの運用担当専門職を176名有しています。

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

各ファンドにつき、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す）。

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 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年1回	日本		
	年2回	北米	ファミリー ファンド	あり ()
	年4回	欧州		
	年6回 (隔月)	アジア		
不動産投信		オセアニア		
	年12回 (毎月)	中南米		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分固定型))	日々	アフリカ	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし
	その他 ()	中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		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) 資産配分固定型))	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固定的とする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、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1回	目論見書または約款において、年1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。

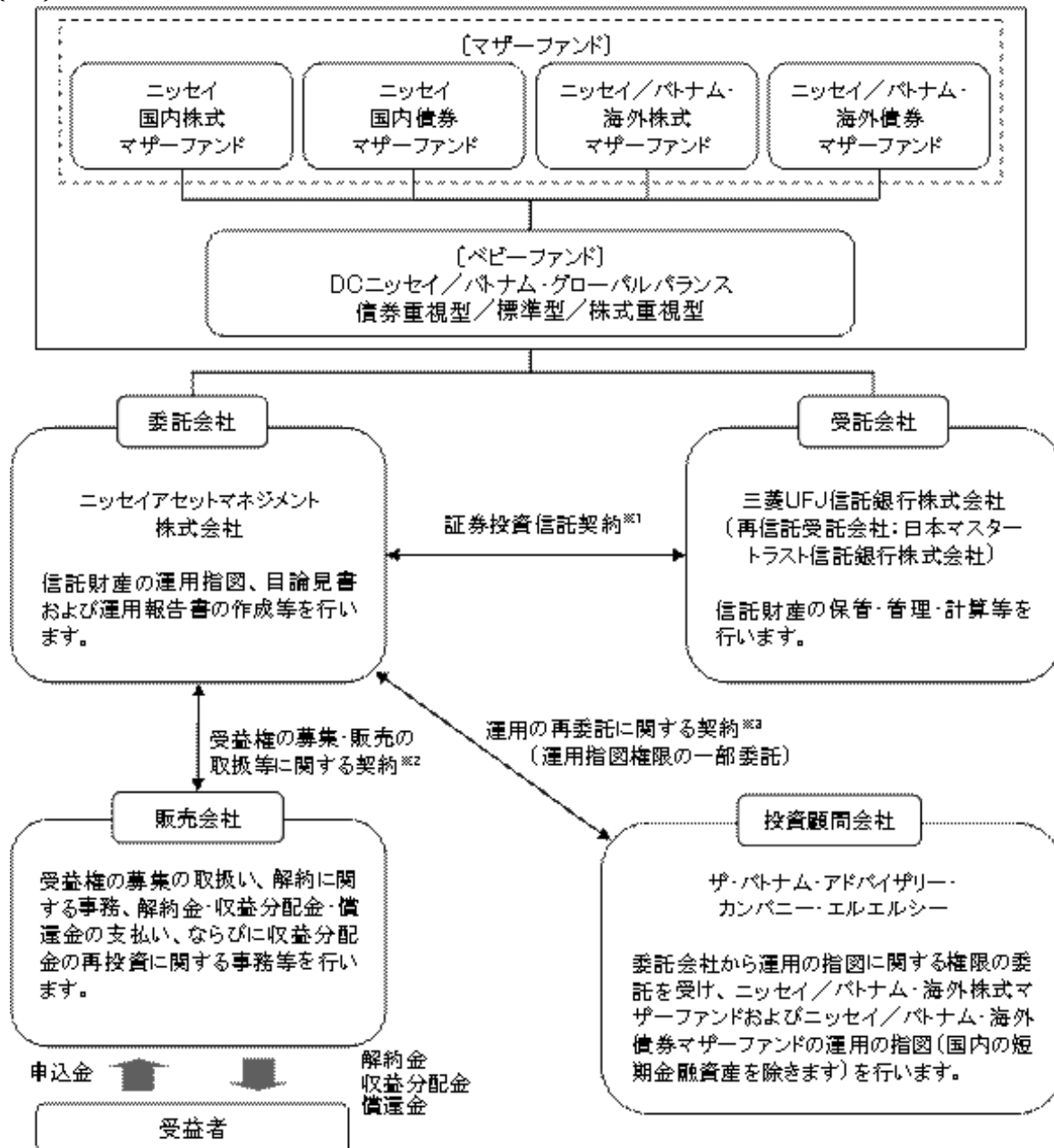
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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】

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

（３）【ファンドの仕組み】



- 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対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26年1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 宇治原 潔
- 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・ピ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%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

主として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、ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンドに投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指します。

基準ポートフォリオは、下記の比率で基準配分します。ただし、市況動向等によっては内外の株式、公社債等に投資を行う場合があります。

	国内株式 マザーファンド	国内債券 マザーファンド	海外株式 マザーファンド	海外債券 マザーファンド	短期金融資産
債券重視型	20%	55%	10%	10%	5%
標準型	30%	35%	20%	10%	5%
株式重視型	40%	15%	30%	10%	5%

基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%（ニッセイ国内債券マザーファンドは±10%）以内に変動幅を抑制します。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損の可能性が大きいと判断されるときには、一時的に為替ヘッジを行う場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式マザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、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。

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所上場株式および店頭登録銘柄を主要投資対象とします。

b 投資態度

国内の証券取引所上場株式および店頭登録銘柄に投資し、TOPIX（東証株価指数）をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標にアクティブ運用を行います。

TOPIX（東証株価指数）とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行うことができます。

銘柄選択は幅広く企業訪問を行い、徹底した調査・分析に基づくボトムアップ・アプローチにより、成長性・割安度といった株価指標はもとより、企業経営を全体的に評価する形で組入候補銘柄を厳選します。

投資スタイルはあらかじめ限定せず、投資環境分析に基づくトップダウン・アプローチにより最も効率的と考えられる運用戦略を決定します。

上記運用戦略に基づき組入銘柄・組入比率を最終的に決定し、ポートフォリオを組成します。

ファンドのリスク状況を随時モニターし、運用戦略との整合性を維持します。

株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

私募により発行された有価証券（短期社債等を除く）および上場予定・登録予定株式への投資は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

ニッセイ国内債券マザーファンド

（１）基本方針

このマザーファンドは、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。

（２）運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

国内の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI国債をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標にアクティブ運用を行います。

NOMURA-BPI国債とは、日本国内で発行される国債の流通市場動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、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、一切の責任を負うものではありません。

デュレーションコントロールに加え、銘柄分析、イールドカーブ分析に基づき、ポートフォリオ・マネージャーが運用戦略を決定し、ポートフォリオを構築します。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちますが、資金動向、市況動向およびその見通し等によってはそのような運用を行わない場合があります。

（３）投資制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

私募により発行された有価証券（短期社債等を除く）および上場予定・登録予定株式への投資は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド

（１）基本方針

このマザーファンドは、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。

（２）運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

主として日本を除く世界主要先進国の株式に分散投資を行い、MSCI KOKUSAI指数（円ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標にアクティブ運用を行います。

MSCI KOKUSAI指数とは、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く世界の主要先進国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。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。

運用にあたっては、ザ・パトナム・アドバイザリー・カンパニー・エルエルシー(The Putnam Advisory Company,LLC.)に運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の運用の指図に関する権限を除きます）を委託します。

運用スタイルを限定せず、幅広い企業訪問等に基づくファンダメンタル分析やクオンツ分析を通じて、世界各国の投資魅力が高い企業を抽出します。

組入れ銘柄の決定に際しては、国・セクターの要素を同時に分析し、分散したポートフォリオを構築します。

株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

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。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

私募により発行された有価証券（短期社債等を除く）および上場予定・登録予定株式への投資は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、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。

(2) 運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

主として日本を除く世界主要先進国の公社債に分散投資を行い、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標にアクティブ運用を行います。

シティグループ世界国債インデックスとは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した債券指数で、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均し、指数化したものです。シティグループ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。シティグループ・グローバル・マーケット・インクは当ファンドとは何ら関係なく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

運用にあたっては、ザ・パトナム・アドバイザリー・カンパニー・エルエルシー(The Putnam Advisory Company, LLC.)に運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の運用の指図に関する権限を除きます）を委託します。

各国の市況動向や政治・経済情勢を勘案して国別配分比率およびデュレーションの調整を行います。

債券の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

為替については、公社債とは独立した投資対象と考え、エクスポージャーのコントロールを行うことにより、運用効率の向上、収益の確保を図ります。ただし、為替エクスポージャーは原則として信託財産の純資産総額の範囲内とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

私募により発行された有価証券（短期社債等を除く）および上場予定・登録予定株式への投資は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

（２）【投資対象】

a 主な投資対象

下記の各マザーファンドを主要投資対象とします。

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

ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド

なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記「（５）投資制限 b 約款に定めるその他の投資制限 先物取引等、スワップ取引 および 金利先渡し取引および為替先渡し取引」に定めるものに限りします）

ハ．金銭債権（イ．およびニ．に掲げるものに該当するものを除きます）

ニ．約束手形（イ．に掲げるものを除きます）

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券

主にニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社として締結された下記１．から４．までのマザーファンドならびに次の５．から26．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます）に投資します。

1．ニッセイ国内株式マザーファンド

2．ニッセイ国内債券マザーファンド

3．ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド

4．ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

9．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます）の新株引受権証券を除きます）

10．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます）

11．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます）

12．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます）

13．特定目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます）

14．コマーシャル・ペーパー

15．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券

- 16．外国または外国の者の発行する証券または証書で、５．から15．までの証券または証書の性質を有するもの
- 17．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます）
- 18．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます）
- 19．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます）
- 20．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります）
- 21．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）
- 22．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 23．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
- 24．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます）
- 25．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 26．外国の者に対する権利で25．の有価証券の性質を有するもの
- なお、５．の証券または証書、16．および21．の証券または証書のうち５．の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、６．から10．までの証券ならびに16．および21．の証券または証書のうち６．から10．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、17．の証券および18．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品

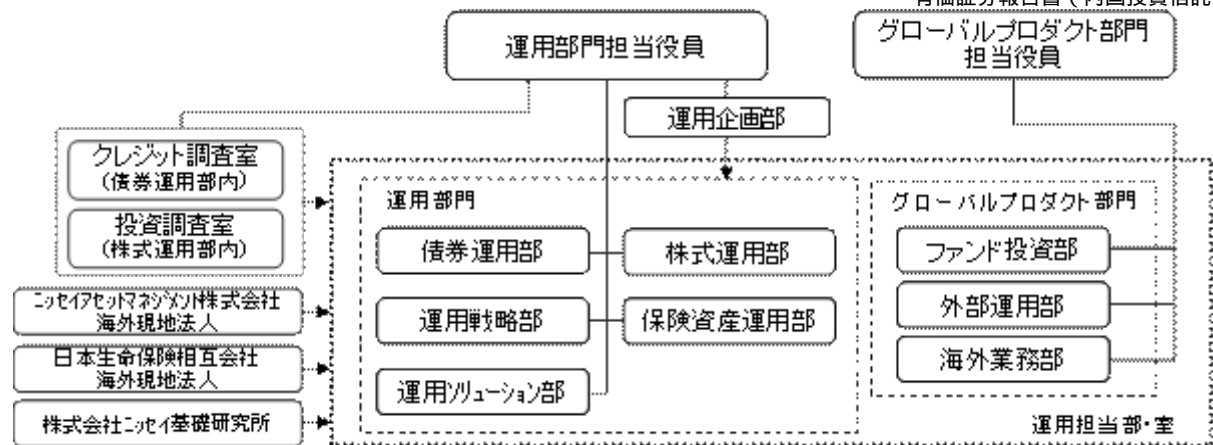
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

- １．預金
- ２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
- ３．コール・ローン
- ４．手形割引市場において売買される手形
- ５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
- ６．外国の者に対する権利で５．の権利の性質を有するもの

前記 にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記 の１．から４．までに掲げる金融商品により運用することができます。

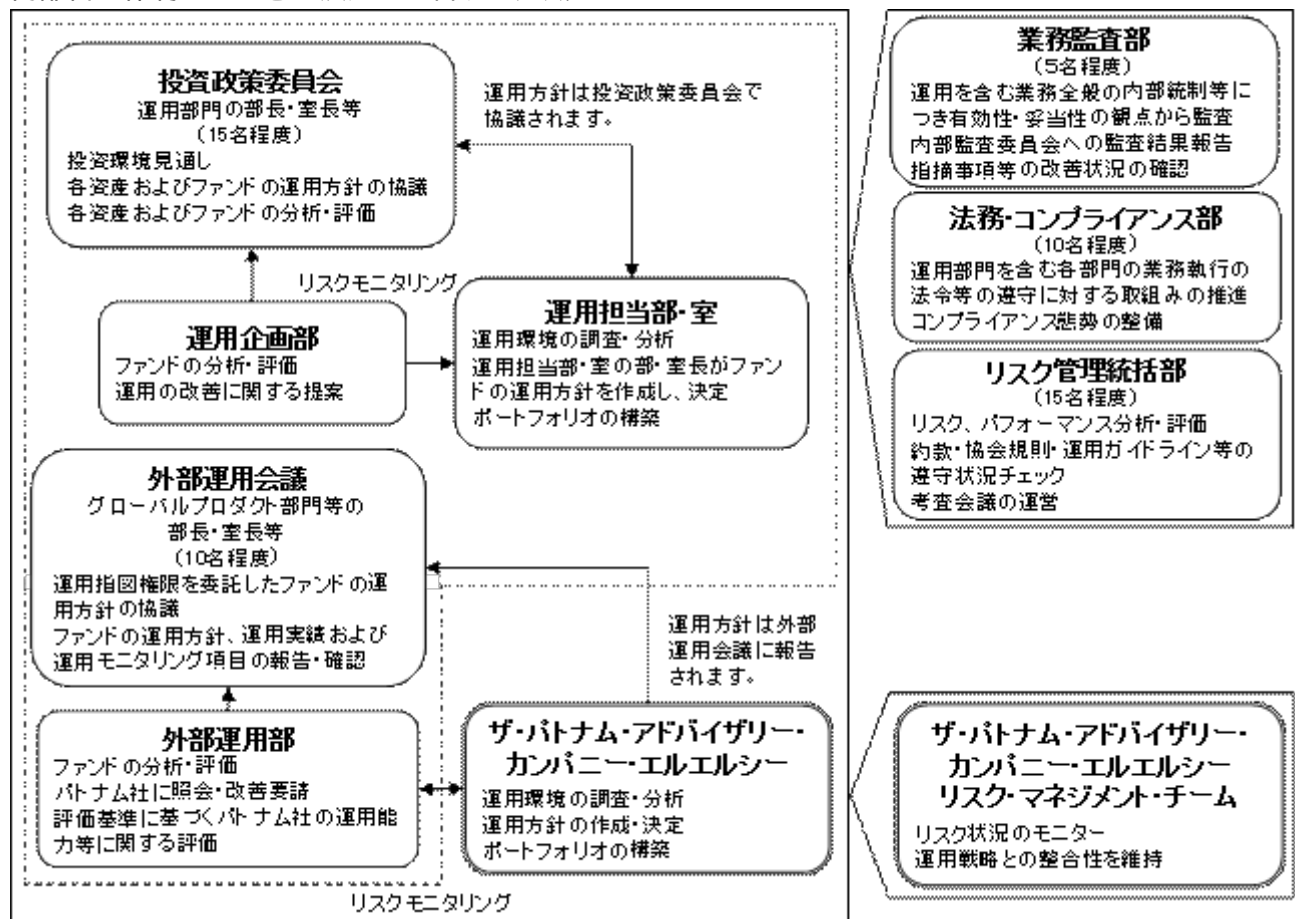
（３）【運用体制】

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・マネジャーサービス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、SAS70、SSAE16またはISAE3402（受託業務にかかわる内部統制について評価する監査人の業務に関する基準）に基づく受託業務の内部統制の有効性についての監査報告書を、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。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

2. 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

3. 留保益の運用方針

特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配時期

毎決算日とし、決算日は12月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。

< 分配金再投資コースの場合 >

自動的に再投資されます。

- 将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合

債券重視型	信託財産の純資産総額の45%以内
標準型	信託財産の純資産総額の65%以内
株式重視型	制限を設けません

外貨建資産への実質投資割合

債券重視型	信託財産の純資産総額の35%以内
標準型	信託財産の純資産総額の45%以内
株式重視型	信託財産の純資産総額の55%以内

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

1. 投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。

2. 前記1.にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、投資することができます。

信用取引の範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
2. 前記1.の信用取引は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

先物取引等

1. 国内の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ）。
2. 国内の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことができます。
3. 国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

スワップ取引

1. 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

金利先渡し取引および為替先渡し取引

- 1．信託財産を効率的に運用するため、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことができます。
- 2．金利先渡し取引および為替先渡し取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3．金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4．金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

有価証券の貸付けおよび範囲

- 1．信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
 - ・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 2．前記1．に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
- 3．有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れを行うものとします。

公社債の空売り

- 1．信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属さない公社債を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます）の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
- 2．前記1．の売付けは、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

公社債の借入れ

- 1．信託財産を効率的に運用するため、公社債の借入れを行うことができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供を行うものとします。
- 2．前記1．は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するものとします。
- 4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

外国為替予約等

- 1．信託財産を効率的に運用するため、外国為替の売買の予約取引を行うことができます。
- 2．前記1．の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。
- 3．前記2．の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。

- 4．予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとし、
- 5．外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

資金の借入れ

- 1．信託財産を効率的に運用ならびに安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て（一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- 3．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c 法令に定める投資制限

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

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。

・短期金融資産の運用に関するリスク

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。

・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。

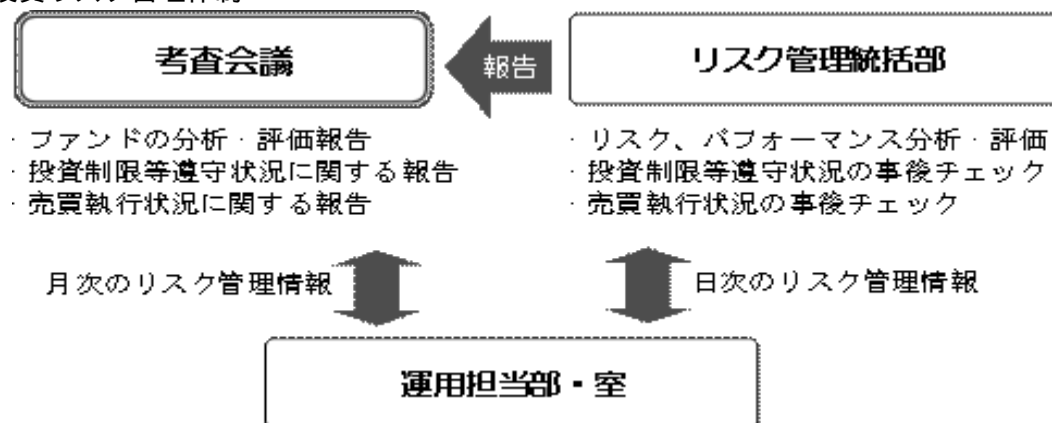
・流動性リスク

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。

・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、月次の考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、月次の考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。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

ファンド	信託報酬率	配分（税抜）		
		委託会社	販売会社	受託会社
債券重視型	1.155% ¹ （税抜 1.1%）	0.6%	0.4%	0.1%
標準型	1.365% ² （税抜 1.3%）	0.7%	0.5%	0.1%
株式重視型	1.575% ³ （税抜 1.5%）	0.8%	0.6%	0.1%

1 消費税率が8%になった場合は、年1.188%となります。

2 消費税率が8%になった場合は、年1.404%となります。

3 消費税率が8%になった場合は、年1.620%となります。

委託会社の報酬には、ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシーへの運用指図権限の一部委託に関する報酬（信託財産に属するニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンドの時価総額に年率0.5%をかけた額およびニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンドの時価総額に年率0.4%をかけた額）が含まれます。

前記の信託報酬については、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払います。

（４）【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および税金等は、信託財産中から支払います。この他に、先物取引・オプション取引等に要する費用についても信託財産中から支払います。

監査費用

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

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

- 消費税率が8%になった場合は、以下の通りとなります。

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

信託事務の諸費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支払います。

借入金の利息

信託財産において一部解約金の支払資金の手当て、または再投資に関する収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入を行った場合、当該借入金の利息は、借入れのつど信託財産中から支払います。

信託財産留保額

ありません。

- 上記の 、 および の費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「４ 手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

なお、委託会社または販売会社が取得した場合には、上記の税制は適用されません。

- 税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

（１）【投資状況】

「ＤＣニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）」

（平成26年1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	3,943,147,726	95.00
内 日本	3,943,147,726	95.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	207,394,708	5.00
純資産総額	4,150,542,434	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。

「ＤＣニッセイ／パトナム・グローバルバランス（標準型）」

（平成26年1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	10,531,335,516	95.00
内 日本	10,531,335,516	95.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	553,819,259	5.00
純資産総額	11,085,154,775	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。

「ＤＣニッセイ／パトナム・グローバルバランス（株式重視型）」

（平成26年1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	5,885,713,314	95.00
内 日本	5,885,713,314	95.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	309,477,016	5.00
純資産総額	6,195,190,330	100.00

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

（参考情報）

「ニッセイ国内株式マザーファンド」

（平成26年1月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	20,421,778,400	98.28
内 日本	20,421,778,400	98.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	357,313,855	1.72
純資産総額	20,779,092,255	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）	303,750,000	1.46
内 日本	303,750,000	1.46

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

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

（参考情報）

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

（平成26年1月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	25,283,934,819	96.20
内 日本	25,283,934,819	96.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	997,987,323	3.80
純資産総額	26,281,922,142	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）	868,440,000	3.30
内 日本	868,440,000	3.30

（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、国債先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

（参考情報）

「ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド」

（平成26年1月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	26,806,883,727	92.73
内 アメリカ	14,722,524,635	50.93
内 イギリス	4,047,701,946	14.00
内 フランス	1,573,608,182	5.44
内 イタリア	922,346,064	3.19
内 スペイン	898,741,651	3.11
内 カナダ	737,459,506	2.55
内 オランダ	651,111,552	2.25
内 ドイツ	614,255,286	2.12
内 オーストリア	360,711,429	1.25
内 シンガポール	342,341,505	1.18

	内 ポルトガル	338,045,051	1.17
	内 オーストラリア	326,450,559	1.13
	内 スウェーデン	213,411,566	0.74
	内 ジョージー	199,762,366	0.69
	内 スイス	192,815,577	0.67
	内 ベルギー	172,812,007	0.60
	内 香港	170,824,797	0.59
	内 バミューダ	165,747,575	0.57
	内 アイルランド	156,212,473	0.54
投資証券		813,337,477	2.81
	内 アメリカ	538,439,595	1.86
	内 アイルランド	274,897,882	0.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,288,490,246	4.46
純資産総額		28,908,711,450	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

該当事項はありません。

（参考情報）

「ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド」

（平成26年1月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	13,289,513,391	76.68
内 アメリカ	3,127,869,027	18.05
内 ベルギー	1,743,175,025	10.06
内 スペイン	1,565,083,065	9.03
内 イタリア	1,533,681,185	8.85
内 イギリス	1,390,771,929	8.02
内 ドイツ	1,316,746,195	7.60
内 メキシコ	534,318,620	3.08
内 カナダ	518,076,952	2.99
内 ポーランド	313,614,660	1.81
内 アイルランド	250,562,859	1.45
内 フィンランド	236,523,160	1.36
内 デンマーク	224,921,643	1.30
内 オーストラリア	197,688,182	1.14
内 南アフリカ	121,654,981	0.70
内 フランス	96,304,958	0.56

	内 スウェーデン	61,911,074	0.36
	内 スイス	56,609,876	0.33
特殊債券		1,082,772,483	6.25
	内 国際機関	541,558,834	3.12
	内 オランダ	271,456,812	1.57
	内 ドイツ	133,846,060	0.77
	内 アメリカ	71,548,062	0.41
	内 フランス	64,362,715	0.37
社債券		1,006,653,972	5.81
	内 アメリカ	897,005,526	5.18
	内 フィンランド	68,438,616	0.39
	内 オーストラリア	41,209,830	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,951,998,427	11.26
純資産総額		17,330,938,273	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

該当事項はありません。

（２）【投資資産】

「ＤＣニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）」

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成26年1月31日現在）

	銘柄名	通貨 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 （％） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内債券 マザーファンド	日本・円 日本	親投資信 託受益証 券	1,752,465,404	1.2955 2,270,490,998	1.3030 2,283,462,421	- -	55.02%
2	ニッセイ国内株式 マザーファンド	日本・円 日本	親投資信 託受益証 券	1,143,062,409	0.7449 851,518,410	0.7224 825,748,284	- -	19.89%
3	ニッセイ／パトナ ム・海外株式マ ザーファンド	日本・円 日本	親投資信 託受益証 券	273,146,899	1.5419 421,189,591	1.5290 417,641,608	- -	10.06%
4	ニッセイ／パトナ ム・海外債券マ ザーファンド	日本・円 日本	親投資信 託受益証 券	174,233,212	2.4017 418,463,969	2.3893 416,295,413	- -	10.03%

（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	95.00
	小計		95.00
合 計（対純資産総額比）			95.00

（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。

「DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年1月31日現在）

	銘柄名	通貨 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 （％） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内債券 マザーファンド	日本・円 日本	親投資信託受益証券	2,978,379,353	1.2955 3,858,768,105	1.3030 3,880,828,296	- -	35.01%
2	ニッセイ国内株式 マザーファンド	日本・円 日本	親投資信託受益証券	4,579,152,266	0.7449 3,411,093,544	0.7224 3,307,979,596	- -	29.84%
3	ニッセイノパトナム・海外株式マ ザーファンド	日本・円 日本	親投資信託受益証券	1,458,937,278	1.5418 2,249,516,926	1.5290 2,230,715,098	- -	20.12%
4	ニッセイノパトナム・海外債券マ ザーファンド	日本・円 日本	親投資信託受益証券	465,329,815	2.4017 1,117,628,770	2.3893 1,111,812,526	- -	10.03%

（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	95.00
	小計		95.00
合 計（対純資産総額比）			95.00

（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。

「DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年1月31日現在）

	銘柄名	通貨 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 （％） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内株式マザーファンド	日本・円 日本	親投資信託受益証券	3,412,113,567	0.7451 2,542,489,841	0.7224 2,464,910,840	- -	39.79%
2	ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド	日本・円 日本	親投資信託受益証券	1,222,966,979	1.5422 1,886,172,168	1.5290 1,869,916,510	- -	30.18%
3	ニッセイ国内債券マザーファンド	日本・円 日本	親投資信託受益証券	713,361,343	1.2955 924,212,552	1.3030 929,509,829	- -	15.00%
4	ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド	日本・円 日本	親投資信託受益証券	260,066,185	2.4019 624,668,069	2.3893 621,376,135	- -	10.03%

（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	95.00
	小計		95.00
合 計（対純資産総額比）			95.00

（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

	銘柄名	通貨 地域	種類 業種	株数、口数 または額面 金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（％） 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車	日本・円 日本	株式 輸送用機器	182,600	6,170.00 1,126,642,000	5,922.00 1,081,357,200	- -	5.20%
2	三菱ＵＦＪ フィナンシャルＧ	日本・円 日本	株式 銀行業	1,254,100	654.00 820,181,400	623.00 781,304,300	- -	3.76%
3	本田技研	日本・円 日本	株式 輸送用機器	130,700	4,300.00 562,010,000	3,893.00 508,815,100	- -	2.45%
4	三井住友フィ ナンシャルＧ	日本・円 日本	株式 銀行業	103,500	5,280.00 546,480,000	4,824.00 499,284,000	- -	2.40%
5	住友不動産	日本・円 日本	株式 不動産業	96,000	4,960.00 476,160,000	4,592.00 440,832,000	- -	2.12%
6	三菱商事	日本・円 日本	株式 卸売業	221,300	1,967.00 435,297,100	1,903.00 421,133,900	- -	2.03%
7	日立	日本・円 日本	株式 電気機器	445,000	765.00 340,425,000	792.00 352,440,000	- -	1.70%
8	ソフトバンク	日本・円 日本	株式 情報・通信業	46,400	8,920.00 413,888,000	7,563.00 350,923,200	- -	1.69%
9	東日本旅客鉄 道	日本・円 日本	株式 陸運業	45,600	8,270.00 377,112,000	7,632.00 348,019,200	- -	1.67%
10	みずほフィナ ンシャルＧ	日本・円 日本	株式 銀行業	1,524,100	214.00 326,157,400	219.00 333,777,900	- -	1.61%
11	ＮＴＴドコモ	日本・円 日本	株式 情報・通信業	191,200	1,687.00 322,554,400	1,663.00 317,965,600	- -	1.53%
12	マツダ	日本・円 日本	株式 輸送用機器	628,000	508.00 319,024,000	501.00 314,628,000	- -	1.51%
13	カカクコム	日本・円 日本	株式 サービス業	156,600	1,766.00 276,555,600	1,961.00 307,092,600	- -	1.48%
14	村田製作所	日本・円 日本	株式 電気機器	30,200	9,050.00 273,310,000	9,604.00 290,040,800	- -	1.40%
15	トプコン	日本・円 日本	株式 精密機器	199,500	1,551.00 309,424,500	1,432.00 285,684,000	- -	1.37%
16	日本たばこ産 業	日本・円 日本	株式 食料品	88,800	3,365.00 298,812,000	3,197.00 283,893,600	- -	1.37%
17	オリックス	日本・円 日本	株式 その他金融業	178,300	1,791.00 319,335,300	1,590.00 283,497,000	- -	1.36%

18	ブロードリーフ	日本・円 日本	株式 情報・通信業	169,400	1,952.00 330,668,800	1,671.00 283,067,400	- -	1.36%
19	アステラス製薬	日本・円 日本	株式 医薬品	43,500	6,040.00 262,740,000	6,398.00 278,313,000	- -	1.34%
20	ファナック	日本・円 日本	株式 電気機器	16,100	18,800.00 302,680,000	16,770.00 269,997,000	- -	1.30%
21	カシオ	日本・円 日本	株式 電気機器	238,200	1,270.00 302,514,000	1,122.00 267,260,400	- -	1.29%
22	エムスリー	日本・円 日本	株式 サービス業	866	249,300.00 215,893,800	302,500.00 261,965,000	- -	1.26%
23	大和ハウス	日本・円 日本	株式 建設業	132,000	1,995.00 263,340,000	1,964.00 259,248,000	- -	1.25%
24	東京急行	日本・円 日本	株式 陸運業	382,000	658.00 251,356,000	641.00 244,862,000	- -	1.18%
25	野村ホールディングス	日本・円 日本	株式 証券、商品先物取引業	337,700	776.00 262,055,200	725.00 244,832,500	- -	1.18%
26	ソニー	日本・円 日本	株式 電気機器	148,200	1,827.00 270,761,400	1,626.00 240,973,200	- -	1.16%
27	ヤマダ電機	日本・円 日本	株式 小売業	667,500	336.00 224,280,000	354.00 236,295,000	- -	1.14%
28	オムロン	日本・円 日本	株式 電気機器	57,300	4,485.00 256,990,500	4,090.00 234,357,000	- -	1.13%
29	伊藤忠	日本・円 日本	株式 卸売業	182,900	1,247.00 228,076,300	1,265.00 231,368,500	- -	1.11%
30	大阪瓦斯	日本・円 日本	株式 電気・ガス業	544,000	413.00 224,672,000	417.00 226,848,000	- -	1.09%

（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	13.67
		輸送用機器	11.75
		銀行業	9.85
		情報・通信業	8.38
		化学	5.48
		機械	4.40
		卸売業	4.14
		小売業	3.81
		医薬品	3.80

		食料品	3.66
		サービス業	3.51
		建設業	3.39
		不動産業	3.32
		陸運業	2.85
		精密機器	2.68
		保険業	2.51
		証券、商品先物取引業	1.71
		電気・ガス業	1.45
		その他金融業	1.36
		鉄鋼	1.18
		石油・石炭製品	1.07
		非鉄金属	1.06
		金属製品	1.01
		空運業	0.60
		ゴム製品	0.58
		海運業	0.57
		繊維製品	0.49
		小計	98.28
	合 計（対純資産総額比）		98.28

（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	東京証券取引所	ＴＯＰＩＸ先物 ２６０３月	買建	25	311,673,625	303,750,000	1.46%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

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

（参考情報）

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年1月31日現在）

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

1	第298回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	2,137,500,000	105.37 2,252,454,750	105.36 2,252,070,000	1.300000 2018/12/20	8.57%
2	第329回 利付国債（2年）	日本・円 日本	国債証券	1,808,500,000	100.16 1,811,412,280	100.16 1,811,429,770	0.200000 2015/6/15	6.89%
3	第312回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	1,306,800,000	105.67 1,380,912,165	105.84 1,383,208,596	1.200000 2020/12/20	5.26%
4	第330回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	1,245,500,000	101.71 1,266,911,609	101.86 1,268,741,030	0.800000 2023/9/20	4.83%
5	第332回 利付国債（2年）	日本・円 日本	国債証券	1,070,500,000	100.02 1,070,732,421	100.03 1,070,842,560	0.100000 2015/9/15	4.07%
6	第313回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	984,200,000	106.48 1,048,037,277	106.48 1,048,064,738	1.300000 2021/3/20	3.99%
7	第39回 利付国債（30年）	日本・円 日本	国債証券	921,500,000	105.75 974,543,800	106.10 977,711,500	1.900000 2043/6/20	3.72%
8	第145回 利付国債（20年）	日本・円 日本	国債証券	841,700,000	104.28 877,801,186	104.49 879,509,164	1.700000 2033/6/20	3.35%
9	第121回 利付国債（20年）	日本・円 日本	国債証券	672,600,000	109.60 737,182,461	110.62 744,036,846	1.900000 2030/9/20	2.83%
10	第320回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	682,000,000	103.72 707,370,400	104.18 710,521,240	1.000000 2021/12/20	2.70%
11	第17回 物価連動国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	598,900,000	106.09 635,378,622	107.54 644,102,574	0.100000 2023/9/10	2.45%

12	第328回 利付国債（2年）	日本・円 日本	国債証券	617,200,000	100.02 617,323,440	100.02 617,354,300	0.100000 2015/5/15	2.35%
13	第36回 利付国債（30年）	日本・円 日本	国債証券	448,900,000	107.46 482,410,385	108.49 487,029,566	2.000000 2042/3/20	1.85%
14	第128回 利付国債（20年）	日本・円 日本	国債証券	438,600,000	108.78 477,109,080	109.90 482,038,944	1.900000 2031/6/20	1.83%
15	第299回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	451,000,000	105.55 476,071,090	105.62 476,386,790	1.300000 2019/3/20	1.81%
16	第305回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	448,400,000	106.12 475,851,350	106.23 476,344,288	1.300000 2019/12/20	1.81%
17	第330回 利付国債（2年）	日本・円 日本	国債証券	441,600,000	100.16 442,307,932	100.17 442,359,552	0.200000 2015/7/15	1.68%
18	第322回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	410,600,000	103.38 424,499,656	103.36 424,408,478	0.900000 2022/3/20	1.61%
19	第140回 利付国債（20年）	日本・円 日本	国債証券	400,700,000	104.28 417,861,981	105.36 422,197,555	1.700000 2032/9/20	1.61%
20	第331回 利付国債（2年）	日本・円 日本	国債証券	414,600,000	100.02 414,682,920	100.03 414,724,380	0.100000 2015/8/15	1.58%
21	第325回 利付国債（10年）	日本・円 日本	国債証券	390,200,000	102.38 399,503,214	102.35 399,381,406	0.800000 2022/9/20	1.52%
22	第88回 利付国債（20年）	日本・円 日本	国債証券	309,700,000	117.85 364,984,547	117.74 364,668,653	2.300000 2026/6/20	1.39%
23	第322回 利付国債（2年）	日本・円 日本	国債証券	362,400,000	100.01 362,456,231	100.01 362,456,231	0.100000 2014/11/15	1.38%

24	第274 回 利付国 債（10 年）	日本・円 日本	国債証 券	349,400,000	102.79 359,148,260	102.65 358,683,558	1.500000 2015/12/20	1.36%
25	第319 回 利付国 債（10 年）	日本・円 日本	国債証 券	340,100,000	104.60 355,771,808	104.98 357,043,782	1.100000 2021/12/20	1.36%
26	第318 回 利付国 債（10 年）	日本・円 日本	国債証 券	336,800,000	104.13 350,714,362	104.24 351,100,528	1.000000 2021/9/20	1.34%
27	第323 回 利付国 債（10 年）	日本・円 日本	国債証 券	322,600,000	102.87 331,865,072	103.25 333,100,630	0.900000 2022/6/20	1.27%
28	第111 回 利付国 債（20 年）	日本・円 日本	国債証 券	277,500,000	115.08 319,347,000	115.98 321,869,475	2.200000 2029/6/20	1.22%
29	第103 回 利付国 債（5年）	日本・円 日本	国債証 券	319,600,000	100.57 321,424,678	100.57 321,437,700	0.300000 2017/3/20	1.22%
30	第122 回 利付国 債（20 年）	日本・円 日本	国債証 券	293,200,000	108.13 317,054,752	109.14 320,019,004	1.800000 2030/9/20	1.22%

（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	96.20
	小計		96.20
合 計（対純資産総額比）			96.20

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
債券先物取引	東京証券取引所	長国 2 6 0 3 月 限	買建	6	863,340,000	868,440,000	3.30%

（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）

「ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年1月31日現在）

	銘柄名	通貨 地域	種類 業種	株数、口数 または額面 金額	簿価単価 (円) 簿価金額 (円)	評価単価 (円) 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	FACEBOOK INC-A	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	91,100	5,662.44 515,848,557	6,282.68 572,352,949	- -	1.98%
2	GOOGLE INC-CL A	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	4,609	111,728.58 514,957,067	116,786.62 538,269,562	- -	1.86%
3	BARCLAYS PLC	イギリス・ポンド イギリス	株式 銀行	1,127,422	436.75 492,408,684	466.61 526,077,653	- -	1.82%
4	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	23,100	22,225.98 513,420,341	22,719.71 524,825,458	- -	1.82%
5	MONSANTO CO	アメリカ・ドル アメリカ	株式 素材	42,900	11,706.49 502,208,704	11,031.73 473,261,431	- -	1.64%
6	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	ユーロ イギリス	株式 エネルギー	126,516	3,517.22 444,985,556	3,645.65 461,234,168	- -	1.60%
7	SANOFI	ユーロ フランス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	42,895	10,487.28 449,851,978	10,232.10 438,906,238	- -	1.52%
8	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 保険	83,368	5,180.02 431,848,707	5,027.79 419,157,363	- -	1.45%
9	CME GROUP INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 各種金融	53,700	8,607.32 462,213,341	7,644.55 410,512,614	- -	1.42%

10	ASTRAZENECA PLC	イギリス・ポンド イギリス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	62,034	6,106.78 378,828,189	6,571.70 407,669,234	- -	1.41%
11	MORGAN STANLEY	アメリカ・ドル アメリカ	株式 各種金融	129,400	3,174.25 410,749,192	3,083.74 399,036,318	- -	1.38%
12	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	161,700	2,223.83 359,593,828	2,412.06 390,031,233	- -	1.35%
13	ANTENA 3 TELEVISION	ユーロ スペイン	株式 メディア	197,212	1,625.87 320,641,153	1,892.20 373,164,704	- -	1.29%
14	ERSTE GROUP BANK AG	ユーロ オーストリア	株式 銀行	94,342	3,463.68 326,771,404	3,823.44 360,711,429	- -	1.25%
15	CATAMARAN CORP	アメリカ・ドル カナダ	株式 ヘルスケア機器・サービス	70,100	4,796.36 336,224,962	5,096.71 357,279,581	- -	1.24%
16	EZION HOLDINGS LTD	シンガポール・ドル シンガポール	株式 エネルギー	1,885,400	181.57 342,341,505	181.57 342,341,505	- -	1.18%
17	THOMAS COOK GROUP PLC	イギリス・ポンド イギリス	株式 消費者サービス	1,118,030	285.40 319,087,729	304.23 340,145,243	- -	1.18%
18	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	ユーロ ポルトガル	株式 銀行	2,100,784	144.95 304,519,212	160.91 338,045,051	- -	1.17%
19	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ・ドル アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	41,400	8,792.47 364,008,373	8,135.19 336,797,172	- -	1.17%
20	UNICREDIT SPA	ユーロ イタリア	株式 銀行	428,982	738.33 316,732,339	776.68 333,182,082	- -	1.15%
21	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 各種金融	190,100	1,620.04 307,970,554	1,741.41 331,043,903	- -	1.15%
22	DISH NETWORK CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 メディア	55,900	5,742.67 321,015,465	5,809.53 324,752,883	- -	1.12%
23	INDITEX SA	ユーロ スペイン	株式 小売	20,602	16,154.12 332,807,262	15,526.64 319,879,919	- -	1.11%
24	ING GROEP NV	ユーロ オランダ	株式 各種金融	227,019	1,334.16 302,880,106	1,395.79 316,871,848	- -	1.10%

25	CELGENE CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19,500	16,871.09 328,986,395	15,838.38 308,848,464	- -	1.07%
26	TUI TRAVEL PLC	イギリス・ポンド イギリス	株式 消費者サービス	418,953	679.56 284,707,219	721.13 302,123,766	- -	1.05%
27	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 保険	85,010	3,653.58 310,591,447	3,471.52 295,114,340	- -	1.02%
28	MARATHON OIL CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	84,200	3,590.84 302,348,946	3,398.49 286,153,228	- -	0.99%
29	GENWORTH FINANCIAL INC-CLASS A	アメリカ・ドル アメリカ	株式 保険	183,900	1,571.70 289,035,777	1,537.75 282,793,512	- -	0.98%
30	YAHOO! INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	77,700	4,134.97 321,287,324	3,631.98 282,205,358	- -	0.98%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
株式	外国	銀行	9.48
		ソフトウェア・サービス	9.34
		エネルギー	8.77
		素材	7.68
		各種金融	7.27
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.16
		保険	5.87
		耐久消費財・アパレル	5.48
		小売	3.85
		メディア	3.82
		資本財	3.78
		ヘルスケア機器・サービス	3.09
		半導体・半導体製造装置	2.92
		不動産	2.72
		消費者サービス	2.60

		食品・飲料・タバコ	2.11
		自動車・自動車部品	1.42
		公益事業	1.31
		電気通信サービス	1.26
		食品・生活必需品小売り	1.23
		商業・専門サービス	1.23
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.87
		家庭用品・パーソナル用品	0.46
		小計	92.73
投資証券	外国	投資証券	2.81
	小計		2.81
合 計（対純資産総額比）			95.54

（注１）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。

（注２）株式（外国）の業種はG I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & P及びMSCI Inc.に帰属します。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）

「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年1月31日現在）

	銘柄名	通貨 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率（％） 償還日	投資 比率
1	BELGIUM KINGDOM	ユーロ ベルギー	国債 証券	1,483,641,600	115.78 1,717,893,772	117.49 1,743,175,025	4.250000 2022/9/28	10.06%
2	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	ユーロ スペイン	国債 証券	1,241,016,000	104.65 1,298,833,122	105.57 1,310,153,001	4.400000 2023/10/31	7.56%
3	BUNDESobligation	ユーロ ドイツ	国債 証券	1,228,466,400	100.98 1,240,514,768	101.80 1,250,689,357	1.000000 2018/10/12	7.22%
4	US TREASURY N/B	アメリカ・ ドル アメリカ	国債 証券	814,239,760	94.99 773,462,632	95.90 780,904,784	1.000000 2019/8/31	4.51%
5	BUONI POLIENNALI DEL TES	ユーロ イタリア	国債 証券	705,566,400	104.78 739,363,030	106.43 750,983,709	4.500000 2023/5/1	4.33%

6	US TREASURY N/B	アメリカ・ ドル アメリカ	国債 証券	750,878,000	91.43 686,580,316	93.03 698,549,312	1.625000 2022/8/15	4.03%
7	BUONI POLIENNALI DEL TES	ユーロ イタリア	国債 証券	634,452,000	107.35 681,084,222	108.59 688,957,771	4.750000 2023/8/1	3.98%
8	US TREASURY N/B	アメリカ・ ドル アメリカ	国債 証券	624,360,200	101.08 631,134,508	101.09 631,184,456	1.000000 2016/8/31	3.64%
9	MEX BONOS DESARR FIX RT	メキシコ・ ペソ メキシコ	国債 証券	499,004,100	107.94 538,644,985	107.07 534,318,620	8.000000 2015/12/17	3.08%
10	UK TSY 1.75% 2022	イギリス・ ポンド イギリス	国債 証券	492,920,400	92.11 454,038,838	93.61 461,427,715	1.750000 2022/9/7	2.66%
11	UK TSY 3 1/4% 2044	イギリス・ ポンド イギリス	国債 証券	480,194,400	92.93 446,287,873	94.90 455,733,297	3.250000 2044/1/22	2.63%
12	US TREASURY N/B	アメリカ・ ドル アメリカ	国債 証券	374,410,400	106.06 397,107,158	106.22 397,721,191	2.750000 2017/12/31	2.29%
13	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド・ ズロチ ポーランド	国債 証券	301,784,700	104.59 315,666,796	103.91 313,614,660	5.000000 2016/4/25	1.81%
14	EUROPEAN UNION	ユーロ 国際機関	特殊 債券	280,274,400	110.19 308,859,586	110.49 309,683,592	3.250000 2018/4/4	1.79%
15	TSY 2 3/4% 2015	イギリス・ ポンド イギリス	国債 証券	283,365,600	102.48 290,401,567	102.23 289,712,989	2.750000 2015/1/22	1.67%
16	US TREASURY N/B	アメリカ・ ドル アメリカ	国債 証券	343,552,400	79.81 274,196,041	84.06 288,797,018	2.750000 2042/8/15	1.67%
17	CANADIAN GOVERNMENT	カナダ・ ドル カナダ	国債 証券	273,804,300	101.25 277,251,496	103.93 284,570,285	2.750000 2022/6/1	1.64%
18	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	ユーロ スペイン	国債 証券	217,526,400	113.81 247,577,672	117.19 254,930,064	5.850000 2022/1/31	1.47%
19	US TREASURY N/B	アメリカ・ ドル アメリカ	国債 証券	237,915,180	93.38 222,169,953	95.12 226,316,814	2.000000 2023/2/15	1.31%

20	TREASURY 5% 2020	ユーロ アイルランド	国債 証券	181,272,000	112.41 203,785,982	115.33 209,077,312	5.000000 2020/10/18	1.21%
21	AUSTRALIAN GOVERNMENT	オーストラ リア・ドル オーストラ リア	国債 証券	176,093,800	110.27 194,190,959	112.26 197,688,182	5.500000 2023/4/21	1.14%
22	EFSF	ユーロ 国際機関	特殊 債券	189,638,400	101.45 192,390,053	102.71 194,788,978	2.250000 2022/9/5	1.12%
23	CANADIAN GOVERNMENT	カナダ・ドル カナダ	国債 証券	192,677,100	97.21 187,320,676	98.50 189,806,211	1.250000 2018/9/1	1.10%
24	TSY 3 3/4% 2019	イギリス・ ポンド イギリス	国債 証券	167,983,200	108.99 183,100,008	109.47 183,897,928	3.750000 2019/9/7	1.06%
25	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	ユーロ オランダ	特殊 債券	156,312,240	104.43 163,249,377	104.52 163,386,931	2.250000 2016/8/24	0.94%
26	KINGDOM OF DENMARK	デンマー ク・クロー ネ デンマーク	国債 証券	130,760,000	113.38 148,255,688	113.59 148,539,437	4.000000 2017/11/15	0.86%
27	KFW	アメリカ・ ドル ドイツ	特殊 債券	121,374,800	109.51 132,928,467	110.27 133,846,060	4.000000 2020/1/27	0.77%
28	FINNISH GOVERNMENT	ユーロ フィンラン ド	国債 証券	122,707,200	103.32 126,790,895	103.41 126,896,423	1.750000 2016/4/15	0.73%
29	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ・ランド 南アフリカ	国債 証券	122,502,700	103.57 126,885,846	99.30 121,654,981	8.000000 2018/12/21	0.70%
30	FINNISH GOVERNMENT	ユーロ フィンラン ド	国債 証券	96,213,600	112.65 108,392,317	113.94 109,626,737	3.500000 2021/4/15	0.63%

（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	76.68
		特殊債券	6.25
		社債券	5.81
	小計		88.74

合 計（対純資産総額比）		88.74
--------------	--	-------

（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／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）」

【純資産の推移】

平成26年1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4計算期間末 （平成16年12月20日）	374,632,443	374,632,443	1.0332	1.0332
第5計算期間末 （平成17年12月20日）	885,284,455	885,284,455	1.1392	1.1392
第6計算期間末 （平成18年12月20日）	1,355,604,051	1,355,604,051	1.1758	1.1758
第7計算期間末 （平成19年12月20日）	1,792,060,027	1,792,060,027	1.1482	1.1482
第8計算期間末 （平成20年12月22日）	1,785,760,813	1,785,760,813	0.9426	0.9426
第9計算期間末 （平成21年12月21日）	2,156,995,676	2,156,995,676	0.9902	0.9902
第10計算期間末 （平成22年12月20日）	2,499,401,321	2,499,401,321	0.9958	0.9958
第11計算期間末 （平成23年12月20日）	2,723,176,396	2,723,176,396	0.9578	0.9578
第12計算期間末 （平成24年12月20日）	3,291,717,592	3,291,717,592	1.0421	1.0421
第13計算期間末 （平成25年12月20日）	4,136,822,542	4,136,822,542	1.2261	1.2261
平成25年1月末日	3,467,316,223	-	1.0920	-
2月末日	3,527,278,161	-	1.1079	-
3月末日	3,633,471,777	-	1.1360	-
4月末日	3,758,437,932	-	1.1746	-
5月末日	3,787,724,264	-	1.1722	-

6月末日	3,763,459,933	-	1.1559	-
7月末日	3,792,708,382	-	1.1651	-
8月末日	3,833,759,124	-	1.1621	-
9月末日	3,965,778,156	-	1.1916	-
10月末日	4,040,466,520	-	1.2016	-
11月末日	4,102,241,472	-	1.2230	-
12月末日	4,178,809,280	-	1.2373	-
平成26年1月末日	4,150,542,434	-	1.2193	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	3.2
第5計算期間	10.3
第6計算期間	3.2
第7計算期間	2.4
第8計算期間	17.9
第9計算期間	5.1
第10計算期間	0.6
第11計算期間	3.8
第12計算期間	8.8
第13計算期間	17.7

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

収益率 = (当計算期間末分配付基準価額 - 前計算期間末分配落基準価額) ÷ 前計算期間末分配落基準価額 × 100

「DCニッセイ / パトナム・グローバルバランス（標準型）」

純資産の推移

平成26年1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4計算期間末 (平成16年12月20日)	1,089,509,534	1,089,509,534	1.0211	1.0211
第5計算期間末 (平成17年12月20日)	2,650,533,979	2,650,533,979	1.1936	1.1936
第6計算期間末 (平成18年12月20日)	4,234,174,591	4,234,174,591	1.2624	1.2624
第7計算期間末 (平成19年12月20日)	5,215,395,051	5,215,395,051	1.2086	1.2086
第8計算期間末 (平成20年12月22日)	4,558,170,987	4,558,170,987	0.8556	0.8556
第9計算期間末 (平成21年12月21日)	5,709,351,382	5,709,351,382	0.9230	0.9230
第10計算期間末 (平成22年12月20日)	6,568,841,343	6,568,841,343	0.9298	0.9298
第11計算期間末 (平成23年12月20日)	6,726,581,423	6,726,581,423	0.861	0.8610
第12計算期間末 (平成24年12月20日)	8,182,354,099	8,182,354,099	0.9778	0.9778
第13計算期間末 (平成25年12月20日)	11,127,504,623	11,127,504,623	1.2525	1.2525
平成25年1月末日	8,843,553,502	-	1.0515	-
2月末日	8,996,280,366	-	1.0703	-
3月末日	9,333,212,122	-	1.1069	-
4月末日	9,835,028,169	-	1.1656	-
5月末日	9,955,704,559	-	1.1744	-
6月末日	9,765,248,836	-	1.1494	-
7月末日	9,997,713,277	-	1.1638	-
8月末日	10,033,555,204	-	1.1563	-
9月末日	10,440,653,571	-	1.1993	-
10月末日	10,644,443,298	-	1.2118	-
11月末日	11,019,715,438	-	1.2453	-
12月末日	11,329,215,233	-	1.2734	-
平成26年1月末日	11,085,154,775	-	1.2391	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

収益率の推移

	収益率(%)
第4計算期間	4.8
第5計算期間	16.9
第6計算期間	5.8
第7計算期間	4.3
第8計算期間	29.2
第9計算期間	7.9
第10計算期間	0.7
第11計算期間	7.4
第12計算期間	13.6
第13計算期間	28.1

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

収益率 = (当計算期間末分配基準価額 - 前計算期間末分配基準価額) ÷ 前計算期間末分配基準価額 × 100

「DCニッセイ / パトナム・グローバルバランス（株式重視型）」

純資産の推移

平成26年1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4計算期間末 (平成16年12月20日)	466,739,039	466,739,039	1.0155	1.0155
第5計算期間末 (平成17年12月20日)	1,400,109,814	1,400,109,814	1.2557	1.2557

第6計算期間末 (平成18年12月20日)	2,364,684,012	2,364,684,012	1.3605	1.3605
第7計算期間末 (平成19年12月20日)	3,001,666,152	3,001,666,152	1.2754	1.2754
第8計算期間末 (平成20年12月22日)	2,109,357,966	2,109,357,966	0.7726	0.7726
第9計算期間末 (平成21年12月21日)	2,868,152,724	2,868,152,724	0.8535	0.8535
第10計算期間末 (平成22年12月20日)	3,384,544,449	3,384,544,449	0.8593	0.8593
第11計算期間末 (平成23年12月20日)	3,341,980,339	3,341,980,339	0.7645	0.7645
第12計算期間末 (平成24年12月20日)	4,297,129,476	4,297,129,476	0.9050	0.9050
第13計算期間末 (平成25年12月20日)	6,284,755,364	6,284,755,364	1.2596	1.2596
平成25年1月末日	4,788,356,289	-	0.9984	-
2月末日	4,893,164,567	-	1.0195	-
3月末日	5,137,846,679	-	1.0633	-
4月末日	5,497,378,980	-	1.1401	-
5月末日	5,624,004,013	-	1.1590	-
6月末日	5,432,311,815	-	1.1256	-
7月末日	5,587,511,841	-	1.1445	-
8月末日	5,591,105,068	-	1.1328	-
9月末日	5,884,660,508	-	1.1883	-
10月末日	5,963,817,167	-	1.2031	-
11月末日	6,192,936,267	-	1.2483	-
12月末日	6,444,064,359	-	1.2901	-
平成26年1月末日	6,195,190,330	-	1.2394	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

収益率の推移

	収益率(%)
第4計算期間	6.3
第5計算期間	23.7
第6計算期間	8.4
第7計算期間	6.3
第8計算期間	39.4
第9計算期間	10.5
第10計算期間	0.7
第11計算期間	11.0
第12計算期間	18.4
第13計算期間	39.2

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

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

(4) 【設定及び解約の実績】

「 D C ニッセイ / パトナム ・ グローバルバランス (債券重視型) 」

	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第4計算期間	205,429,489	34,470,650	362,597,258
第5計算期間	489,123,227	74,582,557	777,137,928
第6計算期間	523,348,836	147,557,343	1,152,929,421
第7計算期間	604,664,864	196,807,697	1,560,786,588
第8計算期間	580,544,434	246,831,713	1,894,499,309
第9計算期間	480,601,174	196,658,764	2,178,441,719
第10計算期間	545,410,468	213,948,678	2,509,903,509
第11計算期間	578,240,163	245,039,210	2,843,104,462
第12計算期間	586,550,726	270,867,225	3,158,787,963
第13計算期間	751,419,947	536,107,413	3,374,100,497

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

「 D C ニッセイ / パトナム ・ グローバルバランス (標準型) 」

	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第4計算期間	607,914,119	74,518,319	1,067,037,080

第5計算期間	1,270,075,493	116,399,714	2,220,712,859
第6計算期間	1,429,658,747	296,270,962	3,354,100,644
第7計算期間	1,366,430,989	405,119,554	4,315,412,079
第8計算期間	1,468,096,357	456,192,473	5,327,315,963
第9計算期間	1,223,158,652	365,141,392	6,185,333,223
第10計算期間	1,370,362,003	490,987,363	7,064,707,863
第11計算期間	1,270,668,761	522,487,871	7,812,888,753
第12計算期間	1,212,513,645	657,382,525	8,368,019,873
第13計算期間	1,600,562,237	1,084,263,068	8,884,319,042

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

「ＤＣニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第4計算期間	272,662,323	63,578,385	459,622,216
第5計算期間	756,275,207	100,934,571	1,114,962,852
第6計算期間	884,510,703	261,365,461	1,738,108,094
第7計算期間	945,866,397	330,373,290	2,353,601,201
第8計算期間	735,800,670	359,217,550	2,730,184,321
第9計算期間	887,321,019	256,976,860	3,360,528,480
第10計算期間	886,009,690	307,793,830	3,938,744,340
第11計算期間	815,153,356	382,188,304	4,371,709,392
第12計算期間	747,912,755	371,377,662	4,748,244,485
第13計算期間	1,206,182,414	964,783,823	4,989,643,076

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2014年1月末現在

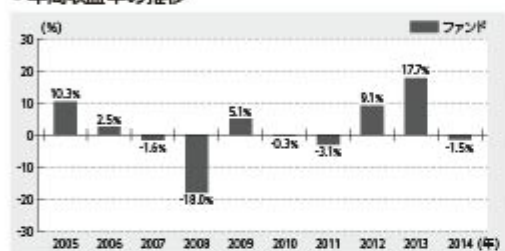
DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

●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。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
 ・ファンド収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。
 ・2014年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

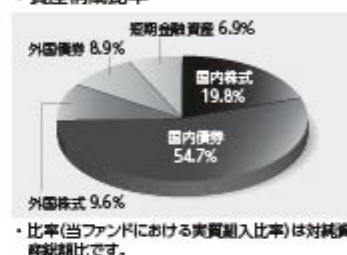
●基準価額および純資産総額

基準価額	12,193円
純資産総額	41億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

第9期	2009年12月	0円
第10期	2010年12月	0円
第11期	2011年12月	0円
第12期	2012年12月	0円
第13期	2013年12月	0円
直近1年間累計		0円
設定以来累計		0円

●資産構成比率



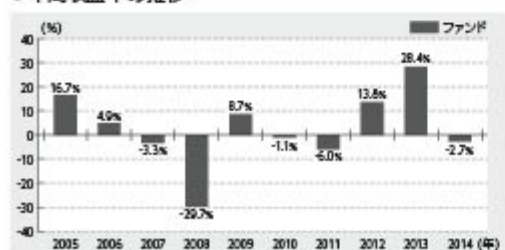
DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（標準型）

●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。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
 ・ファンド収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。
 ・2014年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

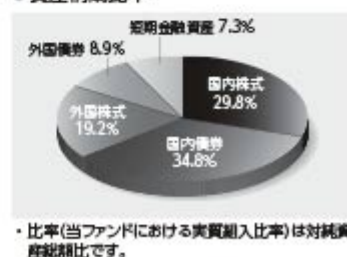
●基準価額および純資産総額

基準価額	12,391円
純資産総額	110億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

第9期	2009年12月	0円
第10期	2010年12月	0円
第11期	2011年12月	0円
第12期	2012年12月	0円
第13期	2013年12月	0円
直近1年間累計		0円
設定以来累計		0円

●資産構成比率



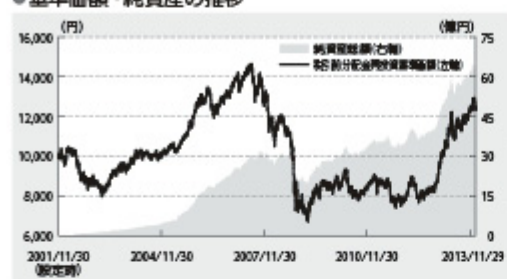
■ ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

■ 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。

2014年1月末現在

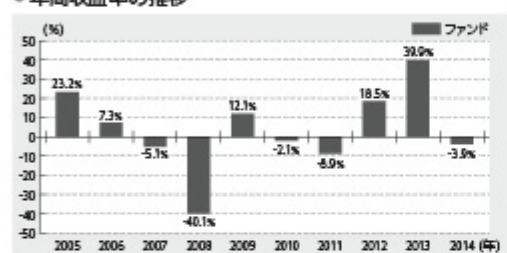
DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

●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。

●年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。
- ・2014年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

●基準価額および純資産総額

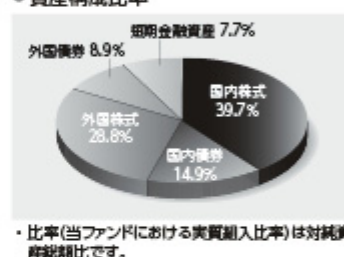
基準価額	12,394円
純資産総額	61億円

●分配の推移

1万口当り（税引前）

第9期	2009年12月	0円
第10期	2010年12月	0円
第11期	2011年12月	0円
第12期	2012年12月	0円
第13期	2013年12月	0円
直近1年間累計		0円
設定以来累計		0円

●資産構成比率



■ 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。

2014年1月末現在

●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	トヨタ自動車	5.3%
2	三菱UFJフィナンシャルG	3.8%
3	本田技研	2.5%
4	三井住友フィナンシャルG	2.4%
5	住友不動産	2.2%

・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298回 利付国債(10年)	2018/12/20	1.30%	8.9%
2	第329回 利付国債(2年)	2015/06/15	0.20%	7.2%
3	第312回 利付国債(10年)	2020/12/20	1.20%	5.5%
4	第330回 利付国債(10年)	2023/09/20	0.80%	5.0%
5	第332回 利付国債(2年)	2015/09/15	0.10%	4.2%

・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	フェイスブック	アメリカ	情報技術	2.1%
2	グーグル	アメリカ	情報技術	1.9%
3	パークレイズ	イギリス	金融	1.9%
4	ビザ	アメリカ	情報技術	1.9%
5	モンサント	アメリカ	農材	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&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	BELGIUM KINGDOM	ベルギー	2022/09/28	4.25%	10.1%
2	BOBOS Y OBLIG DEL ESTADO	スペイン	2023/10/31	4.40%	7.6%
3	BUNDESOBLIGATION	ドイツ	2018/10/12	1.00%	7.2%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	2019/06/31	1.00%	4.5%
5	BUONI POLIENNALI DEL TES	イタリア	2023/05/01	4.50%	4.3%

・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	13.9%
2	輸送用機器	12.0%
3	銀行業	10.0%
4	情報・通信業	8.5%
5	化学	5.6%

・比率は対組入株式評価額比です。

●組入債券

	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	59.0%
2	イギリス	15.4%
3	フランス	6.3%
4	イタリア	3.3%
5	スペイン	3.3%

・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	23.6%
2	ベルギー	10.1%
3	スペイン	9.0%
4	イタリア	8.8%
5	ドイツ	8.4%

・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2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受け付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。

証券取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、申込みの受け付けを中止することおよび既に受け付けた申込みの受け付けを取消すことがあります。

取扱コース

分配金の受取方法により、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の2つのコースがあります（販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります）。

分配金再投資コースを選択した場合、販売会社と「自動けいぞく（累積）投資契約」（同様の権利義務を規定する名称の異なる契約または規定も含まれます）を締結します。

申込単位

1円以上1円単位とします。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

1. ファンドの取得申込者は、販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。
2. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

2【換金（解約）手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受け付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。

証券取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受け付けを中止することがあります。

換金単位

1口単位とします。

換金価額

換金請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

- 換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

換金請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

その他

1. 受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
2. 換金請求の受付が中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記の規定に準じて算出した価額とします。
3. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

ファンドおよびマザーファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	証券取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。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、償却原価法で評価します。
外国株式	証券取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
外国債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。
国内債券先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます）の円換算については、原則として国内における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限です。

（４）【計算期間】

毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの償還日とします。

（５）【その他】

繰上償還

- 1．委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
 - ・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき
 - ・やむを得ない事情が発生したとき
- 2．委託会社は、前記１．により解約するときには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 3．前記２．の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月以上設けるものとします。
- 4．前記３．の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の２分の１を超えるときは、前記１．の信託契約の解約をしません。
- 5．委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 6．前記３．から５．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記３．の一定の期間を１ヵ月以上設けることが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更 4. 」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社の間において存続します。
9. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「 約款の変更 」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
10. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までにお支払いします。

約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することができます。この場合、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、前記1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記1.から5.の規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前記「 繰上償還 」に規定する信託契約の解約または前記「 約款の変更 」に規定する約款の変更を行う場合において、「 繰上償還 3. 」または「 約款の変更 3. 」の一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権の買取りを請求することができます。ただし、当該買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社および販売会社の協議により決定します。

公告

電子公告により行い、委託会社のホームページ（<http://www.nam.co.jp/>）に掲載します。

- 電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

委託会社は、ファンドの計算期間の末日毎および償還時に期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、これを販売会社を通じてファンドの知られたる受益者に交付します。

信託事務処理の再信託

受託会社は、ファンドにかかる信託事務の処理の一部について、日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

関係法人との契約の更改等に関する手続き

委託会社と販売会社との間で締結された「受益権の募集・販売の取扱等に関する契約」は、契約期間満了の3ヵ月前までに委託会社、販売会社いずれかにより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。

委託会社と投資顧問会社との間で締結された「運用の再委託に関する契約」は、委託会社、投資顧問会社いずれかにより別段の意思表示がない限り、ファンドの償還日まで存続するものとしします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（1）収益分配金に対する請求権

受益者には、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利があります。

分配金受取コースの場合、原則として決算日から起算して5営業日目までに販売会社において支払いを開始します。ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

分配金再投資コースの場合、自動的に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（2）償還金に対する請求権

受益者には、持分に応じて償還金を請求する権利があります。原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までに販売会社において支払いを開始します。ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

（3）解約請求権

受益者には、持分に応じて解約請求する権利があります。権利行使の方法等については、前記「2 換金（解約）手続等」の項をご参照ください。

（4）帳簿閲覧権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する法令で定められた帳簿書類の閲覧を請求することができます。

（5）反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要（5）その他 反対者の買取請求権」の項をご参照ください。

第3【ファンドの経理状況】

DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成24年12月21日から平成25年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（標準型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成24年12月21日から平成25年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成24年12月21日から平成25年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【ＤＣニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	180,634,845	227,312,889
親投資信託受益証券	3,129,265,310	3,932,391,368
未収入金	4,777,718	1,413,118
流動資産合計	3,314,677,873	4,161,117,375
資産合計	3,314,677,873	4,161,117,375
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,820,521	1,223,859
未払受託者報酬	1,622,962	2,068,372
未払委託者報酬	16,230,025	20,684,180
その他未払費用	286,773	318,422
流動負債合計	22,960,281	24,294,833
負債合計	22,960,281	24,294,833
純資産の部		
元本等		
元本	3,158,787,963	3,374,100,497
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	132,929,629	762,722,045
純資産合計	3,291,717,592	4,136,822,542
負債純資産合計	3,314,677,873	4,161,117,375

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期 （自平成23年12月21日 至平成24年12月20日）	第13期 （自平成24年12月21日 至平成25年12月20日）
営業収益		
受取利息	96,731	105,614
有価証券売買等損益	291,069,821	638,821,599
営業収益合計	291,166,552	638,927,213
営業費用		
受託者報酬	3,155,020	3,952,773
委託者報酬	31,551,080	39,528,640
その他費用	567,181	623,019
営業費用合計	35,273,281	44,104,432
営業利益又は営業損失（　）	255,893,271	594,822,781
経常利益又は経常損失（　）	255,893,271	594,822,781
当期純利益又は当期純損失（　）	255,893,271	594,822,781
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（　）	10,469,968	57,577,350
期首剰余金又は期首欠損金（　）	119,928,066	132,929,629
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,578,199	120,378,437
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,578,199	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	120,378,437
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,143,807	27,831,452
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	27,831,452
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,143,807	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（　）	132,929,629	762,722,045

（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。
--------------------	---

（表示方法の変更に関する注記）

損益及び剰余金計算書の「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、従来、それぞれ剰余金増加額又は欠損金減少額、剰余金減少額又は欠損金増加額の総額を表示しておりましたが、剰余金の増減をより明瞭に表示するため、当計算期間から純額表示へと変更しております。 変更の結果、前計算期間の「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」が3,498,020円減少し、「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」が3,498,020円増加しておりますが、損益及び剰余金計算書のその他の項目への影響はありません。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
１． 当該計算期間の末日における受益権総口数	3,158,787,963口	3,374,100,497口
２． １口当たり純資産額 (１万口当たり純資産額)	1.0421円 (10,421円)	1.2261円 (12,261円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第12期 (自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)	第13期 (自平成24年12月21日 至平成25年12月20日)
１． 投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために規定する額	2,718,094円	3,409,401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（85,711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（461,017,773円）及び分配準備積立金（54,234,826円）より分配対象収益は515,338,310円（1口当たり0.163144円）ですが、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（91,365円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（513,253,202円）、収益調整金（504,431,317円）及び分配準備積立金（46,042,337円）より分配対象収益は1,063,818,221円（1口当たり0.315289円）ですが、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。
３． 剰余金増加額・減少額及び欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金減少額と欠損金増加額との純額を表示しております。	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金増加額と剰余金減少額との純額を表示しております。

（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12期 （自平成23年12月21日 至平成24年12月20日）	第13期 （自平成24年12月21日 至平成25年12月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	251,056,455	473,007,864
合計	251,056,455	473,007,864

（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）

開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
期首元本額	2,843,104,462円	3,158,787,963円
期中追加設定元本額	586,550,726円	751,419,947円
期中一部解約元本額	270,867,225円	536,107,413円

（4）【附属明細表】（平成25年12月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額 (口)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド	171,361,056	411,523,575	
	ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド	274,420,091	423,183,222	

	ニッセイ国内債券マザーファンド	1,740,166,375	2,254,559,555	
	ニッセイ国内株式マザーファンド	1,131,711,432	843,125,016	
親投資信託受益証券 合計		3,317,658,954	3,932,391,368	
合計		3,317,658,954	3,932,391,368	

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。

【ＤＣニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	452,694,846	617,766,711
親投資信託受益証券	7,781,640,192	10,581,000,911
未収入金	8,307,226	11,683,568
流動資産合計	8,242,642,264	11,210,451,190
資産合計	8,242,642,264	11,210,451,190
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,137,820	11,470,424
未払受託者報酬	3,978,868	5,459,884
未払委託者報酬	47,746,874	65,519,083
その他未払費用	424,603	497,176
流動負債合計	60,288,165	82,946,567
負債合計	60,288,165	82,946,567
純資産の部		
元本等		
元本	8,368,019,873	8,884,319,042
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（　）	185,665,774	2,243,185,581
純資産合計	8,182,354,099	11,127,504,623
負債純資産合計	8,242,642,264	11,210,451,190

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期 （自平成23年12月21日 至平成24年12月20日）	第13期 （自平成24年12月21日 至平成25年12月20日）
営業収益		
受取利息	240,176	276,998
有価証券売買等損益	1,054,149,277	2,477,917,571
営業収益合計	1,054,389,453	2,478,194,569
営業費用		
受託者報酬	7,800,295	10,315,473
委託者報酬	93,604,363	123,786,683
その他費用	841,343	964,923
営業費用合計	102,246,001	135,067,079
営業利益又は営業損失（　）	952,143,452	2,343,127,490
経常利益又は経常損失（　）	952,143,452	2,343,127,490
当期純利益又は当期純損失（　）	952,143,452	2,343,127,490
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（　）	33,794,042	175,718,020
期首剰余金又は期首欠損金（　）	1,086,307,330	185,665,774
剰余金増加額又は欠損金減少額	89,051,722	261,441,885
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	89,051,722	12,156,817
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	249,285,068
剰余金減少額又は欠損金増加額	106,759,576	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	106,759,576	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（　）	185,665,774	2,243,185,581

（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。
--------------------	---

（表示方法の変更に関する注記）

損益及び剰余金計算書の「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、従来、それぞれ剰余金増加額又は欠損金減少額、剰余金減少額又は欠損金増加額の総額を表示しておりましたが、剰余金の増減をより明瞭に表示するため、当計算期間から純額表示へと変更しております。 変更の結果、損益及び剰余金計算書への影響はありません。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
１． 当該計算期間の末日における受益権総口数	8,368,019,873口	8,884,319,042口
２． 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は185,665,774円です。	—————
３． 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9778円 (9,778円)	1.2525円 (12,525円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第12期 (自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)	第13期 (自平成24年12月21日 至平成25年12月20日)
１． 投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために規定する額	10,455,388円	13,817,231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(218,129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(1,881,190,635円)及び分配準備積立金(319,010,964円)より分配対象収益は2,200,419,728円(1口当たり0.262956円)ですが、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(252,703円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,608,413,048円)、収益調整金(2,055,125,287円)及び分配準備積立金(281,076,903円)より分配対象収益は3,944,867,941円(1口当たり0.444026円)ですが、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。

3. 剰余金増加額・減少額及び 欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金減少額と欠損金増加額との純額を表示しております。	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」は、それぞれ欠損金減少額と欠損金増加額との純額を表示しております。
-------------------------------	---	---

(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12期 (自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)	第13期 (自平成24年12月21日 至平成25年12月20日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	926,473,269	1,943,778,460
合計	926,473,269	1,943,778,460

（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）

開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
期首元本額	7,812,888,753円	8,368,019,873円
期中追加設定元本額	1,212,513,645円	1,600,562,237円
期中一部解約元本額	657,382,525円	1,084,263,068円

（4）【附属明細表】（平成25年12月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額 （口）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド	458,179,777	1,100,318,734	
	ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド	1,467,484,566	2,263,007,949	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	2,960,852,779	3,836,080,860	

	ニッセイ国内株式マザーファンド	4,539,051,502	3,381,593,368	
親投資信託受益証券	合計	9,425,568,624	10,581,000,911	
合計		9,425,568,624	10,581,000,911	

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。

【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）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	239,570,219	352,756,190
親投資信託受益証券	4,088,291,839	5,977,979,651
未収入金	2,897,519	3,785,696
流動資産合計	4,330,759,577	6,334,521,537
資産合計	4,330,759,577	6,334,521,537
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,683,810	3,447,610
未払受託者報酬	2,041,969	3,062,572
未払委託者報酬	28,588,223	42,876,594
その他未払費用	316,099	379,397
流動負債合計	33,630,101	49,766,173
負債合計	33,630,101	49,766,173
純資産の部		
元本等		
元本	4,748,244,485	4,989,643,076
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（　）	451,115,009	1,295,112,288
純資産合計	4,297,129,476	6,284,755,364
負債純資産合計	4,330,759,577	6,334,521,537

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期 （自平成23年12月21日 至平成24年12月20日）	第13期 （自平成24年12月21日 至平成25年12月20日）
営業収益		
受取利息	123,444	154,697
有価証券売買等損益	707,160,852	1,804,974,769
営業収益合計	707,284,296	1,805,129,466
営業費用		
受託者報酬	3,995,999	5,733,063
委託者報酬	55,945,167	80,264,160
その他費用	626,051	736,555
営業費用合計	60,567,217	86,733,778
営業利益又は営業損失（　）	646,717,079	1,718,395,688
経常利益又は経常損失（　）	646,717,079	1,718,395,688
当期純利益又は当期純損失（　）	646,717,079	1,718,395,688
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（　）	22,278,350	196,605,746
期首剰余金又は期首欠損金（　）	1,029,729,053	451,115,009
剰余金増加額又は欠損金減少額	85,691,890	224,437,355
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	85,691,890	72,407,859
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	152,029,496
剰余金減少額又は欠損金増加額	131,516,575	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	131,516,575	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（　）	451,115,009	1,295,112,288

（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。
--------------------	---

（表示方法の変更に関する注記）

損益及び剰余金計算書の「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、従来、それぞれ剰余金増加額又は欠損金減少額、剰余金減少額又は欠損金増加額の総額を表示しておりましたが、剰余金の増減をより明瞭に表示するため、当計算期間から純額表示へと変更しております。 変更の結果、損益及び剰余金計算書への影響はありません。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
１． 当該計算期間の末日における受益権総口数	4,748,244,485口	4,989,643,076口
２． 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は451,115,009円です。	—————
３． 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9050円 (9,050円)	1.2596円 (12,596円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第12期 (自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)	第13期 (自平成24年12月21日 至平成25年12月20日)
１． 投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために規定する額	7,267,012円	10,394,099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(110,938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(1,444,650,875円)及び分配準備積立金(178,006,412円)より分配対象収益は1,622,768,225円(1口当たり0.341762円)ですが、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(136,345円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,080,791,329円)、収益調整金(1,559,279,579円)及び分配準備積立金(146,002,487円)より分配対象収益は2,786,209,740円(1口当たり0.558399円)ですが、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。

3. 剰余金増加額・減少額及び 欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金減少額と欠損金増加額との純額を表示しております。	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」は、それぞれ欠損金減少額と欠損金増加額との純額を表示しております。
-------------------------------	---	---

(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12期 (自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)	第13期 (自平成24年12月21日 至平成25年12月20日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
----	-------------------------	-------------------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	639,050,644	1,414,040,318
合計	639,050,644	1,414,040,318

（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）

開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
期首元本額	4,371,709,392円	4,748,244,485円
期中追加設定元本額	747,912,755円	1,206,182,414円
期中一部解約元本額	371,377,662円	964,783,823円

（4）【附属明細表】（平成25年12月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (口)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイノバトナム・海外債券マザーファンド	257,236,220	617,752,782	
	ニッセイノバトナム・海外株式マザーファンド	1,235,850,031	1,905,804,332	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	712,418,405	923,009,285	
	ニッセイ国内株式マザーファンド	3,397,870,138	2,531,413,252	
親投資信託受益証券 合計		5,603,374,794	5,977,979,651	
合計		5,603,374,794	5,977,979,651	

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）

「DCニッセイノバトナム・グローバルバランス（債券重視型）」は、「ニッセイ国内株式マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券マザーファンド」受益証券、「ニッセイノバトナム・海外株式マザーファンド」受益証券及び「ニッセイノバトナム・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計算期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

（参考）

「DCニッセイノバトナム・グローバルバランス（標準型）」は、「ニッセイ国内株式マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券マザーファンド」受益証券、「ニッセイノバトナム・海外株式マザーファンド」受益証券及び「ニッセイノバトナム・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計算期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

（参考）

「ＤＣニッセイ／パトナム・グローバルバランス（株式重視型）」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計算期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	977,503,454	374,713,386
株式	20,992,756,100	21,227,599,800
派生商品評価勘定	50,249,830	-
未収入金	750,164,999	862,180,592
未収配当金	240,000	3,655,239
差入委託証拠金	17,490,000	9,300,000
流動資産合計	22,788,404,383	22,477,449,017
資産合計	22,788,404,383	22,477,449,017
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	10,395
前受金	53,530,000	712,000
未払金	749,633,917	861,103,898
未払解約金	74,184,666	79,409,002
流動負債合計	877,348,583	941,235,295
負債合計	877,348,583	941,235,295
純資産の部		
元本等		
元本	44,708,506,918	28,909,364,883
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,797,451,118	7,373,151,161
純資産合計	21,911,055,800	21,536,213,722
負債純資産合計	22,788,404,383	22,477,449,017

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
--------------------	--

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
1. 計算日における受益権総口数	44,708,506,918口	28,909,364,883口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は 22,797,451,118円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は 7,373,151,161円であります。
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4901円 (4,901円)	0.7450円 (7,450円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日）	（自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．時価の算定方法	（１）有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成24年12月20日現在	平成25年12月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	2,635,793,349	4,759,704,765
合計	2,635,793,349	4,759,704,765

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

株式関連

種類	（平成24年12月20日 現在）				（平成25年12月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	838,460,000	-	888,810,000	50,350,000	138,600,000	-	138,600,000	-
合計	838,460,000	-	888,810,000	50,350,000	138,600,000	-	138,600,000	-

（注） 時価の算定方法

- 1．株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 2．株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 3．評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 4．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの計算期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
同計算期間の期首元本額	48,875,783,884円	44,708,506,918円
同計算期間中の追加設定元本額	8,907,603,458円	6,963,668,806円
同計算期間中の一部解約元本額	13,074,880,424円	22,762,810,841円
同計算期間末日の元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ／パトナム・グローバルバランスオープン （債券重視型）	1,383,142,108円	716,367,768円
ニッセイ／パトナム・グローバルバランスオープン （標準型）	1,053,238,643円	548,813,158円
ニッセイ／パトナム・グローバルバランスオープン （株式重視型）	677,166,597円	369,837,898円
ニッセイ／パトナム・グローバルバランスオープン （標準型）VA（適格機関投資家専用）	349,480,117円	220,023,666円
ニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型） SA（適格機関投資家限定）	8,357,344,915円	3,393,523,313円
ニッセイ／パトナム・グローバルバランス（標準型） SA（適格機関投資家限定）	14,385,111,722円	8,364,053,787円

ニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型） S A（適格機関投資家限定）	1,144,984,435円	969,573,124円
D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス （債券重視型）	1,390,082,156円	1,131,711,432円
D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス （標準型）	5,143,831,830円	4,539,051,502円
D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス （株式重視型）	3,574,718,118円	3,397,870,138円
D Cニッセイ国内株式アクティブ	645,826,046円	616,567,253円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（成長型） S A（適格機関投資家限定）	6,236,305,340円	4,287,045,187円
D Cニッセイバランスアクティブ	367,274,891円	354,926,657円
計	44,708,506,918円	28,909,364,883円

附属明細表（平成25年12月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ショーボンドHD	22,300	4,530	101,019,000	
コムシスホールディングス	69,500	1,584	110,088,000	
N I P P O	67,000	1,669	111,823,000	
大和ハウス	133,000	1,995	265,335,000	
大 気 社	56,500	2,220	125,430,000	
日本M & A センター	14,200	6,270	89,034,000	
カルビー	10,400	2,449	25,469,600	
カカクコム	157,600	1,766	278,321,600	
エムスリー	872	249,300	217,389,600	
キリンHD	135,000	1,500	202,500,000	
サントリー食品インター	55,400	3,490	193,346,000	
パル	18,400	2,532	46,588,800	
J P ホールディングス	84,400	390	32,916,000	
日本たばこ産業	89,400	3,365	300,831,000	
オープンハウス	46,800	2,369	110,869,200	
セブン&アイ・H L D G S	36,500	4,050	147,825,000	
T S I ホールディングス	166,100	638	105,971,800	
ブロードリーフ	179,500	1,952	350,384,000	
協和発酵キリン	93,000	1,152	107,136,000	
三菱瓦斯化学	293,000	843	246,999,000	
J S R	112,800	1,932	217,929,600	
三菱ケミカルH L D G S	311,000	480	149,280,000	
ダイセル	186,000	798	148,428,000	
宇部興産	666,000	208	138,528,000	
日立化成	82,600	1,667	137,694,200	
アステラス製薬	43,800	6,040	264,552,000	

日本新薬	41,000	1,942	79,622,000	
中外製薬	36,300	2,291	83,163,300	
小野薬品	11,300	8,380	94,694,000	
大塚ホールディングス	47,700	2,897	138,186,900	
D I C	434,000	304	131,936,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	11,200	4,140	46,368,000	
ポーラ・オルビスHD	24,300	3,850	93,555,000	
J Xホールディングス	448,100	526	235,700,600	
住友ゴム	84,300	1,453	122,487,900	
新日鐵住金	573,000	341	195,393,000	
神戸製鋼所	390,000	174	67,860,000	
住友鉱山	69,000	1,305	90,045,000	
住友電工	80,200	1,722	138,104,400	
ノーリツ	29,500	2,219	65,460,500	
リンナイ	13,400	7,750	103,850,000	
アマダ	126,000	928	116,928,000	
S M C	5,500	25,630	140,965,000	
小松製作所	74,300	2,102	156,178,600	
椿本チエイン	162,000	784	127,008,000	
不二越	383,000	575	220,225,000	
T H K	96,300	2,510	241,713,000	
日立	448,000	765	342,720,000	
三菱電機	117,000	1,271	148,707,000	
オムロン	57,700	4,485	258,784,500	
パナソニック	88,500	1,215	107,527,500	
ソニー	149,100	1,827	272,405,700	
堀場製作所	26,300	3,515	92,444,500	
O B A R A G R O U P	46,900	3,075	144,217,500	
カシオ	239,700	1,270	304,419,000	
ファナック	16,100	18,800	302,680,000	
村田製作所	30,400	9,050	275,120,000	
三菱重工業	186,000	633	117,738,000	
F P G	112,000	1,017	113,904,000	
日産自動車	94,700	871	82,483,700	
トヨタ自動車	183,900	6,170	1,134,663,000	
ケーヒン	65,500	1,596	104,538,000	
マツダ	632,000	508	321,056,000	
本田技研	131,600	4,300	565,880,000	
スズキ	79,100	2,747	217,287,700	
富士重工業	49,700	2,903	144,279,100	
スター精密	78,700	1,247	98,138,900	
東京精密	56,200	2,167	121,785,400	
トプコン	200,800	1,551	311,440,800	
朝日インテック	19,200	7,050	135,360,000	

キヤノン	74,000	3,325	246,050,000	
リコー	180,000	1,095	197,100,000	
エイベックス・グループHD	62,200	2,200	136,840,000	
伊藤忠	184,000	1,247	229,448,000	
丸紅	152,000	716	108,832,000	
ファミリーマート	22,700	4,735	107,484,500	
日立ハイテクノロジーズ	41,400	2,542	105,238,800	
三菱商事	222,700	1,967	438,050,900	
AOKIホールディングス	20,000	3,265	65,300,000	
青山商事	37,500	2,758	103,425,000	
三菱UFJフィナンシャルG	1,262,400	654	825,609,600	
三井住友トラストHD	416,000	540	224,640,000	
三井住友フィナンシャルG	104,200	5,280	550,176,000	
千葉銀行	164,000	697	114,308,000	
ふくおかフィナンシャルG	283,000	448	126,784,000	
みずほフィナンシャルG	1,533,600	214	328,190,400	
オリックス	179,400	1,791	321,305,400	
野村ホールディングス	339,800	776	263,684,800	
NKSJホールディングス	29,600	2,865	84,804,000	
第一生命	51,000	1,687	86,037,000	
東京海上HD	72,100	3,425	246,942,500	
T&Dホールディングス	116,200	1,402	162,912,400	
三菱地所	29,000	3,020	87,580,000	
住友不動産	97,000	4,960	481,120,000	
タカラレーベン	277,600	325	90,220,000	
東京急行	385,000	658	253,330,000	
東日本旅客鉄道	45,900	8,270	379,593,000	
商船三井	155,000	444	68,820,000	
日本航空	24,200	5,000	121,000,000	
日本電信電話	35,400	5,490	194,346,000	
光通信	33,300	7,970	265,401,000	
NTTドコモ	192,400	1,687	324,578,800	
中部電力	61,300	1,298	79,567,400	
大阪瓦斯	548,000	413	226,324,000	
NTTデータ	50,600	3,765	190,509,000	
ヤマダ電機	671,400	336	225,590,400	
ファーストリテイリング	2,800	41,850	117,180,000	
ソフトバンク	46,700	8,920	416,564,000	
合計	17,583,972		21,227,599,800	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ国内債券マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,029,098,915	896,815,660
国債証券	28,036,248,582	25,848,161,208
派生商品評価勘定	284,250	-
未収入金	4,391,862,920	6,064,148,568
未収利息	26,482,266	21,932,336
前払金	480,000	1,800,000
前払費用	26,317,938	17,871,373
差入委託証拠金	2,340,000	3,420,000
流動資産合計	33,513,114,871	32,854,149,145
資産合計	33,513,114,871	32,854,149,145
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,055,750
未払金	4,337,938,669	5,818,685,431
未払解約金	123,481,544	106,018,987
流動負債合計	4,461,420,213	5,926,760,168
負債合計	4,461,420,213	5,926,760,168
純資産の部		
元本等		

元本	22,992,942,186	20,783,679,317
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,058,752,472	6,143,709,660
純資産合計	29,051,694,658	26,927,388,977
負債純資産合計	33,513,114,871	32,854,149,145

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 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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
1. 計算日における受益権総口数	22,992,942,186口	20,783,679,317口
2. 1口当たり純資産額	1.2635円	1.2956円
（1万口当たり純資産額）	(12,635円)	(12,956円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日）	（自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
1 . 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成24年12月20日現在	平成25年12月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	43,208,221	78,960,995
合計	43,208,221	78,960,995

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

債券関連

種類	(平成24年12月20日 現在)				(平成25年12月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	863,760,000	-	864,060,000	300,000	865,380,000	-	863,340,000	2,040,000
合計	863,760,000	-	864,060,000	300,000	865,380,000	-	863,340,000	2,040,000

(注) 時価の算定方法

1. 債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 債券先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
3. 評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(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計算期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
同計算期間の期首元本額	23,864,166,533円	22,992,942,186円
同計算期間中の追加設定元本額	5,372,316,939円	8,104,893,711円
同計算期間中の一部解約元本額	6,243,541,286円	10,314,156,580円
同計算期間末日の元本の内訳		
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）	1,406,119,903円	1,101,228,051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）	454,267,353円	357,874,050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）	93,875,191円	77,494,762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）	150,705,747円	143,518,237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）	8,285,447,839円	5,389,232,445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）	6,051,281,250円	5,633,299,757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）	154,848,722円	209,833,674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）	1,413,234,049円	1,740,166,375円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス （標準型）	2,218,588,091円	2,960,852,779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）	495,613,988円	712,418,405円
DCニッセイ国内債券アクティブ	856,371,507円	904,576,862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）	1,215,478,912円	1,337,678,481円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	54,471,362円	56,705,879円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	23,354,573円	26,241,502円
DCニッセイバランスアクティブ	119,283,699円	132,558,058円
計	22,992,942,186円	20,783,679,317円

附属明細表（平成25年12月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考
国債証券	第328回 利付国債（2年）	1,100,500,000	1,100,720,100	
	第329回 利付国債（2年）	2,265,900,000	2,269,706,712	
	第330回 利付国債（2年）	1,105,700,000	1,107,579,690	
	第331回 利付国債（2年）	1,230,000,000	1,230,196,800	

第332回 利付国債（2年）	904,800,000	904,953,816	
第103回 利付国債（5年）	25,500,000	25,639,485	
第106回 利付国債（5年）	223,600,000	224,013,660	
第110回 利付国債（5年）	280,700,000	282,114,728	
第112回 利付国債（5年）	61,000,000	61,569,130	
第113回 利付国債（5年）	13,500,000	13,566,015	
第115回 利付国債（5年）	265,400,000	265,400,000	
第1回 利付国債（40年）	56,300,000	66,408,665	
第2回 利付国債（40年）	41,800,000	47,184,676	
第3回 利付国債（40年）	23,500,000	26,520,925	
第4回 利付国債（40年）	30,100,000	33,957,315	
第5回 利付国債（40年）	165,400,000	177,308,800	
第274回 利付国債（10年）	409,400,000	420,842,730	
第297回 利付国債（10年）	800,000	846,976	
第298回 利付国債（10年）	2,137,500,000	2,252,454,750	
第299回 利付国債（10年）	451,000,000	476,071,090	
第300回 利付国債（10年）	81,700,000	87,087,298	
第303回 利付国債（10年）	223,700,000	238,182,338	
第305回 利付国債（10年）	552,600,000	585,612,324	
第306回 利付国債（10年）	26,800,000	28,577,376	
第312回 利付国債（10年）	601,900,000	634,191,935	
第313回 利付国債（10年）	567,100,000	601,284,788	
第314回 利付国債（10年）	43,200,000	45,198,432	
第315回 利付国債（10年）	1,107,800,000	1,166,269,684	
第317回 利付国債（10年）	202,700,000	211,837,716	
第318回 利付国債（10年）	600,000	622,578	
第320回 利付国債（10年）	739,200,000	766,698,240	
第325回 利付国債（10年）	285,700,000	290,805,459	
第327回 利付国債（10年）	150,700,000	153,203,127	
第328回 利付国債（10年）	443,000,000	442,029,830	
第329回 利付国債（10年）	13,100,000	13,287,330	
第330回 利付国債（10年）	416,900,000	422,236,320	
第7回 利付国債（30年）	20,800,000	23,764,832	
第10回 利付国債（30年）	51,000,000	47,705,400	
第16回 利付国債（30年）	46,600,000	54,227,954	
第23回 利付国債（30年）	32,500,000	37,932,375	
第25回 利付国債（30年）	43,200,000	48,815,136	
第26回 利付国債（30年）	134,600,000	154,803,460	
第27回 利付国債（30年）	80,200,000	93,909,388	
第28回 利付国債（30年）	67,500,000	79,214,625	
第29回 利付国債（30年）	176,100,000	203,409,588	
第30回 利付国債（30年）	140,900,000	160,068,036	
第35回 利付国債（30年）	84,000,000	90,281,520	
第36回 利付国債（30年）	448,900,000	482,410,385	

第 3 7 回 利付国債（ 3 0 年）	1,900,000	1,998,439	
第 3 9 回 利付国債（ 3 0 年）	1,053,100,000	1,106,407,922	
第 7 2 回 利付国債（ 2 0 年）	7,100,000	8,116,933	
第 8 5 回 利付国債（ 2 0 年）	245,800,000	282,505,314	
第 8 6 回 利付国債（ 2 0 年）	25,600,000	30,045,952	
第 9 0 回 利付国債（ 2 0 年）	281,200,000	326,895,000	
第 9 2 回 利付国債（ 2 0 年）	524,900,000	603,750,478	
第 9 5 回 利付国債（ 2 0 年）	199,300,000	233,978,200	
第 9 7 回 利付国債（ 2 0 年）	96,000,000	111,393,600	
第 1 0 1 回 利付国債（ 2 0 年）	179,600,000	212,782,896	
第 1 0 8 回 利付国債（ 2 0 年）	1,100,000	1,224,234	
第 1 1 0 回 利付国債（ 2 0 年）	155,700,000	177,284,691	
第 1 1 1 回 利付国債（ 2 0 年）	532,800,000	613,183,536	
第 1 1 3 回 利付国債（ 2 0 年）	5,000,000	5,674,500	
第 1 1 4 回 利付国債（ 2 0 年）	64,900,000	73,523,263	
第 1 1 6 回 利付国債（ 2 0 年）	86,200,000	98,715,378	
第 1 1 8 回 利付国債（ 2 0 年）	800,000	891,144	
第 1 2 1 回 利付国債（ 2 0 年）	743,600,000	815,007,908	
第 1 2 2 回 利付国債（ 2 0 年）	293,200,000	317,054,752	
第 1 2 3 回 利付国債（ 2 0 年）	200,800,000	225,661,048	
第 1 2 8 回 利付国債（ 2 0 年）	438,600,000	477,109,080	
第 1 3 0 回 利付国債（ 2 0 年）	74,500,000	79,696,375	
第 1 3 2 回 利付国債（ 2 0 年）	3,900,000	4,097,535	
第 1 3 4 回 利付国債（ 2 0 年）	800,000	850,800	
第 1 3 5 回 利付国債（ 2 0 年）	674,500,000	706,451,065	
第 1 3 6 回 利付国債（ 2 0 年）	163,100,000	168,203,399	
第 1 4 0 回 利付国債（ 2 0 年）	61,200,000	63,735,516	
第 1 4 2 回 利付国債（ 2 0 年）	133,400,000	140,664,964	
第 1 4 3 回 利付国債（ 2 0 年）	43,100,000	43,906,832	
第 1 4 4 回 利付国債（ 2 0 年）	500,000	501,120	
第 1 4 5 回 利付国債（ 2 0 年）	380,600,000	392,965,694	
第 1 5 回 物価連動国債（ 1 0 年）	140,200,000	158,001,753	
第 1 7 回 物価連動国債（ 1 0 年）	203,400,000	215,158,350	
国債証券 合計	24,591,800,000	25,848,161,208	
合計	24,591,800,000	25,848,161,208	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第 4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	109,486,482	517,891,533
コール・ローン	242,830,212	68,856,562
株式	23,270,776,347	28,620,161,669
投資証券	120,995,597	713,695,457
派生商品評価勘定	159,944,260	156,516,531
未収入金	347,504,967	-
未収配当金	24,484,324	18,668,051
流動資産合計	24,276,022,189	30,095,789,803
資産合計	24,276,022,189	30,095,789,803
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	137,707,508	232,406,622
未払金	379,240,101	-
未払解約金	68,240,837	76,662,321
流動負債合計	585,188,446	309,068,943
負債合計	585,188,446	309,068,943
純資産の部		
元本等		
元本	25,159,133,563	19,316,232,198
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,468,299,820	10,470,488,662
純資産合計	23,690,833,743	29,786,720,860
負債純資産合計	24,276,022,189	30,095,789,803

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
1. 計算日における受益権総口数	25,159,133,563口	19,316,232,198口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,468,299,820円であります。	—
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9416円 (9,416円)	1.5421円 (15,421円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日）	（自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成24年12月20日現在	平成25年12月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	2,766,322,181	4,836,236,767
投資証券	3,209,900	165,557,903
合計	2,763,112,281	5,001,794,670

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成24年12月20日 現在）				（平成25年12月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	5,749,605,749	-	5,886,784,656	137,178,907	7,926,484,497	-	8,158,891,119	232,406,622
アメリカ・ドル	4,205,159,244	-	4,294,927,440	89,768,196	4,229,115,097	-	4,407,337,418	178,222,321
イギリス・ポンド	1,214,949,908	-	1,258,475,787	43,525,879	1,799,799,664	-	1,825,700,682	25,901,018
カナダ・ドル	-	-	-	-	159,988,612	-	161,592,798	1,604,186
シンガポール・ドル	-	-	-	-	125,649,702	-	130,865,230	5,215,528
スイス・フラン	46,772,799	-	46,666,509	106,290	256,078,210	-	256,320,980	242,770
スウェーデン・クローナ	140,208,294	-	143,219,928	3,011,634	-	-	-	-
ユーロ	142,515,504	-	143,494,992	979,488	1,355,853,212	-	1,377,074,011	21,220,799
買 建	5,749,605,749	-	5,909,021,408	159,415,659	7,649,824,497	-	7,806,341,028	156,516,531

アメリカ・ドル	1,544,446,505	-	1,575,994,541	31,548,036	3,697,369,400	-	3,757,160,579	59,791,179
イスラエル・シ ケル	66,212,922	-	69,192,064	2,979,142	85,914,443	-	91,618,560	5,704,117
オーストラリア・ ドル	691,889,691	-	711,976,176	20,086,485	845,894,518	-	850,119,242	4,224,724
カナダ・ドル	1,208,173,558	-	1,241,591,980	33,418,422	1,250,003,307	-	1,283,303,598	33,300,291
シンガポール・ド ル	50,946,798	-	52,046,056	1,099,258	-	-	-	-
スイス・フラン	588,086,665	-	610,070,581	21,983,916	1,207,650,903	-	1,241,675,968	34,025,065
スウェーデン・ク ローナ	339,117,917	-	351,615,696	12,497,779	112,405,314	-	113,953,737	1,548,423
デンマーク・ク ローネ	97,163,662	-	100,650,320	3,486,658	125,665,595	-	128,781,140	3,115,545
ノルウェー・ク ローネ	98,894,991	-	102,384,152	3,489,161	113,011,412	-	114,672,966	1,661,554
ユーロ	1,008,779,453	-	1,037,544,822	28,765,369	-	-	-	-
香港・ドル	55,893,587	-	55,955,020	61,433	211,909,605	-	225,055,238	13,145,633
合計	11,499,211,498	-	11,795,806,064	22,236,752	15,576,308,994	-	15,965,232,147	75,890,091

（注） 時価の算定方法

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの計算期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
同計算期間の期首元本額	29,601,963,078円	25,159,133,563円
同計算期間中の追加設定元本額	4,732,092,054円	4,654,696,656円
同計算期間中の一部解約元本額	9,174,921,569円	10,497,598,021円
同計算期間末日の元本の内訳		
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）	352,736,815円	173,696,908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）	358,135,460円	177,419,176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）	259,043,111円	134,494,758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）V A（適格機関投資家専用）	118,824,918円	71,133,693円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型） S A（適格機関投資家限定）	2,128,308,269円	866,724,701円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型） S A（適格機関投資家限定）	4,885,881,739円	2,847,152,096円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型） S A（適格機関投資家限定）	437,616,410円	371,019,494円
D Cニッセイノパトナム・グローバル・コア株式	9,742,811,420円	9,467,993,992円
D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス （債券重視型）	354,508,067円	274,420,091円
D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス （標準型）	1,749,103,810円	1,467,484,566円
D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス （株式重視型）	1,367,527,125円	1,235,850,031円
ニッセイノパトナム・グローバルバランス（成長型） S A（適格機関投資家限定）	2,404,630,430円	1,656,380,264円
ニッセイノパトナム・グローバル・コア株式 S A （適格機関投資家限定）	131,945,893円	85,762,912円
ニッセイノパトナム・バランスアップオープン	750,163,833円	378,157,131円
D Cニッセイバランスアクティブ	117,896,263円	108,542,385円
計	25,159,133,563円	19,316,232,198円

附属明細表（平成25年12月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AIRGAS INC	20,400	109.95	2,242,980.00	
	ALCATEL-LUCENT-SPONSORED ADR	638,900	4.54	2,900,606.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	86,768	50.36	4,369,636.48	
	APPLIED MATERIALS INC	141,400	16.88	2,386,832.00	
	ASSURED GUARANTY LTD	77,100	22.68	1,748,628.00	
	BANK OF AMERICA CORP	197,800	15.75	3,115,350.00	
	BEAM INC	20,800	66.94	1,392,352.00	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	55,300	53.84	2,977,352.00	
	BRUNSWICK CORP	42,425	45.38	1,925,246.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	60,600	38.31	2,321,586.00	
	CAPITAL SENIOR LIVING CORP	92,200	23.76	2,190,672.00	
	CARLYLE GROUP/THE	67,400	34.90	2,352,260.00	
	CATAMARAN CORP	73,000	46.63	3,403,990.00	
	CBRE GROUP INC	66,100	25.56	1,689,516.00	
	CBS CORP-CL B	38,600	60.72	2,343,792.00	
	CELGENE CORP	20,300	164.02	3,329,606.00	
	CENTURYLINK INC	97,600	31.36	3,060,736.00	

CHARLES SCHWAB CORP	133,700	25.58	3,420,046.00	
CME GROUP INC	72,200	83.68	6,041,696.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	33,000	54.35	1,793,550.00	
COTY INC-CL A	95,500	15.18	1,449,690.00	
DISH NETWORK CORP	69,800	55.83	3,896,934.00	
ELECTRONIC ARTS INC	73,600	23.42	1,723,712.00	
EMERITUS CORP	83,901	20.55	1,724,165.55	
ENERGY TRANSFER EQUITY LP	22,700	79.14	1,796,478.00	
EXCO RESOURCES INC	268,800	4.99	1,341,312.00	
FACEBOOK INC-A	94,800	55.05	5,218,740.00	
FORESTAR REAL ESTATE GROUP	103,500	20.36	2,107,260.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	62,279	43.27	2,694,812.33	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	191,400	15.28	2,924,592.00	
GOOGLE INC-CL A	4,796	1,086.22	5,209,511.12	
GROUPON INC	155,800	11.65	1,815,070.00	
HALLIBURTON CO	40,500	49.42	2,001,510.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	88,510	35.52	3,143,875.20	
HOME DEPOT INC	29,070	79.95	2,324,146.50	
HOMEAWAY INC	42,000	40.00	1,680,000.00	
HOVNANIAN ENTERPRISES-A	337,400	5.64	1,902,936.00	
HOWARD HUGHES CORP/THE	13,800	111.84	1,543,392.00	
J.C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	131,800	7.96	1,049,128.00	
KODIAK OIL & GAS CORP	238,100	11.03	2,626,243.00	
LAM RESEARCH CORP	43,200	53.02	2,290,464.00	
LOWE'S COS INC	69,600	48.39	3,367,944.00	
MARATHON OIL CORP	87,600	34.91	3,058,116.00	
MASCO CORP	109,500	21.67	2,372,865.00	
MEADWESTVACO CORP	68,200	36.16	2,466,112.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	168,300	21.62	3,638,646.00	
MONSANTO CO	44,600	113.81	5,075,926.00	
MORGAN STANLEY	134,700	30.86	4,156,842.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	18,100	110.55	2,000,955.00	
NRG ENERGY INC	65,900	28.42	1,872,878.00	
OFFICE DEPOT INC	360,500	5.28	1,903,440.00	
PENN NATIONAL GAMING INC	94,300	14.12	1,331,516.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	49,900	85.48	4,265,452.00	
PULTE GROUP INC	100,400	18.25	1,832,300.00	
RADIAN GROUP INC	193,880	13.97	2,708,503.60	
RE/MAX HOLDINGS INC-CL A	74,916	29.53	2,212,269.48	
SEALED AIR CORP	80,800	32.55	2,630,040.00	
SEARS HOMETOWN AND OUTLET ST	38,600	24.88	960,368.00	
STANDARD PACIFIC CORP	244,146	8.20	2,001,997.20	

	TAYLOR MORRISON HOME CORP-A	77,242	20.92	1,615,902.64	
	TESLA MOTORS INC	11,900	140.72	1,674,568.00	
	TILE SHOP HLDGS INC	65,215	17.43	1,136,697.45	
	TRONOX LTD	60,442	22.57	1,364,175.94	
	VISA INC-CLASS A SHARES	24,000	216.08	5,185,920.00	
	YAHOO! INC	80,900	40.20	3,252,180.00	
	ZIONS BANCORPORATION	64,300	29.22	1,878,846.00	
アメリカ・ドル 小計		6,614,790		169,434,864.99 (17,688,999,905)	
イギリス・ポンド	ASTRAZENECA PLC	64,563	35.99	2,323,622.37	
	BARCLAYS PLC	1,513,616	2.57	3,896,047.58	
	BG GROUP PLC	139,569	12.57	1,755,080.17	
	BRITVIC PLC	242,631	6.74	1,635,332.94	
	CAIRN ENERGY PLC	313,150	2.66	833,605.30	
	COMPASS GROUP PLC	148,985	9.31	1,387,050.35	
	EXPERIAN PLC	87,966	10.84	953,551.44	
	FIDESSA GROUP PLC	51,607	22.50	1,161,157.50	
	PERSIMMON PLC	112,809	11.82	1,333,402.38	
	PRUDENTIAL PLC	133,468	13.06	1,743,092.08	
	REGUS PLC	589,649	2.00	1,181,066.94	
	TAYLOR WIMPEY PLC	1,288,112	1.09	1,406,618.30	
	TELECITY GROUP PLC	171,346	6.84	1,172,863.37	
	THOMAS COOK GROUP PLC	1,163,616	1.68	1,957,202.11	
	TUI TRAVEL PLC	436,035	4.00	1,746,320.17	
イギリス・ポンド 小計		6,457,122		24,486,013.00 (4,181,721,300)	
オーストラリア・ドル	ORIGIN ENERGY LIMITED	149,066	13.67	2,037,732.22	
オーストラリア・ドル 小計		149,066		2,037,732.22 (188,551,362)	
カナダ・ドル	NORBORD INC	46,900	33.55	1,573,495.00	
カナダ・ドル 小計		46,900		1,573,495.00 (153,903,546)	
シンガポール・ドル	EZION HOLDINGS LTD	1,885,400	2.25	4,242,150.00	
シンガポール・ドル 小計		1,885,400		4,242,150.00 (349,256,210)	
スイス・フラン	NOVARTIS AG	23,414	70.40	1,648,345.60	
スイス・フラン 小計		23,414		1,648,345.60 (191,422,374)	
スウェーデン・クローナ	VOLVO AB	202,750	81.90	16,605,225.00	
スウェーデン・クローナ 小計		202,750		16,605,225.00 (263,026,764)	

ユーロ	ANTENA 3 TELEVISION	205,253	11.66	2,393,249.98	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	1,800,156	0.99	1,791,155.22	
	BANKIA SA	1,128,665	1.09	1,231,373.51	
	BUZZI UNICEM SPA	87,208	12.64	1,102,309.12	
	ERSTE GROUP BANK AG	98,188	24.84	2,438,989.92	
	EURAZEO	22,042	56.86	1,253,308.12	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENSE AND SPACE CO	33,785	55.84	1,886,554.40	
	FAURECIA	46,101	27.02	1,245,649.02	
	HEIDELBERGCEMENT AG	32,407	53.96	1,748,681.72	
	INDITEX SA	21,441	115.85	2,483,939.85	
	ING GROEP NV	236,275	9.56	2,260,679.20	
	MONCLER SPA	26,291	14.60	383,848.60	
	NUMERICABLE GROUP- W/I	39,854	28.25	1,125,875.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	129,826	25.23	3,276,159.11	
	SANOFI	44,643	75.21	3,357,600.03	
	SOCIETE GENERALE	26,863	40.83	1,096,950.60	
	SOLVAY SA	12,556	109.35	1,372,998.60	
	UNICREDIT SPA	446,473	5.29	2,364,074.53	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	213,069	4.85	1,035,089.20	
	UNIPOL GRUPPO FINANZIARI-PRF	521,982	3.39	1,770,562.94	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	115,085	11.21	1,290,678.27	
	WACKER CHEMIE AG	15,450	77.49	1,197,220.50	
ユーロ 小計		5,303,613		38,106,947.94 (5,425,286,178)	
香港・ドル	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	643,500	20.55	13,223,925.00	
香港・ドル 小計		643,500		13,223,925.00 (177,994,030)	
合計		21,326,555		28,620,161,669 (28,620,161,669)	

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	BLACKSTONE GROUP LP/THE	82,000.00	2,470,660.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,700.00	1,660,399.00	
	アメリカ・ドル 小計		115,700.00	4,131,059.00 (431,282,560)	
	ユーロ	HIBERNIA REIT PLC-W/I	1,744,639.00	1,983,654.54	
	ユーロ 小計		1,744,639.00	1,983,654.54 (282,412,897)	
投資証券 合計				713,695,457 (713,695,457)	
合計				713,695,457	

- （注）１．通貨種類ごとの小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
- ２．種類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。
- 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 66銘柄	59.39%	-%	61.77%
	投資証券 2銘柄	-%	1.45%	
イギリス・ポンド	株式 15銘柄	14.04%	-%	14.26%
オーストラリア・ドル	株式 1銘柄	0.63%	-%	0.64%
カナダ・ドル	株式 1銘柄	0.52%	-%	0.52%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	1.17%	-%	1.19%
スイス・フラン	株式 1銘柄	0.64%	-%	0.65%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	0.88%	-%	0.90%
ユーロ	株式 22銘柄	18.21%	-%	19.46%
	投資証券 1銘柄	-%	0.95%	
香港・ドル	株式 1銘柄	0.60%	-%	0.61%

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第４ 不動産等明細表

該当事項はありません。

第５ 商品明細表

該当事項はありません。

第６ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第７ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第８ 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド」の状況

	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,352,037,484	2,167,153,382
コール・ローン	74,558,795	182,875,823
国債証券	14,959,017,474	13,185,844,194
特殊債券	1,600,613,059	1,100,716,791
社債券	1,049,790,386	985,676,906
派生商品評価勘定	236,258,479	277,060,690
未収入金	-	357,818,824
未収利息	126,087,243	122,826,614
前払費用	21,617,681	32,920,455
流動資産合計	19,419,980,601	18,412,893,679
資産合計	19,419,980,601	18,412,893,679
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	209,970,306	298,747,797
未払金	-	179,524,363
未払解約金	47,059,400	84,139,362
流動負債合計	257,029,706	562,411,522
負債合計	257,029,706	562,411,522
純資産の部		
元本等		
元本	9,876,583,502	7,432,986,902
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,286,367,393	10,417,495,255
純資産合計	19,162,950,895	17,850,482,157
負債純資産合計	19,419,980,601	18,412,893,679

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	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
1． 計算日における受益権総口数	9,876,583,502口	7,432,986,902口
2． 1口当たり純資産額	1.9402円	2.4015円
（1万口当たり純資産額）	(19,402円)	(24,015円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日）	（自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日）
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成24年12月20日現在	平成25年12月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	292,235,142	143,085,447
特殊債券	42,184,086	28,941,006
社債券	2,416,303	18,366,779
合計	336,835,531	190,393,232

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成24年12月20日 現在）				（平成25年12月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	8,004,998,307	-	8,214,968,613	209,970,306	9,734,476,276	-	10,012,249,110	277,772,834
アメリカ・ドル	4,742,118,065	-	4,842,145,412	100,027,347	4,489,365,934	-	4,672,336,081	182,970,147
イギリス・ポンド	788,624,768	-	818,094,336	29,469,568	757,279,911	-	765,072,219	7,792,308
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	1,279,762,630	-	1,273,166,069	6,596,561
カナダ・ドル	1,335,221,637	-	1,371,258,850	36,037,213	1,152,041,566	-	1,181,577,717	29,536,151
スイス・フラン	-	-	-	-	32,609,155	-	33,506,390	897,235
スウェーデン・クローナ	94,450,734	-	97,960,212	3,509,478	-	-	-	-
デンマーク・クローネ	13,684,662	-	14,238,156	553,494	85,440,649	-	87,432,200	1,991,551
ノルウェー・クローネ	90,228,372	-	93,474,888	3,246,516	133,080,612	-	134,540,673	1,460,061
ポーランド・ズロチ	168,697,617	-	174,368,598	5,670,981	21,191,845	-	21,470,022	278,177
メキシコ・ペソ	7,168,807	-	7,324,893	156,086	806,551,288	-	854,651,396	48,100,108
ユーロ	764,803,645	-	796,103,268	31,299,623	833,799,000	-	844,998,438	11,199,438
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	143,353,686	-	143,497,905	144,219
買 建	7,824,108,307	-	8,060,366,786	236,258,479	9,734,476,276	-	9,990,562,003	256,085,727
アメリカ・ドル	3,262,880,242	-	3,336,963,590	74,083,348	5,245,110,342	-	5,424,313,290	179,202,948
イギリス・ポンド	-	-	-	-	403,113,860	-	405,809,820	2,695,960
オーストラリア・ドル	954,042,733	-	981,739,872	27,697,139	1,211,221,284	-	1,198,997,380	12,223,904
カナダ・ドル	24,704,426	-	24,781,120	76,694	715,969,347	-	737,681,187	21,711,840
シンガポール・ドル	80,161,519	-	81,891,130	1,729,611	72,209,755	-	74,539,110	2,329,355
スイス・フラン	76,976,322	-	79,853,860	2,877,538	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	42,665,269	-	43,252,998	587,729
ノルウェー・クローネ	141,365,121	-	143,983,840	2,618,719	124,748,429	-	126,048,381	1,299,952
ポーランド・ズロチ	396,198,937	-	415,682,064	19,483,127	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	527,634,115	-	546,495,228	18,861,113	504,434,983	-	540,420,482	35,985,499
ユーロ	2,243,764,677	-	2,324,601,056	80,836,379	1,318,718,175	-	1,339,898,860	21,180,685
南アフリカ・ランド	116,380,215	-	124,375,026	7,994,811	96,284,832	-	99,600,495	3,315,663
合計	15,829,106,614	-	16,275,335,399	26,288,173	19,468,952,552	-	20,002,811,113	21,687,107

（注） 時価の算定方法

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されていない先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの計算期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成24年12月20日現在）	（平成25年12月20日現在）
同計算期間の期首元本額	10,828,142,624円	9,876,583,502円
同計算期間中の追加設定元本額	850,371,405円	977,989,408円
同計算期間中の一部解約元本額	1,801,930,527円	3,421,586,008円
同計算期間末日の元本の内訳		
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）	168,493,903円	108,442,228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）	85,535,089円	55,379,948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）	41,243,010円	27,983,614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）	28,379,648円	22,210,492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）	1,013,295,382円	543,009,298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）	1,163,002,295円	891,888,224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）	69,439,179円	77,489,376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）	169,343,383円	171,361,056円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス （標準型）	417,743,539円	458,179,777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）	217,735,634円	257,236,220円
DCニッセイノパトナム・グローバル債券	1,338,098,010円	1,362,352,905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）	408,814,779円	370,619,307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）	4,727,794,413円	3,055,450,722円
DCニッセイバランスアクティブ	27,665,238円	31,383,735円
計	9,876,583,502円	7,432,986,902円

附属明細表（平成25年12月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 1 2016/08/31	6,070,000.00	6,135,859.50	
		US TREASURY N/B 1 2019/08/31	7,916,000.00	7,519,566.72	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	7,300,000.00	6,674,901.00	
		US TREASURY N/B 2 2023/02/15	2,313,000.00	2,159,925.66	
		US TREASURY N/B 2.75 2017/12/31	3,640,000.00	3,860,656.80	
		US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	3,340,000.00	2,665,720.80	
		US TREASURY N/B 3.5 2018/02/15	930,000.00	1,014,276.60	
	アメリカ・ドル 小計		31,509,000.00	30,030,907.08 (3,135,226,699)	
	イギリス・ポンド	TSY 2 3/4% 2015 2.75 2015/01/22	1,670,000.00	1,711,466.10	
		TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	990,000.00	1,079,090.10	
		UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	2,905,000.00	2,675,853.60	
		UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	2,830,000.00	2,630,173.70	
	イギリス・ポンド 小計		8,395,000.00	8,096,583.50 (1,382,734,530)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	1,940,000.00	2,139,373.80	
	オーストラリア・ドル 小計		1,940,000.00	2,139,373.80 (197,956,258)	
	カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2018/09/01	2,090,000.00	2,031,898.00	
		CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	2,970,000.00	3,007,392.30	
		CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	350,000.00	454,104.00	
	カナダ・ドル 小計		5,410,000.00	5,493,394.30 (537,308,896)	
	スイス・フラン	SWITZERLAND 2 2022/05/25	450,000.00	487,476.00	
	スイス・フラン 小計		450,000.00	487,476.00 (56,610,588)	

スウェーデン・クロナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	3,540,000.00	3,877,857.60	
スウェーデン・クロナ 小計		3,540,000.00	3,877,857.60 (61,425,264)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 4 2017/11/15	7,000,000.00	7,936,600.00	
	KINGDOM OF DENMARK 7 2024/11/10	2,680,000.00	4,027,611.20	
デンマーク・クローネ 小計		9,680,000.00	11,964,211.20 (228,277,150)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 5 2016/04/25	9,170,000.00	9,591,820.00	
ポーランド・ズロチ 小計		9,170,000.00	9,591,820.00 (328,327,999)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2015/12/17	64,890,000.00	70,044,861.60	
メキシコ・ペソ 小計		64,890,000.00	70,044,861.60 (563,160,687)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	10,640,000.00	12,319,949.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.25 2016/04/30	1,060,000.00	1,097,757.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.1 2018/07/30	3,690,000.00	3,932,986.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	2,860,000.00	2,924,922.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	2,320,000.00	2,640,508.00	
	BUNDES Obligation 1 2018/10/12	3,280,000.00	3,300,598.40	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25 2020/09/04	2,640,000.00	2,810,702.40	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	2,136,000.00	2,047,676.40	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2016/08/01	636,000.00	670,757.40	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	5,060,000.00	5,302,374.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	4,550,000.00	4,884,425.00	
	FINNISH GOVERNMENT 1.75 2016/04/15	880,000.00	909,286.40	
	FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	690,000.00	777,340.20	
	FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	554,000.00	676,644.52	

		IRISH TSY 5.5% 2017 5.5 2017/10/18	260,000.00	295,913.80	
		TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	1,300,000.00	1,461,460.00	
	ユーロ 小計		42,556,000.00	46,053,301.82 (6,556,608,580)	
	南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2018/12/21	13,330,000.00	13,806,947.40	
	南アフリカ・ランド 小計		13,330,000.00	13,806,947.40 (138,207,543)	
国債証券 合計				13,185,844,194 (13,185,844,194)	
特殊債券	アメリカ・ドル	FHLMC GOLD A17598 6.5 2034/01/01	6,828.42	7,633.42	
		FHLMC GOLD A20871 6.5 2034/04/01	38,504.83	43,023.75	
		FHLMC GOLD C52510 6.5 2031/05/01	2,266.09	2,532.15	
		FHLMC GOLD G08008 6.5 2034/07/01	20,259.91	22,582.49	
		FNMA 545477 7 2032/03/01	26,665.73	30,771.18	
		FNMA 555571 6.5 2033/03/01	9,439.62	10,766.16	
		FNMA 602285 6.5 2031/08/01	6,573.13	7,320.10	
		FNMA 609480 7 2031/10/01	4,728.93	5,336.97	
		FNMA 797553 5 2020/04/01	4,065.16	4,341.67	
		FNMA 813915 4.5 2020/11/01	14,782.91	15,772.33	
		FNW 2003-W1 2A 6.7311 2042/12/01	448,552.04	520,320.36	
		FNW 2003-W3 1A1 6.5 2042/08/01	7,676.74	8,713.71	
		GNMA 781542 6 2033/01/01	20,315.27	22,920.70	
		KFW 4 2020/01/27	1,180,000.00	1,292,324.20	
	アメリカ・ドル 小計		1,790,658.78	1,994,359.19 (208,211,099)	
	ノルウェー・クローネ	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN 3.5 2014/09/05	6,500,000.00	6,568,705.00	
	ノルウェー・クローネ 小計		6,500,000.00	6,568,705.00 (111,339,550)	
	ユーロ	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN 2.25 2016/08/24	1,121,000.00	1,170,749.98	
		EFSF 2.25 2022/09/05	1,360,000.00	1,379,733.60	
		ELECTRICITE DE FRANCE 5 2018/02/05	400,000.00	459,168.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.125 2024/04/15	225,000.00	262,221.75	

		EUROPEAN UNION 3.25 2018/04/04	2,010,000.00	2,214,999.90	
	ユーロ 小計		5,116,000.00	5,486,873.23 (781,166,142)	
特殊債券 合計				1,100,716,791 (1,100,716,791)	
社債券	アメリカ・ドル	AUST & NZ BANKING GROUP 0.9 2016/02/12	400,000.00	400,512.00	
		BACM 2005-1 AJ 5.2895 2042/11/10	775,000.00	814,122.00	
		BACM 2006-5 A2 5.317 2047/09/01	865,430.81	870,779.16	
		BACM 2006-6 A2 5.309 2045/10/01	43,884.36	43,996.25	
		BACM 2007-2 A2 5.6326 2049/04/01	29,003.86	29,045.03	
		BERKSHIRE HATHAWAY FIN 4.3 2043/05/15	95,000.00	84,735.25	
		Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Inc 5.1705 2042/11/01	525,819.29	534,374.35	
		COMM 2005-LP5 D 5.08603 2043/05/01	500,000.00	521,505.00	
		CSMC 2007-C4 A2 5.75977 2039/09/01	296,017.70	296,366.97	
		DBRR 2013-EZ3 A 1.636 2049/12/15	483,869.16	484,623.99	
		DLJCM 1998-CG1 B4 7.1722 2031/06/01	10,612.85	10,615.50	
		GSMS 2004-GG2 C 5.532 2038/08/01	295,000.00	300,593.20	
		GSMS 2006-GG6 A2 5.506 2038/04/01	28,602.11	28,598.95	
		JPMCC 2003-CB6 E 5.83977 2037/07/01	120,000.00	126,112.80	
		JPMCC 2004-LN2 A2 5.115 2041/07/01	483,044.95	488,899.45	
		JPMCC 2007-LD11 A2 5.79051 2049/06/01	275,417.50	277,656.63	
		JPMCC 2007-LD12 A3 5.92724 2051/02/01	1,069,012.29	1,079,413.77	
		JPMCC 2007-LDPX A3S 5.317 2049/01/01	183,195.94	183,118.99	
		MLCFC 2006-4 A2FL 0.28935 2049/12/12	114,265.00	114,075.31	
		MLMT 2007-C1 A3 5.85848 2050/06/01	99,954.04	103,003.63	

有価証券報告書（内国投資信託）

		MSC 2006-T23 A2 5.74113 2041/08/01	12,618.14	12,596.67	
		MSC 2007-IQ14 A2 5.61 2049/04/01	179,008.57	179,375.53	
		MSRR 2010-C30 A3B 5.246 2043/12/01	366,932.90	367,791.51	
		WBCMT 2007-C34 A2 5.569 2046/05/01	317,794.45	317,355.89	
		WFRBS 2012-C9 C 4.543 2045/11/01	630,000.00	610,923.60	
		WFRBS 2013-C17 XA 1.62136 2046/12/01	2,782,437.44	260,936.98	
	アメリカ・ドル 小計		10,981,921.36	8,541,128.41 (891,693,806)	
	ユーロ	FORTUM OYJ 4.5 2016/06/20	450,000.00	490,801.50	
		GE CAPITAL TRUST IV 4.625 2066/09/15	165,000.00	169,331.25	
	ユーロ 小計		615,000.00	660,132.75 (93,983,100)	
社債券 合計				985,676,906 (985,676,906)	
合計				15,272,237,891 (15,272,237,891)	

（注）１．通貨種類ごとの小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

２．種類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。

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 7銘柄	17.56%	27.73%
	特殊債券 14銘柄	1.17%	
	社債券 26銘柄	5.00%	
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	7.75%	9.05%
オーストラリア・ドル	国債証券 1銘柄	1.11%	1.30%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	3.01%	3.52%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.32%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	0.34%	0.40%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	1.28%	1.49%
ノルウェー・クローネ	特殊債券 1銘柄	0.62%	0.73%
ポーランド・ズロチ	国債証券 1銘柄	1.84%	2.15%
メキシコ・ペソ	国債証券 1銘柄	3.15%	3.69%
ユーロ	国債証券 16銘柄	36.73%	48.66%
	特殊債券 5銘柄	4.38%	
	社債券 2銘柄	0.53%	
南アフリカ・ランド	国債証券 1銘柄	0.77%	0.90%

(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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）」（平成26年1月31日現在）

資産総額	4,158,390,248円
負債総額	7,847,814円
純資産総額（ - ）	4,150,542,434円
発行済数量	3,404,091,695口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2193円

「DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）」（平成26年1月31日現在）

資産総額	11,126,839,516円
負債総額	41,684,741円
純資産総額（ - ）	11,085,154,775円
発行済数量	8,946,424,342口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2391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）」（平成26年1月31日現在）

資産総額	6,210,958,888円
負債総額	15,768,558円
純資産総額（ - ）	6,195,190,330円
発行済数量	4,998,462,553口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2394円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者に対する特典

ありません。

（3）譲渡制限

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（4）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

前記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部【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】

（1）資本金の額

平成26年1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年間ににおける資本金の増減はありません。

（2）委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年1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	213	25,013
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	19	3,074
単位型公社債投資信託	0	0

合計	232	28,087
----	-----	--------

- 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】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

- (1) 委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
- (2) 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第18期事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第19期事業年度に係る中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

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

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金				
利益準備金		139,807		139,807
その他利益剰余金				
配当準備積立金		120,000		120,000
研究開発積立金		70,000		70,000
別途積立金		350,000		350,000
繰越利益剰余金		17,833,930		18,272,607
利益剰余金合計		18,513,737		18,952,414
株主資本合計		36,795,577		37,234,254

評価・換算差額等

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

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

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

負債・純資産合計

40,162,198

41,987,127

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月 1 日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月 1 日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	10,000,000	10,000,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	8,281,840	8,281,840
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計		
当期首残高	8,281,840	8,281,840
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	139,807	139,807
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
当期首残高	120,000	120,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	120,000	120,000
研究開発積立金		
当期首残高	70,000	70,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	70,000	70,000
別途積立金		
当期首残高	350,000	350,000
当期変動額		

当期変動額合計	-	-
当期末残高	350,000	350,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	17,625,364	17,833,930
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	17,833,930	18,272,607
利益剰余金合計		
当期首残高	18,305,171	18,513,737
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	18,513,737	18,952,414
株主資本合計		
当期首残高	36,587,011	36,795,577
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	36,795,577	37,234,254
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	227,494	280,116
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	52,622	566,019
当期変動額合計	52,622	566,019
当期末残高	280,116	846,135
評価・換算差額等合計		
当期首残高	227,494	280,116
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	52,622	566,019
当期変動額合計	52,622	566,019
当期末残高	280,116	846,135
純資産合計		
当期首残高	36,814,506	37,075,694
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236

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

（重要な会計方針）**1．有価証券の評価基準及び評価方法**

満期保有目的の債券

償却原価法（定額法）によっております。

其他有価証券

時価のあるもの

…決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。

時価のないもの

…移動平均法に基づく原価法によっております。

関係会社株式

移動平均法に基づく原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定率法によっております。

主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。

無形固定資産

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4．引当金の計上基準

賞与引当金

従業員への賞与の支給に充てるため、当事業年度末在籍者に対する支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

退職給付引当金

従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額（簡便法により自己都合退職による期末要支給額の100%）を計上しております。

なお受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。

役員退職慰労引当金

役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

5．リース取引の処理方法

平成19年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるものの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。

6．消費税及び地方消費税の会計処理

税抜方式によっております。

（会計方針の変更）

平成23年度の税制改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以降に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。この結果、従来の方法に比べて、当事業年度の減価償却費が3,082千円減少し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益が3,082千円増加しております。

(注記事項)

(貸借対照表関係)

１．関係会社に対する資産及び負債は以下のとおりであり、すべて親会社に対するものであります。

	前事業年度 (平成24年 3月31日)	当事業年度 (平成25年 3月31日)
前払費用	52,725千円	54,152千円
未収運用受託報酬	383,091	493,954
未収投資助言報酬	135,967	133,324
差入保証金	280,262	280,262
未払手数料	90,057	112,306
その他未払金	19,525	35,771
未払費用	59,677	12,606
その他固定負債	4,973	-

２．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (平成24年 3月31日)	当事業年度 (平成25年 3月31日)
建物	206,955千円	232,440千円
車両	4,043	5,282
器具備品	573,767	599,393
計	784,767	837,116

(損益計算書関係)

１．役員報酬の限度額は以下のとおりであります。

取締役	180,000千円
監査役	40,000千円

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

３．事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。

４．固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

５．清算配当金は、会社型投資信託の清算配当であります。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成23年 6 月27日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成23年 3 月31日

効力発生日 平成23年 6 月27日

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

平成24年 6 月25日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成24年 3 月31日

効力発生日 平成24年 6 月25日

当事業年度（自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成24年 6 月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成24年 3 月31日

効力発生日 平成24年 6 月25日

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

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

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成25年 3 月31日

効力発生日 平成25年 6 月24日

（リース取引関係）

１．ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額（単位：千円）

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

（単位：千円）

	当事業年度（平成25年３月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	589	273

未経過リース料期末残高相当額等（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年３月31日）	当事業年度 （平成25年３月31日）
１年内	174	186
１年超	287	108
合計	462	295

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）
支払リース料	361	186
減価償却費相当額	330	172
支払利息相当額	19	12

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さないよう、分離して行っております。

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,199,671	1,199,671	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,010,860	4,020,850	9,989
其他有価証券	2,799,720	2,799,720	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	21,902,802	22,023,000	120,197
其他有価証券	6,576,671	6,576,671	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

（注３）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成24年3月31日)

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

（注）投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

当事業年度(平成25年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	1,199,671	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,000,000	21,800,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	3,606,000	2,706,150	989,200	-
合計	8,805,671	24,506,150	989,200	-

（注）投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

（有価証券関係）

１．満期保有目的の債券

前事業年度（平成24年３月31日）

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

当事業年度（平成25年３月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照 表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	25,913,663	26,043,000	130,186
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	25,913,663	26,043,000	130,186
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		25,913,663	26,043,000	130,186

２．その他有価証券

前事業年度（平成24年３月31日）

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

当事業年度（平成25年３月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	2,799,720	2,799,436	283
	国債・地方債等	2,799,720	2,799,436	283
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注１）	5,851,826	4,439,350	1,412,476
	小計	8,651,546	7,238,786	1,412,760
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注１）	724,845	808,500	83,654
	小計	724,845	808,500	83,654
合計		9,376,391	8,047,286	1,329,105

（注１）投資信託受益証券等であります。

（注２）非上場株式、関係会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上記の「その他有価証券」には含めておりません。

区分	前事業年度 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日)
非上場株式	67,500千円	67,500千円
関係会社株式	- 千円	66,222千円

3．売却したその他有価証券

前事業年度（自平成23年 4 月 1 日 至平成24年 3 月31日）

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

当事業年度（自平成24年 4 月 1 日 至平成25年 3 月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

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

（注）当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

3．退職給付費用に関する事項

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

（注）福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金

	前事業年度 （自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日）	当事業年度 （自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日）
福利厚生費として確定拠出 型年金制度への拠出金	45,640千円	44,561千円

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳			
	前事業年度 (平成24年 3 月31日)	当事業年度 (平成25年 3 月31日)	
(流動資産)			
繰延税金資産			
賞与引当金	204,554千円	283,235千円	
未払事業税	19,923	38,976	
その他	49,981	38,054	
繰延税金資産合計	274,458	360,265	
繰延税金負債			
有価証券評価差額	491	107	
繰延税金負債合計	491	107	
繰延税金資産の純額	273,967	360,157	
(固定資産)			
繰延税金資産			
退職給付引当金	276,081	333,409	
役員退職慰労引当金	4,857	2,339	
税務上の繰延資産償却超過額	2,519	4,508	
投資有価証券評価損	472,994	492,770	
投資有価証券評価差額	212,965	31,716	
その他	6,911	3,505	
小計	976,328	868,247	
評価性引当額	106,755	95,324	
繰延税金資産合計	869,573	772,923	
繰延税金負債			
特別分配金否認	50,467	85,903	
投資有価証券評価差額	381,742	514,578	
繰延税金負債合計	432,209	600,481	
繰延税金資産の純額	437,364	172,442	
2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳			
	前事業年度 (平成24年 3 月31日)	当事業年度 (平成25年 3 月31日)	
法定実効税率	40.00%	法定実効税率	38.01%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.93	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.38
住民税均等割	0.85	住民税均等割	0.58
税率変更に伴う影響	9.27	税率変更に伴う影響	3.66
その他	1.32	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.44
税効果会計適用後の法人税等の負担率	49.73	その他	0.71
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.90

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1．サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,205,257

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1．サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,745,589

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有)直接90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	2,098,663	未収運用受託報酬	493,954
								投資助言報酬の受取	599,826	未収投資助言報酬	133,324
								業務受託料の受取	47,100	-	-
								関係会社株式の取得	66,222	-	-

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

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

２ 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）
１株当たり純資産額	341,875円31銭	351,139円62銭
１株当たり当期純利益金額	3,173円18銭	5,295円04銭

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

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）
当期純利益	344,126千円	574,236千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	344,126千円	574,236千円
期中平均株式数	108千株	108千株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第19期中間会計期間末

(平成25年9月30日現在)

資産の部

流動資産

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

固定資産

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

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

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

負債の部

流動負債

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

固定負債

退職給付引当金	1,024,873
役員退職慰労引当金	16,300
固定負債合計	1,041,173
負債合計	4,248,270
純資産の部	
株主資本	
資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	19,168,379
利益剰余金合計	19,848,186
株主資本合計	38,130,026
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,065,336
評価・換算差額等合計	1,065,336
純資産合計	39,195,363
負債・純資産合計	43,443,634

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第19期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
株主資本	
資本金	
当期首残高	10,000,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840
資本剰余金合計	
当期首残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	139,807
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
当期首残高	120,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	120,000
研究開発積立金	
当期首残高	70,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	70,000
別途積立金	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	18,272,607
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	1,031,331
当中間期変動額合計	895,771
当中間期末残高	19,168,379
利益剰余金合計	
当期首残高	18,952,414
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560

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

（重要な会計方針）

項目	第19期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。
2．固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。 無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
3．引当金の計上基準	賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。 退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額（簡便法により自己都合退職による中間会計期間末要支給額の100％）を計上しております。 なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。 役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．リース取引の処理方法	平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。なお、仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。

(注記事項)

[中間貸借対照表関係]

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

[中間損益計算書関係]

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

[中間株主資本等変動計算書関係]

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

1．発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

	前事業年度末 株式数（千株）	当中間会計期間増加 株式数（千株）	当中間会計期間減少 株式数（千株）	当中間会計期間末 株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2．配当に関する事項
配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成25年6月24日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成25年3月31日	平成25年6月24日

〔リース取引関係〕

第19期中間会計期間
（自 平成25年4月1日
至 平成25年9月30日）

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

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

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

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1 年内	183千円
1 年超	15千円
合計	198千円

当中間会計期間の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料	93千円
減価償却費相当額	86千円
支払利息相当額	4千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

2. オペレーティング・リース取引

該当取引はありません。

〔金融商品関係〕

第19期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日（中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2を参照ください）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,039,584	1,039,584	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,016,432	4,023,430	6,997
其他有価証券	2,499,750	2,499,750	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,567,200	22,631,520	64,319
其他有価証券	7,138,652	7,138,652	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

これらの時価は、中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価は、中間決算日の市場価格等によっております。

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

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

〔有価証券関係〕

第19期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

１．満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	23,585,186	23,663,320	78,133
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	23,585,186	23,663,320	78,133
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	2,998,446	2,991,630	6,816
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,998,446	2,991,630	6,816
合計		26,583,632	26,654,950	71,317

２．その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	2,499,429	2,499,750	321
	国債・地方債等	2,499,429	2,499,750	321
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,846,150	5,443,586	1,597,436
	小計	6,345,579	7,943,336	1,597,757
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	1,744,700	1,695,065	49,634
	小計	1,744,700	1,695,065	49,634
合計		8,090,279	9,638,402	1,548,123

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

[デリバティブ取引関係]

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

1．サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	1,937,710

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

該当事項はありません。

〔 1 株当たり情報 〕

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

(注) 1 . 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2 . 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

〔 重要な後発事象 〕

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます）。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます）。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下

において同じ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第 2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

（ 1 ）受託会社

a . 名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

b . 資本金の額

平成25年9月末現在、324,279百万円

c . 事業の内容

銀行法に基づき監督官庁の免許を受けて銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき監督官庁の認可を受けて信託業務を営んでいます。

（参考）再信託受託会社の概況

a . 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b . 資本金の額

平成25年9月末現在、10,000百万円

c . 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（ 2 ）販売会社

（平成25年9月末現在）

a . 名称	b . 資本金の額	c . 事業の内容
岡三証券株式会社	5,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	47,937百万円	
株式会社第四銀行	32,776百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
労働金庫連合会	120,000百万円	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
日本生命保険相互会社	1,250,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

（ 3 ）投資顧問会社

a . 名称

ザ・パトナム・アドバイザリー・カンパニー・エルエルシー

b . 資本金の額

平成25年9月末現在、204,000米ドル（約19百万円。1米ドル＝97.75円）

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

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、「ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド」および「ニッセイノパトナム・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。

第3【参考情報】

下記の書類が関東財務局に提出されています。

平成25年3月19日	有価証券報告書
	有価証券届出書
平成25年9月20日	半期報告書
	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成26年2月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）の平成24年12月21日から平成25年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイ／パトナム・グローバルバランス（標準型）の平成２５年１２月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- １．上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 - ２．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成26年2月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）の平成24年12月21日から平成25年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）の平成２５年１２月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- １．上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 - ２．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 小 暮 和 敏 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 大 竹 新 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第18期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年11月22日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 小 暮 和 敏 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 大 竹 新 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第19期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成26年2月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）の平成24年12月21日から平成25年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）の平成２５年１２月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- １．上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 - ２．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)