

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	平成26年8月20日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 宇治原 潔
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型） ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 各ファンドにつき以下を上限とします。 ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型） 1兆円 ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型） 1兆円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成26年2月20日をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、有価証券報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

## 【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第一部【証券情報】

### （５）【申込手数料】

#### <訂正前>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%（税抜3.5%）を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。

消費税率が8%になった場合は、3.78%となります。

手数料率は変更となる場合があります。

（略）

#### <訂正後>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.78%（税抜3.5%）を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。

手数料率は変更となる場合があります。

（略）

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (3)【ファンドの仕組み】

###### <訂正前>

(略)

###### 委託会社の概況(平成25年12月末現在)

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社

(略)

###### <訂正後>

(略)

###### 委託会社の概況(平成26年6月末現在)

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社

(略)

#### 2【投資方針】

##### (1)【投資方針】

###### <訂正前>

(略)

(参考) マザーファンドの概要

(略)

## ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド

( 略 )

## ( 2 ) 運用方法

( 略 )

## 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。

( 略 )

( 略 )

## &lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

## ( 参考 ) マザーファンドの概要

( 略 )

## ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド

( 略 )

## ( 2 ) 運用方法

( 略 )

## 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。

シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLC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、Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLC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。

( 略 )

( 略 )

## ( 3 ) 【運用体制】

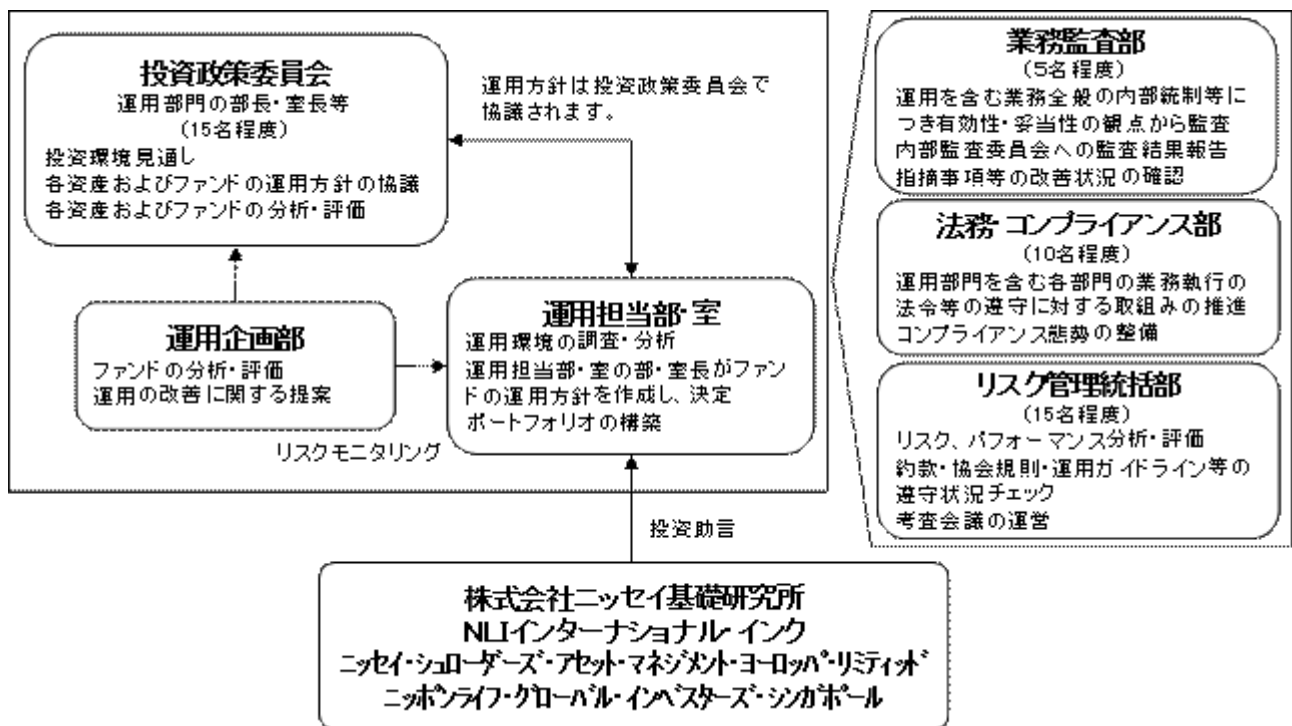
原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」「(3) 運用体制」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。

## 委託会社の組織体制

( 略 )

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

## 内部管理体制および意思決定を監督する組織



### < 受託会社に対する管理体制等 >

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

( 略 )

## 3 【投資リスク】

### < 訂正前 >

( 略 )

### ( 1 ) 投資リスクおよび留意事項

( 略 )

- ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社および委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は平成25年10月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に保有しています。

当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（％）	
	委託会社	日本生命保険相互会社
ニッセイ外国株マザーファンド	89.5	
ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド		7.7
ニッセイJ-REITマザーファンド		2.2
ニッセイグローバルリートマザーファンド	19.7	76.9

委託会社については実質保有比率が5％超のマザーファンドを記載しています。

（略）

#### <訂正後>

（略）

#### （1）投資リスクおよび留意事項

（略）

##### ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社および委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は平成26年4月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に保有しています。

当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（％）	
	委託会社	日本生命保険相互会社
ニッセイ外国株マザーファンド	90.8	
ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド		8.6
ニッセイJ-REITマザーファンド		1.8
ニッセイグローバルリートマザーファンド	14.9	58.5

委託会社については実質保有比率が5％超のマザーファンドを記載しています。

（略）

#### 4【手数料等及び税金】

##### （1）【申込手数料】

#### <訂正前>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%（税抜3.5%）を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。

消費税率が8%になった場合は、3.78%となります。

手数料率は変更となる場合があります。

（略）

#### <訂正後>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.78%（税抜3.5%）を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。

手数料率は変更となる場合があります。

（略）

### （3）【信託報酬等】

#### <訂正前>

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.3125%（税抜1.25%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

消費税率が8%になった場合は、年1.35%となります。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.60%	0.60%	0.05%

（略）

#### <訂正後>

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.35%（税抜1.25%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.60%	0.60%	0.05%

（略）

### （4）【その他の手数料等】

#### <訂正前>

（略）

#### 監査費用

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

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

消費税率が8%になった場合は、以下の通りとなります。



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

(略)

## &lt;訂正後&gt;

(略)

## 監査費用

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

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

(略)

## 5【運用状況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

### (1)【投資状況】

#### 「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）」

（平成26年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	334,875,652	100.01
内 日本	334,875,652	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	38,307	0.01
純資産総額	334,837,345	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。

#### 「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）」

（平成26年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	151,072,925	100.01
内 日本	151,072,925	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,056	0.01
純資産総額	151,055,869	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）

#### 「ニッセイ日本株 マザーファンド」

（平成26年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	54,676,980,400	94.62
内 日本	54,676,980,400	94.62
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,111,904,020	5.38
純資産総額	57,788,884,420	100.00

#### 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）	3,093,125,000	5.35
内 日本	3,093,125,000	5.35

（注1）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。

（注2）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）

「ニッセイ外国株 マザーファンド」

（平成26年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	536,501,353	90.98
内 アメリカ	289,406,478	49.08
内 イギリス	48,328,428	8.20
内 スイス	26,601,507	4.51
内 フランス	25,576,507	4.34
内 ドイツ	21,580,677	3.66
内 オーストラリア	20,452,623	3.47
内 カナダ	18,223,194	3.09
内 スペイン	17,241,969	2.92
内 オランダ	12,668,956	2.15
内 アイルランド	9,908,486	1.68
内 スウェーデン	9,321,014	1.58
内 オランダ領キュラソー	8,059,640	1.37
内 香港	5,871,481	1.00
内 イタリア	5,509,902	0.93
内 シンガポール	4,505,654	0.76
内 ジャージー	4,332,335	0.73
内 ベルギー	2,971,548	0.50
内 ノルウェー	2,611,500	0.44
内 デンマーク	1,425,420	0.24
内 ケイマン諸島	1,009,775	0.17
内 イスラエル	894,259	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	53,166,982	9.02
純資産総額	589,668,335	100.00

#### 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）	49,463,680	8.39
内 アメリカ	49,463,680	8.39

（注1）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。

（注2）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6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	24,910,808,172	96.26
内 日本	24,910,808,172	96.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	968,972,800	3.74
純資産総額	25,879,780,972	100.00

## 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）	873,900,000	3.38
内 日本	873,900,000	3.38

（注1）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。

（注2）その他資産として、債券先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

## （参考情報）

## 「ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド」

（平成26年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	3,641,740,504	96.82
内 アメリカ	959,445,648	25.51
内 イタリア	769,528,786	20.46
内 フランス	385,366,882	10.25
内 メキシコ	337,445,827	8.97
内 ベルギー	312,762,199	8.32
内 スペイン	310,980,846	8.27
内 イギリス	265,344,443	7.05
内 オーストラリア	57,126,570	1.52
内 オーストリア	46,054,421	1.22
内 アイルランド	43,407,402	1.15
内 スウェーデン	32,370,575	0.86
内 ドイツ	25,848,299	0.69
内 ポーランド	23,022,272	0.61
内 マレーシア	22,395,418	0.60
内 南アフリカ	18,219,400	0.48
内 ノルウェー	14,568,551	0.39
内 シンガポール	13,281,400	0.35
内 カナダ	3,076,615	0.08

内 スイス	1,275,374	0.03
内 デンマーク	219,576	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	119,509,924	3.18
純資産総額	3,761,250,428	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」- R E I T マザーファンド」

（平成26年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	308,422,099,540	97.55
内 日本	308,422,099,540	97.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,749,126,212	2.45
純資産総額	316,171,225,752	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）

「ニッセイグローバルリート マザーファンド」

（平成26年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	2,772,194,546	97.09
内 アメリカ	1,826,480,082	63.97
内 オーストラリア	258,209,045	9.04
内 イギリス	177,126,192	6.20
内 フランス	149,158,049	5.22
内 シンガポール	89,201,509	3.12
内 カナダ	62,312,208	2.18
内 香港	44,815,689	1.57
内 メキシコ	43,789,119	1.53
内 南アフリカ	42,294,666	1.48
内 オランダ	32,829,786	1.15
内 トルコ	14,692,439	0.51
内 ベルギー	10,540,618	0.37
内 ニュージーランド	6,218,189	0.22
内 イタリア	5,321,297	0.19
内 アイルランド	4,892,024	0.17
内 ドイツ	2,333,057	0.08
内 マン島	1,980,577	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	82,974,303	2.91
純資産総額	2,855,168,849	100.00

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

## （２）【投資資産】

「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）」

### 【投資有価証券の主要銘柄】

（平成26年6月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価 （円） 簿価金額 （円）	評価単価 （円） 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資 比率
1	ニッセイJ-REIT マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券	45,241,500	1.6761 75,833,744	1.6639 75,277,331	- -	22.48%
2	ニッセイ日本株 マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	39,681,598	1.9024 75,494,208	1.8951 75,200,596	- -	22.46%
3	ニッセイ国内債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	56,131,553	1.3094 73,498,663	1.3130 73,700,729	- -	22.01%
4	ニッセイグローバルリート マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	42,359,695	0.8744 37,039,319	0.8765 37,128,272	- -	11.09%
5	ニッセイ外国債券アクティブ マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	14,944,648	2.4633 36,813,156	2.4669 36,866,952	- -	11.01%
6	ニッセイ外国株 マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	32,638,304	1.1359 37,077,103	1.1245 36,701,772	- -	10.96%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率（%）
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	100.01
	小計		100.01
合 計（対純資産総額比）			100.01

### 【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。

「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）」

## 投資有価証券の主要銘柄

（平成26年6月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価 （円） 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資 比率
1	ニッセイJ-REIT マザー ファンド 日本	親投資信託受益 証券	20,413,445	1.5577 31,798,215	1.6639 33,965,931	- -	22.49%
2	ニッセイ日本株 マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券	17,902,817	1.7297 30,966,687	1.8951 33,927,628	- -	22.46%
3	ニッセイ国内債券マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券	25,320,468	1.3072 33,099,800	1.3130 33,245,774	- -	22.01%
4	ニッセイグローバルリート マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券	19,108,058	0.8583 16,400,945	0.8765 16,748,212	- -	11.09%
5	ニッセイ外国債券アクティブ マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券	6,740,386	2.4481 16,501,229	2.4669 16,627,858	- -	11.01%
6	ニッセイ外国株 マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券	14,724,342	1.0926 16,088,894	1.1245 16,557,522	- -	10.96%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（%）
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	100.01
	小計		100.01
合 計（対純資産総額比）			100.01

## 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）

「ニッセイ日本株 マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

（平成26年6月30日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	375,300	5,468.00 2,052,140,400	6,084.00 2,283,325,200	- -	3.95%
2	三菱UFJフィナンシャル G 日本	株式 銀行業	3,159,000	547.57 1,729,788,600	621.00 1,961,739,000	- -	3.39%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	202,800	5,773.00 1,170,764,400	6,318.00 1,281,290,400	- -	2.22%
4	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	168,800	6,796.00 1,147,164,800	7,543.00 1,273,258,400	- -	2.20%
5	三井住友フィナンシャル G 日本	株式 銀行業	263,000	3,868.00 1,017,284,000	4,244.00 1,116,172,000	- -	1.93%
6	本田技研 日本	株式 輸送用機器	276,600	3,402.00 940,993,200	3,537.00 978,334,200	- -	1.69%
7	日立 日本	株式 電気機器	1,305,000	676.62 882,995,000	742.00 968,310,000	- -	1.68%
8	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	65,400	12,755.00 834,177,000	14,450.00 945,030,000	- -	1.64%
9	オリックス 日本	株式 その他金融業	513,800	1,524.00 783,031,200	1,679.00 862,670,200	- -	1.49%
10	国際石油開発帝石 日本	株式 鉱業	525,400	1,431.00 751,847,400	1,540.00 809,116,000	- -	1.40%
11	住友商事 日本	株式 卸売業	559,200	1,282.00 716,894,400	1,368.00 764,985,600	- -	1.32%
12	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	3,657,300	198.00 724,145,400	208.00 760,718,400	- -	1.32%
13	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	1,273,400	507.00 645,613,800	590.00 751,306,000	- -	1.30%
14	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	1,334,100	506.18 675,299,400	542.00 723,082,200	- -	1.25%
15	日本航空 日本	株式 空運業	126,700	5,190.00 657,573,000	5,600.00 709,520,000	- -	1.23%
16	富士フイルムHLDGS 日本	株式 化学	250,300	2,550.00 638,265,000	2,825.00 707,097,500	- -	1.22%
17	KDDI 日本	株式 情報・通信業	111,200	5,441.00 605,039,200	6,179.00 687,104,800	- -	1.19%



18	イオン 日本	株式 小売業	547,800	1,222.75 669,823,200	1,246.00 682,558,800	- -	1.18%
19	大塚ホールディングス 日本	株式 医薬品	208,500	2,892.00 602,982,000	3,140.00 654,690,000	- -	1.13%
20	日本電気硝子 日本	株式 ガラス・土石製品	1,100,000	498.00 547,800,000	590.00 649,000,000	- -	1.12%
21	三菱ケミカルHLDGS 日本	株式 化学	1,439,400	414.08 596,028,700	449.00 646,290,600	- -	1.12%
22	ふくおかフィナンシャル G 日本	株式 銀行業	1,306,000	426.00 556,356,000	489.00 638,634,000	- -	1.11%
23	双日 日本	株式 卸売業	3,367,100	161.53 543,906,600	179.00 602,710,900	- -	1.04%
24	三井物産 日本	株式 卸売業	351,700	1,517.00 533,528,900	1,624.00 571,160,800	- -	0.99%
25	三菱商事 日本	株式 卸売業	265,900	1,965.00 522,493,500	2,107.00 560,251,300	- -	0.97%
26	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	571,000	896.00 511,616,000	961.00 548,731,000	- -	0.95%
27	丸紅 日本	株式 卸売業	709,000	684.31 485,182,000	741.00 525,369,000	- -	0.91%
28	ユニーグループ・HD 日本	株式 小売業	825,000	647.00 533,775,000	635.00 523,875,000	- -	0.91%
29	旭硝子 日本	株式 ガラス・土石製品	872,000	564.60 492,336,000	597.00 520,584,000	- -	0.90%
30	日本製紙 日本	株式 パルプ・紙	265,400	1,948.56 517,149,600	1,906.00 505,852,400	- -	0.88%

（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	銀行業	10.73
		電気機器	9.92
		輸送用機器	9.85
		情報・通信業	7.21
		卸売業	6.32
		化学	5.23
		小売業	4.31
		建設業	3.93
		陸運業	3.68

	機械	3.08
	その他金融業	2.68
	保険業	2.51
	医薬品	2.40
	ガラス・土石製品	2.02
	食料品	1.95
	電気・ガス業	1.94
	パルプ・紙	1.78
	ゴム製品	1.61
	非鉄金属	1.49
	鋳業	1.47
	鉄鋼	1.36
	不動産業	1.31
	倉庫・運輸関連業	1.28
	石油・石炭製品	1.25
	空運業	1.23
	その他製品	1.04
	証券、商品先物取引業	0.81
	海運業	0.71
	サービス業	0.60
	金属製品	0.38
	繊維製品	0.31
	水産・農林業	0.20
	精密機器	0.02
	小計	94.62
合計（対純資産総額比）		94.62

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数 先物取引	大阪取引所	TOPIX先物2609月	買建	245	3,037,127,300	3,093,125,000	5.35%

（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）

## 「ニッセイ外国株 マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

（平成26年6月30日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 （円） 簿価金額 （円）	評価単価 （円） 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	1,071	8,754.46 9,376,030	9,323.09 9,985,032	- -	1.69%
2	MERCK & CO INC 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	1,571	5,711.63 8,972,980	5,831.24 9,160,879	- -	1.55%
3	CVS CAREMARK CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	1,150	7,730.72 8,890,336	7,674.97 8,826,226	- -	1.50%
4	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	837	10,224.18 8,557,641	10,258.64 8,586,486	- -	1.46%
5	SCHLUMBERGER LTD オランダ領キュラソー	株式 エネルギー	675	10,165.39 6,861,641	11,940.20 8,059,640	- -	1.37%
6	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	936	8,690.60 8,134,407	8,600.39 8,049,970	- -	1.37%
7	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	999	8,054.20 8,046,153	7,821.00 7,813,179	- -	1.33%
8	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 エネルギー	1,650	4,474.56 7,383,039	4,403.79 7,266,255	- -	1.23%
9	LAS VEGAS SANDS CORP アメリカ	株式 消費者サービス	921	7,531.04 6,936,095	7,695.25 7,087,326	- -	1.20%
10	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP アメリカ	株式 各種金融	796	7,713.49 6,139,942	8,413.89 6,697,459	- -	1.14%
11	DOW CHEMICAL CO アメリカ	株式 素材	1,240	5,001.10 6,201,366	5,231.18 6,486,675	- -	1.10%
12	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	1,509	4,029.05 6,079,851	4,282.45 6,462,232	- -	1.10%
13	AMERIPRISE FINANCIAL INC アメリカ	株式 各種金融	520	11,118.17 5,781,452	12,143.94 6,314,849	- -	1.07%

14	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	1,140	5,016.30 5,718,589	5,361.94 6,112,616	- -	1.04%
15	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	450	12,462.21 5,607,995	13,213.28 5,945,980	- -	1.01%
16	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP アメリカ	株式 保険	1,063	5,384.96 5,724,217	5,535.26 5,883,991	- -	1.00%
17	L BRANDS INC アメリカ	株式 小売	974	5,874.82 5,722,080	5,926.51 5,772,429	- -	0.98%
18	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 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	480	12,091.23 5,803,792	11,990.88 5,755,626	- -	0.98%
19	MORGAN STANLEY アメリカ	株式 各種金融	1,755	3,057.01 5,365,065	3,197.90 5,612,328	- -	0.95%
20	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP アメリカ	株式 エネルギー	540	9,724.47 5,251,218	10,360.00 5,594,403	- -	0.95%
21	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO カナダ	株式 運輸	840	6,105.36 5,128,510	6,527.34 5,482,971	- -	0.93%
22	KERRY GROUP PLC-A アイルランド	株式 食品・飲料・タバコ	703	7,579.38 5,328,309	7,537.89 5,299,140	- -	0.90%
23	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	692	7,527.25 5,208,857	7,439.82 5,148,358	- -	0.87%
24	PRECISION CASTPARTS CORP アメリカ	株式 資本財	198	24,727.78 4,896,101	25,781.92 5,104,822	- -	0.87%
25	MONSTER BEVERAGE CORP アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	718	7,140.81 5,127,103	7,019.17 5,039,771	- -	0.85%
26	ROCHE HOLDING AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	166	30,544.55 5,070,396	29,953.00 4,972,199	- -	0.84%
27	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	851	5,550.80 4,723,735	5,831.23 4,962,385	- -	0.84%
28	CUMMINS INC アメリカ	株式 資本財	316	15,214.13 4,807,666	15,675.32 4,953,402	- -	0.84%
29	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	84	53,605.23 4,502,840	58,509.03 4,914,759	- -	0.83%

30	PFIZER INC 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	1,634	2,967.82 4,849,419	3,007.35 4,914,011	- -	0.83%
----	--------------------	------------------------------	-------	-----------------------	-----------------------	--------	-------

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.25
		銀行	9.79
		エネルギー	9.30
		資本財	7.31
		食品・飲料・タバコ	7.13
		各種金融	5.81
		ソフトウェア・サービス	5.16
		素材	5.09
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.35
		公益事業	3.28
		電気通信サービス	3.00
		小売	2.94
		保険	2.81
		消費者サービス	2.49
		食品・生活必需品小売り	2.38
		半導体・半導体製造装置	2.30
		メディア	1.77
		耐久消費財・アパレル	1.59
		自動車・自動車部品	1.31
		運輸	1.03
商業・専門サービス	1.02		
家庭用品・パーソナル用品	0.87		
ヘルスケア機器・サービス	0.70		
不動産	0.31		
	小計		90.98
合 計（対純資産総額比）			90.98

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

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	シカゴ商品取 引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T U R E 2 0 1 4 0 9	買建	5	48,866,923	49,463,680	8.39%

(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6月30日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	第308回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	1,561,900,000	106.49 1,663,320,075	106.48 1,663,204,834	1.300000 2020/6/20	6.43%
2	第334回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	1,221,300,000	100.03 1,221,705,603	100.04 1,221,800,733	0.100000 2015/11/15	4.72%
3	第325回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	1,177,600,000	102.93 1,212,150,940	103.14 1,214,588,416	0.800000 2022/9/20	4.69%
4	第331回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	1,208,500,000	100.03 1,208,957,296	100.03 1,208,898,805	0.100000 2015/8/15	4.67%
5	第329回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	1,199,500,000	100.11 1,200,918,643	100.11 1,200,918,643	0.200000 2015/6/15	4.64%
6	第328回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	1,123,600,000	100.02 1,123,835,716	100.02 1,123,835,716	0.100000 2015/5/15	4.34%
7	第330回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	1,002,800,000	100.13 1,004,109,739	100.13 1,004,143,752	0.200000 2015/7/15	3.88%
8	第140回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	767,400,000	106.16 814,735,990	106.83 819,859,464	1.700000 2032/9/20	3.17%

9	第340回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	739,900,000	100.02 740,109,539	100.05 740,306,945	0.100000 2016/5/15	2.86%
10	第121回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	604,800,000	110.42 667,820,160	111.93 676,982,880	1.900000 2030/9/20	2.62%
11	第341回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	659,600,000	100.03 659,817,668	100.05 659,982,568	0.100000 2016/6/15	2.55%
12	第111回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	546,400,000	116.37 635,880,640	116.91 638,829,024	2.200000 2029/6/20	2.47%
13	第333回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	562,400,000	100.03 562,575,648	100.03 562,613,712	0.100000 2015/10/15	2.17%
14	第318回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	515,600,000	104.79 540,297,240	104.90 540,910,804	1.000000 2021/9/20	2.09%
15	第335回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	505,700,000	100.02 505,849,864	100.04 505,917,451	0.100000 2015/12/15	1.95%
16	第127回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	412,900,000	110.65 456,885,690	111.53 460,511,499	1.900000 2031/3/20	1.78%
17	第313回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	414,300,000	106.53 441,391,077	106.89 442,882,557	1.300000 2021/3/20	1.71%
18	第105回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	379,600,000	115.73 439,343,036	115.78 439,512,268	2.100000 2028/9/20	1.70%
19	第26回 利付国債(3 0年) 日本	国債証券	376,000,000	116.20 436,934,882	116.73 438,908,560	2.400000 2037/3/20	1.70%
20	第113回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	350,600,000	114.81 402,535,161	115.44 404,746,664	2.100000 2029/9/20	1.56%
21	第43回 利付国債(3 0年) 日本	国債証券	393,600,000	100.58 395,909,146	100.29 394,772,928	1.700000 2044/6/20	1.53%

22	第333回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	386,600,000	100.23 387,493,046	100.55 388,737,898	0.600000 2024/3/20	1.50%
23	第329回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	327,100,000	102.04 333,790,840	102.79 336,242,445	0.800000 2023/6/20	1.30%
24	第125回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	279,800,000	114.70 320,930,600	116.10 324,858,992	2.200000 2031/3/20	1.26%
25	第122回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	293,200,000	108.13 317,054,752	110.47 323,898,040	1.800000 2030/9/20	1.25%
26	第128回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	277,800,000	109.64 304,594,920	111.35 309,355,302	1.900000 2031/6/20	1.20%
27	第330回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	295,000,000	102.55 302,541,654	102.68 302,932,550	0.800000 2023/9/20	1.17%
28	第88回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	253,400,000	117.85 298,631,900	118.25 299,658,170	2.300000 2026/6/20	1.16%
29	第328回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	266,600,000	100.15 266,999,900	101.21 269,839,190	0.600000 2023/3/20	1.04%
30	第79回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	219,100,000	113.98 249,741,135	114.46 250,790,624	2.000000 2025/6/20	0.97%

(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	96.26
	小計		96.26
合計(対純資産総額比)			96.26

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの



種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
債券先物取引	大阪取引所	長国2609月限	買建	6	871,276,200	873,900,000	3.38%

(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)

「ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド」

### 投資有価証券の主要銘柄

(平成26年6月30日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 (円) 簿価金額 (円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	219,912,900	112.74 247,935,211	113.18 248,917,212	5.250000 2017/8/1	6.62%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	165,216,800	108.28 178,901,865	108.59 179,413,879	3.375000 2019/11/15	4.77%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	159,135,200	110.07 175,172,017	109.93 174,948,464	3.750000 2018/11/15	4.65%
4	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	143,027,800	100.33 143,507,292	101.19 144,744,133	4.750000 2018/6/14	3.85%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	121,632,000	106.14 129,105,443	106.71 129,803,237	3.125000 2021/5/15	3.45%
6	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	106,498,700	115.59 123,111,529	116.16 123,718,474	4.000000 2019/3/28	3.29%
7	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	113,414,200	104.11 118,079,271	106.34 120,611,465	2.250000 2023/6/22	3.21%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	113,523,200	103.91 117,962,579	103.88 117,930,170	2.250000 2017/11/30	3.14%
9	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	112,999,000	102.64 115,992,765	103.00 116,398,009	6.000000 2015/6/18	3.09%
10	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	107,881,800	100.90 108,860,149	103.04 111,165,721	1.750000 2023/5/25	2.96%

11	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	103,732,500	106.20 110,172,213	106.45 110,426,358	3.750000 2016/8/1	2.94%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	80,074,400	119.67 95,826,331	126.50 101,294,116	4.750000 2041/2/15	2.69%
13	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	96,817,000	102.28 99,030,374	102.49 99,235,488	3.000000 2015/6/15	2.64%
14	TSY 4 1/4% 2040 イギリス	国債証券	81,136,100	113.14 91,804,582	115.61 93,809,558	4.250000 2040/12/7	2.49%
15	FRENCH OAT フランス	国債証券	65,005,700	134.11 87,184,994	142.12 92,387,400	5.500000 2029/4/25	2.46%
16	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	65,005,700	112.22 72,952,273	113.26 73,630,006	4.500000 2018/8/1	1.96%
17	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	55,324,000	121.99 67,491,849	125.57 69,475,879	4.000000 2038/10/25	1.85%
18	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	62,239,500	104.95 65,324,504	105.06 65,390,685	3.250000 2016/4/30	1.74%
19	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	56,707,100	108.90 61,757,337	110.97 62,932,405	3.750000 2021/8/1	1.67%
20	BTPS 6.5 11/01/27 イタリア	国債証券	45,642,300	128.51 58,656,496	135.79 61,978,592	6.500000 2027/11/1	1.65%
21	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	54,583,600	111.68 60,964,320	111.92 61,095,423	7.750000 2017/12/14	1.62%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	63,856,800	92.59 59,126,926	94.59 60,404,062	1.750000 2023/5/15	1.61%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	58,788,800	101.62 59,746,591	102.13 60,042,177	2.750000 2024/2/15	1.60%
24	TSY 4 1/4% 2032 イギリス	国債証券	51,789,000	112.66 58,350,148	114.30 59,196,898	4.250000 2032/6/7	1.57%
25	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	47,025,400	120.38 56,613,630	123.17 57,924,476	5.400000 2023/1/31	1.54%
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	53,720,800	104.04 55,895,052	105.15 56,490,644	3.625000 2043/8/15	1.50%

27	TSY 3 3/4% 2019 イギリス	国債証券	48,336,400	109.47 52,916,204	108.68 52,532,966	3.750000 2019/9/7	1.40%
28	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	45,642,300	112.03 51,136,484	112.47 51,334,351	4.500000 2018/1/31	1.36%
29	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	34,577,500	131.81 45,578,552	138.82 48,003,943	5.000000 2035/3/28	1.28%
30	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	37,343,700	114.10 42,610,447	115.78 43,239,523	3.500000 2020/4/25	1.15%

（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	96.82
	小計		96.82
合 計（対純資産総額比）			96.82

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### （参考情報）

「ニッセイ」- R E I T マザーファンド」

#### 投資有価証券の主要銘柄

（平成26年6月30日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	49,110	578,000.00 28,385,580,000	592,000.00 29,073,120,000	- -	9.20%
2	ジャパンリアルエステイト投資 法人 日本	投資証券	43,692	551,321.64 24,088,345,263	590,000.00 25,778,280,000	- -	8.15%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	87,783	204,700.00 17,969,180,100	227,800.00 19,996,967,400	- -	6.32%
4	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	27,535	533,000.00 14,676,155,000	551,000.00 15,171,785,000	- -	4.80%

5	ユニテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	92,641	155,296.40 14,386,814,434	163,500.00 15,146,803,500	- -	4.79%
6	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	60,767	215,500.00 13,095,288,500	236,200.00 14,353,165,400	- -	4.54%
7	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	95,962	136,200.00 13,070,024,400	146,800.00 14,087,221,600	- -	4.46%
8	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	55,576	222,200.00 12,348,987,200	240,300.00 13,354,912,800	- -	4.22%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	49,280	232,200.00 11,442,816,000	256,000.00 12,615,680,000	- -	3.99%
10	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	101,053	109,448.05 11,060,054,576	123,800.00 12,510,361,400	- -	3.96%
11	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	84,587	130,600.00 11,047,062,200	142,000.00 12,011,354,000	- -	3.80%
12	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	12,456	858,000.00 10,687,248,000	891,000.00 11,098,296,000	- -	3.51%
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	27,418	367,000.00 10,062,406,000	363,500.00 9,966,443,000	- -	3.15%
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	183,447	45,450.00 8,337,666,150	53,300.00 9,777,725,100	- -	3.09%
15	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	54,022	142,000.00 7,671,124,000	160,900.00 8,692,139,800	- -	2.75%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	14,892	495,500.00 7,378,986,000	551,000.00 8,205,492,000	- -	2.60%
17	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	16,847	421,000.00 7,092,587,000	475,000.00 8,002,325,000	- -	2.53%
18	G L P 投資法人 日本	投資証券	61,732	104,900.00 6,475,686,800	113,400.00 7,000,408,800	- -	2.21%
19	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	7,476	878,000.00 6,563,928,000	907,000.00 6,780,732,000	- -	2.14%
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	13,817	514,000.00 7,101,938,000	482,000.00 6,659,794,000	- -	2.11%

21	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	14,057	424,000.00 5,960,168,000	448,000.00 6,297,536,000	- -	1.99%
22	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	30,511	156,383.12 4,771,405,612	170,900.00 5,214,329,900	- -	1.65%
23	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	26,277	132,100.00 3,471,191,700	141,300.00 3,712,940,100	- -	1.17%
24	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	27,414	136,200.00 3,733,786,800	134,600.00 3,689,924,400	- -	1.17%
25	野村不動産オフィスファンド投資法人 日本	投資証券	7,447	440,000.00 3,276,680,000	478,500.00 3,563,389,500	- -	1.13%
26	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	8,436	363,000.00 3,062,268,000	384,000.00 3,239,424,000	- -	1.02%
27	平和不動産リート投資法人 日本	投資証券	31,386	82,100.00 2,576,790,600	87,100.00 2,733,720,600	- -	0.86%
28	いちご不動産投資法人 日本	投資証券	39,404	61,438.62 2,420,927,402	67,600.00 2,663,710,400	- -	0.84%
29	積水ハウス・S I レジデンスシャル投資法人 日本	投資証券	24,434	96,500.00 2,357,881,000	102,000.00 2,492,268,000	- -	0.79%
30	福岡リート投資法人 日本	投資証券	13,840	164,500.00 2,276,680,000	178,000.00 2,463,520,000	- -	0.78%

（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 (%)
投資証券	国内	投資証券	97.55
	小計		97.55
合 計（対純資産総額比）			97.55

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）

## 「ニッセイグローバルリート マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

(平成26年6月30日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	9,425	16,751.61 157,883,982	16,933.20 159,595,425	- -	5.59%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	3,013	27,667.43 83,361,983	29,404.70 88,596,379	- -	3.10%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	4,300	17,410.79 74,866,421	17,451.15 75,039,950	- -	2.63%
4	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	10,100	6,248.53 63,110,182	6,439.40 65,037,948	- -	2.28%
5	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	14,728	4,168.32 61,391,051	4,174.00 61,474,742	- -	2.15%
6	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	9,200	6,509.58 59,888,150	6,348.17 58,403,226	- -	2.05%
7	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	5,282	10,685.95 56,443,226	10,880.99 57,473,420	- -	2.01%
8	HCP INC アメリカ	投資証券	13,700	4,278.27 58,612,332	4,187.18 57,364,387	- -	2.01%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	8,817	6,799.29 59,949,420	6,501.23 57,321,348	- -	2.01%
10	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	4,600	12,147.42 55,878,146	12,014.20 55,265,323	- -	1.94%
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	3,700	14,284.88 52,854,070	14,428.59 53,385,805	- -	1.87%
12	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	23,565	2,208.53 52,044,178	2,251.20 53,049,659	- -	1.86%
13	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券	154,586	301.48 46,606,082	310.37 47,979,629	- -	1.68%
14	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	23,137	1,833.90 42,431,162	1,795.35 41,539,059	- -	1.45%
15	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資証券	57,453	677.25 38,910,290	684.73 39,340,079	- -	1.38%
16	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	31,456	1,215.00 38,219,042	1,221.35 38,419,013	- -	1.35%

17	LINK REIT 香港	投資証券	70,000	525.53 36,787,781	548.70 38,409,420	- -	1.35%
18	GENERAL GROWTH PROPERTIES アメリカ	投資証券	15,581	2,388.46 37,214,703	2,388.04 37,208,076	- -	1.30%
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,900	18,196.57 34,573,490	18,702.94 35,535,599	- -	1.24%
20	AMERICAN REALTY CAPITAL PROP アメリカ	投資証券	27,900	1,289.79 35,985,232	1,267.00 35,349,300	- -	1.24%
21	SL GREEN REALTY CORP アメリカ	投資証券	2,900	11,002.41 31,907,013	11,080.67 32,133,958	- -	1.13%
22	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	6,634	4,428.82 29,380,795	4,482.13 29,734,511	- -	1.04%
23	MACERICH CO/THE アメリカ	投資証券	4,219	6,663.30 28,112,467	6,770.84 28,566,207	- -	1.00%
24	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	12,000	2,312.76 27,753,178	2,330.26 27,963,196	- -	0.98%
25	STOCKLAND オーストラリア	投資証券	68,208	363.65 24,804,175	376.26 25,664,624	- -	0.90%
26	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA メキシコ	投資証券	72,600	333.58 24,218,485	351.97 25,553,617	- -	0.89%
27	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	2,000	12,103.34 24,206,693	12,299.02 24,598,044	- -	0.86%
28	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	4,100	5,954.40 24,413,062	5,919.42 24,269,638	- -	0.85%
29	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	48,028	482.77 23,186,520	491.82 23,621,371	- -	0.83%
30	UDR INC アメリカ	投資証券	7,500	2,813.14 21,098,590	2,902.95 21,772,128	- -	0.76%

（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 (%)
投資証券	外国	投資証券	97.09
	小計		97.09
合 計（対純資産総額比）			97.09

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）」

#### 【純資産の推移】

平成26年6月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各特定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1特定期間末 (平成19年5月21日)	10,356,842	10,356,842	1.0357	1.0357
第2特定期間末 (平成19年11月20日)	1,044,770,267	1,049,455,313	0.8916	0.8956
第3特定期間末 (平成20年5月20日)	954,843,858	957,128,617	0.8358	0.8378
第4特定期間末 (平成20年11月20日)	564,024,349	566,180,235	0.5232	0.5252
第5特定期間末 (平成21年5月20日)	615,231,092	617,362,410	0.5771	0.5791
第6特定期間末 (平成21年11月20日)	601,451,346	603,486,728	0.5907	0.5927
第7特定期間末 (平成22年5月20日)	573,509,351	574,456,921	0.6052	0.6062
第8特定期間末 (平成22年11月22日)	493,402,840	494,206,368	0.6140	0.6150
第9特定期間末 (平成23年5月20日)	438,233,367	438,935,482	0.6242	0.6252
第10特定期間末 (平成23年11月21日)	335,117,356	335,730,297	0.5467	0.6252
第11特定期間末 (平成24年5月21日)	311,210,799	311,751,345	0.5757	0.5477
第12特定期間末 (平成24年11月20日)	301,947,350	302,437,003	0.6167	0.5767
第13特定期間末 (平成25年5月20日)	391,222,868	391,684,902	0.8467	0.6177
第14特定期間末 (平成25年11月20日)	340,986,637	341,401,558	0.8218	0.8228
第15特定期間末 (平成26年5月20日)	324,339,262	324,725,915	0.8388	0.8398



平成25年6月末日	352,845,890	-	0.7820	-
7月末日	343,308,326	-	0.7767	-
8月末日	335,690,451	-	0.7641	-
9月末日	354,625,648	-	0.8117	-
10月末日	343,592,203	-	0.8192	-
11月末日	340,944,990	-	0.8354	-
12月末日	342,297,772	-	0.8557	-
平成26年1月末日	330,265,069	-	0.8345	-
2月末日	332,983,138	-	0.8414	-
3月末日	328,631,275	-	0.8372	-
4月末日	327,616,050	-	0.8401	-
5月末日	330,534,628	-	0.8562	-
6月末日	334,837,345	-	0.8730	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0240
第3特定期間	0.0140
第4特定期間	0.0120
第5特定期間	0.0120
第6特定期間	0.0120
第7特定期間	0.0090
第8特定期間	0.0060
第9特定期間	0.0060
第10特定期間	0.0060
第11特定期間	0.0060
第12特定期間	0.0060
第13特定期間	0.0060
第14特定期間	0.0060
第15特定期間	0.0060

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	3.6
第2特定期間	11.6
第3特定期間	4.7
第4特定期間	36.0
第5特定期間	12.6
第6特定期間	4.4
第7特定期間	4.0
第8特定期間	2.4
第9特定期間	2.6

第10特定期間	11.5
第11特定期間	6.4
第12特定期間	8.2
第13特定期間	38.3
第14特定期間	2.2
第15特定期間	2.8

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

## 「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）」

### 純資産の推移

平成26年6月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）(円)	1口当たりの 純資産額 （分配付）(円)
第1計算期間末 （平成19年5月21日）	10,356,895	10,356,895	1.0357	1.0357
第2計算期間末 （平成19年11月20日）	344,421,668	344,421,668	0.9125	0.9125
第3計算期間末 （平成20年5月20日）	310,238,699	310,238,699	0.8703	0.8703
第4計算期間末 （平成20年11月20日）	177,766,938	177,766,938	0.5532	0.5532
第5計算期間末 （平成21年5月20日）	197,810,127	197,810,127	0.6225	0.6225
第6計算期間末 （平成21年11月20日）	205,542,371	205,542,371	0.6510	0.6510
第7計算期間末 （平成22年5月20日）	188,954,519	188,954,519	0.6765	0.6765
第8計算期間末 （平成22年11月22日）	185,269,334	185,269,334	0.6935	0.6935
第9計算期間末 （平成23年5月20日）	170,531,897	170,531,897	0.7117	0.7117
第10計算期間末 （平成23年11月21日）	130,307,276	130,307,276	0.6297	0.6297
第11計算期間末 （平成24年5月21日）	124,660,847	124,660,847	0.6699	0.6699
第12計算期間末 （平成24年11月20日）	128,747,595	128,747,595	0.7247	0.7247
第13計算期間末 （平成25年5月20日）	168,666,825	168,666,825	1.0034	1.0034

第14計算期間末 (平成25年11月20日)	153,501,430	153,501,430	0.9812	0.9812
第15計算期間末 (平成26年5月20日)	150,287,273	150,287,273	1.0087	1.0087
平成25年6月末日	150,913,800	-	0.9278	-
7月末日	147,829,057	-	0.9228	-
8月末日	142,931,363	-	0.9090	-
9月末日	152,218,518	-	0.9668	-
10月末日	154,554,342	-	0.9769	-
11月末日	156,098,803	-	0.9974	-
12月末日	158,887,919	-	1.0229	-
平成26年1月末日	153,783,406	-	0.9987	-
2月末日	156,036,258	-	1.0081	-
3月末日	148,584,654	-	1.0044	-
4月末日	149,542,820	-	1.0090	-
5月末日	153,419,106	-	1.0296	-
6月末日	151,055,869	-	1.0511	-

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
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
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

## 収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	3.6
第2計算期間	11.9
第3計算期間	4.6

第4計算期間	36.4
第5計算期間	12.5
第6計算期間	4.6
第7計算期間	3.9
第8計算期間	2.5
第9計算期間	2.6
第10計算期間	11.5
第11計算期間	6.4
第12計算期間	8.2
第13計算期間	38.5
第14計算期間	2.2
第15計算期間	2.8

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

##### 「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第1特定期間	10,000,000	-	10,000,000
第2特定期間	1,179,356,533	17,614,816	1,171,741,717
第3特定期間	9,813,775	39,172,454	1,142,383,038
第4特定期間	9,026,392	73,466,398	1,077,943,032
第5特定期間	7,185,011	19,032,736	1,066,095,307
第6特定期間	1,634,788	49,540,920	1,018,189,175
第7特定期間	2,083,152	72,701,677	947,570,650
第8特定期間	179,632	144,222,070	803,528,212
第9特定期間	431,808	101,844,992	702,115,028
第10特定期間	419,137	89,592,474	612,941,691
第11特定期間	-	72,395,120	540,546,571
第12特定期間	177,073	51,070,334	489,653,310
第13特定期間	892,871	28,511,768	462,034,413
第14特定期間	379,023	47,491,954	414,921,482
第15特定期間	556,573	28,824,896	386,653,159

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 「ニッセイセカンドライフ応援ファンド(成長重視型)」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	10,000,000	-	10,000,000
第2計算期間	368,139,121	706,376	377,432,745
第3計算期間	10,497,942	31,450,581	356,480,106
第4計算期間	2,109,702	37,271,017	321,318,791
第5計算期間	3,679,235	7,222,698	317,775,328
第6計算期間	4,782,655	6,811,641	315,746,342
第7計算期間	1,539,453	37,983,808	279,301,987
第8計算期間	1,029,695	13,177,405	267,154,277
第9計算期間	719,082	28,271,845	239,601,514
第10計算期間	783,722	33,461,675	206,923,561
第11計算期間	1,399,186	22,234,378	186,088,369
第12計算期間	1,373,849	9,815,124	177,647,094
第13計算期間	1,596,522	11,142,686	168,100,930
第14計算期間	1,818,320	13,476,673	156,442,577
第15計算期間	2,693,129	10,149,865	148,985,841

(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6月末現在

## ● 基準価額・純資産の推移

【毎月分配型】



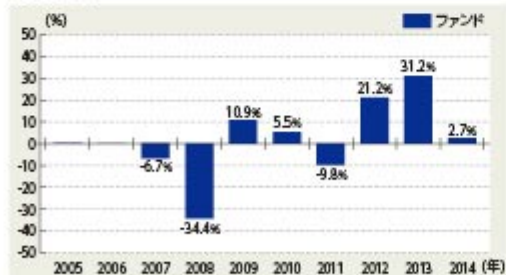
【成長重視型】



- ・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

【毎月分配型】



- ・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。
- ・2007年はファンド設定前から年末まで、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

	毎月分配型	成長重視型
基準価額	8,730円	10,511円
純資産総額	334百万円	151百万円

## ● 分配の推移

【毎月分配型】 1万口当り(税引前) 【成長重視型】 1万口当り(税引前)

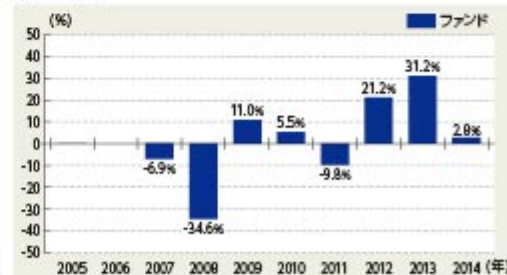
第84期	2014年2月	10円	第11期	2012年5月	0円
第85期	2014年3月	10円	第12期	2012年11月	0円
第86期	2014年4月	10円	第13期	2013年5月	0円
第87期	2014年5月	10円	第14期	2013年11月	0円
第88期	2014年6月	10円	第15期	2014年5月	0円
直近1年間累計	120円		直近1年間累計	0円	
設定来累計	1,320円		設定来累計	0円	

## ● マザーファンド組入比率

	毎月分配型	成長重視型
ニッセイ日本株マザーファンド	22.5%	22.5%
ニッセイ外国株マザーファンド	11.0%	11.0%
ニッセイ国内債券マザーファンド	22.0%	22.0%
ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド	11.0%	11.0%
ニッセイJ-REITマザーファンド	22.5%	22.5%
ニッセイグローバルリートマザーファンド	11.1%	11.1%

- ・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

【成長重視型】



- 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。
- 最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2014年6月末現在

## ●各マザーファンドの組入上位銘柄

## 1. ニッセイ日本株マザーファンド

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	4.2%
2	三菱UFJフィナンシャルG	3.6%
3	日本電信電話	2.3%
4	ソフトバンク	2.3%
5	三井住友フィナンシャルG	2.0%
6	本田技研	1.8%
7	日立	1.8%
8	東海旅客鉄道	1.7%
9	オリックス	1.6%
10	国際石油開発帝石	1.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2. ニッセイ外国株マザーファンド

	銘柄	国・地域	業種	比率
1	アップル	アメリカ	情報技術	1.9%
2	メルク	アメリカ	ヘルスケア	1.7%
3	CVSケアマーズ	アメリカ	生活必需品	1.6%
4	エクソンモービル	アメリカ	エネルギー	1.6%
5	シュルンベルジェ	オランダ	エネルギー	1.5%
6	フィリップモリスインターナショナル	アメリカ	生活必需品	1.5%
7	ネスレ	スイス	生活必需品	1.5%
8	ロイヤルダッチ/シェル	イギリス	エネルギー	1.4%
9	ラスベガス・サンズ	アメリカ	娯楽サービス	1.3%
10	キャピタルワンファイナンシャル	アメリカ	金融	1.2%

・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。  
 ・比率は対組入株式評価額比です。

## 3. ニッセイ国内債券マザーファンド

	銘柄	比率
1	第308回 利付国債(10年)	6.5%
2	第334回 利付国債(2年)	4.7%
3	第325回 利付国債(10年)	4.7%
4	第331回 利付国債(2年)	4.7%
5	第329回 利付国債(2年)	4.7%
6	第328回 利付国債(2年)	4.4%
7	第330回 利付国債(2年)	3.9%
8	第140回 利付国債(20年)	3.2%
9	第340回 利付国債(2年)	2.9%
10	第121回 利付国債(20年)	2.6%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 4. ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド

	銘柄	比率
1	イタリア国債	6.8%
2	アメリカ国債	4.9%
3	アメリカ国債	4.8%
4	メキシコ国債	4.0%
5	アメリカ国債	3.6%
6	ベルギー国債	3.4%
7	ベルギー国債	3.3%
8	アメリカ国債	3.2%
9	メキシコ国債	3.2%
10	フランス国債	3.1%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 5. ニッセイJ-REITマザーファンド

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	9.4%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	8.4%
3	日本リテールファンド投資法人	6.5%
4	フロンティア不動産投資法人	4.9%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.9%
6	日本プロロジスリート投資法人	4.7%
7	森ビルズリート投資法人	4.6%
8	日本ロジスティクスファンド投資法人	4.3%
9	アドバンス・レジデンス投資法人	4.1%
10	野村不動産マスターファンド投資法人	4.1%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

## 6. ニッセイグローバルリートマザーファンド

	銘柄	国・地域	比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	5.8%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	3.2%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.7%
4	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.3%
5	PROLOGIS INC	アメリカ	2.2%
6	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	2.1%
7	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	2.1%
8	HCP INC	アメリカ	2.1%
9	VENTAS INC	アメリカ	2.1%
10	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	2.0%

・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。  
 ・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

❶ 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。

❷ 最新の運用実績については、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】

#### <訂正前>

（略）

申込手数料

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%（税抜3.5%）を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。

消費税率が8%になった場合は、3.78%となります。

手数料率は変更となる場合があります。

（略）

#### <訂正後>

（略）

申込手数料

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.78%（税抜3.5%）を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。

手数料率は変更となる場合があります。

（略）



### 第3【ファンドの経理状況】

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

#### ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）

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）当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月（特定期間）ごとに作成しております。

3）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成25年11月21日から平成26年5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。

#### ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）

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

3）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（平成25年11月21日から平成26年5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】

#### 【ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）】

#### （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14特定期間 （平成25年11月20日現在）	第15特定期間 （平成26年5月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	316,600	300,238
親投資信託受益証券	340,998,380	324,351,637
未収入金	1,259,361	436,399
流動資産合計	342,574,341	325,088,274

資産合計	342,574,341	325,088,274
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	414,921	386,653
未払解約金	792,415	-
未払受託者報酬	14,737	14,043
未払委託者報酬	353,851	337,093
その他未払費用	11,780	11,223
流動負債合計	1,587,704	749,012
負債合計	1,587,704	749,012
純資産の部		
元本等		
元本	414,921,482	386,653,159
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	73,934,845	62,313,897
純資産合計	340,986,637	324,339,262
負債純資産合計	342,574,341	325,088,274

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14特定期間 (自平成25年5月21日 至平成25年11月20日)	第15特定期間 (自平成25年11月21日 至平成26年5月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	7,377,445	11,582,721
営業収益合計	7,377,445	11,582,721
営業費用		
受託者報酬	92,429	87,094
委託者報酬	2,219,642	2,091,360
その他費用	73,898	69,624
営業費用合計	2,385,969	2,248,078
営業利益又は営業損失（ ）	9,763,414	9,334,643
経常利益又は経常損失（ ）	9,763,414	9,334,643
当期純利益又は当期純損失（ ）	9,763,414	9,334,643
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（ ）	524,420	158,288
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	70,811,545	73,934,845
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,810,069	4,903,359
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,810,069	4,903,359
当期追加信託に伴う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	74,253	93,729
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	74,253	93,729
分配金	2,620,122	2,365,037
期末剰余金又は期末欠損金( )	73,934,845	62,313,897

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
---------------------	---

( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第14特定期間 (平成25年11月20日現在)	第15特定期間 (平成26年5月20日現在)
1 . 受益権総口数	414,921,482口	386,653,159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73,934,845円です。	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62,313,897円です。
3 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8218円 (8,218円)	0.8388円 (8,388円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第14特定期間 (自平成25年5月21日 至平成25年11月20日)	第15特定期間 (自平成25年11月21日 至平成26年5月20日)
1 . 分配金の計算過程	<p>(自平成25年5月21日 至平成25年6月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(178,839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(4,846,689円)及び分配準備積立金(4,452,542円)より分配対象収益は9,478,070円(1口当たり0.021005円)であり、うち451,232円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成25年6月21日 至平成25年7月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(764,407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(4,819,556円)及び分配準備積立金(4,156,741円)より分配対象収益は9,740,704円(1口当たり0.021708円)であり、うち448,705円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成25年11月21日 至平成25年12月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(480,198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(4,321,902円)及び分配準備積立金(4,371,863円)より分配対象収益は9,173,963円(1口当たり0.022815円)であり、うち402,106円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成25年12月21日 至平成26年1月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(770,709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(4,278,223円)及び分配準備積立金(4,404,478円)より分配対象収益は9,453,410円(1口当たり0.023751円)であり、うち398,018円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。</p>

<p>（自平成25年7月23日 至平成25年8月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（226,746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（4,739,752円）及び分配準備積立金（4,398,378円）より分配対象収益は9,364,876円（1口当たり0.021222円）であり、うち441,275円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成26年1月21日 至平成26年2月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（174,092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（4,259,546円）及び分配準備積立金（4,745,048円）より分配対象収益は9,178,686円（1口当たり0.023192円）であり、うち395,771円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成25年8月21日 至平成25年9月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（645,471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（4,701,166円）及び分配準備積立金（4,147,297円）より分配対象収益は9,493,934円（1口当たり0.021698円）であり、うち437,555円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成26年2月21日 至平成26年3月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（345,217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（4,224,938円）及び分配準備積立金（4,485,557円）より分配対象収益は9,055,712円（1口当たり0.023071円）であり、うち392,507円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成25年9月21日 至平成25年10月21日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（905,922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（4,581,687円）及び分配準備積立金（4,244,518円）より分配対象収益は9,732,127円（1口当たり0.022822円）であり、うち426,434円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成26年3月21日 至平成26年4月21日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,214,434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（4,198,213円）及び分配準備積立金（4,409,324円）より分配対象収益は9,821,971円（1口当たり0.025186円）であり、うち389,982円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成25年10月22日 至平成25年11月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（331,254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（4,459,351円）及び分配準備積立金（4,595,149円）より分配対象収益は9,385,754円（1口当たり0.022621円）であり、うち414,921円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成26年4月22日 至平成26年5月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（401,382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（4,162,380円）及び分配準備積立金（5,189,095円）より分配対象収益は9,752,857円（1口当たり0.025224円）であり、うち386,653円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>

（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14特定期間 (自平成25年5月21日 至平成25年11月20日)	第15特定期間 (自平成25年11月21日 至平成26年5月20日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14特定期間 (平成25年11月20日現在)	第15特定期間 (平成26年5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	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14特定期間 (平成25年11月20日現在)	第15特定期間 (平成26年5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	1,907,134	1,068,209
合計	1,907,134	1,068,209

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第14特定期間 (平成25年11月20日現在)	第15特定期間 (平成26年5月20日現在)
期首元本額	462,034,413円	414,921,482円
期中追加設定元本額	379,023円	556,573円
期中一部解約元本額	47,491,954円	28,824,896円

## (4)【附属明細表】(平成26年5月20日現在)

## 第1 有価証券明細表

## 株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ日本株 マザーファンド	40,989,393	70,882,957	
	ニッセイ外国株 マザーファンド	32,770,722	35,795,459	

	ニッセイ国内債券マザーファンド	55,605,873	72,687,997	
	ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド	14,751,960	36,109,847	
	ニッセイJ-REIT マザーファンド	46,713,800	72,756,743	
	ニッセイグローバルリート マザーファンド	42,091,405	36,118,634	
	親投資信託受益証券 合計	232,923,153	324,351,637	
	合計	232,923,153	324,351,637	

## 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。



## 【ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）】

## （１）【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (平成25年11月20日現在)	第15期 (平成26年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,002,338	1,006,245
親投資信託受益証券	153,506,986	150,292,831
未収入金	22,902	23,014
流動資産合計	154,532,226	151,322,090
資産合計	154,532,226	151,322,090
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	39,913	40,062
未払委託者報酬	959,004	962,762
その他未払費用	31,879	31,993
流動負債合計	1,030,796	1,034,817
負債合計	1,030,796	1,034,817
純資産の部		
元本等		
元本	156,442,577	148,985,841
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,941,147	1,301,432
純資産合計	153,501,430	150,287,273
負債純資産合計	154,532,226	151,322,090

## （２）【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期 (自平成25年5月21日 至平成25年11月20日)	第15期 (自平成25年11月21日 至平成26年5月20日)
営業収益		
受取利息	46	32
有価証券売買等損益	3,264,173	5,266,865
営業収益合計	3,264,127	5,266,897
営業費用		
受託者報酬	39,913	40,062
委託者報酬	959,004	962,762

その他費用	31,879	31,993
営業費用合計	1,030,796	1,034,817
営業利益又は営業損失（ ）	4,294,923	4,232,080
経常利益又は経常損失（ ）	4,294,923	4,232,080
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,294,923	4,232,080
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（ ）	929,754	165,405
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	565,895	2,941,147
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	190,493
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	190,493
当期追加信託に伴う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	141,873	14,589
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	42,602	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	99,271	14,589
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,941,147	1,301,432

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第14期 (平成25年11月20日現在)	第15期 (平成26年5月20日現在)
1. 受益権総口数	156,442,577口	148,985,841口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,941,147円です。	
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9812円 (9,812円)	1.0087円 (10,087円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第14期 (自平成25年5月21日 至平成25年11月20日)	第15期 (自平成25年11月21日 至平成26年5月20日)

1. 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（698,227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（6,314,870円）及び分配準備積立金（15,007,240円）より分配対象収益は22,020,337円（1口当たり0.140757円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,606,507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（6,279,180円）及び分配準備積立金（14,694,152円）より分配対象収益は22,579,839円（1口当たり0.151557円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。
-------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期 (自平成25年5月21日 至平成25年11月20日)	第15期 (自平成25年11月21日 至平成26年5月20日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (平成25年11月20日現在)	第15期 (平成26年5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14期 (平成25年11月20日現在)	第15期 (平成26年5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	1,944,121	4,785,607
合計	1,944,121	4,785,607

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本額の変動

項目	第14期 (平成25年11月20日現在)	第15期 (平成26年5月20日現在)
期首元本額	168,100,930円	156,442,577円
期中追加設定元本額	1,818,320円	2,693,129円
期中一部解約元本額	13,476,673円	10,149,865円

## (4)【附属明細表】(平成26年5月20日現在)

## 第1 有価証券明細表

## 株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ日本株 マザーファンド	18,992,035	32,842,926	
	ニッセイ外国株 マザーファンド	15,185,029	16,586,607	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	25,770,064	33,686,627	
	ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド	6,834,512	16,729,518	
	ニッセイJ-REIT マザーファンド	21,642,256	33,707,813	
	ニッセイグローバルリート マザーファンド	19,507,447	16,739,340	
親投資信託受益証券 合計		107,931,343	150,292,831	
合計		107,931,343	150,292,831	

## 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)

ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）及びニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）は、「ニッセイ日本株 マザーファンド」、「ニッセイ外国株 マザーファンド」、「ニッセイ国内債券マザーファンド」、「ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド」、「ニッセイJ-REIT マザーファンド」及び「ニッセイグローバルリート マザーファンド」の受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ日本株 マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
--	-----------------	----------------

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	943,815,622	1,398,709,366
株式	52,676,075,000	49,962,382,300
派生商品評価勘定	34,766,205	-
未収入金	695,998,700	-
未収配当金	384,880,540	604,353,496
前払金	-	60,064,000
差入委託証拠金	33,375,000	68,625,000
流動資産合計	54,768,911,067	52,094,134,162
資産合計	54,768,911,067	52,094,134,162
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	62,067,961
前受金	37,585,000	-
未払解約金	426,895,969	47,980,430
流動負債合計	464,480,969	110,048,391
負債合計	464,480,969	110,048,391
純資産の部		
元本等		
元本	30,117,802,642	30,060,252,806
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,186,627,456	21,923,832,965
純資産合計	54,304,430,098	51,984,085,771
負債純資産合計	54,768,911,067	52,094,134,162

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
1. 担保に供している資産 差入代用有価証券	株式 1,373,040,000円	株式 1,181,208,000円
2. 受益権総口数	30,117,802,642口	30,060,252,806口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8031円 (18,031円)	1.7293円 (17,293円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	(自平成25年5月21日 至平成25年11月20日)	(自平成25年11月21日 至平成26年5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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成25年11月20日現在	平成26年5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	70,890,190	3,030,897,685
合計	70,890,190	3,030,897,685

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 株式関連



種類	（平成25年11月20日 現在）				（平成26年5月20日 現在）			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年 超			（円）	うち 1年 超		
市場取引 先物取引 買 建	1,583,615,000	-	1,618,505,000	34,890,000	2,170,054,000	-	2,108,160,000	61,894,000
合計	1,583,615,000	-	1,618,505,000	34,890,000	2,170,054,000	-	2,108,160,000	61,894,000

## （注） 時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

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

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	31,466,417,115円	30,117,802,642円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	5,072,509,355円	3,726,873,406円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	6,421,123,828円	3,784,423,242円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ日本株ファンド	30,056,624,445円	30,000,271,378円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	42,188,749円	40,989,393円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	18,989,448円	18,992,035円
計	30,117,802,642円	30,060,252,806円

## 附属明細表（平成26年5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	
日本水産	743,400	267	198,487,800	
マルハニチロ	33,600	1,502	50,467,200	
日鉄鉱業	99,000	384	38,016,000	
国際石油開発帝石	562,900	1,431	805,509,900	
コムシスホールディングス	27,900	1,779	49,634,100	

大成建設	123,000	472	58,056,000
大林組	23,000	603	13,869,000
前田建設	78,000	699	54,522,000
N I P P O	221,000	1,566	346,086,000
前田道路	200,000	1,569	313,800,000
住友林業	188,900	1,047	197,778,300
パナホーム	186,000	733	136,338,000
大和ハウス	65,000	1,861	120,965,000
積水ハウス	302,000	1,260	380,520,000
中電工	75,200	1,418	106,633,600
関電工	343,000	534	183,162,000
九電工	207,000	879	181,953,000
日清製粉G本社	56,400	1,163	65,593,200
山崎製パン	19,000	1,191	22,629,000
森永乳業	515,000	380	195,700,000
雪印メグミルク	169,000	1,309	221,221,000
ディー・エヌ・エー	71,600	1,251	89,571,600
アサヒグループホールディング	25,800	2,874	74,149,200
双日	3,006,400	161	484,030,400
味の素	40,000	1,512	60,480,000
キューピー	61,200	1,462	89,474,400
ハウス食品G本社	43,300	1,791	77,550,300
日本たばこ産業	64,700	3,238	209,498,600
J. フロント リテイリング	162,000	718	116,316,000
三越伊勢丹HD	26,500	1,295	34,317,500
東洋紡	30,000	162	4,860,000
日清紡ホールディングス	150,000	936	140,400,000
セブン&アイ・HLDGS	90,600	3,963	359,047,800
旭化成	347,000	725	251,575,000
ITホールディングス	202,400	1,563	316,351,200
王子ホールディングス	571,000	419	239,249,000
日本製紙	208,100	1,911	397,679,100
レンゴー	583,000	458	267,014,000
日本触媒	35,000	1,229	43,015,000
カネカ	203,000	619	125,657,000
協和発酵キリン	89,000	1,206	107,334,000
東京応化工業	67,500	2,160	145,800,000
三菱ケミカルHLDGS	987,500	410	404,875,000
ダイセル	105,000	886	93,030,000
積水化学	61,000	1,078	65,758,000
宇部興産	565,000	167	94,355,000
武田薬品	11,100	4,488	49,816,800
塩野義製薬	20,100	1,869	37,566,900
田辺三菱製薬	180,300	1,450	261,435,000

大塚ホールディングス	230,700	2,892	667,184,400
大正製薬HD	25,400	7,150	181,610,000
日本ペイント	9,000	1,470	13,230,000
D I C	623,000	263	163,849,000
東洋インキSCホールディン	297,000	421	125,037,000
フジ・メディア・HD	9,100	1,594	14,505,400
楽天	60,900	1,180	71,862,000
富士フイルムHLDGS	250,300	2,550	638,265,000
コニカミノルタ	252,500	845	213,362,500
JXホールディングス	1,327,300	506	671,613,800
横浜ゴム	117,000	859	100,503,000
ブリヂストン	137,700	3,386	466,252,200
住友ゴム	223,100	1,376	306,985,600
旭硝子	432,000	553	238,896,000
日本電気硝子	1,205,000	498	600,090,000
新日鐵住金	980,000	273	267,540,000
神戸製鋼所	988,000	135	133,380,000
JFEホールディングス	97,700	1,850	180,745,000
日新製鋼	21,800	1,126	24,546,800
日本軽金属HD	1,389,900	146	202,925,400
三井金属	263,000	244	64,172,000
三菱マテリアル	283,000	304	86,032,000
住友鉱山	84,000	1,588	133,392,000
住友電工	104,500	1,321	138,044,500
フジクラ	157,000	431	67,667,000
東洋製罐グループHD	81,300	1,443	117,315,900
LIXILグループ	30,500	2,443	74,511,500
アマダ	59,000	943	55,637,000
豊田自動織機	56,800	4,435	251,908,000
SMC	3,400	24,345	82,773,000
小松製作所	71,800	2,239	160,760,200
住友重機械	488,000	433	211,304,000
日立建機	48,000	1,877	90,096,000
クボタ	112,000	1,357	151,984,000
小森コーポレーション	27,600	1,191	32,871,600
荏原製作所	217,000	600	130,200,000
ダイキン工業	26,600	5,639	149,997,400
椿本チエイン	113,000	736	83,168,000
平和	136,300	1,971	268,647,300
ブラザー工業	95,300	1,494	142,378,200
セガサミーホールディングス	38,800	1,774	68,831,200
ミネベア	107,000	971	103,897,000
日立	1,172,000	670	785,240,000
東芝	527,000	397	209,219,000

三菱電機	367,000	1,085	398,195,000
富士電機	247,000	422	104,234,000
日本電産	32,000	5,472	175,104,000
オムロン	6,100	3,415	20,831,500
日本電気	581,000	291	169,071,000
富士通	501,000	649	325,149,000
パナソニック	265,000	1,040	275,600,000
ソニー	179,300	1,625	291,362,500
T D K	27,300	4,105	112,066,500
キーエンス	7,700	38,590	297,143,000
デンソー	30,000	4,315	129,450,000
ファナック	20,100	16,855	338,785,500
ローム	18,000	5,380	96,840,000
京セラ	78,900	4,464	352,209,600
村田製作所	15,700	8,521	133,779,700
三井造船	609,000	184	112,056,000
三菱重工業	245,000	559	136,955,000
日産自動車	571,000	896	511,616,000
いすゞ自動車	233,000	595	138,635,000
トヨタ自動車	387,700	5,468	2,119,943,600
三菱自動車工業	66,600	1,023	68,131,800
新明和工業	113,000	850	96,050,000
トピー工業	589,000	180	106,020,000
アイシン精機	45,300	3,405	154,246,500
マツダ	221,000	421	93,041,000
本田技研	276,600	3,402	940,993,200
スズキ	133,200	2,835	377,622,000
富士重工業	137,700	2,417	332,820,900
ニコン	14,300	1,559	22,293,700
キャノン	28,900	3,340	96,526,000
リコー	321,000	1,146	367,866,000
バンダイナムコHLDGS	6,600	2,129	14,051,400
トッパン・フォームズ	97,200	918	89,229,600
凸版印刷	257,000	730	187,610,000
共同印刷	134,000	278	37,252,000
タカラスタンダ-ド	133,000	771	102,543,000
コクヨ	51,200	733	37,529,600
岡村製作所	82,000	830	68,060,000
伊藤忠	266,200	1,161	309,058,200
丸紅	549,000	678	372,222,000
豊田通商	77,400	2,591	200,543,400
オンワードホールディングス	31,000	704	21,824,000
三井物産	376,600	1,517	571,302,200
東京エレクトロン	3,700	6,191	22,906,700

住友商事	559,200	1,282	716,894,400
三菱商事	296,700	1,965	583,015,500
キャノンマーケティングJPN	51,600	1,647	84,985,200
しまむら	6,800	10,340	70,312,000
高島屋	189,000	991	187,299,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	66,000	758	50,028,000
クレディセゾン	106,000	1,783	188,998,000
イオン	538,000	1,222	657,436,000
ユニグループ・HD	877,800	647	567,936,600
イズミ	36,600	3,075	112,545,000
三菱UFJフィナンシャルG	3,123,400	547	1,708,499,800
りそなホールディングス	1,276,300	507	647,084,100
三井住友フィナンシャルG	263,000	3,868	1,017,284,000
千葉銀行	618,000	638	394,284,000
横浜銀行	771,000	543	418,653,000
常陽銀行	45,000	488	21,960,000
七十七銀行	74,000	451	33,374,000
ふくおかフィナンシャルG	1,370,000	426	583,620,000
静岡銀行	8,000	955	7,640,000
八十二銀行	86,000	551	47,386,000
みずほフィナンシャルG	3,657,300	198	724,145,400
アコム	210,200	386	81,137,200
日立キャピタル	78,300	2,412	188,859,600
オリックス	531,100	1,524	809,396,400
三菱UFJリース	683,800	511	349,421,800
大和証券G本社	42,000	756	31,752,000
野村ホールディングス	740,000	623	461,020,000
日本取引所グループ	24,300	2,201	53,484,300
MS&AD	88,900	2,350	208,915,000
第一生命	217,800	1,440	313,632,000
東京海上HD	133,100	2,939	391,180,900
T&Dホールディングス	222,500	1,259	280,127,500
三井不動産	91,000	3,272	297,752,000
三菱地所	45,000	2,447	110,115,000
住友不動産	66,000	4,401	290,466,000
レオパレス21	3,800	440	1,672,000
イオンモール	3,800	2,537	9,640,600
東日本旅客鉄道	56,100	7,496	420,525,600
西日本旅客鉄道	19,700	4,167	82,089,900
東海旅客鉄道	71,100	12,755	906,880,500
阪急阪神HLDGS	374,000	547	204,578,000
日本通運	145,000	482	69,890,000
福山通運	149,000	606	90,294,000
セイノーホールディングス	433,000	1,026	444,258,000

日本郵船	423,000	293	123,939,000
商船三井	86,000	364	31,304,000
日本航空	127,100	5,190	659,649,000
三井倉庫	14,000	386	5,404,000
住友倉庫	405,000	478	193,590,000
上組	483,000	911	440,013,000
郵船ロジスティクス	15,900	1,082	17,203,800
日本電信電話	208,100	5,773	1,201,361,300
KDDI	111,200	5,441	605,039,200
NTTドコモ	281,900	1,644	463,443,600
中部電力	98,000	1,174	115,052,000
関西電力	143,800	941	135,315,800
東北電力	7,000	1,081	7,567,000
電源開発	5,900	2,780	16,402,000
東京瓦斯	613,000	557	341,441,000
大阪瓦斯	956,000	385	368,060,000
富士ソフト	51,300	2,052	105,267,600
ヤマダ電機	1,651,400	388	640,743,200
ニトリホールディングス	27,800	4,915	136,637,000
ソフトバンク	173,100	6,796	1,176,387,600
スズケン	1,700	3,380	5,746,000
合計	57,993,400		49,962,382,300

(注) 1. 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

トヨタ自動車 156,000株 三菱UFJフィナンシャルG 600,000株

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。

## 「ニッセイ外国株 マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	327,667	2,250,067
コール・ローン	18,657,533	34,126,737
株式	505,029,376	522,826,588
派生商品評価勘定	2,973,452	612,632
未収入金	8,499	8,474,448
未収配当金	740,373	1,303,035
差入委託証拠金	22,167,288	12,761,248
流動資産合計	549,904,188	582,354,755
資産合計	549,904,188	582,354,755
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	148,200
未払金	-	8,363,182
未払解約金	183,955	96,318
流動負債合計	183,955	8,607,700
負債合計	183,955	8,607,700
純資産の部		
元本等		
元本	532,629,595	525,279,428
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	17,090,638	48,467,627
純資産合計	549,720,233	573,747,055
負債純資産合計	549,904,188	582,354,755

### 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
--------------------	----

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
1. 受益権総口数	532,629,595口	525,279,428口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0321円 (10,321円)	1.0923円 (10,923円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年5月21日 至 平成25年11月20日）	（自 平成25年11月21日 至 平成26年5月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>	同左



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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成25年11月20日現在	平成26年5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	31,962,707	16,310,879
合計	31,962,707	16,310,879

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	(平成25年11月20日 現在)				(平成26年5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	-	-	-	-	1,523,175	-	1,521,900	1,275
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,523,175	-	1,521,900	1,275
買 建	19,640,440	-	20,034,000	393,560	20,436,200	-	20,288,000	148,200
アメリカ・ドル	19,640,440	-	20,034,000	393,560	20,436,200	-	20,288,000	148,200
合計	19,640,440	-	20,034,000	393,560	21,959,375	-	21,809,900	146,925

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

## 2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	（平成25年11月20日 現在）				（平成26年5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	42,134,904	-	44,714,797	2,579,893	47,136,620	-	47,747,976	611,356
合計	42,134,904	-	44,714,797	2,579,893	47,136,620	-	47,747,976	611,356

## （注） 時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

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

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	543,398,002円	532,629,595円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	913,138円	1,053,717円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	11,681,545円	8,403,884円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ外国株ファンド（適格機関投資家限定）	478,793,520円	477,323,677円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	37,123,863円	32,770,722円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	16,712,212円	15,185,029円
計	532,629,595円	525,279,428円

## 附属明細表（平成26年5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	ABBVIE INC	340	54.11	18,397.40	
	AMAZON.COM INC	72	296.75	21,366.36	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	815	52.71	42,958.65	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	719	46.85	33,685.15	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	520	109.69	57,038.80	
ANADARKO PETROLEUM CORP	100	100.04	10,004.00	
APPLE INC	153	604.59	92,502.27	
APPLIED MATERIALS INC	1,158	20.12	23,298.96	
AT&T INC	795	36.38	28,922.10	
BANK OF AMERICA CORP	2,033	14.67	29,824.11	
BLACKROCK INC	134	299.00	40,066.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	520	49.34	25,656.80	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	796	76.10	60,575.60	
CBOE HOLDINGS INC	1,024	48.85	50,022.40	
CELGENE CORP	110	147.38	16,211.80	
CHEVRON CORP	450	122.95	55,327.50	
CHURCH & DWIGHT CO INC	626	67.79	42,436.54	
CITIGROUP INC	436	46.77	20,391.72	
COMCAST CORP	540	50.90	27,486.00	
CUMMINS INC	316	150.10	47,431.60	
CVS CAREMARK CORP	1,150	76.27	87,710.50	
DOW CHEMICAL CO	1,240	49.34	61,181.60	
DUKE ENERGY CORP	302	70.30	21,230.60	
EOG RESOURCES INC	120	102.30	12,276.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	170	68.87	11,707.90	
EXXON MOBIL CORP	837	100.87	84,428.19	
FACEBOOK INC-A	407	59.21	24,098.47	
FREEMPORT-MCMORAN COPPER	665	35.05	23,308.25	
GENERAL ELECTRIC CO	1,614	26.61	42,948.54	
GENERAL MOTORS CO	518	34.25	17,741.50	
GILEAD SCIENCES INC	472	82.05	38,727.60	
GOOGLE INC-CL A	50	538.83	26,941.50	
GOOGLE INC-CL C	84	528.86	44,424.24	
HEWLETT-PACKARD CO	950	33.11	31,454.50	
HOME DEPOT INC	823	76.50	62,959.50	
INTERSIL CORP	2,110	13.47	28,432.25	
ITC HOLDINGS CORP	357	36.42	13,001.94	
JARDEN CORP	770	56.53	43,528.10	
JOHNSON & JOHNSON	271	100.64	27,273.44	
JPMORGAN CHASE & CO	603	53.83	32,459.49	
L BRANDS INC	974	57.96	56,453.04	
LAS VEGAS SANDS CORP	921	74.30	68,430.30	
MASTERCARD INC-CLASS A	566	73.86	41,804.76	
MCDONALD'S CORP	180	102.09	18,376.20	
MERCK & CO INC	1,571	56.35	88,525.85	
MICRON TECHNOLOGY INC	1,095	26.94	29,499.30	

MICROSOFT CORP	1,802	39.75	71,629.50	
MONSANTO CO	100	116.19	11,619.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	718	70.45	50,583.10	
MORGAN STANLEY	1,755	30.16	52,930.80	
NIKE INC	336	74.49	25,028.64	
NORTHEAST UTILITIES	230	45.26	10,409.80	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	540	95.94	51,807.60	
ORACLE CORP	674	42.16	28,415.84	
PACCAR INC	501	62.15	31,137.15	
PENTAIR LTD-REGISTERED	625	74.36	46,475.00	
PEPSICO INC	346	86.10	29,790.60	
PFIZER INC	1,634	29.28	47,843.52	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	936	85.74	80,252.64	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	103	202.86	20,894.58	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	150	83.21	12,481.50	
PRAXAIR INC	170	131.54	22,361.80	
PRECISION CASTPARTS CORP	198	243.96	48,304.08	
QUALCOMM INC	198	79.81	15,802.38	
SCHLUMBERGER LTD	675	100.29	67,695.75	
SEMPRA ENERGY	200	97.08	19,416.00	
SERVICENOW INC	104	48.40	5,033.60	
SLM CORP	1,450	8.86	12,847.00	
SPECTRA ENERGY CORP	430	39.61	17,032.30	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	167	49.95	8,341.65	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	480	119.29	57,259.20	
TIME WARNER INC	190	70.11	13,320.90	
TYCO INTERNATIONAL LTD	1,038	43.17	44,810.46	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	150	115.02	17,253.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	220	77.20	16,984.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	777	49.15	38,189.55	
VMWARE INC-CLASS A	190	95.23	18,093.70	
WAL-MART STORES INC	229	76.61	17,543.69	
WELLS FARGO & CO	1,140	49.49	56,418.60	
YAHOO! INC	1,106	33.89	37,482.34	
YUM! BRANDS INC	507	74.60	37,822.20	
アメリカ・ドル 小計	50,546		2,925,838.79 (296,884,862)	
イギリス・ポンド	ASTRAZENECA PLC	371	42.87	15,906.62
	BARCLAYS PLC	2,060	2.38	4,921.34
	BG GROUP PLC	730	12.96	9,464.45
	BHP BILLITON PLC	480	19.42	9,321.60
	BP PLC	4,170	5.09	21,229.47
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	247	35.28	8,714.16

	BT GROUP PLC	2,290	3.71	8,498.19	
	DIAGEO PLC	540	19.19	10,362.60	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	790	16.20	12,798.00	
	GLENCORE PLC	3,275	3.27	10,728.90	
	HSBC HOLDINGS PLC	3,185	6.32	20,157.86	
	IG GROUP HOLDINGS PLC	1,600	6.07	9,720.00	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	1,075	26.65	28,648.75	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,138	0.73	16,359.98	
	NATIONAL GRID PLC	1,030	8.89	9,161.85	
	PRUDENTIAL PLC	2,023	13.95	28,220.85	
	RIO TINTO PLC	270	32.25	8,707.50	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,315	10.21	13,426.15	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	176,210	0.00	176.21	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,650	25.92	42,768.00	
	TESCO PLC	1,770	3.12	5,522.40	
	VODAFONE GROUP PLC	5,749	2.17	12,481.07	
	WPP PLC	1,143	12.22	13,967.46	
イギリス・ポンド	小計	234,111		321,263.41 (54,813,963)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	700	32.66	22,862.00	
	BHP BILLITON LTD	950	37.43	35,558.50	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	370	79.56	29,437.20	
	CROWN RESORTS LTD	372	15.65	5,821.80	
	CSL LIMITED	160	69.25	11,080.00	
	METCASH LTD	3,020	2.78	8,395.60	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	610	32.95	20,099.50	
	RIO TINTO LTD	200	60.10	12,020.00	
	TELSTRA CORP LTD	3,520	5.26	18,515.20	
	WESFARMERS LIMITED	177	42.67	7,552.59	
	WESTPAC BANKING CORP	670	33.78	22,632.60	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	210	41.11	8,633.10	
	WOOLWORTHS LTD	330	36.92	12,183.60	
オーストラリア・ドル	小計	11,289		214,791.69 (20,310,702)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	190	74.78	14,208.20	
	BANK OF NOVA SCOTIA	300	67.03	20,109.00	
	BARRICK GOLD CORP	410	18.06	7,404.60	
	BCE INC	190	49.80	9,462.00	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	840	64.24	53,961.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	440	39.50	17,380.00	
	GOLDCORP INC	260	26.74	6,952.40	
	ROYAL BANK OF CANADA	280	72.84	20,395.20	

	TORONTO-DOMINION BANK	440	51.61	22,708.40	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	300	137.62	41,286.00	
カナダ・ドル 小計		3,650		213,867.40 (19,951,690)	
シンガポール・ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,000	16.85	16,850.00	
	KEPPEL CORP LTD	1,000	10.56	10,560.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,000	3.84	7,680.00	
シンガポール・ドル 小計		4,000		35,090.00 (2,846,150)	
スイス・フラン	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	80	91.05	7,284.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	896	26.07	23,358.72	
	NESTLE SA	999	70.80	70,729.20	
	NOVARTIS AG	430	79.70	34,271.00	
	ROCHE HOLDING AG	166	268.50	44,571.00	
	SYNGENTA AG	44	345.90	15,219.60	
スイス・フラン 小計		2,615		195,433.52 (22,232,517)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	235	197.30	46,365.50	
	HENNES & MAURITZ AB	1,035	281.90	291,766.50	
	NORDEA BANK AB	1,573	93.95	147,783.35	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	590	81.55	48,114.50	
	VOLVO AB	819	98.05	80,302.95	
スウェーデン・クローナ 小計		4,252		614,332.80 (9,454,581)	
デンマーク・クローネ	NOVO-NORDISK A/S	307	230.50	70,763.50	
デンマーク・クローネ 小計		307		70,763.50 (1,319,031)	
ノルウェー・クローネ	STATOIL ASA	831	179.30	148,998.30	
ノルウェー・クローネ 小計		831		148,998.30 (2,547,871)	
ユーロ	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	716	30.55	21,873.80	
	ADIDAS AG	50	77.87	3,893.50	
	AIR LIQUIDE	64	105.70	6,764.80	
	AIRBUS GROUP NV	130	51.32	6,671.60	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	190	80.11	15,220.90	
	AXA	1,725	17.12	29,540.62	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	2,222	8.85	19,682.47	
	BANCO SANTANDER SA	4,112	7.25	29,812.00	
	BASF SE	140	82.68	11,575.20	

BAYER AG	276	103.25	28,497.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	60	88.11	5,286.60	
BNP PARIBAS	550	52.20	28,710.00	
CONTINENTAL AG	107	160.05	17,125.35	
DAIMLER AG	210	66.00	13,860.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,100	12.50	13,755.50	
E.ON SE	540	13.35	7,209.00	
ENEL SPA	2,140	3.97	8,508.64	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	422	18.07	7,625.54	
GDF SUEZ	320	19.68	6,299.20	
IBERDROLA SA	2,093	5.14	10,770.57	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,700	8.60	23,220.00	
ING GROEP NV	3,201	9.50	30,412.70	
INTESA SANPAOLO	1,790	2.21	3,963.06	
JC DECAUX SA	618	28.45	17,585.19	
KERRY GROUP PLC-A	703	54.80	38,524.40	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,266	23.11	29,263.59	
L'OREAL SA	40	129.10	5,164.00	
LAFARGE SA	96	63.08	6,055.68	
LINDE AG	40	153.70	6,148.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	40	142.35	5,694.00	
RANDSTAD HOLDINGS NV	230	39.64	9,118.35	
REED ELSEVIER NV	560	15.39	8,618.40	
RWE AG	180	27.26	4,906.80	
SAFRAN SA	420	47.46	19,933.20	
SANOFI	227	77.29	17,544.83	
SAP AG	180	55.00	9,900.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	130	67.36	8,756.80	
SIEMENS AG	160	95.88	15,340.80	
SOLVAY SA	46	118.35	5,444.10	
TELEFONICA SA	660	12.11	7,995.90	
TOTAL SA	380	52.15	19,817.00	
UNILEVER NV	560	32.20	18,032.00	
VIVENDI SA	450	18.90	8,505.00	
VOLKSWAGEN AG	20	189.85	3,797.00	
ユーロ 小計	31,864		616,423.09 (85,762,945)	
香港・ドル				
AIA GROUP LTD	2,600	38.00	98,800.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,500	22.45	56,125.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	1,000	134.10	134,100.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,000	103.70	103,700.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	1,200	25.65	30,780.00	



	MTR CORP	1,500	28.50	42,750.00	
	SANDS CHINA LTD	800	57.20	45,760.00	
香港・ドル	小計	10,600		512,015.00 (6,702,276)	
合計		354,065		522,826,588 (522,826,588)	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式 81銘柄	51.74%	56.78%
イギリス・ポンド	株式 23銘柄	9.55%	10.48%
オーストラリア・ドル	株式 13銘柄	3.54%	3.88%
カナダ・ドル	株式 10銘柄	3.48%	3.82%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	0.50%	0.54%
スイス・フラン	株式 6銘柄	3.87%	4.25%
スウェーデン・クローナ	株式 5銘柄	1.65%	1.81%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	0.23%	0.25%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	0.44%	0.49%
ユーロ	株式 44銘柄	14.95%	16.40%
香港・ドル	株式 7銘柄	1.17%	1.28%

(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。

## 「ニッセイ国内債券マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	960,361,532	939,579,072
国債証券	25,932,332,535	24,244,143,500
派生商品評価勘定	9,154,250	2,204,250
未収入金	2,132,704,262	1,826,725,940
未収利息	29,897,140	37,438,829
前払費用	39,280,056	31,955,573
差入委託証拠金	3,240,000	1,800,000
流動資産合計	29,106,969,775	27,083,847,164
資産合計	29,106,969,775	27,083,847,164
負債の部		
流動負債		
前受金	9,470,000	2,280,000
未払金	2,054,463,874	1,826,687,521
未払解約金	78,553,479	20,626,538
流動負債合計	2,142,487,353	1,849,594,059
負債合計	2,142,487,353	1,849,594,059
純資産の部		
元本等		
元本	20,793,441,022	19,303,910,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,171,041,400	5,930,342,865
純資産合計	26,964,482,422	25,234,253,105
負債純資産合計	29,106,969,775	27,083,847,164

## 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
--------------------	------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
1. 受益権総口数	20,793,441,022口	19,303,910,240口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2968円 (12,968円)	1.3072円 (13,072円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	(自平成25年5月21日 至平成25年11月20日)	(自平成25年11月21日 至平成26年5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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、債券先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、市場金利の変動によるリスクを有しております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成25年11月20日現在	平成26年5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	137,693,342	43,658,980
合計	137,693,342	43,658,980

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

債券関連

種類	（平成25年11月20日 現在）				（平成26年5月20日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	860,290,000	-	869,460,000	9,170,000	869,220,000	-	871,440,000	2,220,000
合計	860,290,000	-	869,460,000	9,170,000	869,220,000	-	871,440,000	2,220,000

（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開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	24,230,847,344円	20,793,441,022円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	2,146,726,260円	1,867,845,743円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	5,584,132,582円	3,357,376,525円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン （債券重視型）	1,144,484,746円	1,013,806,279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）	382,393,725円	316,590,635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）	83,710,999円	68,826,442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）	142,113,832円	127,979,149円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型） SA（適格機関投資家限定）	5,497,003,307円	4,524,732,728円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA （適格機関投資家限定）	5,644,821,520円	5,148,537,583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)	203,024,889円	208,249,338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)	1,699,158,041円	1,777,591,931円
DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(標準型)	2,862,747,681円	2,992,601,503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)	685,185,458円	716,784,533円
DCニッセイ国内債券アクティブ	904,129,296円	915,840,747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)	1,327,357,257円	1,240,123,372円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(毎月分配型)	58,022,139円	55,605,873円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(成長重視型)	26,129,473円	25,770,064円
DCニッセイバランスアクティブ	133,158,659円	170,870,063円
計	20,793,441,022円	19,303,910,240円

附属明細表(平成26年5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325回 利付国債(2年)	51,800,000	51,814,238	
	第327回 利付国債(2年)	251,300,000	251,354,572	
	第328回 利付国債(2年)	1,123,600,000	1,123,865,974	
	第329回 利付国債(2年)	1,199,500,000	1,201,095,335	
	第330回 利付国債(2年)	1,088,200,000	1,089,690,834	
	第331回 利付国債(2年)	938,400,000	938,625,216	
	第332回 利付国債(2年)	1,058,800,000	1,059,138,816	
	第333回 利付国債(2年)	17,400,000	17,405,916	
	第334回 利付国債(2年)	197,300,000	197,373,001	
	第335回 利付国債(2年)	347,600,000	347,735,564	
	第337回 利付国債(2年)	917,900,000	918,212,086	
	第339回 利付国債(2年)	233,800,000	233,886,506	
	第103回 利付国債(5年)	40,400,000	40,633,512	
	第106回 利付国債(5年)	104,100,000	104,375,865	
	第113回 利付国債(5年)	193,600,000	194,815,808	
	第1回 利付国債(40年)	56,300,000	65,967,836	
	第2回 利付国債(40年)	41,800,000	46,832,720	
	第3回 利付国債(40年)	23,500,000	26,321,175	
	第4回 利付国債(40年)	30,100,000	33,699,057	
	第5回 利付国債(40年)	17,400,000	18,495,156	
第6回 利付国債(40年)	13,600,000	14,039,144		

第297回 利付国債(10年)	800,000	844,720	
第298回 利付国債(10年)	783,500,000	823,740,560	
第305回 利付国債(10年)	451,200,000	478,326,144	
第308回 利付国債(10年)	1,369,500,000	1,456,476,945	
第313回 利付国債(10年)	414,300,000	441,722,517	
第315回 利付国債(10年)	350,400,000	371,231,280	
第319回 利付国債(10年)	8,800,000	9,259,976	
第323回 利付国債(10年)	123,200,000	127,670,928	
第327回 利付国債(10年)	124,000,000	127,269,880	
第328回 利付国債(10年)	266,600,000	268,738,132	
第329回 利付国債(10年)	358,100,000	366,791,087	
第330回 利付国債(10年)	188,200,000	192,545,538	
第333回 利付国債(10年)	380,800,000	381,329,312	
第7回 利付国債(30年)	20,800,000	24,150,048	
第10回 利付国債(30年)	24,000,000	22,892,880	
第16回 利付国債(30年)	46,600,000	54,799,270	
第23回 利付国債(30年)	32,500,000	38,111,450	
第25回 利付国債(30年)	43,200,000	48,987,936	
第26回 利付国債(30年)	134,600,000	155,199,184	
第27回 利付国債(30年)	40,200,000	47,147,364	
第28回 利付国債(30年)	67,500,000	79,209,225	
第29回 利付国債(30年)	118,000,000	136,323,040	
第30回 利付国債(30年)	100,000,000	113,649,000	
第36回 利付国債(30年)	228,500,000	245,388,435	
第37回 利付国債(30年)	1,900,000	1,997,489	
第39回 利付国債(30年)	21,200,000	22,263,180	
第40回 利付国債(30年)	141,000,000	144,750,600	
第70回 利付国債(20年)	234,500,000	275,666,475	
第72回 利付国債(20年)	90,100,000	103,398,760	
第79回 利付国債(20年)	219,100,000	249,798,101	
第84回 利付国債(20年)	138,800,000	158,467,960	
第88回 利付国債(20年)	295,700,000	348,198,578	
第92回 利付国債(20年)	202,100,000	233,330,513	
第93回 利付国債(20年)	68,000,000	77,673,680	
第94回 利付国債(20年)	71,000,000	81,975,890	
第97回 利付国債(20年)	188,100,000	219,426,174	
第99回 利付国債(20年)	114,800,000	132,432,132	
第105回 利付国債(20年)	201,700,000	232,572,202	
第110回 利付国債(20年)	40,000,000	46,008,000	
第111回 利付国債(20年)	383,000,000	445,555,390	
第113回 利付国債(20年)	288,700,000	331,574,837	
第116回 利付国債(20年)	119,500,000	138,715,600	
第117回 利付国債(20年)	1,000,000	1,146,390	
第118回 利付国債(20年)	800,000	903,928	

第121回 利付国債(20年)	664,800,000	739,962,288	
第122回 利付国債(20年)	293,200,000	322,059,676	
第123回 利付国債(20年)	32,700,000	37,311,681	
第125回 利付国債(20年)	309,500,000	357,333,225	
第127回 利付国債(20年)	412,900,000	457,848,294	
第128回 利付国債(20年)	277,800,000	307,321,806	
第130回 利付国債(20年)	1,100,000	1,197,262	
第131回 利付国債(20年)	160,800,000	172,458,000	
第132回 利付国債(20年)	3,900,000	4,173,975	
第134回 利付国債(20年)	800,000	866,032	
第136回 利付国債(20年)	400,000	420,408	
第140回 利付国債(20年)	1,523,400,000	1,615,992,252	
第142回 利付国債(20年)	329,100,000	353,459,982	
第143回 利付国債(20年)	45,300,000	46,999,656	
第144回 利付国債(20年)	500,000	510,490	
第145回 利付国債(20年)	783,100,000	822,803,170	
第147回 利付国債(20年)	146,000,000	150,025,220	
第148回 利付国債(20年)	292,400,000	294,423,408	
第9回 物価連動国債(10年)	164,700,000	183,282,853	
第10回 物価連動国債(10年)	9,700,000	10,845,734	
第13回 物価連動国債(10年)	32,300,000	37,050,361	
第14回 物価連動国債(10年)	39,400,000	45,144,007	
第15回 物価連動国債(10年)	155,800,000	179,927,499	
第16回 物価連動国債(10年)	128,000,000	148,225,982	
第17回 物価連動国債(10年)	329,600,000	362,248,528	
第18回 物価連動国債(10年)	329,100,000	359,212,650	
国債証券 合計	22,909,000,000	24,244,143,500	
合計	22,909,000,000	24,244,143,500	

## 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。

## 「ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド」の状況

### 貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	7,434,390	24,342,177
コール・ローン	78,461,064	78,799,678
国債証券	4,115,257,340	3,729,225,811
派生商品評価勘定	2,269,457	2,697,969
未収入金	100,714,770	526,271,369
未収利息	35,278,107	29,050,797
前払費用	8,544,813	14,266,025
流動資産合計	4,347,959,941	4,404,653,826
資産合計	4,347,959,941	4,404,653,826
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,280,527	3,073,503
未払金	106,224,146	518,157,595
未払解約金	10,182,780	5,776,655
流動負債合計	118,687,453	527,007,753
負債合計	118,687,453	527,007,753
純資産の部		
元本等		
元本	1,822,637,609	1,584,136,138
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,406,634,879	2,406,634,879
純資産合計	4,229,272,488	3,877,646,073
負債純資産合計	4,347,959,941	4,404,653,826

### 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 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25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
1. 受益権総口数	1,822,637,609口	1,584,136,138口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3204円 (23,204円)	2.4478円 (24,478円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年5月21日 至 平成25年11月20日）	（自 平成25年11月21日 至 平成26年5月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成25年11月20日現在	平成26年5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	41,979,559	42,711,336
合計	41,979,559	42,711,336

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	（平成25年11月20日 現在）				（平成26年5月20日 現在）			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年 超			（円）	うち 1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売 建	241,674,839	-	243,950,366	2,275,527	651,441,769	-	648,837,117	2,604,652
アメリカ・ドル	54,805,852	-	55,041,138	235,286	11,647,899	-	11,635,168	12,731
イギリス・ポンド	-	-	-	-	7,390,768	-	7,383,516	7,252
オーストラリア・ドル	11,154,996	-	11,317,023	162,027	-	-	-	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	1,009,285	-	1,005,392	3,893
スウェーデン・クローナ	8,699,848	-	8,789,017	89,169	7,423,124	-	7,353,178	69,946
デンマーク・クローネ	23,007,748	-	23,279,664	271,916	65,582,168	-	65,294,424	287,744
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	7,773,705	-	7,788,480	14,775
メキシコ・ペソ	974,883	-	982,782	7,899	219,563,338	-	218,654,464	908,874
ユーロ	143,031,512	-	144,540,742	1,509,230	331,051,482	-	329,722,495	1,328,987
買 建	310,529,398	-	312,793,855	2,264,457	712,992,695	-	710,012,509	2,980,186
アメリカ・ドル	176,922,450	-	177,891,903	969,453	499,232,918	-	497,198,016	2,034,902
イギリス・ポンド	24,028,321	-	24,226,140	197,819	40,523,009	-	40,464,396	58,613
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	22,194,144	-	22,007,189	186,955
カナダ・ドル	19,477,609	-	19,598,685	121,076	103,384,080	-	102,881,760	502,320
シンガポール・ドル	10,346,604	-	10,427,052	80,448	-	-	-	-
スイス・フラン	15,181,928	-	15,346,546	164,618	14,384,771	-	14,321,125	63,646
ノルウェー・クローネ	3,122,361	-	3,180,848	58,487	15,691,747	-	15,624,784	66,963
ポーランド・ズロチ	5,462,603	-	5,549,932	87,329	3,035,154	-	3,021,456	13,698
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	11,972,024	-	11,931,696	40,328
ユーロ	53,247,692	-	53,793,273	545,581	1,042,585	-	1,043,621	1,036
南アフリカ・ランド	2,739,830	-	2,779,476	39,646	1,532,263	-	1,518,466	13,797
合計	552,204,237	-	556,744,221	11,070	1,364,434,464	-	1,358,849,626	375,534

（注） 時価の算定方法

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

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

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

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	2,162,280,226円	1,822,637,609円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	4,822,066円	3,055,828円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	344,464,683円	241,557,299円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイバランスポートフォリオ	142,932,789円	137,118,991円
ニッセイ外国債券アクティブS A（適格機関投資家限定）	1,655,827,077円	1,425,430,675円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	16,465,137円	14,751,960円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	7,412,606円	6,834,512円
計	1,822,637,609円	1,584,136,138円

附属明細表（平成26年5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 BONDS 5.375 2031/02/15	210,000.00	275,131.50	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	380,000.00	365,244.60	
		US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	990,000.00	934,619.40	
		US TREASURY N/B 2.25 2017/11/30	570,000.00	593,997.00	
		US TREASURY N/B 2.625 2014/07/31	750,000.00	753,832.50	
		US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	30,000.00	30,618.60	

	US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	540,000.00	577,292.40	
	US TREASURY N/B 3.375 2019/11/15	1,020,000.00	1,111,157.40	
	US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	1,120,000.00	1,226,836.80	
	US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	120,000.00	125,755.20	
	US TREASURY N/B 3.75 2018/11/15	1,570,000.00	1,733,374.20	
	US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	980,000.00	1,237,700.80	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	170,000.00	202,725.00	
アメリカ・ドル 小計		8,450,000.00	9,168,285.40 (930,305,920)	
イギリス・ポンド	TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	280,000.00	306,745.60	
	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	140,000.00	154,315.00	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	320,000.00	367,228.80	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	460,000.00	533,788.60	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	80,000.00	89,681.60	
	TSY 5% 2018 5 2018/03/07	30,000.00	33,938.40	
	UK TREASURY 8.75 2017/08/25	30,000.00	37,158.30	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	80,000.00	77,810.40	
イギリス・ポンド 小計		1,420,000.00	1,600,666.70 (273,105,752)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	50,000.00	45,505.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	260,000.00	284,419.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	190,000.00	217,570.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	40,000.00	45,828.00	
オーストラリア・ドル 小計		540,000.00	593,323.10 (56,104,632)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	20,000.00	32,463.80	
カナダ・ドル 小計		20,000.00	32,463.80 (3,028,548)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	100,000.00	107,512.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 4 2018/09/01	50,000.00	56,482.50	
シンガポール・ドル	小計	150,000.00	163,994.50 (13,301,594)	
スイス・フラン	SWITZERLAND 2.5 2016/03/12	10,000.00	10,464.50	
スイス・フラン	小計	10,000.00	10,464.50 (1,190,442)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	640,000.00	729,030.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.75 2017/08/12	1,050,000.00	1,149,067.50	
スウェーデン・クローナ	小計	1,690,000.00	1,878,097.90 (28,903,927)	
デンマーク・クロー ネ	KINGDOM OF DENMARK 4 2019/11/15	3,140,000.00	3,714,588.60	
デンマーク・クローネ	小計	3,140,000.00	3,714,588.60 (69,239,932)	
ノルウェー・クロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	780,000.00	872,625.00	
ノルウェー・クローネ	小計	780,000.00	872,625.00 (14,921,888)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 3.75 2018/04/25	40,000.00	40,806.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	580,000.00	639,380.40	
ポーランド・ズロチ	小計	620,000.00	680,186.40 (22,582,188)	
マレーシア・リン ギット	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.24 2018/02/07	420,000.00	428,782.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.734 2019/07/30	250,000.00	272,815.00	
マレーシア・リングギット	小計	670,000.00	701,597.20 (22,142,408)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	1,290,000.00	1,752,813.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 4.75 2018/06/14	5,420,000.00	5,414,742.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6 2015/06/18	21,910,000.00	22,492,367.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	800,000.00	843,336.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	130,000.00	145,398.50	

	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	910,000.00	1,041,777.10	
メキシコ・ペソ 小計		30,460,000.00	31,690,435.30 (249,086,821)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	170,000.00	177,318.50	
	BELGIUM KINGDOM 4 2018/03/28	130,000.00	147,140.50	
	BELGIUM KINGDOM 4 2019/03/28	180,000.00	207,864.00	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	160,000.00	192,713.60	
	BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	180,000.00	245,437.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2017/01/31	30,000.00	32,236.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.1 2018/07/30	120,000.00	133,038.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.5 2018/01/31	310,000.00	345,516.70	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	30,000.00	34,425.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	60,000.00	71,942.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2017/07/30	460,000.00	522,242.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	80,000.00	96,536.00	
	BTPS 6.5 11/01/27 6.5 2027/11/01	240,000.00	314,988.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	320,000.00	327,788.80	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2022/07/04	10,000.00	10,547.50	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2016/01/04	70,000.00	73,874.50	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.75 2017/01/04	490,000.00	536,795.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2018/01/04	400,000.00	455,192.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	180,000.00	237,245.40	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	300,000.00	427,506.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	70,000.00	104,979.70		



BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	310,000.00	333,783.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2014/08/01	1,840,000.00	1,853,064.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	150,000.00	167,547.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/02/01	100,000.00	110,895.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/08/01	150,000.00	167,605.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	110,000.00	122,708.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	110,000.00	126,120.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	200,000.00	227,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2017/08/01	2,080,000.00	2,335,860.80	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	330,000.00	334,270.20	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	450,000.00	477,490.50	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2016/04/25	600,000.00	635,718.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	50,000.00	57,140.50	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	400,000.00	460,044.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2017/04/25	600,000.00	660,912.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	130,000.00	160,108.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2018/10/25	30,000.00	34,857.60	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	50,000.00	66,682.50	
FRENCH OAT 5.5 2029/04/25	470,000.00	658,263.20	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	40,000.00	44,600.80	
Netherlands Government Bond 2.25 2022/07/15	20,000.00	21,435.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.35 2019/03/15	90,000.00	106,028.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	170,000.00	223,966.50	
SPANISH GVOT 5.75 07 5.75 2032/07/30	230,000.00	291,318.00	

	TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	70,000.00	81,101.30	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	80,000.00	98,612.80	
	TREASURY 5.9% 2019 5.9 2019/10/18	10,000.00	12,311.00	
ユーロ 小計		12,860,000.00	14,564,932.70 (2,026,419,087)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	1,140,000.00	865,020.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.25 2020/01/15	1,080,000.00	1,064,772.00	
南アフリカ・ランド 小計		2,220,000.00	1,929,792.60 (18,892,670)	
国債証券 合計			3,729,225,811 (3,729,225,811)	
合計			3,729,225,811 (3,729,225,811)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 13銘柄	23.99%	24.95%
イギリス・ポンド	国債証券 8銘柄	7.04%	7.32%
オーストラリア・ドル	国債証券 4銘柄	1.45%	1.50%
カナダ・ドル	国債証券 1銘柄	0.08%	0.08%
シンガポール・ドル	国債証券 2銘柄	0.34%	0.36%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.03%	0.03%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.75%	0.78%
デンマーク・クローネ	国債証券 1銘柄	1.79%	1.86%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	0.38%	0.40%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	0.58%	0.61%
マレーシア・リングgit	国債証券 2銘柄	0.57%	0.59%
メキシコ・ペソ	国債証券 6銘柄	6.42%	6.68%
ユーロ	国債証券 48銘柄	52.26%	54.34%
南アフリカ・ランド	国債証券 2銘柄	0.49%	0.51%

(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」-REIT マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,830,927,951	3,544,302,934
投資証券	228,452,013,100	297,268,295,110
未収配当金	1,049,087,323	1,536,982,241
流動資産合計	235,332,028,374	302,349,580,285
資産合計	235,332,028,374	302,349,580,285
負債の部		
流動負債		
未払金	792,814,436	593,148,325
未払解約金	1,974,055,387	2,134,025,284
流動負債合計	2,766,869,823	2,727,173,609
負債合計	2,766,869,823	2,727,173,609
純資産の部		
元本等		
元本	159,988,180,751	192,372,970,484
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	72,576,977,800	107,249,436,192
純資産合計	232,565,158,551	299,622,406,676
負債純資産合計	235,332,028,374	302,349,580,285

## 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	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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
1. 受益権総口数	159,988,180,751口	192,372,970,484口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4536円 (14,536円)	1.5575円 (15,575円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年5月21日 至 平成25年11月20日）	（自 平成25年11月21日 至 平成26年5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。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	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	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5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	平成25年11月20日現在	平成26年5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）
投資証券	1,365,257,853	1,796,704,354
合計	1,365,257,853	1,796,704,354

## （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開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	128,372,060,875円	159,988,180,751円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	71,960,921,866円	78,499,406,621円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	40,344,801,990円	46,114,616,888円
元本の内訳		
ファンド名		

ニッセイJ - R E I Tファンド（毎月決算型）	133,765,806,777円	149,992,232,674円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	51,717,060円	46,713,800円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	23,278,184円	21,642,256円
ニッセイJ - R E I Tファンド（適格機関投資家限定）	9,688,880,873円	10,528,300,036円
ニッセイJリートオープン（毎月分配型）	16,210,389,576円	28,961,345,511円
ニッセイJリートオープン（年1回決算型）	247,427,140円	2,126,076,865円
ニッセイJ - R E I Tファンド（年1回決算型）	681,141円	696,659,342円
計	159,988,180,751円	192,372,970,484円

附属明細表（平成26年5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
投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	12,629	10,620,989,000	
	G L P投資法人	63,172	6,746,769,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	82,841	9,112,510,000	
	いちご不動産投資法人	39,833	2,441,762,900	
	アドバンス・レジデンス投資法人	50,172	11,870,695,200	
	イオンリート投資法人	15,607	2,008,620,900	
	インヴィンシブル投資法人	51,636	922,218,960	
	オリックス不動産投資法人	85,936	11,420,894,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	4,420	1,365,780,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	15,134	7,430,794,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	2,334	517,681,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	201,021	9,277,119,150	
	ジャパンエクセレント投資法人	43,655	5,963,273,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	44,193	24,438,729,000	
	トップリート投資法人	3,759	1,678,393,500	
	ヒューリックリート投資法人	54,469	8,001,496,100	
	フロンティア不動産投資法人	29,137	15,355,199,000	
	プレミア投資法人	1,277	494,199,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	90,932	14,249,044,400	
	阪急リート投資法人	3,856	2,140,080,000	
	産業ファンド投資法人	7,590	6,664,020,000	
	森トラスト総合リート投資法人	29,283	4,732,132,800	
	森ヒルズリート投資法人	96,913	13,209,241,900	
	積水ハウス・S I投資法人	25,062	2,463,594,600	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	17,104	7,337,616,000	
	大和ハウスリート投資法人	14,259	6,174,147,000	
大和証券オフィス投資法人	15,836	8,076,360,000		

東急リアル・エステート投資法人	26,948	3,673,012,400	
日本アコモデーションファンド投資法人	8,752	3,194,480,000	
日本ビルファンド投資法人	50,079	28,845,504,000	
日本プライムリアルティ投資法人	32,356	11,518,736,000	
日本プロロジスリート投資法人	61,840	13,648,088,000	
日本リテールファンド投資法人	89,368	18,525,986,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	56,146	12,666,537,600	
日本賃貸住宅投資法人	31,504	2,006,804,800	
福岡リート投資法人	14,313	2,354,488,500	
平和不動産リート投資法人	31,992	2,636,140,800	
野村不動産オフィスファンド投資法人	7,702	3,485,155,000	
投資証券 合計	1,513,060	297,268,295,110	
合計	1,513,060	297,268,295,110	

## 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。

## 「ニッセイグローバルリート マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	11,595,821	20,003,439
コール・ローン	20,830,556	104,315,808
投資証券	1,563,313,192	2,407,985,451

未収入金	12,309,616	156,647
未収配当金	3,394,626	9,944,805
流動資産合計	1,611,443,811	2,542,406,150
資産合計	1,611,443,811	2,542,406,150
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	43,270	35,315
未払金	-	25,648,443
未払解約金	14,963,456	55,705,379
流動負債合計	15,006,726	81,389,137
負債合計	15,006,726	81,389,137
純資産の部		
元本等		
元本	2,104,664,040	2,868,114,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	508,226,955	407,097,443
純資産合計	1,596,437,085	2,461,017,013
負債純資産合計	1,611,443,811	2,542,406,150

## 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	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25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
----	-----------------	----------------



1 . 受益権総口数	2,104,664,040口	2,868,114,456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508,226,955円です。	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407,097,443円です。
3 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7585円 (7,585円)	0.8581円 (8,581円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成25年5月21日 至 平成25年11月20日)	(自 平成25年11月21日 至 平成26年5月20日)
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2 . 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成25年11月20日現在）	（平成26年5月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成25年11月20日現在	平成26年5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）
投資証券	214,200,745	189,947,000
合計	214,200,745	189,947,000

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	（平成25年11月20日 現在）				（平成26年5月20日 現在）			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
	うち 1年超			うち 1年超				

市場取引以外の取引									
為替予約取引									
売 建	4,769,365	-	4,812,635	43,270	-	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	4,769,365	-	4,812,635	43,270	-	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	25,681,306	-	25,645,991	35,315	
アメリカ・ドル	-	-	-	-	18,909,591	-	18,889,112	20,479	
イギリス・ポンド	-	-	-	-	1,011,634	-	1,009,622	2,012	
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	1,664,573	-	1,654,946	9,627	
シンガポール・ドル	-	-	-	-	1,167,490	-	1,165,765	1,725	
ユーロ	-	-	-	-	2,928,018	-	2,926,546	1,472	
合計	4,769,365	-	4,812,635	43,270	25,681,306	-	25,645,991	35,315	

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

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

項目	(平成25年11月20日現在)	(平成26年5月20日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	2,127,009,438円	2,104,664,040円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	11,576,739円	995,553,731円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	33,922,137円	232,103,315円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイグローバルリートファンド（適格機関投資家限定）	2,032,041,838円	2,001,316,151円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	50,082,503円	42,091,405円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	22,539,699円	19,507,447円
<購入・換金手数料なし>ニッセイグローバルリートインデックスファンド	-円	805,199,453円
計	2,104,664,040円	2,868,114,456円

## 附属明細表（平成26年5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
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	1,600.00	43,920.00	
		AGREE REALTY CORP	400.00	11,940.00	
		ALEXANDER'S INC	100.00	35,610.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,900.00	143,754.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	900.00	30,834.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,800.00	109,396.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	800.00	13,920.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	19,800.00	255,420.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO - A	4,100.00	127,756.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1,100.00	10,747.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1,900.00	28,994.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3,600.00	37,872.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	1,600.00	27,424.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,200.00	450,752.00	
		AVIV REIT INC	600.00	16,464.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	4,900.00	104,909.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,200.00	504,000.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	4,500.00	68,940.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2,100.00	46,956.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200.00	154,880.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	1,800.00	15,858.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	5,900.00	111,982.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	3,900.00	23,907.00	
		CHAMBERS STREET PROPERTIES	7,500.00	57,225.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	500.00	10,905.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	1,300.00	36,660.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	3,300.00	89,133.00	
		COMMONWEALTH REIT	2,700.00	67,743.00	
		CORESITE REALTY CORP	600.00	18,798.00	

CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2,700.00	73,791.00	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	3,199.00	102,975.81	
COUSINS PROPERTIES INC	4,304.00	50,830.24	
CUBESMART	3,100.00	55,428.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	9,000.00	69,390.00	
DDR CORP	8,308.00	143,728.40	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	6,014.00	72,528.84	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,400.00	200,532.00	
DOUGLAS EMMETT INC	3,400.00	94,928.00	
DUKE REALTY CORP	9,200.00	159,896.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	1,900.00	49,001.00	
EASTGROUP PROPERTIES	800.00	49,968.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	2,800.00	29,680.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	4,000.00	67,640.00	
EPR PROPERTIES	1,300.00	70,057.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,100.00	90,510.00	
EQUITY ONE INC	1,600.00	36,176.00	
EQUITY RESIDENTIAL	8,900.00	548,507.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,700.00	304,776.00	
EXCEL TRUST INC	1,300.00	16,744.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,000.00	156,390.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,800.00	214,902.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3,100.00	57,009.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	1,700.00	22,219.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,800.00	22,356.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	13,981.00	329,112.74	
GETTY REALTY CORP	400.00	7,748.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	200.00	3,502.00	
GLIMCHER REALTY TRUST	5,500.00	58,740.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	1,100.00	27,753.00	
GOVERNMENT PROPERTIES TRUST	1,800.00	9,882.00	
HCP INC	12,200.00	516,060.00	
HEALTH CARE REIT INC	7,600.00	489,592.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,400.00	59,688.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	4,300.00	52,030.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,600.00	40,656.00	

HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,500.00	100,425.00	
HOME PROPERTIES INC	1,400.00	87,066.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	4,300.00	124,270.00	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	21,265.00	462,513.75	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	1,400.00	32,774.00	
INLAND REAL ESTATE CORP	2,000.00	21,040.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,100.00	18,417.00	
KILROY REALTY CORP	2,100.00	128,541.00	
KIMCO REALTY CORP	11,200.00	255,584.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	2,100.00	13,209.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	2,900.00	94,569.00	
LEXINGTON CORPORATE PPTYS TR	5,153.00	57,352.89	
LIBERTY PROPERTY TRUST	4,000.00	152,120.00	
LTC PROPERTIES INC	700.00	27,650.00	
MACERICH CO/THE	3,819.00	250,984.68	
MACK-CALI REALTY CORP	2,600.00	52,624.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4,600.00	62,100.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,000.00	144,660.00	
MONMOUTH REIT -CL A	1,400.00	12,908.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	3,300.00	115,401.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	700.00	43,379.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3,200.00	116,800.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	1,800.00	34,398.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,700.00	59,143.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2,600.00	46,540.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	800.00	10,360.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	4,000.00	74,920.00	
POST PROPERTIES INC	1,400.00	71,554.00	
PROLOGIS INC	13,628.00	560,383.36	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	400.00	34,080.00	
PUBLIC STORAGE	3,800.00	653,334.00	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	900.00	26,532.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1,700.00	27,897.00	
REALTY INCOME CORP	5,734.00	250,403.78	
REGENCY CENTERS CORP	2,400.00	127,344.00	

RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	1,200.00	18,984.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	4,700.00	69,137.00	
RLJ LODGING TRUST	3,300.00	90,750.00	
ROUSE PROPERTIES INC	1,450.00	24,142.50	
SAUL CENTERS INC	400.00	18,884.00	
SELECT INCOME REIT	1,000.00	28,530.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	5,400.00	128,520.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	700.00	10,836.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	8,525.00	1,496,222.75	
SL GREEN REALTY CORP	2,600.00	281,762.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	900.00	68,517.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	9,200.00	104,420.00	
STAG INDUSTRIAL INC	1,200.00	28,332.00	
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	1,000.00	27,550.00	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC	6,300.00	68,229.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,400.00	13,384.00	
SUN COMMUNITIES INC	1,000.00	47,430.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6,000.00	85,260.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	2,400.00	85,224.00	
TAUBMAN CENTERS INC	1,700.00	125,630.00	
TERRENO REALTY CORP	600.00	11,178.00	
UDR INC	6,500.00	180,310.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	400.00	17,344.00	
URSTADT BIDDLE - CL A	500.00	10,275.00	
VENTAS INC	7,817.00	527,178.48	
VORNADO REALTY TRUST	4,682.00	493,435.98	
WASHINGTON REAL ESTATE INV	2,000.00	49,400.00	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,200.00	100,256.00	
WINTHROP REALTY TRUST	1,900.00	27,816.00	
WP CAREY INC	1,500.00	93,750.00	
アメリカ・ドル 小計	451,379.00	15,695,391.20 (1,592,611,345)	
イギリス・ポンド			
BIG YELLOW GROUP PLC	3,961.00	19,725.78	
BRITISH LAND CO PLC	27,000.00	189,810.00	
DERWENT LONDON PLC	2,273.00	61,098.24	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	8,353.00	52,456.84	

	HAMMERSON PLC	19,092.00	111,210.90	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	12,171.00	12,463.10	
	INTU PROPERTIES PLC	24,315.00	73,844.65	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	20,863.00	221,773.69	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	13,177.00	18,856.28	
	MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	1,367.00	6,124.16	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	2,337.00	8,097.70	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	20,672.00	11,700.35	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	4,961.00	10,467.71	
	SEGRO PLC	20,144.00	71,672.35	
	SHAFTESBURY PLC	6,710.00	44,286.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,358.00	5,813.43	
	WORKSPACE GROUP PLC	2,376.00	13,234.32	
	イギリス・ポンド 小計	195,130.00	932,635.50 (159,126,269)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	6,894.00	16,821.36	
	ALE PROPERTY GROUP	3,962.00	11,648.28	
	ASPEN GROUP	1,858.00	2,452.56	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	3,630.00	13,939.20	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	13,578.00	57,163.38	
	BWP TRUST	14,441.00	36,246.91	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	64,781.00	130,209.81	
	CHARTER HALL GROUP	8,630.00	36,591.20	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	7,370.00	28,669.30	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	40,664.00	39,850.72	
	DEXUS PROPERTY GROUP	149,439.00	165,877.29	
	FEDERATION CENTRES	36,772.00	90,091.40	
	GOODMAN GROUP	42,889.00	216,589.45	
	GPT GROUP	42,533.00	162,901.39	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	24,642.00	12,321.00	
	INVESTA OFFICE FUND	15,054.00	49,226.58	
	MIRVAC GROUP	101,550.00	176,189.25	
	NATIONAL STORAGE REIT	11,236.00	14,269.72	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	13,937.00	23,553.53	
	STOCKLAND	62,279.00	236,037.41	
	WESTFIELD GROUP	53,564.00	587,061.44	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	81,245.00	262,421.35	
	オーストラリア・ドル 小計	800,948.00	2,370,132.53 (224,119,732)	



カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	900.00	32,184.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1,100.00	17,677.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	700.00	45,353.00	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTI-U	600.00	16,206.00	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	1,300.00	35,516.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,000.00	23,450.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	900.00	41,427.00	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCE	1,500.00	16,080.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1,000.00	19,240.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	600.00	8,184.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900.00	55,909.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,200.00	35,448.00	
	Dream Global Real Estate Investment Trust	1,300.00	12,441.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	400.00	16,076.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT- UTS	3,300.00	77,649.00	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	1,400.00	7,336.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	500.00	8,570.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	500.00	13,610.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,300.00	92,070.00		
カナダ・ドル 小計		26,400.00	574,426.00 (53,588,202)	
シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	15,600.00	21,918.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	26,000.00	18,980.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	52,000.00	123,760.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	10,000.00	12,000.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	8,000.00	9,600.00	

	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	27,000.00	20,655.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	59,000.00	96,170.00	
	CAPITAMALL TRUST	59,000.00	119,770.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	24,000.00	35,760.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	20,000.00	34,800.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	21,000.00	18,690.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	16,000.00	18,960.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	13,000.00	23,855.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	25,600.00	33,024.00	
	KEPPEL REIT	25,000.00	31,500.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	51,000.00	20,910.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	42,000.00	56,280.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	68,000.00	60,520.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	24,000.00	35,640.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	32,000.00	37,280.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	7,000.00	16,590.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	19,000.00	20,140.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	16,000.00	13,280.00	
	SUNTEC REIT	58,000.00	103,530.00	
シンガポール・ドル	小計	718,200.00	983,612.00 (79,780,769)	
トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	62,146.00	173,387.34	
	IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	23,546.00	31,787.10	
	SINPAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	69,884.00	59,401.40	
	TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	15,089.00	51,302.60	
トルコ・リラ	小計	170,665.00	315,878.44 (15,301,152)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	12,256.00	12,746.24	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	15,150.00	17,498.25	
ニュージーランド・ドル	小計	27,406.00	30,244.49 (2,645,788)	
メキシコ・ペソ	ASESOR DE ACTIVOS PRISMA SAP	25,900.00	432,530.00	
	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	8,400.00	238,560.00	
	CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA	14,700.00	322,812.00	

	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	41,000.00	1,686,330.00	
	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	25,600.00	643,584.00	
	TF ADMINISTRADORA INDUSTRIAL	19,300.00	512,222.00	
メキシコ・ペソ 小計		134,900.00	3,836,038.00 (30,151,259)	
ユーロ	AEDIFICA	150.00	7,650.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,773.00	17,304.48	
	ALTAREA	57.00	7,256.10	
	ANF	370.00	8,639.50	
	BEFIMMO S.C.A.	398.00	21,273.10	
	BENI STABILI SPA	41,500.00	24,900.00	
	COFINIMMO	359.00	31,311.98	
	CORIO NV	2,749.00	100,104.83	
	EUROCOMMERCIAL-CVA	994.00	33,895.40	
	FONCIERE DES REGIONS	1,321.00	94,055.20	
	GECINA SA	654.00	66,381.00	
	GREEN REIT PLC	13,000.00	16,380.00	
	HIBERNIA REIT PLC-W/I	10,000.00	10,470.00	
	ICADE	714.00	49,787.22	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,200.00	9,741.60	
	KLEPIERRE	2,431.00	84,088.29	
	MERCIALYS	1,042.00	16,468.81	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	4,546.00	20,775.22	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	178.00	9,325.42	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,663.00	529,803.85	
VASTNED RETAIL NV	516.00	18,908.82		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	258.00	13,880.40		
WERELDHAVE NV	611.00	38,187.50		
ユーロ 小計		94,484.00	1,230,588.72 (171,211,809)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	58,000.00	214,600.00	
	FORTUNE REIT	27,000.00	176,850.00	
	LINK REIT	61,000.00	2,440,000.00	
	PROSPERITY REIT	40,000.00	96,800.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,400.00	67,160.00	
香港・ドル 小計		204,400.00	2,995,410.00 (39,209,917)	
南アフリカ・ランド	ACUCAP PROPERTIES LTD	5,530.00	253,274.00	
	CAPITAL PROPERTY FUND	43,702.00	465,426.30	

	EMIRA PROPERTY FUND	8,476.00	120,867.76	
	FOUNTAINHEAD PROPERTY TRUST	23,692.00	187,640.64	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	42,112.00	1,027,532.80	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	4,901.00	383,013.15	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	76,070.00	763,742.80	
	RESILIENT PROPERTY INCOME	7,738.00	439,286.26	
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUND	40,368.00	167,123.52	
	SYCOM PROPERTY FUND	5,076.00	136,899.72	
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	9,646.00	165,428.90	
	南アフリカ・ランド 小計	267,311.00	4,110,235.85	(40,239,209)
投資証券 合計			2,407,985,451	(2,407,985,451)
合計			2,407,985,451	(2,407,985,451)

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 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	投資証券 130銘柄	64.71%	66.14%
イギリス・ポンド	投資証券 17銘柄	6.47%	6.61%
オーストラリア・ドル	投資証券 22銘柄	9.11%	9.31%
カナダ・ドル	投資証券 19銘柄	2.18%	2.23%
シンガポール・ドル	投資証券 24銘柄	3.24%	3.31%
トルコ・リラ	投資証券 4銘柄	0.62%	0.64%
ニュージーランド・ドル	投資証券 2銘柄	0.11%	0.11%
メキシコ・ペソ	投資証券 6銘柄	1.23%	1.25%
ユーロ	投資証券 23銘柄	6.96%	7.11%
香港・ドル	投資証券 5銘柄	1.59%	1.63%
南アフリカ・ランド	投資証券 11銘柄	1.64%	1.67%

(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】

「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）」（平成26年6月30日現在）

資産総額	335,801,610円
負債総額	964,265円
純資産総額（ - ）	334,837,345円
発行済数量	383,539,520口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8730円

「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）」（平成26年6月30日現在）

資産総額	151,343,864円
負債総額	287,995円
純資産総額（ - ）	151,055,869円
発行済数量	143,718,797口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0511円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「1 委託会社等の概況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

##### (1) 資本金の額

平成26年6月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。

最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「2 事業の内容及び営業の概況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

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

平成26年6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	219	25,233
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	21	3,240
単位型公社債投資信託	0	0
合計	240	28,473

純資産総額合計額の金額については、億円未満の端数を切り捨てて記載しておりますので、表中の個々の金額の合計と合計欄の金額とは一致しないことがあります。



### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」について以下の通り記載内容を訂正いたします。

#### 1.財務諸表の作成方法について

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条および「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）に基づいて作成しております。

#### 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、事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

未払費用	1	80,370	1	79,355
未払法人税等		437,800		1,283,286
前受運用受託報酬		58		-
賞与引当金		745,159		769,569
その他		68,729		168,940
流動負債合計		2,964,217		4,248,293
固定負債				
退職給付引当金		929,869		1,106,561
役員退職慰労引当金		12,650		19,950
固定負債合計		942,519		1,126,511
負債合計		3,906,737		5,374,805
純資産の部				
株主資本				
資本金		10,000,000		10,000,000
資本剰余金				
資本準備金		8,281,840		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840		8,281,840
利益剰余金				
利益準備金		139,807		139,807
その他利益剰余金				
配当準備積立金		120,000		120,000
研究開発積立金		70,000		70,000
別途積立金		350,000		350,000
繰越利益剰余金		18,272,607		20,276,469
利益剰余金合計		18,952,414		20,956,276
株主資本合計		37,234,254		39,238,116
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		846,135		1,236,049
評価・換算差額等合計		846,135		1,236,049
純資産合計		38,080,390		40,474,166
負債・純資産合計		41,987,127		45,848,971

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

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

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

寄付金 - 142,550

特別損失計 413,196 160,764

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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

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

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

満期保有目的の債券

償却原価法（定額法）によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

…移動平均法に基づく原価法によっております。

関係会社株式

移動平均法に基づく原価法によっております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定率法によっております。

主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。

無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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



## 4. 引当金の計上基準

## 賞与引当金

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

## 退職給付引当金

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

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

## 役員退職慰労引当金

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

## 5. リース取引の処理方法

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

## 6. 消費税及び地方消費税の会計処理

税抜方式によっております。

## (貸借対照表関係)

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

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

2. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

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

## (損益計算書関係)

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。

取締役	180,000千円
監査役	40,000千円

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

3. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

平成24年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成24年3月31日

効力発生日 平成24年6月25日

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

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

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成25年3月31日

効力発生日 平成25年6月24日

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

平成25年6月24日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成25年3月31日

効力発生日 平成25年6月24日

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

平成26年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26日

## (リース取引関係)

## 1. ファイナンス・リース取引

## 所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

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

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

(単位：千円)

	当事業年度（平成26年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	762	100

未経過リース料期末残高相当額等 (単位：千円)

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

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)

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

## 減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

## 利息相当額の算定方法

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,509,845	1,509,845	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,626,076	4,632,360	6,283
その他有価証券	2,699,730	2,699,730	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,227,190	23,229,720	72,529
その他有価証券	7,864,894	7,864,894	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 現金・預金

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

## 有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

## 投資有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成25年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

当事業年度(平成26年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	1,509,845	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,600,000	23,200,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの その他(注)	4,888,361	3,035,620	1,624,417	3,044
合計	10,998,206	26,235,620	1,624,417	3,044

(注) 投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

(有価証券関係)

## 1. 満期保有目的の債券

前事業年度(平成25年3月31日)

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

当事業年度(平成26年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)

時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	26,554,298	26,634,680	80,381
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,554,298	26,634,680	80,381
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	1,298,967	1,297,400	1,567
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,298,967	1,297,400	1,567
合計		27,853,266	27,932,080	78,813

## 2. その他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日）

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

当事業年度（平成26年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,799,820	1,799,764	55
	国債・地方債等	1,799,820	1,799,764	55
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	7,295,640	5,502,350	1,793,290
	小計	9,095,460	7,302,114	1,793,345
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	899,910	899,912	2
	国債・地方債等	899,910	899,912	2
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	569,254	583,000	13,745
	小計	1,469,164	1,482,912	13,748
合計		10,564,624	8,785,027	1,779,597

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

### 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	256,377	1,377	-
合計	256,377	1,377	-

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

#### 1．採用している退職給付制度の概要

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

#### 2．退職給付債務に関する事項

(1)退職給付債務	929,869千円
(2)退職給付引当金	929,869千円

（注）当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

#### 3．退職給付費用に関する事項

(1)勤務費用	186,034千円
(2)退職給付負担金	22,515千円

#### 4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

### 2. 簡便法を適用した確定給付制度

#### （1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

#### （2）退職給付費用

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

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,191千円であります。

### （税効果会計関係）

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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



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

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

### (セグメント情報等)

#### [セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### [関連情報]

前事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

#### 1. サービスごとの情報

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

#### 2. 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,745,589

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	3,851,374

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引)

## 1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				

親会社	日本生命 保険相互 会社	大阪府大 阪市 中央区	250,000	生命保険業	(被所有)直 接90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業 取引	運用受託報酬 の受取	2,098,663	未収運用受 託報酬	493,954
								投資助言報酬 の受取	599,826	未収投資助 言報酬	133,324
								業務受託料 の受取	47,100	-	-
								関係会社株式 の取得	66,222	-	-

## 当事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)

種類	会社等 の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の 被所有割合	関連当事者 との関係		取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の兼 任等	事業上の 関係				
親会社	日本生命 保険相互 会社	大阪府大 阪市 中央区	250,000	生命保険業	(被所有)直 接90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業 取引	運用受託報酬 の受取	3,139,318	未収運用受 託報酬	738,331
								投資助言報酬 の受取	664,956	未収投資助 言報酬	151,082
								業務受託料 の受取	47,100	-	-

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社に関する注記

## 親会社情報

日本生命保険相互会社(非上場)

## (1株当たり情報)

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

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

## 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	当事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
当期純利益	574,236千円	2,139,422千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	574,236千円	2,139,422千円
期中平均株式数	108千株	108千株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」「1 名称、資本金の額及び事業の内容」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

平成26年3月末現在、324,279百万円

##### c. 事業の内容

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

#### (参考) 再信託受託会社の概況

##### a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

平成26年3月末現在、10,000百万円

##### c. 事業の内容

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

#### (2) 販売会社

(平成26年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
東海東京証券株式会社	6,000百万円	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。
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社SBI証券	47,937百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
株式会社四国銀行	25,000百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	

#### (3) その他の関係する法人（参考情報）

##### a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

##### b. 資本金の額

平成26年3月末現在、450百万円

##### c. 事業の内容

「有価証券に係る投資顧問業の規制に関する法律」に基づき監督官庁の登録を受け、投資顧問業を営むとともに、内外の経済、産業動向や金融・投資手法等に関する調査研究の受託、コンサルティング業等を営んでいます。「ニッセイ」-REITマザーファンド」の運用に関する助言を行います。

## a . 名称

NLI International Inc.

## b . 資本金の額

平成25年12月末現在 7,883,615米ドル（約830百万円、1米ドル = 105.39円）

## c . 事業の内容

米国において投資顧問業務を行っています。「ニッセイ外国株マザーファンド」の運用に関する助言を行います。

## a . 名称

Nissay Schroders Asset Management Europe Limited

## b . 資本金の額

平成25年12月末現在 1,750,000英ポンド（約304百万円、1英ポンド = 173.76円）

## c . 事業の内容

英国において投資顧問業務を行っています。「ニッセイ外国株マザーファンド」の運用に関する助言を行います。

## a . 名称

Nippon Life Global Investors Singapore Limited

## b . 資本金の額

平成25年12月末現在 1,000,000シンガポールドル（約83百万円、1シンガポールドル = 83.06円）

## c . 事業の内容

シンガポールにおいて投資顧問業務を行っています。「ニッセイ外国株マザーファンド」の運用に関する助言を行います。

## 独立監査人の監査報告書

平成26年6月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小暮和敏	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	大竹 新	印

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成26年7月11日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

岩本 正

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）の平成25年11月21日から平成26年5月20日までの特定期間の財務諸表、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、ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）の平成26年5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特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係



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

以 上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成26年7月11日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

岩本 正

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）の平成25年11月21日から平成26年5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、ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）の平成26年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)