

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年8月20日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 宇治原 潔
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集(売 出)内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	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)
【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】	継続募集額 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
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成27年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。

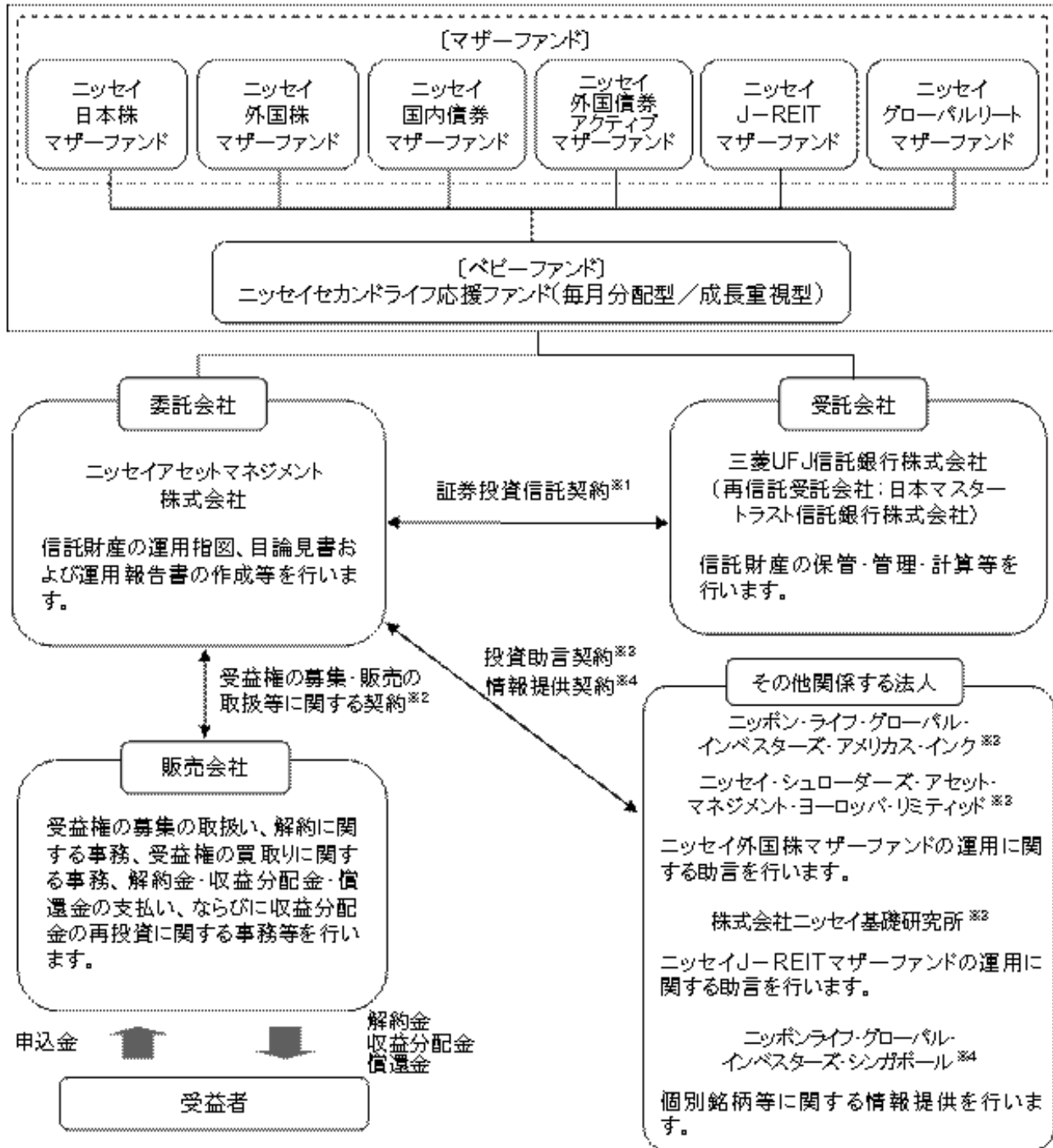
## 第二部【ファンド情報】

### 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】

原届出書「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」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。



(略)

- 3 委託会社とその他関係する法人との間で結ばれ、その他関係する法人が委託会社に対して運用に関する投資助言を行うことを定めた契約です。

- 4 委託会社とその他関係する法人との間で結ばれ、その他関係する法人が委託会社に対して個別銘柄等に関する情報提供を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（平成27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）

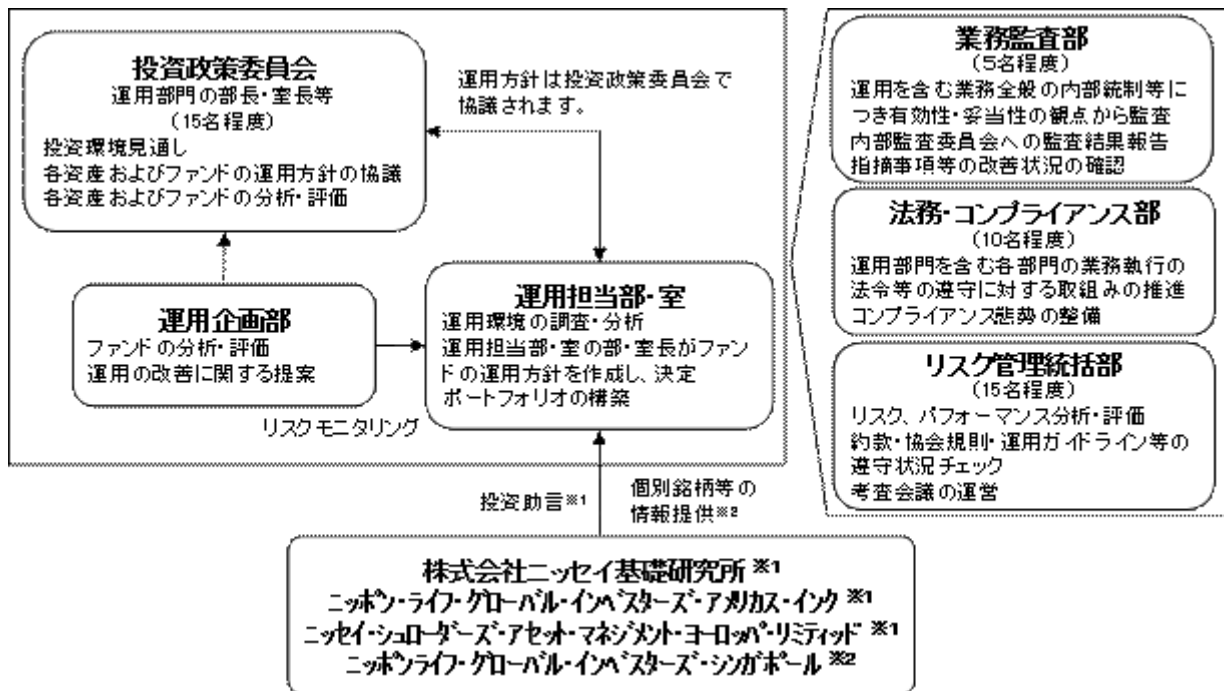
## 2【投資方針】

### （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。

（略）

内部管理体制および意思決定を監督する組織



（略）

## 3【投資リスク】

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

（略）

### （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27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	94.4	
ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド		87.3
ニッセイJ-REITマザーファンド		1.5
ニッセイグローバルリートマザーファンド		35.6

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。

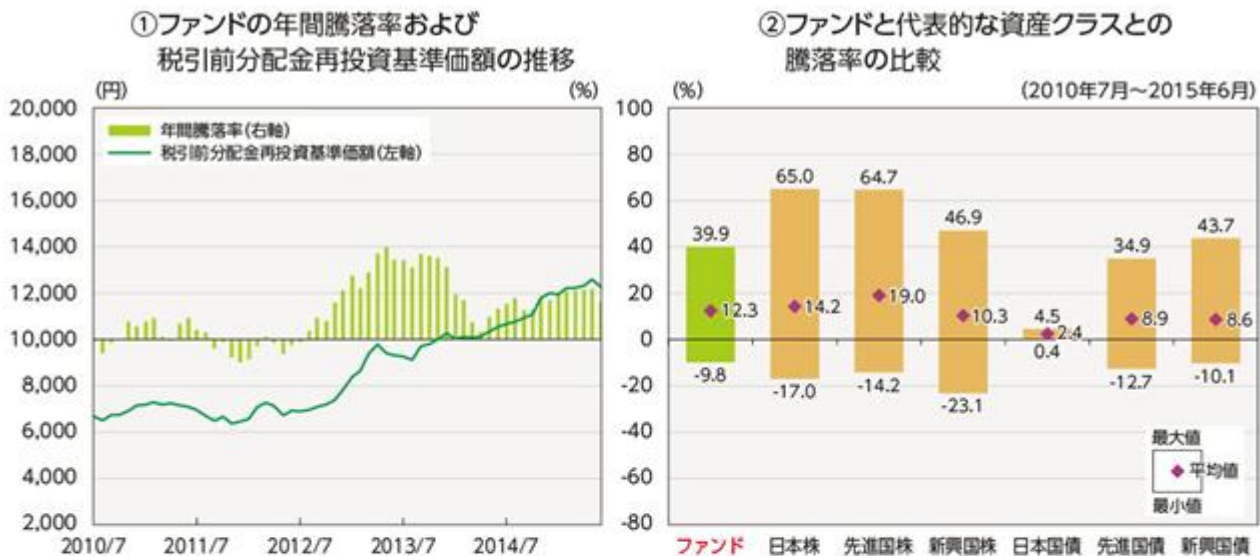
## (2) 投資リスク管理体制

(略)

## (参考情報)

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

## 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)



・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります\*。  
ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。

\*ニッセイセカンドライフ応援ファンド(毎月分配型)につきましては、「分配金受取コース」のみの取扱いとなり、実際には分配金は再投資されません。

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間におけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

## &lt;代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数&gt;

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (4)【その他の手数料等】

## &lt;訂正前&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)

## &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	0.01080%	（税抜0.010%）

( 略 )

## ( 5 ) 【課税上の取扱い】

## &lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

## 個人の課税の取扱い

( 略 )

確定申告を行い、上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した場合に限ります）から上場株式等の譲渡損失を控除することができます。

## &lt; 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について &gt;

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。  
NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問合せください。

( 略 )

## &lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

## 個人の課税の取扱い

( 略 )

確定申告を行い、上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した場合に限ります）から上場株式等の譲渡損失を控除することができます。

## &lt; 少額投資非課税制度について &gt;

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。  
少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」（平成28年4月1日より投資が可能となる「ジュニアNISA」が新たに創設される予定です）をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問合せください。

( 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27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	258,571,752	100.00
内 日本	258,571,752	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,664	0.00
純資産総額	258,562,088	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27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	77,042,283	100.00
内 日本	77,042,283	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,680	0.00
純資産総額	77,039,603	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27年6月30日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	70,220,993,960	96.74
内 日本	70,220,993,960	96.74
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,367,926,036	3.26
純資産総額	72,588,919,996	100.00

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

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	2,364,225,000	3.26
内 日本	2,364,225,000	3.26

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

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

## (参考情報)

## 「ニッセイ外国株 マザーファンド」

（平成27年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	642,833,314	93.28
内 アメリカ	370,321,432	53.74
内 イギリス	51,783,898	7.51
内 ドイツ	31,281,724	4.54
内 カナダ	26,653,921	3.87
内 フランス	23,900,244	3.47
内 スイス	20,779,027	3.02
内 オーストラリア	16,649,277	2.42
内 アイルランド	16,557,306	2.40
内 スペイン	12,781,222	1.85
内 オランダ	12,228,960	1.77
内 香港	10,763,882	1.56
内 ベルギー	10,485,058	1.52
内 シンガポール	8,468,957	1.23
内 バミューダ	7,998,017	1.16
内 スウェーデン	6,228,272	0.90
内 イタリア	5,074,788	0.74
内 ジャージー	3,820,525	0.55
内 オランダ領キュラソー	2,779,602	0.40
内 デンマーク	2,065,208	0.30
内 イスラエル	1,214,066	0.18
内 ケイマン諸島	997,928	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	46,287,466	6.72
純資産総額	689,120,780	100.00

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

## その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	37,662,558	5.47
内 アメリカ	37,662,558	5.47

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

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

## （参考情報）

## 「ニッセイ国内債券マザーファンド」

（平成27年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	23,011,451,824	95.24

	内 日本	23,011,451,824	95.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,149,510,505	4.76
純資産総額		24,160,962,329	100.00

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

#### その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引（買建）	881,820,000	3.65
内 日本	881,820,000	3.65

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

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

#### （参考情報）

「ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド」

（平成27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	22,280,878,675	97.77
内 アメリカ	6,649,483,250	29.18
内 フランス	5,624,217,274	24.68
内 イタリア	2,410,440,214	10.58
内 ドイツ	1,506,073,408	6.61
内 イギリス	1,488,518,825	6.53
内 スペイン	1,315,105,484	5.77
内 メキシコ	1,023,268,961	4.49
内 カナダ	480,814,774	2.11
内 アイルランド	360,732,520	1.58
内 ベルギー	318,853,958	1.40
内 オーストラリア	316,634,131	1.39
内 スウェーデン	163,845,883	0.72
内 デンマーク	136,354,506	0.60
内 南アフリカ	117,494,202	0.52
内 マレーシア	114,353,481	0.50
内 ノルウェー	95,126,571	0.42
内 シンガポール	82,717,659	0.36
内 ポーランド	75,336,634	0.33
内 スイス	1,506,940	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	508,010,849	2.23
純資産総額	22,788,889,524	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27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	423,906,671,000	96.37
内 日本	423,906,671,000	96.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,984,981,479	3.63
純資産総額	439,891,652,479	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27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	4,480,241,848	96.62
内 アメリカ	3,034,654,118	65.44
内 オーストラリア	386,154,881	8.33
内 イギリス	320,629,273	6.91
内 フランス	223,113,699	4.81
内 シンガポール	137,353,163	2.96
内 南アフリカ	86,248,773	1.86
内 香港	65,665,935	1.42
内 カナダ	61,464,196	1.33
内 メキシコ	58,246,459	1.26
内 トルコ	36,188,365	0.78
内 オランダ	25,681,020	0.55
内 ベルギー	11,603,875	0.25
内 アイルランド	9,324,777	0.20
内 イタリア	8,531,356	0.18
内 スペイン	5,793,576	0.12
内 ニュージーランド	3,531,945	0.08
内 マン島	3,243,302	0.07
内 ドイツ	2,813,135	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	156,956,110	3.38
純資産総額	4,637,197,958	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27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	ニッセイ国内債券マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	43,118,020	1.3538 58,373,179	1.3513 58,265,380	- -	22.53%
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	22,989,182	2.5282 58,121,252	2.5049 57,585,601	- -	22.27%
3	ニッセイJ-REIT マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	29,666,111	1.9467 57,751,022	1.9302 57,261,527	- -	22.15%
4	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	10,269,047	2.8331 29,093,239	2.7958 28,710,201	- -	11.10%
5	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	20,698,217	1.4110 29,205,187	1.3759 28,478,676	- -	11.01%
6	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	26,490,224	1.1064 29,308,787	1.0672 28,270,367	- -	10.93%

（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	100.00
	小計		100.00
合 計（対純資産総額比）			100.00

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

「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27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	ニッセイ国内債券マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	12,845,377	1.3500 17,341,487	1.3513 17,357,957	- -	22.53%
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	6,850,207	2.5148 17,227,170	2.5049 17,159,083	- -	22.27%
3	ニッセイJ-REIT マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	8,838,407	1.9753 17,458,906	1.9302 17,059,893	- -	22.14%
4	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	3,059,865	2.7886 8,532,837	2.7958 8,554,770	- -	11.10%
5	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	6,169,131	1.4027 8,653,828	1.3759 8,488,107	- -	11.02%
6	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	7,892,123	1.1229 8,862,119	1.0672 8,422,473	- -	10.93%

(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	100.00
	小計		100.00
合計(対純資産総額比)			100.00

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### (参考情報)

「ニッセイ日本株 マザーファンド」

#### 投資有価証券の主要銘柄

(平成27年6月30日現在)

銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は 額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
-----------	----------	---------------------	--------------------	--------------------	------------------	----------

1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	385,600	8,407.06 3,241,764,800	8,203.00 3,163,076,800	- -	4.36%
2	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	343,000	5,345.00 1,833,335,000	5,459.00 1,872,437,000	- -	2.58%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	2,116,400	898.70 1,902,008,680	879.80 1,862,008,720	- -	2.57%
4	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	5,956,300	246.10 1,465,845,430	265.00 1,578,419,500	- -	2.17%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	311,800	4,257.50 1,327,488,500	4,433.50 1,382,365,300	- -	1.90%
6	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	52,200	22,035.00 1,150,227,000	22,105.00 1,153,881,000	- -	1.59%
7	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	253,800	4,429.50 1,124,207,100	4,508.00 1,144,130,400	- -	1.58%
8	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	3,384,000	317.70 1,075,096,800	317.40 1,074,081,600	- -	1.48%
9	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	653,400	1,602.50 1,047,073,500	1,617.00 1,056,547,800	- -	1.46%
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	345,700	2,857.28 987,762,850	2,954.00 1,021,197,800	- -	1.41%
11	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	557,700	1,819.35 1,014,651,600	1,745.50 973,465,350	- -	1.34%
12	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	1,365,000	681.70 930,520,500	668.50 912,502,500	- -	1.26%
13	村田製作所 日本	株式 電気機器	42,100	19,620.00 826,002,000	21,360.00 899,256,000	- -	1.24%
14	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,111,000	846.74 940,732,300	806.80 896,354,800	- -	1.23%
15	中部電力 日本	株式 電気・ガス業	462,000	1,780.61 822,643,200	1,824.50 842,919,000	- -	1.16%
16	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	656,100	1,270.50 833,575,050	1,275.00 836,527,500	- -	1.15%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	73,700	11,445.00 843,496,500	11,010.00 811,437,000	- -	1.12%
18	宇部興産 日本	株式 化学	3,382,000	215.00 727,130,000	231.00 781,242,000	- -	1.08%
19	三菱電機 日本	株式 電気機器	488,000	1,654.50 807,396,000	1,582.00 772,016,000	- -	1.06%



20	日本郵船 日本	株式 海運業	2,230,000	375.36 837,058,000	341.00 760,430,000	- -	1.05%
21	大阪瓦斯 日本	株式 電気・ガス業	1,570,000	502.00 788,140,000	483.30 758,781,000	- -	1.05%
22	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	316,000	2,202.00 695,832,000	2,344.00 740,704,000	- -	1.02%
23	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	181,600	4,183.50 759,723,600	3,961.50 719,408,400	- -	0.99%
24	ユニーグループ・ホールディングス 日本	株式 小売業	913,300	700.00 639,310,000	783.00 715,113,900	- -	0.99%
25	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	1,341,600	529.40 710,243,040	528.20 708,633,120	- -	0.98%
26	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	97,200	7,286.21 708,219,800	7,209.00 700,714,800	- -	0.97%
27	東北電力 日本	株式 電気・ガス業	413,100	1,737.00 717,554,700	1,658.00 684,919,800	- -	0.94%
28	オリックス 日本	株式 その他金融業	373,200	1,932.50 721,209,000	1,821.00 679,597,200	- -	0.94%
29	第一生命保険 日本	株式 保険業	268,900	2,162.00 581,361,800	2,406.50 647,107,850	- -	0.89%
30	日本製紙 日本	株式 パルプ・紙	301,500	2,020.00 609,030,000	2,146.00 647,019,000	- -	0.89%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	銀行業	11.31
		電気機器	10.50
		輸送用機器	10.18
		化学	7.22
		情報・通信業	5.94
		建設業	4.62
		卸売業	3.83
		陸運業	3.59
		保険業	3.49
		電気・ガス業	3.49
		機械	3.02
		非鉄金属	2.82
		医薬品	2.59
		小売業	2.48

	その他金融業	2.41
	鉄鋼	2.33
	食料品	2.03
	ガラス・土石製品	1.61
	その他製品	1.59
	海運業	1.37
	空運業	1.30
	ゴム製品	1.27
	サービス業	1.07
	パルプ・紙	1.02
	石油・石炭製品	0.98
	不動産業	0.85
	証券、商品先物取引業	0.71
	繊維製品	0.68
	倉庫・運輸関連業	0.67
	鉱業	0.62
	精密機器	0.61
	水産・農林業	0.48
	金属製品	0.09
	小計	96.74
合計（対純資産総額比）		96.74

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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 2709月	買建	145	2,381,971,300	2,364,225,000	3.26%

（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27年6月30日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は 額面金額	簿価単価 (円) 簿価金額 (円)	評価単価 (円) 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	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	977	15,927.07 15,560,748	15,248.69 14,897,978	- -	2.16%
2	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	1,888	6,906.17 13,038,867	6,864.54 12,960,264	- -	1.88%
3	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小 売り	1,103	10,514.66 11,597,674	10,320.08 11,383,054	- -	1.65%
4	DARDEN RESTAURANTS INC アメリカ	株式 消費者サービス	1,219	7,975.16 9,721,730	8,718.43 10,627,778	- -	1.54%
5	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV ベルギー	株式 食品・飲料・タバコ	700	15,259.97 10,681,983	14,978.65 10,485,058	- -	1.52%
6	MOLSON COORS BREWING CO -B アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	1,101	9,268.23 10,204,332	8,643.74 9,516,763	- -	1.38%
7	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	1,747	5,826.17 10,178,320	5,433.10 9,491,637	- -	1.38%
8	DISCOVER FINANCIAL SERVICES アメリカ	株式 各種金融	1,315	7,361.69 9,680,627	7,020.05 9,231,376	- -	1.34%
9	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	134	65,799.73 8,817,164	63,860.11 8,557,256	- -	1.24%
10	KERRY GROUP PLC-A アイルランド	株式 食品・飲料・タバコ	917	9,235.57 8,469,025	9,180.68 8,418,689	- -	1.22%
11	PRUDENTIAL PLC イギリス	株式 保険	2,830	3,216.49 9,102,685	2,974.63 8,418,211	- -	1.22%
12	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN バミューダ	株式 消費者サービス	1,179	6,936.12 8,177,693	6,783.72 7,998,017	- -	1.16%
13	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	576	13,538.07 7,797,929	13,842.97 7,973,552	- -	1.16%
14	AMERIPRISE FINANCIAL INC アメリカ	株式 各種金融	513	15,792.37 8,101,489	15,158.08 7,776,097	- -	1.13%
15	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP アメリカ	株式 銀行	661	11,701.32 7,734,573	11,713.56 7,742,667	- -	1.12%
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	742	10,651.92 7,903,728	10,141.30 7,524,851	- -	1.09%

17	HAIN CELESTIAL GROUP INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	888	7,603.77 6,752,156	8,020.47 7,122,181	- -	1.03%
18	ROSS STORES INC アメリカ	株式 小売	1,144	6,304.95 7,212,863	5,944.33 6,800,319	- -	0.99%
19	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバコ	1,089	6,296.16 6,856,520	6,018.64 6,554,305	- -	0.95%
20	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 エネルギー	1,821	3,854.39 7,018,862	3,547.97 6,460,862	- -	0.94%
21	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	768	8,428.51 6,473,100	8,169.86 6,274,455	- -	0.91%
22	TORONTO-DOMINION BANK カナダ	株式 銀行	1,174	5,531.03 6,493,434	5,224.35 6,133,396	- -	0.89%
23	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	813	7,962.92 6,473,856	7,490.87 6,090,083	- -	0.88%
24	ALLIANZ SE ドイツ	株式 保険	308	20,837.13 6,417,838	19,230.44 5,922,978	- -	0.86%
25	JOHNSON & JOHNSON 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	491	12,729.90 6,250,381	11,960.91 5,872,809	- -	0.85%
26	SEMPRA ENERGY アメリカ	株式 公益事業	474	13,202.55 6,258,012	12,156.83 5,762,340	- -	0.84%
27	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	1,763	3,349.00 5,904,300	3,262.06 5,751,025	- -	0.83%
28	EBAY INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	789	7,255.16 5,724,323	7,269.85 5,735,916	- -	0.83%
29	MAGNA INTERNATIONAL INC カナダ	株式 自動車・自動車部品	841	6,724.21 5,655,065	6,797.18 5,716,434	- -	0.83%
30	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	973	6,067.39 5,903,577	5,726.98 5,572,357	- -	0.81%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	銀行	10.86
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.98

	食品・飲料・タバコ	7.86
	ソフトウェア・サービス	7.75
	エネルギー	6.88
	資本財	6.17
	各種金融	4.26
	小売	4.12
	公益事業	3.71
	電気通信サービス	3.33
	保険	3.21
	素材	3.05
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.01
	消費者サービス	2.91
	メディア	2.62
	ヘルスケア機器・サービス	2.37
	食品・生活必需品小売り	2.32
	半導体・半導体製造装置	2.15
	自動車・自動車部品	1.97
	耐久消費財・アパレル	1.61
	運輸	1.59
	家庭用品・パーソナル用品	0.71
	商業・専門サービス	0.57
	不動産	0.28
	小計	93.28
合計（対純資産総額比）		93.28

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

株式（外国）の業種はGICS分類（産業グループ）によるものです。なお、GICS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 5 0 9	買建	3	38,597,464	37,662,558	5.47%

（注1）投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

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

（参考情報）

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

## 投資有価証券の主要銘柄

（平成27年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	第325回 利付国 債（10年） 日本	国債証券	2,591,900,000	103.96 2,694,611,876	104.01 2,695,835,190	0.800000 2022/9/20	11.16%
2	第123回 利付国 債（5年） 日本	国債証券	2,137,700,000	100.01 2,138,044,741	100.02 2,138,191,671	0.100000 2020/3/20	8.85%
3	第352回 利付国 債（2年） 日本	国債証券	1,412,200,000	100.22 1,415,426,442	100.19 1,414,967,912	0.100000 2017/5/15	5.86%
4	第350回 利付国 債（2年） 日本	国債証券	1,051,100,000	100.17 1,052,952,068	100.17 1,052,970,958	0.100000 2017/3/15	4.36%
5	第113回 利付国 債（5年） 日本	国債証券	906,900,000	100.90 915,076,103	100.84 914,563,305	0.300000 2018/6/20	3.79%
6	第318回 利付国 債（10年） 日本	国債証券	734,200,000	105.49 774,550,106	105.20 772,415,110	1.000000 2021/9/20	3.20%
7	第17回 物価連動 国債（10年） 日本	国債証券	662,300,000	109.82 727,355,632	110.06 728,945,922	0.100000 2023/9/10	3.02%
8	第330回 利付国 債（2年） 日本	国債証券	720,000,000	100.00 720,000,000	100.00 720,000,000	0.200000 2015/7/15	2.98%
9	第351回 利付国 債（2年） 日本	国債証券	708,300,000	100.18 709,574,940	100.18 709,624,521	0.100000 2017/4/15	2.94%
10	第331回 利付国 債（2年） 日本	国債証券	601,000,000	100.00 601,032,226	100.00 601,032,226	0.100000 2015/8/15	2.49%
11	第26回 利付国債 （30年） 日本	国債証券	454,600,000	123.44 561,171,878	121.08 550,466,048	2.400000 2037/3/20	2.28%
12	第99回 利付国債 （20年） 日本	国債証券	377,100,000	118.68 447,549,445	117.67 443,744,883	2.100000 2027/12/20	1.84%
13	第114回 利付国 債（20年） 日本	国債証券	375,600,000	119.38 448,419,285	118.00 443,226,780	2.100000 2029/12/20	1.83%

14	第128回 利付国債(20年) 日本	国債証券	353,400,000	116.28 410,945,294	114.92 406,137,882	1.900000 2031/6/20	1.68%
15	第109回 利付国債(20年) 日本	国債証券	334,800,000	118.18 395,687,667	115.44 386,523,252	1.900000 2029/3/20	1.60%
16	第113回 利付国債(20年) 日本	国債証券	325,700,000	119.10 387,930,048	118.02 384,417,196	2.100000 2029/9/20	1.59%
17	第29回 利付国債(30年) 日本	国債証券	298,600,000	123.68 369,328,556	121.46 362,679,560	2.400000 2038/9/20	1.50%
18	第47回 利付国債(30年) 日本	国債証券	340,300,000	102.87 350,093,890	103.67 352,802,622	1.600000 2045/6/20	1.46%
19	第138回 利付国債(20年) 日本	国債証券	316,300,000	107.71 340,689,597	108.27 342,467,499	1.500000 2032/6/20	1.42%
20	第120回 利付国債(5年) 日本	国債証券	306,400,000	100.57 308,146,480	100.54 308,072,944	0.200000 2019/9/20	1.28%
21	第88回 利付国債(20年) 日本	国債証券	253,400,000	120.99 306,601,330	119.02 301,604,282	2.300000 2026/6/20	1.25%
22	第150回 利付国債(20年) 日本	国債証券	287,400,000	103.88 298,551,120	104.34 299,887,530	1.400000 2034/9/20	1.24%
23	第118回 利付国債(5年) 日本	国債証券	297,900,000	100.74 300,130,050	100.57 299,606,967	0.200000 2019/6/20	1.24%
24	第132回 利付国債(20年) 日本	国債証券	267,300,000	112.24 300,039,048	111.71 298,611,522	1.700000 2031/12/20	1.24%
25	第107回 利付国債(5年) 日本	国債証券	256,300,000	100.51 257,607,130	100.48 257,532,803	0.200000 2017/12/20	1.07%
26	第116回 利付国債(20年) 日本	国債証券	209,300,000	121.23 253,736,483	119.37 249,849,782	2.200000 2030/3/20	1.03%
27	第79回 利付国債(20年) 日本	国債証券	208,200,000	116.92 243,427,440	115.17 239,783,940	2.000000 2025/6/20	0.99%
28	第92回 利付国債(20年) 日本	国債証券	202,100,000	119.10 240,707,163	117.22 236,915,767	2.100000 2026/12/20	0.98%

29	第140回 利付国 債(20年) 日本	国債証券	209,000,000	111.09 232,194,820	111.26 232,539,670	1.700000 2032/9/20	0.96%
30	第143回 利付国 債(20年) 日本	国債証券	206,500,000	108.50 224,071,085	109.19 225,483,545	1.600000 2033/3/20	0.93%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	国内	国債証券	95.24
	小計		95.24
合計(対純資産総額比)			95.24

(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

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2709月限	買建	6	878,356,200	881,820,000	3.65%

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

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

#### (参考情報)

「ニッセイ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27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	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	3,168,640,700	107.45 3,404,918,456	107.14 3,395,198,510	3.750000 2017/4/25	14.90%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,709,402,000	109.20 1,866,695,107	108.77 1,859,367,837	3.500000 2020/5/15	8.16%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,440,012,000	97.23 1,400,217,704	98.09 1,412,550,971	1.750000 2022/5/15	6.20%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,166,948,500	100.38 1,171,413,581	100.29 1,170,402,667	1.250000 2015/9/30	5.14%



5	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	1,041,575,700	107.23 1,116,928,281	105.70 1,101,049,672	4.000000 2017/2/1	4.83%
6	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	934,536,300	108.95 1,018,190,623	109.26 1,021,121,088	1.750000 2022/7/4	4.48%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	917,150,500	116.78 1,071,075,842	110.00 1,008,865,550	3.625000 2043/8/15	4.43%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	809,394,500	106.33 860,675,574	103.87 840,758,536	2.750000 2024/2/15	3.69%
9	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	679,288,500	114.35 776,829,676	113.50 771,046,790	4.300000 2019/10/31	3.38%
10	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	520,101,700	126.16 656,195,010	123.59 642,804,093	5.500000 2022/11/1	2.82%
11	TSY 4 1/4% 2040 イギリス	国債証券	499,144,800	131.39 655,829,455	127.98 638,840,455	4.250000 2040/12/7	2.80%
12	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	591,461,300	101.15 598,265,588	101.01 597,482,376	3.000000 2015/10/25	2.62%
13	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	493,272,000	108.06 533,060,465	107.94 532,467,393	7.750000 2017/12/14	2.34%
14	UK TSY 2 1/4% 2023 イギリス	国債証券	487,581,600	103.72 505,730,215	101.29 493,910,409	2.250000 2023/9/7	2.17%
15	FRENCH OAT フランス	国債証券	326,607,400	160.35 523,743,564	148.19 484,002,772	5.500000 2029/4/25	2.12%
16	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	377,382,500	141.23 533,001,964	126.86 478,770,082	5.000000 2034/8/1	2.10%
17	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	402,083,900	112.42 452,034,165	110.16 442,971,811	2.250000 2024/5/25	1.94%
18	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	260,737,000	178.85 466,351,988	166.64 434,505,173	4.750000 2040/7/4	1.91%
19	TSY 4 1/4% 2032 イギリス	国債証券	287,152,800	128.75 369,712,756	123.89 355,767,961	4.250000 2032/6/7	1.56%
20	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	327,600,000	102.76 336,673,070	102.22 334,872,720	8.000000 2015/12/17	1.47%
21	TREASURY 4 1/2% 2020 アイルランド	国債証券	253,875,500	120.77 306,613,057	118.29 300,334,716	4.500000 2020/4/18	1.32%
22	CANADIAN GOVERNMENT カナダ	国債証券	258,358,200	113.07 292,139,955	111.69 288,565,440	3.750000 2019/6/1	1.27%

23	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	244,269,400	119.81 292,664,053	116.56 284,739,954	3.250000 2021/10/25	1.25%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	252,247,000	107.81 271,960,356	106.99 269,884,110	3.125000 2021/5/15	1.18%
25	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	236,035,600	112.51 265,586,639	112.38 265,268,609	3.800000 2024/4/30	1.16%
26	AUSTRALIAN GOVERNMENT オーストラリア	国債証券	193,495,800	123.21 238,413,229	119.40 231,041,725	5.500000 2023/4/21	1.01%
27	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	148,208,400	168.33 249,488,092	147.79 219,040,158	4.500000 2041/4/25	0.96%
28	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	174,282,100	115.30 200,957,718	115.20 200,781,693	3.500000 2020/4/25	0.88%
29	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	131,740,800	167.83 221,105,854	151.12 199,097,236	5.000000 2035/3/28	0.87%
30	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	124,879,300	145.42 181,611,417	127.26 158,933,885	4.900000 2040/7/30	0.70%

（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	97.77
	小計		97.77
合 計（対純資産総額比）			97.77

（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」- R E I T マザーファンド」

#### 投資有価証券の主要銘柄

（平成27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	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	102,063	254,300.00 25,954,620,900	244,900.00 24,995,228,700	- -	5.68%
2	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	41,370	570,657.34 23,608,094,565	536,000.00 22,174,320,000	- -	5.04%
3	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	39,468	551,843.48 21,780,158,857	556,000.00 21,944,208,000	- -	4.99%
4	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	59,324	292,300.00 17,340,405,200	299,900.00 17,791,267,600	- -	4.04%
5	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	98,358	174,200.00 17,133,963,600	176,400.00 17,350,351,200	- -	3.94%
6	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	94,191	189,700.00 17,868,032,700	173,100.00 16,304,462,100	- -	3.71%
7	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	28,149	573,803.25 16,151,987,809	553,000.00 15,566,397,000	- -	3.54%
8	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	27,657	585,000.00 16,179,345,000	548,000.00 15,156,036,000	- -	3.45%
9	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	176,598	83,064.62 14,669,046,936	81,500.00 14,392,737,000	- -	3.27%
10	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	13,339	1,072,000.00 14,299,408,000	1,037,000.00 13,832,543,000	- -	3.14%
11	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	22,936	615,380.22 14,114,360,929	586,000.00 13,440,496,000	- -	3.06%
12	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	58,536	249,700.00 14,616,439,200	225,400.00 13,194,014,400	- -	3.00%
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	34,182	420,368.46 14,369,035,000	380,500.00 13,006,251,000	- -	2.96%
14	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	52,963	233,000.00 12,340,379,000	237,700.00 12,589,305,100	- -	2.86%
15	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	20,339	630,000.00 12,813,570,000	614,000.00 12,488,146,000	- -	2.84%
16	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	77,726	150,100.00 11,666,672,600	155,600.00 12,094,165,600	- -	2.75%
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	47,998	259,300.00 12,445,881,400	246,200.00 11,817,107,600	- -	2.69%

18	野村不動産オフィスファンド 投資法人 日本	投資証券	21,197	549,000.00 11,637,153,000	555,000.00 11,764,335,000	- -	2.67%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	74,139	165,000.00 12,232,935,000	158,400.00 11,743,617,600	- -	2.67%
20	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	55,078	189,300.00 10,426,265,400	174,400.00 9,605,603,200	- -	2.18%
21	G L P 投資法人 日本	投資証券	79,650	122,000.00 9,717,300,000	116,900.00 9,311,085,000	- -	2.12%
22	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	129,878	62,300.00 8,091,399,400	65,300.00 8,481,033,400	- -	1.93%
23	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	15,646	531,000.00 8,308,026,000	516,000.00 8,073,336,000	- -	1.84%
24	大和ハウス・レジデンシャル 投資法人 日本	投資証券	28,271	275,000.00 7,774,525,000	277,700.00 7,850,856,700	- -	1.78%
25	日本アコモデーションファン ド投資法人 日本	投資証券	16,461	468,000.00 7,703,748,000	473,000.00 7,786,053,000	- -	1.77%
26	グローバル・ワン不動産投資 法人 日本	投資証券	15,811	412,000.00 6,514,132,000	465,500.00 7,360,020,500	- -	1.67%
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	42,894	164,300.00 7,047,484,200	163,500.00 7,013,169,000	- -	1.59%
28	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	72,646	79,997.98 5,811,533,887	86,000.00 6,247,556,000	- -	1.42%
29	プレミア投資法人 日本	投資証券	8,779	648,000.00 5,688,792,000	674,000.00 5,917,046,000	- -	1.35%
30	ケネディクス・レジデンシャル 投資法人 日本	投資証券	16,145	347,000.00 5,602,315,000	362,500.00 5,852,562,500	- -	1.33%

(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	96.37
	小計		96.37
合計(対純資産総額比)			96.37

(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27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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	11,625	22,534.47 261,963,254	20,938.94 243,415,293	- -	5.25%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	3,834	34,019.31 130,430,061	31,562.89 121,012,158	- -	2.61%
3	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	13,400	9,137.21 122,438,734	8,586.19 115,054,999	- -	2.48%
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	5,100	24,141.01 123,119,189	22,405.90 114,270,095	- -	2.46%
5	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	13,000	8,763.74 113,928,704	8,052.31 104,680,056	- -	2.26%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	4,800	20,525.06 98,520,331	19,479.34 93,500,860	- -	2.02%
7	VENTAS INC アメリカ	投資証券	11,917	8,474.76 100,993,768	7,638.43 91,027,182	- -	1.96%
8	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	19,728	4,965.34 97,956,375	4,550.24 89,767,174	- -	1.94%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	5,700	16,333.60 93,101,551	14,795.63 84,335,110	- -	1.82%
10	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	6,582	12,498.47 82,264,939	11,619.28 76,478,104	- -	1.65%
11	GENERAL GROWTH PROPERTIES アメリカ	投資証券	24,281	3,503.29 85,063,493	3,148.18 76,441,189	- -	1.65%
12	HCP INC アメリカ	投資証券	16,700	4,877.18 81,448,964	4,498.81 75,130,177	- -	1.62%
13	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券	209,745	364.44 76,441,229	353.17 74,077,067	- -	1.60%
14	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	30,465	2,523.69 76,884,352	2,395.12 72,967,391	- -	1.57%
15	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	30,099	2,626.77 79,063,258	2,347.32 70,652,273	- -	1.52%

16	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資証券	76,066	853.82 64,946,953	850.06 64,661,158	- -	1.39%
17	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	40,775	1,707.49 69,623,279	1,547.54 63,101,008	- -	1.36%
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	2,400	27,434.92 65,843,814	25,774.50 61,858,801	- -	1.33%
19	LINK REIT 香港	投資証券	82,000	742.91 60,919,399	718.44 58,912,490	- -	1.27%
20	SL GREEN REALTY CORP アメリカ	投資証券	3,700	14,739.30 54,535,434	13,473.17 49,850,741	- -	1.08%
21	MACERICH CO/THE アメリカ	投資証券	5,419	10,171.92 55,121,642	9,183.74 49,766,741	- -	1.07%
22	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	8,534	5,793.10 49,438,396	5,433.10 46,366,130	- -	1.00%
23	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	16,200	2,998.80 48,580,568	2,775.94 44,970,252	- -	0.97%
24	KLEPIERRE フランス	投資証券	8,281	5,957.15 49,331,194	5,426.76 44,939,001	- -	0.97%
25	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	5,200	8,069.45 41,961,166	8,068.23 41,954,798	- -	0.90%
26	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	2,500	16,715.64 41,789,123	15,654.00 39,135,020	- -	0.84%
27	FEDERATION CENTRES オーストラリア	投資証券	142,699	285.30 40,713,082	271.45 38,736,742	- -	0.84%
28	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	31,591	1,355.78 42,830,609	1,194.86 37,746,948	- -	0.81%
29	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	63,047	583.30 36,775,649	589.88 37,190,189	- -	0.80%
30	STOCKLAND オーストラリア	投資証券	94,656	402.02 38,053,642	382.29 36,186,524	- -	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	外国	投資証券	96.62
	小計		96.62
合 計（対純資産総額比）			96.62

（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

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27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	0.5477
第11特定期間末 (平成24年5月21日)	311,210,799	311,751,345	0.5757	0.5767
第12特定期間末 (平成24年11月20日)	301,947,350	302,437,003	0.6167	0.6177
第13特定期間末 (平成25年5月20日)	391,222,868	391,684,902	0.8467	0.8477

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
第16特定期間末 (平成26年11月20日)	312,670,042	312,996,752	0.9570	0.9580
第17特定期間末 (平成27年5月20日)	269,296,601	269,561,142	1.0180	1.0190
平成26年6月末日	334,837,345	-	0.8730	-
7月末日	331,987,834	-	0.8828	-
8月末日	328,265,806	-	0.8883	-
9月末日	327,275,654	-	0.9018	-
10月末日	328,057,602	-	0.9134	-
11月末日	307,814,429	-	0.9698	-
12月末日	293,030,693	-	0.9863	-
平成27年1月末日	282,959,389	-	0.9812	-
2月末日	286,446,886	-	1.0026	-
3月末日	279,903,824	-	1.0019	-
4月末日	266,461,964	-	1.0087	-
5月末日	269,454,234	-	1.0296	-
6月末日	258,562,088	-	1.0021	-

## 【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



第16特定期間	0.0060
第17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
第16特定期間	14.8
第17特定期間	7.0

(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（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27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
第16計算期間末 (平成26年11月20日)	99,755,852	99,755,852	1.1586	1.1586
第17計算期間末 (平成27年5月20日)	79,285,838	79,285,838	1.2398	1.2398
平成26年6月末日	151,055,869	-	1.0511	-
7月末日	145,948,439	-	1.0641	-
8月末日	143,581,977	-	1.0719	-
9月末日	114,454,475	-	1.0894	-
10月末日	116,441,616	-	1.1047	-
11月末日	100,110,191	-	1.1741	-
12月末日	90,351,356	-	1.1953	-
平成27年1月末日	81,072,794	-	1.1903	-
2月末日	81,620,113	-	1.2175	-
3月末日	79,897,269	-	1.2179	-

4月末日	81,010,194	-	1.2274	-
5月末日	79,521,587	-	1.2540	-
6月末日	77,039,603	-	1.2217	-

## 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
第16計算期間	0.0000
第17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
第16計算期間	14.9
第17計算期間	7.0

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

##### 「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
第16特定期間	2,103,345	62,046,052	326,710,452
第17特定期間	5,039,883	67,208,341	264,541,994

(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
第16計算期間	20,024,403	82,910,131	86,100,113
第17計算期間	6,134,974	28,284,536	63,950,551

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2015年6月末現在

## ● 基準価額・純資産の推移

【毎月分配型】



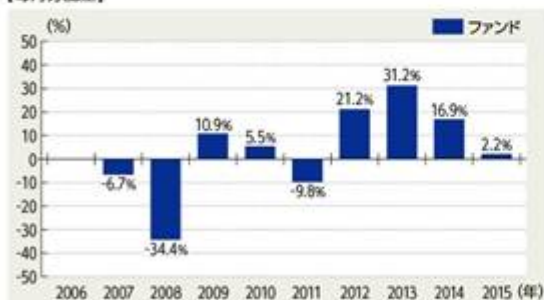
【成長重視型】



- ・ 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として計算しております。

## ● 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として計算しております。
- ・ 2007年はファンド設定時から年末まで、2015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	10,021円	12,217円
純資産総額	258百万円	77百万円

## ● 分配の推移

【毎月分配型】 1万口当たり（税引前）

第96期	2015年2月	10円
第97期	2015年3月	10円
第98期	2015年4月	10円
第99期	2015年5月	10円
第100期	2015年6月	10円
直近1年間累計		120円
設定来累計		1,440円

【成長重視型】 1万口当たり（税引前）

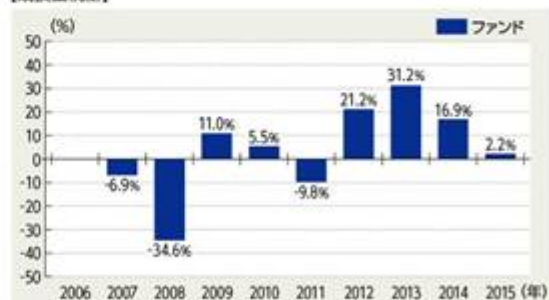
第13期	2013年5月	0円
第14期	2013年11月	0円
第15期	2014年5月	0円
第16期	2014年11月	0円
第17期	2015年5月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

## ● 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	22.3%	22.3%
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	22.5%	22.5%
ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド	11.1%	11.1%
ニッセイJ-REITマザーファンド	22.1%	22.1%
ニッセイグローバルリートマザーファンド	10.9%	10.9%

- ・ 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。

2015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	4.5%
2	三井住友フィナンシャルグループ	2.7%
3	三菱UFJフィナンシャルグループ	2.7%
4	みずほフィナンシャルグループ	2.2%
5	日本電信電話	2.0%
6	東海旅客鉄道	1.6%
7	富士重工業	1.6%
8	新日鐵住金	1.5%
9	伊藤忠商事	1.5%
10	KDDI	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	2.3%
2	ウェルズ・ファーゴ・アンド・カンパニー	アメリカ	金融	2.0%
3	ウォルグリーン・ブーツ・アライアンス	アメリカ	生活必需品	1.8%
4	ダーデン・レストランツ	アメリカ	一般消費サービス	1.7%
5	アンハイザー・ブッシュ・インベブ	ベルギー	生活必需品	1.6%
6	モルソン・クアーズ	アメリカ	生活必需品	1.5%
7	マイクロソフト	アメリカ	情報技術	1.5%
8	ディスカバー・フィナンシャル・サービス	アメリカ	金融	1.4%
9	グーグル(C)	アメリカ	情報技術	1.3%
10	ケリー・グループ	アイルランド	生活必需品	1.3%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。  
 ・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。  
 ・比率は対組入株式等評価額比です。

## 3. ニッセイ国内債券マザーファンド

	銘柄	比率
1	第325回 利付国債(10年)	11.3%
2	第123回 利付国債(5年)	8.9%
3	第352回 利付国債(2年)	5.9%
4	第350回 利付国債(2年)	4.4%
5	第113回 利付国債(5年)	3.8%
6	第318回 利付国債(10年)	3.2%
7	第17回 物価連動国債(10年)	3.1%
8	第330回 利付国債(2年)	3.0%
9	第351回 利付国債(2年)	3.0%
10	第331回 利付国債(2年)	2.5%

・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	フランス国債	15.2%
2	アメリカ国債	8.3%
3	アメリカ国債	6.3%
4	アメリカ国債	5.3%
5	イタリア国債	4.9%
6	ドイツ国債	4.6%
7	アメリカ国債	4.5%
8	アメリカ国債	3.8%
9	スペイン国債	3.5%
10	イタリア国債	2.9%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 5. ニッセイ-REITマザーファンド

	銘柄	比率
1	日本リートファンド投資法人	5.9%
2	日本ビルファンド投資法人	5.2%
3	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.2%
4	アドバンス・レジデンス投資法人	4.2%
5	オリックス不動産投資法人	4.1%
6	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.8%
7	産業ファンド投資法人	3.7%
8	フロンティア不動産投資法人	3.6%
9	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3.4%
10	アクティビア・プロパティーズ投資法人	3.3%

・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	5.4%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.7%
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.6%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.6%
5	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	2.3%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.1%
7	VENTAS INC	アメリカ	2.0%
8	PROLOGIS INC	アメリカ	2.0%
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	1.9%
10	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	1.7%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。  
 ・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

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

■ 最新の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】

### 3【資産管理等の概要】

#### (5)【その他】

##### <訂正前>

(略)

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

委託会社とその他関係する法人との間で締結された「投資助言契約」は契約期間満了の1ヵ月前までに委託会社、その他関係する法人いずれかにより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。

##### <訂正後>

(略)

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

委託会社とその他関係する法人との間で締結された「投資助言契約」、「情報提供契約」は契約期間満了の1ヵ月前までに委託会社、その他関係する法人いずれかにより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。



### 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26年11月21日から平成27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17期計算期間（平成26年11月21日から平成27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16特定期間 (平成26年11月20日現在)	第17特定期間 (平成27年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	345,129	253,516
親投資信託受益証券	312,671,403	269,306,882
未収入金	1,140,000	305,241
流動資産合計	314,156,532	269,865,639
資産合計	314,156,532	269,865,639
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	326,710	264,541
未払解約金	778,716	-
未払受託者報酬	14,762	11,792
未払委託者報酬	354,499	283,275
その他未払費用	11,803	9,430
流動負債合計	1,486,490	569,038
負債合計	1,486,490	569,038
純資産の部		
元本等		
元本	326,710,452	264,541,994
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	14,040,410	4,754,607
純資産合計	312,670,042	269,296,601
負債純資産合計	314,156,532	269,865,639

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16特定期間 （自平成26年5月21日 至平成26年11月20日）	第17特定期間 （自平成26年11月21日 至平成27年5月20日）
営業収益		
有価証券売買等損益	47,550,417	21,641,117
営業収益合計	47,550,417	21,641,117
営業費用		
受託者報酬	89,253	75,990
委託者報酬	2,143,097	1,825,166
その他費用	71,348	60,760
営業費用合計	2,303,698	1,961,916
営業利益又は営業損失（ ）	45,246,719	19,679,201
経常利益又は経常損失（ ）	45,246,719	19,679,201
当期純利益又は当期純損失（ ）	45,246,719	19,679,201
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（ ）	2,241,807	634,463
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	62,313,897	14,040,410
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,731,072	1,446,840
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減 少額	7,731,072	1,446,840
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	268,650	6,003
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	268,650	6,003
分配金	2,193,847	1,690,558
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,040,410	4,754,607

## (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16特定期間 (平成26年11月20日現在)	第17特定期間 (平成27年5月20日現在)
1. 受益権総口数	326,710,452口	264,541,994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14,040,410円であります。	
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9570円 (9,570円)	1.0180円 (10,180円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第16特定期間 (自平成26年5月21日 至平成26年11月20日)	第17特定期間 (自平成26年11月21日 至平成27年5月20日)
1. 分配金の計算過程	<p>(自平成26年5月21日 至平成26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(530,686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(4,164,484円)及び分配準備積立金(5,173,909円)より分配対象収益は9,869,079円(1口当たり0.025602円)であり、うち385,479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6月21日 至平成26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(361,901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(4,088,508円)及び分配準備積立金(5,216,082円)より分配対象収益は9,666,491円(1口当たり0.025559円)であり、うち378,199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11月21日 至平成26年12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(408,675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(3,224,747円)及び分配準備積立金(4,566,918円)より分配対象収益は8,200,340円(1口当たり0.027604円)であり、うち297,065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12月23日 至平成27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(513,157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(3,173,081円)及び分配準備積立金(4,599,770円)より分配対象収益は8,286,008円(1口当たり0.028361円)であり、うち292,159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7月23日 至平成26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（444,141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（4,044,342円）及び分配準備積立金（5,123,263円）より分配対象収益は9,611,746円（1口当たり0.025750円）であり、うち373,268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8月21日 至平成26年9月22日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（625,457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（3,991,277円）及び分配準備積立金（5,121,663円）より分配対象収益は9,738,397円（1口当たり0.026449円）であり、うち368,190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27年1月21日 至平成27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（334,787円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,194,079円）、収益調整金（3,119,446円）及び分配準備積立金（4,734,213円）より分配対象収益は9,382,525円（1口当たり0.032688円）であり、うち287,033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9月23日 至平成26年10月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（595,594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（3,925,372円）及び分配準備積立金（5,287,404円）より分配対象収益は9,808,370円（1口当たり0.027095円）であり、うち362,001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10月21日 至平成26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（370,300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（3,542,900円）及び分配準備積立金（4,982,548円）より分配対象収益は8,895,748円（1口当たり0.027228円）であり、うち326,710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27年2月21日 至平成27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（462,017円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（3,095,368円）、収益調整金（3,151,989円）及び分配準備積立金（5,826,415円）より分配対象収益は12,535,789円（1口当たり0.044255円）であり、うち283,261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10月21日 至平成26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（370,300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（3,542,900円）及び分配準備積立金（4,982,548円）より分配対象収益は8,895,748円（1口当たり0.027228円）であり、うち326,710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11月21日 至平成26年12月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（370,300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（3,542,900円）及び分配準備積立金（4,982,548円）より分配対象収益は8,895,748円（1口当たり0.027228円）であり、うち326,710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27年3月21日 至平成27年4月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（665,357円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（116,207円）、収益調整金（2,967,132円）及び分配準備積立金（8,560,404円）より分配対象収益は12,309,100円（1口当たり0.046188円）であり、うち266,499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10月21日 至平成26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（370,300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（3,542,900円）及び分配準備積立金（4,982,548円）より分配対象収益は8,895,748円（1口当たり0.027228円）であり、うち326,710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11月21日 至平成26年12月20日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（370,300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（3,542,900円）及び分配準備積立金（4,982,548円）より分配対象収益は8,895,748円（1口当たり0.027228円）であり、うち326,710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27年4月21日 至平成27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（427,083円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（3,117,548円）、収益調整金（2,984,190円）及び分配準備積立金（8,971,024円）より分配対象収益は15,499,845円（1口当たり0.058591円）であり、うち264,541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16特定期間 （自平成26年5月21日 至平成26年11月20日）	第17特定期間 （自平成26年11月21日 至平成27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16特定期間 (平成26年11月20日現在)	第17特定期間 (平成27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16特定期間 (平成26年11月20日現在)	第17特定期間 (平成27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	27,638,802	3,788,174
合計	27,638,802	3,788,174

(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16特定期間 (平成26年11月20日現在)	第17特定期間 (平成27年5月20日現在)
期首元本額	386,653,159円	326,710,452円
期中追加設定元本額	2,103,345円	5,039,883円
期中一部解約元本額	62,046,052円	67,208,341円

## ( 4 ) 【附属明細表】（平成27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	24,152,931	60,708,392	
	ニッセイ外国株 マザーファンド	21,514,308	30,165,211	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	43,778,180	59,100,543	
	ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド	10,632,260	29,637,424	
	ニッセイJ-REIT マザーファンド	30,022,316	59,336,105	
	ニッセイグローバルリート マザーファンド	27,029,209	30,359,207	
親投資信託受益証券 合計		157,129,204	269,306,882	
合計		157,129,204	269,306,882	

## 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16期 （平成26年11月20日現在）	第17期 （平成27年5月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	937,171	566,438
親投資信託受益証券	99,759,452	79,288,657
未収入金	15,504,519	11,710
流動資産合計	116,201,142	79,866,805
資産合計	116,201,142	79,866,805
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,495,704	-
未払受託者報酬	36,770	22,472
未払委託者報酬	883,454	540,573
その他未払費用	29,362	17,922
流動負債合計	16,445,290	580,967
負債合計	16,445,290	580,967
純資産の部		
元本等		
元本	86,100,113	63,950,551
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,655,739	15,335,287
純資産合計	99,755,852	79,285,838
負債純資産合計	116,201,142	79,866,805

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 （自平成26年5月21日 至平成26年11月20日）	第17期 （自平成26年11月21日 至平成27年5月20日）
営業収益		
受取利息	15	7
有価証券売買等損益	19,191,630	6,395,587
営業収益合計	19,191,645	6,395,594
営業費用		
受託者報酬	36,770	22,472
委託者報酬	883,454	540,573
その他費用	29,362	17,922
営業費用合計	949,586	580,967
営業利益又は営業損失（ ）	18,242,059	5,814,627
経常利益又は経常損失（ ）	18,242,059	5,814,627
当期純利益又は当期純損失（ ）	18,242,059	5,814,627
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（ ）	6,681,308	913,529
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,301,432	13,655,739
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,948,096	1,280,326
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減 少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減 少額	1,948,096	1,280,326
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,154,540	4,501,876
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	1,154,540	4,501,876
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,655,739	15,335,287

## (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16期 (平成26年11月20日現在)	第17期 (平成27年5月20日現在)
1. 受益権総口数	86,100,113口	63,950,551口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1586円 (11,586円)	1.2398円 (12,398円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第16期 (自平成26年5月21日 至平成26年11月20日)	第17期 (自平成26年11月21日 至平成27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(960,862円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(4,169,499円)、収益調整金(5,167,914円)及び分配準備積立金(7,897,226円)より分配対象収益は18,195,501円(1口当たり0.211330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(816,955円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(4,084,143円)、収益調整金(4,696,528円)及び分配準備積立金(8,825,211円)より分配対象収益は18,422,837円(1口当たり0.288079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16期 (自平成26年5月21日 至平成26年11月20日)	第17期 (自平成26年11月21日 至平成27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る場合、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16期 (平成26年11月20日現在)	第17期 (平成27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16期 (平成26年11月20日現在)	第17期 (平成27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	11,589,586	4,982,696
合計	11,589,586	4,982,696

## (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16期 （平成26年11月20日現在）	第17期 （平成27年5月20日現在）
期首元本額	148,985,841円	86,100,113円
期中追加設定元本額	20,024,403円	6,134,974円
期中一部解約元本額	82,910,131円	28,284,536円

（４）【附属明細表】（平成27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	7,109,758	17,870,376	
	ニッセイ外国株 マザーファンド	6,337,123	8,885,280	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	12,890,412	17,402,056	
	ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド	3,129,609	8,723,785	
	ニッセイJ-REIT マザーファンド	8,840,967	17,473,287	
	ニッセイグローバルリート マザーファンド	7,953,947	8,933,873	
親投資信託受益証券 合計		46,261,816	79,288,657	
合計		46,261,816	79,288,657	

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」- R E I T 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はありません。

## 「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26年11月20日現在）	（平成27年5月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,364,748,932	1,860,269,353
株式	59,178,037,810	70,418,519,680
派生商品評価勘定	149,218,120	110,842,620
未収配当金	436,378,649	712,570,460
差入委託証拠金	65,880,000	72,765,000
流動資産合計	61,194,263,511	73,174,967,113
資産合計	61,194,263,511	73,174,967,113
負債の部		
流動負債		
前受金	151,724,000	96,222,000
未払解約金	238,340,116	254,517,866
流動負債合計	390,064,116	350,739,866
負債合計	390,064,116	350,739,866
純資産の部		
元本等		
元本	29,347,779,645	28,972,832,326
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,456,419,750	43,851,394,921
純資産合計	60,804,199,395	72,824,227,247
負債純資産合計	61,194,263,511	73,174,967,113

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27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 1,509,408,000円	株式 1,850,400,000円
2. 受益権総口数	29,347,779,645口	28,972,832,326口
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0719円 (20,719円)	2.5135円 (25,135円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成26年5月21日 至 平成26年11月20日）	（自 平成26年11月21日 至 平成27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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	同左
4 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年11月20日現在)	(平成27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	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
------------	--	----

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年11月20日現在	平成27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	8,591,845,028	15,340,523,091
合計	8,591,845,028	15,340,523,091

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## デリバティブ取引

## 株式関連

種類	（平成26年11月20日 現在）				（平成27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	1,557,496,000	-	1,706,780,000	149,284,000	2,307,228,000	-	2,418,150,000	110,922,000
合計	1,557,496,000	-	1,706,780,000	149,284,000	2,307,228,000	-	2,418,150,000	110,922,000

## （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いません。
2. 株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
3. 評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27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	30,060,252,806円	29,347,779,645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	4,393,588,198円	4,215,980,404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	5,106,061,359円	4,590,927,723円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ日本株ファンド	29,304,238,968円	28,941,569,637円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	33,015,943円	24,152,931円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	10,524,734円	7,109,758円
計	29,347,779,645円	28,972,832,326円

## 附属明細表（平成27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	256,800	384.00	98,611,200	
マルハニチロ	30,100	1,889.00	56,858,900	
サカタのタネ	6,700	2,188.00	14,659,600	
日鉄鉱業	96,000	569.00	54,624,000	
国際石油開発帝石	283,000	1,460.50	413,321,500	
コムシスホールディングス	116,900	1,762.00	205,977,800	
大成建設	729,000	682.00	497,178,000	
大林組	431,000	806.00	347,386,000	
清水建設	55,000	929.00	51,095,000	
戸田建設	284,000	513.00	145,692,000	
N I P P O	325,000	2,164.00	703,300,000	
前田道路	147,000	2,206.00	324,282,000	
住友林業	273,100	1,597.00	436,140,700	
パナホーム	99,000	925.00	91,575,000	
積水ハウス	38,300	2,054.50	78,687,350	
中電工	43,000	2,388.00	102,684,000	
九電工	169,000	1,753.00	296,257,000	
森永乳業	193,000	435.00	83,955,000	
明治ホールディングス	3,800	13,720.00	52,136,000	
雪印メグミルク	119,500	1,493.00	178,413,500	
日本ハム	115,000	2,607.00	299,805,000	
アサヒグループホールディングス	40,800	4,089.50	166,851,600	
キリンホールディングス	221,300	1,764.50	390,483,850	
双日	2,689,200	281.00	755,665,200	
味の素	29,000	2,590.50	75,124,500	
キューピー	1,400	2,979.00	4,170,600	
日本たばこ産業	98,900	4,548.00	449,797,200	
セブン&アイ・ホールディングス	84,100	5,244.00	441,020,400	
帝人	437,000	435.00	190,095,000	
クラレ	21,100	1,664.00	35,110,400	
旭化成	343,000	1,114.50	382,273,500	
I Tホールディングス	167,800	2,555.00	428,729,000	
日本製紙	338,100	2,020.00	682,962,000	
電気化学工業	77,000	548.00	42,196,000	

信越化学工業	35,100	7,485.00	262,723,500
三菱瓦斯化学	877,000	698.00	612,146,000
三井化学	866,000	404.00	349,864,000
三菱ケミカルホールディングス	548,400	770.00	422,268,000
ダイセル	73,800	1,589.00	117,268,200
宇部興産	3,488,000	215.00	749,920,000
日立化成	62,900	2,515.00	158,193,500
電通	45,500	6,190.00	281,645,000
花王	79,200	5,867.00	464,666,400
武田薬品工業	18,300	5,998.00	109,763,400
アステラス製薬	492,600	1,819.00	896,039,400
塩野義製薬	51,800	4,695.00	243,201,000
田辺三菱製薬	142,600	2,063.00	294,183,800
中外製薬	13,500	3,895.00	52,582,500
エーザイ	10,400	8,144.00	84,697,600
みらかホールディングス	11,300	6,260.00	70,738,000
大塚ホールディングス	27,000	3,905.50	105,448,500
大正製薬ホールディングス	18,100	8,900.00	161,090,000
D I C	222,000	357.00	79,254,000
東洋インキS Cホールディングス	321,000	554.00	177,834,000
オリエンタルランド	28,600	8,424.00	240,926,400
フジ・メディア・ホールディングス	8,800	1,794.00	15,787,200
楽天	78,500	2,085.50	163,711,750
富士フイルムホールディングス	144,700	4,693.00	679,077,100
コニカミノルタ	314,000	1,630.00	511,820,000
J Xホールディングス	1,371,500	529.40	726,072,100
ブリヂストン	126,800	4,825.00	611,810,000
住友ゴム工業	182,100	2,101.00	382,592,100
旭硝子	631,000	794.00	501,014,000
日本板硝子	5,703,000	120.00	684,360,000
太平洋セメント	778,000	377.00	293,306,000
新日鐵住金	3,448,000	317.70	1,095,429,600
神戸製鋼所	641,000	222.00	142,302,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	96,600	2,809.00	271,349,400
日新製鋼	35,400	1,603.00	56,746,200
日本軽金属ホールディングス	2,389,700	209.00	499,447,300
三井金属鉱業	1,243,000	337.00	418,891,000
三菱マテリアル	209,000	472.00	98,648,000
住友金属鉱山	211,000	1,853.00	390,983,000

DOWAホールディングス	79,000	1,115.00	88,085,000	
住友電気工業	219,000	1,869.50	409,420,500	
フジクラ	392,000	679.00	266,168,000	
豊田自動織機	6,900	7,040.00	48,576,000	
S M C	6,200	35,540.00	220,348,000	
小松製作所	207,200	2,513.00	520,693,600	
住友重機械工業	103,000	792.00	81,576,000	
荏原製作所	411,000	577.00	237,147,000	
椿本チエイン	112,000	1,062.00	118,944,000	
平和	157,900	2,500.00	394,750,000	
ブラザー工業	178,300	1,876.00	334,490,800	
ジェイテクト	75,100	2,151.00	161,540,100	
ミネベア	58,000	2,186.00	126,788,000	
日立製作所	1,051,000	847.30	890,512,300	
東芝	551,000	407.60	224,587,600	
三菱電機	488,000	1,654.50	807,396,000	
富士電機	223,000	575.00	128,225,000	
オムロン	8,300	5,500.00	45,650,000	
日本電気	678,000	414.00	280,692,000	
富士通	339,000	670.00	227,130,000	
パナソニック	235,300	1,752.00	412,245,600	
ソニー	121,900	3,906.50	476,202,350	
T D K	38,600	9,340.00	360,524,000	
キーエンス	7,600	65,890.00	500,764,000	
ファナック	26,200	25,805.00	676,091,000	
京セラ	5,500	6,577.00	36,173,500	
村田製作所	42,100	19,620.00	826,002,000	
日東電工	74,500	8,998.00	670,351,000	
三井造船	1,410,000	216.00	304,560,000	
三菱重工業	425,000	738.00	313,650,000	
日産自動車	656,100	1,270.50	833,575,050	
いすゞ自動車	170,900	1,651.00	282,155,900	
トヨタ自動車	376,000	8,405.00	3,160,280,000	
新明和工業	114,000	1,281.00	146,034,000	
トピー工業	243,000	313.00	76,059,000	
アイシン精機	36,500	5,410.00	197,465,000	
マツダ	80,300	2,551.50	204,885,450	
本田技研工業	181,600	4,183.50	759,723,600	
スズキ	56,400	4,215.00	237,726,000	
富士重工業	262,800	4,429.50	1,164,072,600	
シマノ	2,200	17,490.00	38,478,000	

HOYA	71,900	4,820.50	346,593,950
キヤノン	17,300	4,345.50	75,177,150
リコー	373,200	1,283.00	478,815,600
シチズンホールディングス	25,200	926.00	23,335,200
バンダイナムコホールディングス	57,600	2,515.00	144,864,000
トッパン・フォームズ	82,900	1,592.00	131,976,800
共同印刷	93,000	376.00	34,968,000
日本写真印刷	28,400	2,204.00	62,593,600
任天堂	10,200	21,795.00	222,309,000
タカラスタンダード	117,000	929.00	108,693,000
コクヨ	136,400	1,109.00	151,267,600
岡村製作所	68,800	1,090.00	74,992,000
伊藤忠商事	653,400	1,602.50	1,047,073,500
丸紅	708,600	717.50	508,420,500
豊田通商	73,200	3,310.00	242,292,000
ファミリーマート	13,700	5,250.00	71,925,000
三井物産	313,800	1,709.00	536,284,200
東京エレクトロン	53,800	7,399.00	398,066,200
住友商事	26,500	1,461.00	38,716,500
三菱商事	129,200	2,712.00	350,390,400
キヤノンマーケティングジャパン	55,200	2,272.00	125,414,400
しまむら	22,300	12,680.00	282,764,000
クレディセゾン	85,500	2,464.00	210,672,000
ユニーグループ・ホールディングス	913,300	700.00	639,310,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,945,400	898.70	2,647,030,980
りそなホールディングス	1,382,600	681.70	942,518,420
三井住友トラスト・ホールディングス	267,000	560.80	149,733,600
三井住友フィナンシャルグループ	343,000	5,345.00	1,833,335,000
千葉銀行	250,000	979.00	244,750,000
横浜銀行	586,000	760.80	445,828,800
七十七銀行	71,000	676.00	47,996,000
ふくおかフィナンシャルグループ	258,000	688.00	177,504,000
静岡銀行	40,000	1,345.00	53,800,000
八十二銀行	83,000	952.00	79,016,000
みずほフィナンシャルグループ	5,956,300	246.10	1,465,845,430
日立キャピタル	38,300	2,962.00	113,444,600
オリックス	373,200	1,932.50	721,209,000
三菱UFJリース	868,600	652.00	566,327,200
野村ホールディングス	618,400	810.00	500,904,000

損保ジャパン日本興亜ホールディングス	11,100	4,185.00	46,453,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	128,600	3,681.50	473,440,900	
第一生命保険	272,400	2,162.00	588,928,800	
東京海上ホールディングス	131,600	4,940.00	650,104,000	
T & Dホールディングス	363,000	1,808.50	656,485,500	
三井不動産	23,000	3,680.00	84,640,000	
三菱地所	125,000	2,705.00	338,125,000	
住友不動産	45,000	4,851.00	218,295,000	
レオパレス21	3,600	726.00	2,613,600	
イオンモール	15,700	2,430.00	38,151,000	
東日本旅客鉄道	73,700	11,445.00	843,496,500	
西日本旅客鉄道	38,000	7,097.00	269,686,000	
東海旅客鉄道	52,200	22,035.00	1,150,227,000	
阪急阪神ホールディングス	370,000	749.00	277,130,000	
福山通運	90,000	720.00	64,800,000	
日本郵船	2,064,000	377.00	778,128,000	
日本航空	120,900	4,070.00	492,063,000	
A N Aホールディングス	476,000	334.30	159,126,800	
住友倉庫	284,000	685.00	194,540,000	
上組	202,000	1,179.00	238,158,000	
郵船ロジスティクス	22,700	1,575.00	35,752,500	
日本電信電話	194,100	8,515.00	1,652,761,500	
K D D I	329,900	2,859.50	943,349,050	
N T Tドコモ	347,300	2,202.00	764,754,600	
中部電力	412,400	1,760.00	725,824,000	
東北電力	511,000	1,737.00	887,607,000	
九州電力	178,600	1,378.00	246,110,800	
電源開発	5,600	4,110.00	23,016,000	
東京瓦斯	356,000	677.30	241,118,800	
大阪瓦斯	1,570,000	502.00	788,140,000	
東京ドーム	142,000	531.00	75,402,000	
富士ソフト	44,300	2,604.00	115,357,200	
ニトリホールディングス	14,900	9,610.00	143,189,000	
ファーストリテイリング	2,000	50,200.00	100,400,000	
ソフトバンク	64,900	7,247.00	470,330,300	
合計	70,615,200		70,418,519,680	

(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・グループ

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26年11月20日現在)	(平成27年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	805,036	2,794,565
コール・ローン	33,782,479	21,034,724
株式	614,972,964	656,310,147
派生商品評価勘定	3,617,168	1,492,098
未収入金	-	49,026
未収配当金	938,190	1,356,591
差入委託証拠金	19,120,615	21,126,555
流動資産合計	673,236,452	704,163,706
資産合計	673,236,452	704,163,706
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,902,336	91,961
流動負債合計	1,902,336	91,961
負債合計	1,902,336	91,961
純資産の部		
元本等		
元本	511,269,213	502,168,997
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	160,064,903	201,902,748
純資産合計	671,334,116	704,071,745
負債純資産合計	673,236,452	704,163,706

## 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。 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26年11月20日現在）	（平成27年5月20日現在）
1. 受益権総口数	511,269,213口	502,168,997口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3131円 (13,131円)	1.4021円 (14,021円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自平成26年5月21日 至平成26年11月20日）	（自平成26年11月21日 至平成27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	<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26年11月20日現在）	（平成27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26年11月20日現在	平成27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	26,520,987	36,058,949
合計	26,520,987	36,058,949

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	(平成26年11月20日 現在)				(平成27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								
買 建	21,795,460	-	23,638,000	1,842,540	-	-	-	-
アメリカ・ ドル	21,795,460	-	23,638,000	1,842,540	-	-	-	-
合計	21,795,460	-	23,638,000	1,842,540	-	-	-	-

## (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26年11月20日 現在）				（平成27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	58,726,728	-	60,501,355	1,774,627	37,048,457	-	38,540,554	1,492,097
合計	58,726,728	-	60,501,355	1,774,627	37,048,457	-	38,540,554	1,492,097

#### （注） 時価の算定方法

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

#### （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

#### （その他の注記）

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

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27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	525,279,428円	511,269,213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	5,948,492円	2,426,459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	19,958,707円	11,526,675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）	475,807,565円	474,317,566円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	26,876,372円	21,514,308円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	8,585,276円	6,337,123円
計	511,269,213円	502,168,997円

## 附属明細表（平成27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	3M CO	175	163.12	28,546.00	
	ABBOTT LABORATORIES	397	49.01	19,456.97	
	ABBVIE INC	419	65.73	27,540.87	
	ACTAVIS PLC	84	298.43	25,068.12	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	48	161.96	7,774.08	
	ALTRIA GROUP INC	994	51.78	51,469.32	
	AMAZON.COM INC	102	421.71	43,014.42	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	218	59.41	12,951.38	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	719	53.66	38,581.54	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	513	128.97	66,161.61	
	AMGEN INC	83	163.56	13,575.48	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	359	83.56	29,998.04	
	APPLE INC	977	130.07	127,078.39	
	AT&T INC	1,145	34.37	39,353.65	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	317	129.47	41,041.99	
	BANK OF AMERICA CORP	1,590	16.77	26,664.30	
	BIOGEN INC	44	395.17	17,387.48	
	BOEING CO	115	147.05	16,910.75	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	471	68.27	32,155.17	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	237	85.41	20,242.17	
	CARDINAL HEALTH INC	136	87.30	11,872.80	
	CATERPILLAR INC	102	87.24	8,898.48	
	CBOE HOLDINGS INC	396	58.45	23,146.20	
	CELANESE CORP-SERIES A	158	67.01	10,587.58	
	CELGENE CORP	226	116.85	26,408.10	
	CHEVRON CORP	309	105.02	32,451.18	
	CISCO SYSTEMS INC	1,374	29.73	40,855.89	
	CITIGROUP INC	436	55.33	24,123.88	
	COACH INC	496	37.38	18,540.48	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	813	65.03	52,869.39	
COMCAST CORP	575	57.23	32,907.25		
CONCHO RESOURCES INC	107	116.61	12,477.27		

CONOCOPHILLIPS	273	65.12	17,777.76	
CSX CORP	364	35.60	12,958.40	
CUMMINS INC	86	140.55	12,087.30	
CVS HEALTH CORP	377	102.32	38,574.64	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,219	65.13	79,393.47	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,315	60.12	79,057.80	
DOW CHEMICAL CO	434	50.73	22,016.82	
EBAY INC	789	59.25	46,748.25	
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	150	71.25	10,687.50	
EOG RESOURCES INC	250	90.26	22,565.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	133	88.75	11,803.75	
EXXON MOBIL CORP	742	86.99	64,546.58	
FACEBOOK INC-A	230	80.63	18,544.90	
FEDEX CORP	91	177.98	16,196.18	
FREEMPORT-MCMORAN INC	287	21.29	6,110.23	
GENERAL ELECTRIC CO	1,763	27.35	48,218.05	
GILEAD SCIENCES INC	303	110.56	33,499.68	
GOOGLE INC-CL C	134	537.36	72,006.24	
HAIN CELESTIAL GROUP INC	617	61.75	38,099.75	
HALLIBURTON CO	153	45.07	6,895.71	
HCA HOLDINGS INC	165	82.52	13,615.80	
HEWLETT-PACKARD CO	257	33.40	8,583.80	
HOME DEPOT INC	354	112.34	39,768.36	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	220	105.81	23,278.20	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	141	96.67	13,630.47	
INTERSIL CORP	1,359	13.17	17,898.03	
ITC HOLDINGS CORP	960	35.91	34,473.60	
JARDEN CORP	404	53.68	21,686.72	
JOHNSON & JOHNSON	491	103.96	51,044.36	
JPMORGAN CHASE & CO	564	67.01	37,793.64	
KANSAS CITY SOUTHERN	75	94.51	7,088.25	
LAM RESEARCH CORP	219	80.78	17,690.82	
LAS VEGAS SANDS CORP	150	50.46	7,569.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	171	101.23	17,310.33	
MASTERCARD INC-CLASS A	623	93.80	58,437.40	
MEDTRONIC PLC	191	78.44	14,982.04	
MERCK & CO INC	525	60.52	31,773.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	1,604	26.31	42,201.24	
MICROSOFT CORP	1,747	47.58	83,122.26	
MOLSON COORS BREWING CO -B	1,101	75.69	83,334.69	



MONSANTO CO	100	119.91	11,991.00	
MORGAN STANLEY	542	38.69	20,969.98	
MYLAN NV	121	71.35	8,633.35	
NIKE INC	169	104.64	17,684.16	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	833	57.30	47,730.90	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	273	75.84	20,704.32	
ORACLE CORP	441	44.32	19,545.12	
PATTERSON COS INC	265	47.33	12,542.45	
PEPSICO INC	209	97.95	20,471.55	
PERRIGO CO PLC	87	197.68	17,198.16	
PFIZER INC	1,263	34.21	43,207.23	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	103	152.97	15,755.91	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	661	95.56	63,165.16	
PRAXAIR INC	91	121.33	11,041.03	
PRECISION CASTPARTS CORP	75	220.22	16,516.50	
REGENERON PHARMACEUTICALS	19	504.15	9,578.85	
ROCKWELL AUTOMATION INC	88	125.01	11,000.88	
ROPER TECHNOLOGIES INC	103	176.61	18,190.83	
ROSS STORES INC	572	102.98	58,904.56	
SCHLUMBERGER LTD	265	90.56	23,998.40	
SEMPRA ENERGY	474	107.82	51,106.68	
SERVICENOW INC	451	77.78	35,078.78	
SPECTRA ENERGY CORP	430	35.88	15,428.40	
T-MOBILE US INC	396	34.40	13,622.40	
TARGET CORP	462	77.92	35,999.04	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	167	60.55	10,111.85	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	131	130.55	17,102.05	
TIFFANY & CO	147	86.41	12,702.27	
TIME WARNER INC	190	85.71	16,284.90	
TYCO INTERNATIONAL PLC	295	40.19	11,856.05	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	228	119.07	27,147.96	
UNITEDHEALTH GROUP INC	220	120.55	26,521.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	114	87.44	9,968.16	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	973	49.55	48,212.15	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	773	85.84	66,354.32	
WALT DISNEY CO	576	110.56	63,682.56	

	WELLS FARGO & CO	1,888	56.40	106,483.20	
	WHOLE FOODS MARKET INC	211	42.48	8,963.28	
	YAHOO! INC	576	40.98	23,604.48	
	ZIMMER HOLDINGS INC	117	114.34	13,377.78	
アメリカ・ドル	小計	50,265		3,345,617.90 (404,619,029)	
イギリス・ポンド	ASTRAZENECA PLC	257	44.03	11,316.99	
	BARCLAYS PLC	7,528	2.62	19,776.05	
	BG GROUP PLC	2,067	11.54	23,853.18	
	BHP BILLITON PLC	293	14.05	4,118.11	
	BP PLC	2,779	4.52	12,569.41	
	BT GROUP PLC	2,290	4.66	10,680.56	
	CAPITA PLC	402	12.70	5,105.40	
	COMPASS GROUP PLC	654	11.66	7,625.64	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	790	14.42	11,395.75	
	GLENCORE PLC	3,275	2.89	9,484.40	
	HSBC HOLDINGS PLC	3,048	6.16	18,797.01	
	IG GROUP HOLDINGS PLC	1,600	7.74	12,384.00	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	1,089	32.67	35,577.63	
	LONMIN PLC	35	1.38	48.40	
	NATIONAL GRID PLC	643	9.00	5,788.92	
	PRUDENTIAL PLC	2,830	16.69	47,232.70	
	RIO TINTO PLC	270	28.47	7,686.90	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	900	10.09	9,081.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	126,900	0.00	126.90	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,821	20.00	36,420.00	
	STANDARD CHARTERED PLC	775	10.56	8,184.00	
	VODAFONE GROUP PLC	5,749	2.26	13,027.23	
	WPP PLC	778	15.81	12,300.18	
イギリス・ポンド	小計	166,773		322,580.36 (60,474,140)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	700	32.00	22,400.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	370	82.85	30,654.50	
	CSL LIMITED	160	88.50	14,160.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	610	33.67	20,538.70	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK-R	48	5.16	247.68	
	RIO TINTO LTD	200	57.45	11,490.00	
	SOUTH32 LTD	293	2.33	682.69	

	TELSTRA CORP LTD	4,070	6.13	24,949.10	
	TRANSURBAN GROUP	1,498	9.96	14,920.08	
	WESFARMERS LIMITED	173	43.71	7,561.83	
	WESTPAC BANKING CORP	670	32.28	21,627.60	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	210	34.35	7,213.50	
	WOOLWORTHS LTD	167	28.10	4,692.70	
オーストラリア・ドル 小計		9,169		181,138.38 (17,322,263)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	190	77.84	14,789.60	
	BANK OF NOVA SCOTIA	300	65.27	19,581.00	
	BARRICK GOLD CORP	410	15.26	6,256.60	
	BCE INC	398	53.37	21,241.26	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	320	74.58	23,865.60	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	68	212.77	14,468.36	
	GOLDCORP INC	260	22.76	5,917.60	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	841	68.19	57,347.79	
	ROYAL BANK OF CANADA	280	80.09	22,425.20	
	SUNCOR ENERGY INC	400	36.13	14,452.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	1,174	56.09	65,849.66	
	TRANSCANADA CORP	265	54.18	14,357.70	
カナダ・ドル 小計		4,906		280,552.37 (27,724,185)	
シンガポール・ ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,000	21.05	21,050.00	
	KEPPEL CORP LTD	1,000	8.83	8,830.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,000	4.31	8,620.00	
シンガポール・ドル 小計		4,000		38,500.00 (3,486,175)	
スイス・フラン	ABB LTD	380	20.43	7,763.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	202	85.65	17,301.30	
	NESTLE SA	944	73.40	69,289.60	
	NOVARTIS AG	430	97.55	41,946.50	
	ROCHE HOLDING AG	146	278.30	40,631.80	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	4	1,840.00	7,360.00	
	SWATCH GROUP AG	12	402.20	4,826.40	
	SYNGENTA AG	44	408.00	17,952.00	
スイス・フラン 小計		2,162		207,071.00 (26,701,805)	

スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	445	5.95	2,647.75	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	445	250.90	111,650.50	
	HENNES & MAURITZ AB	168	338.60	56,884.80	
	NORDEA BANK AB	786	109.10	85,752.60	
	VOLVO AB	819	114.10	93,447.90	
スウェーデン・クローナ 小計		2,663		350,383.55 (5,073,553)	
デンマーク・クローネ	NOVO-NORDISK A/S	307	382.20	117,335.40	
デンマーク・クローネ 小計		307		117,335.40 (2,116,730)	
ユーロ	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	142	30.80	4,373.60	
	ADIDAS AG	50	75.66	3,783.10	
	AIRBUS GROUP SE	130	62.81	8,165.30	
	ALLIANZ SE	308	151.84	46,767.02	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	700	111.20	77,840.00	
	AXA	1,322	23.66	31,278.52	
	BANCO SANTANDER SA	2,722	6.72	18,294.56	
	BANKIA SA	10,736	1.22	13,108.65	
	BASF SE	140	88.11	12,335.68	
	BAYER AG	201	137.03	27,543.63	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	96	106.71	10,244.16	
	CAP GEMINI SA	138	82.34	11,362.92	
	CONTINENTAL AG	77	219.55	16,905.42	
	DAIMLER AG	210	88.88	18,665.64	
	DEUTSCHE POST AG	283	28.65	8,109.08	
	DEUTSCHE TELEKOM AG	669	16.88	11,295.39	
	ENEL SPA	4,114	4.33	17,846.53	
	GEA GROUP AG	147	43.24	6,357.45	
	IBERDROLA SA	5,868	6.33	37,150.30	
	INDITEX SA	1,072	29.70	31,838.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,175	11.67	25,395.30	
	ING GROEP NV	2,266	14.86	33,672.76	
	INTESA SANPAOLO	6,128	3.34	20,479.77	
	KERING	35	170.30	5,960.50	
KERRY GROUP PLC-A	917	67.30	61,714.10		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	358	24.92	8,923.15		
LAFARGE SA	96	64.56	6,197.76		
LINDE AG	40	177.06	7,082.40		

	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	40	165.95	6,638.00	
	RANDSTAD HOLDINGS NV	89	54.32	4,834.48	
	REED ELSEVIER NV	560	22.80	12,770.80	
	SAFRAN SA	120	65.12	7,814.40	
	SANOFI	227	91.35	20,736.45	
	SAP SE	268	68.87	18,459.30	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	130	69.88	9,084.40	
	SIEMENS AG	160	97.63	15,621.28	
	TELEFONICA SA	660	13.21	8,721.90	
	TOTAL SA	380	47.30	17,975.90	
	VINCI SA	170	55.04	9,356.80	
	VOLKSWAGEN AG	20	232.80	4,656.16	
ユーロ 小計		43,964		719,360.96 (96,790,017)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	2,600	52.00	135,200.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,500	30.70	76,750.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	2,000	64.05	128,100.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,000	168.60	168,600.00	
	CLP HOLDINGS LTD	1,500	68.40	102,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,000	37.40	37,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,000	63.05	63,050.00	
	MTR CORP	1,500	38.45	57,675.00	
香港・ドル 小計		13,100		769,375.00 (12,002,250)	
合計		297,309		656,310,147 (656,310,147)	

## 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 112銘柄	57.47%	61.65%
イギリス・ポンド	株式 23銘柄	8.59%	9.21%
オーストラリア・ドル	株式 13銘柄	2.46%	2.64%
カナダ・ドル	株式 12銘柄	3.94%	4.22%

シンガポール・ドル	株式	3銘柄	0.50%	0.53%
スイス・フラン	株式	8銘柄	3.79%	4.07%
スウェーデン・クローナ	株式	5銘柄	0.72%	0.77%
デンマーク・クローネ	株式	1銘柄	0.30%	0.32%
ユーロ	株式	40銘柄	13.75%	14.75%
香港・ドル	株式	8銘柄	1.70%	1.83%

(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26年11月20日現在)	(平成27年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,053,466,214	910,126,810
国債証券	23,447,916,300	22,963,800,808
派生商品評価勘定	3,343,800	1,783,800
未収入金	3,576,056,416	4,299,365,198
未収利息	37,629,285	34,140,470
前払費用	22,984,841	25,445,613
差入委託証拠金	2,520,000	4,860,000
流動資産合計	28,143,916,856	28,239,522,699
資産合計	28,143,916,856	28,239,522,699
負債の部		
流動負債		
前受金	3,000,000	2,160,000
未払金	3,571,398,243	4,221,544,239
未払解約金	131,269,292	56,696,579
流動負債合計	3,705,667,535	4,280,400,818
負債合計	3,705,667,535	4,280,400,818
純資産の部		
元本等		
元本	18,300,241,516	17,747,327,541
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,138,007,805	6,211,794,340
純資産合計	24,438,249,321	23,959,121,881
負債純資産合計	28,143,916,856	28,239,522,699

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27年5月20日現在）
1. 受益権総口数	18,300,241,516口	17,747,327,541口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3354円 (13,354円)	1.3500円 (13,500円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自平成26年5月21日 至平成26年11月20日）	（自平成26年11月21日 至平成27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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、債券先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、市場金利の変動によるリスクを有しております。</p>	同左



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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成26年11月20日現在	平成27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	222,261,157	84,274,085

合計	222,261,157	84,274,085
----	-------------	------------

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

債券関連

種類	（平成26年11月20日 現在）				（平成27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	874,800,000	-	878,160,000	3,360,000	882,120,000	-	883,920,000	1,800,000
合計	874,800,000	-	878,160,000	3,360,000	882,120,000	-	883,920,000	1,800,000

（注） 時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27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	19,303,910,240円	18,300,241,516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	2,408,541,118円	3,203,261,125円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	3,412,209,842円	3,756,175,100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）	953,046,156円	813,164,434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）	286,161,021円	295,942,870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）	64,559,294円	69,868,731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)	114,658,183円	91,574,888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)	3,820,681,986円	3,167,961,438円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)SA (適格機関投資家限定)	4,629,665,263円	4,124,052,844円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型) SA(適格機関投資家限定)	208,310,299円	237,655,543円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (債券重視型)	1,937,386,480円	2,149,170,459円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準 型)	3,231,895,762円	3,674,801,922円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (株式重視型)	769,835,820円	912,016,189円
DCニッセイ国内債券アクティブ	983,591,084円	1,051,334,398円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(成長型)SA (適格機関投資家限定)	1,085,880,193円	940,576,184円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(毎月分配型)	51,696,799円	43,778,180円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(成長重視型)	16,486,208円	12,890,412円
DCニッセイバランスアクティブ	146,386,968円	162,539,049円
計	18,300,241,516円	17,747,327,541円

## 附属明細表（平成27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329回 利付国債(2年)	130,000,000	130,010,564	
	第330回 利付国債(2年)	990,700,000	990,919,036	
	第331回 利付国債(2年)	601,000,000	601,059,573	
	第332回 利付国債(2年)	125,500,000	125,526,200	
	第333回 利付国債(2年)	78,200,000	78,225,105	
	第334回 利付国債(2年)	143,400,000	143,464,620	
	第338回 利付国債(2年)	57,800,000	57,847,082	
	第339回 利付国債(2年)	89,200,000	89,279,873	
	第349回 利付国債(2年)	34,900,000	34,969,451	
	第350回 利付国債(2年)	244,400,000	244,908,352	
	第352回 利付国債(2年)	1,112,700,000	1,115,225,829	
	第102回 利付国債(5年)	184,500,000	185,404,050	
	第107回 利付国債(5年)	262,400,000	263,788,096	
	第113回 利付国債(5年)	906,900,000	915,415,791	
	第118回 利付国債(5年)	297,900,000	299,717,190	
	第119回 利付国債(5年)	378,600,000	379,368,558	
	第120回 利付国債(5年)	1,703,900,000	1,713,833,737	
	第122回 利付国債(5年)	1,660,100,000	1,661,610,691	
	第123回 利付国債(5年)	338,900,000	338,981,336	
	第1回 利付国債(40年)	56,300,000	69,430,849	
	第2回 利付国債(40年)	41,800,000	49,419,304	
	第3回 利付国債(40年)	13,500,000	15,972,390	
	第7回 利付国債(40年)	2,100,000	2,181,627	
	第297回 利付国債(10年)	800,000	839,496	
	第318回 利付国債(10年)	732,000,000	771,989,160	
	第321回 利付国債(10年)	151,100,000	159,671,903	
	第322回 利付国債(10年)	234,600,000	246,322,962	
	第323回 利付国債(10年)	834,200,000	875,567,978	
	第331回 利付国債(10年)	94,600,000	96,946,080	
	第333回 利付国債(10年)	408,100,000	417,727,079	
	第338回 利付国債(10年)	1,513,100,000	1,514,522,314	

第16回 利付国債(30年)	46,600,000	57,550,534	
第26回 利付国債(30年)	454,600,000	551,338,880	
第27回 利付国債(30年)	40,200,000	49,534,440	
第28回 利付国債(30年)	67,500,000	83,298,375	
第29回 利付国債(30年)	298,600,000	362,921,426	
第30回 利付国債(30年)	124,100,000	148,567,556	
第34回 利付国債(30年)	5,500,000	6,488,460	
第37回 利付国債(30年)	1,900,000	2,114,966	
第39回 利付国債(30年)	48,600,000	54,042,228	
第40回 利付国債(30年)	45,900,000	49,979,133	
第42回 利付国債(30年)	506,300,000	539,153,807	
第43回 利付国債(30年)	215,000,000	228,800,850	
第45回 利付国債(30年)	69,100,000	70,105,405	
第72回 利付国債(20年)	73,100,000	84,812,813	
第79回 利付国債(20年)	208,200,000	240,824,940	
第84回 利付国債(20年)	138,800,000	161,098,220	
第88回 利付国債(20年)	253,400,000	303,030,924	
第92回 利付国債(20年)	202,100,000	237,887,868	
第99回 利付国債(20年)	241,600,000	285,327,184	
第105回 利付国債(20年)	71,500,000	84,634,550	
第107回 利付国債(20年)	141,200,000	167,166,680	
第109回 利付国債(20年)	334,800,000	387,648,180	
第112回 利付国債(20年)	16,700,000	19,785,158	
第113回 利付国債(20年)	223,500,000	264,771,510	
第114回 利付国債(20年)	375,600,000	444,875,664	
第116回 利付国債(20年)	209,300,000	250,797,911	
第117回 利付国債(20年)	1,500,000	1,776,120	
第118回 利付国債(20年)	800,000	936,104	
第121回 利付国債(20年)	80,000,000	92,459,200	
第122回 利付国債(20年)	130,600,000	149,045,944	
第123回 利付国債(20年)	1,300,000	1,539,460	
第124回 利付国債(20年)	3,700,000	4,327,076	
第125回 利付国債(20年)	146,400,000	175,439,904	
第127回 利付国債(20年)	190,100,000	219,322,172	
第128回 利付国債(20年)	353,400,000	407,328,840	
第130回 利付国債(20年)	85,400,000	96,964,868	
第131回 利付国債(20年)	160,800,000	180,141,024	
第132回 利付国債(20年)	221,400,000	247,669,110	
第133回 利付国債(20年)	26,800,000	30,389,592	
第134回 利付国債(20年)	800,000	905,880	
第136回 利付国債(20年)	400,000	440,596	

第137回 利付国債(20年)	231,200,000	257,815,744	
第139回 利付国債(20年)	301,600,000	331,624,280	
第140回 利付国債(20年)	395,200,000	439,960,352	
第141回 利付国債(20年)	41,900,000	46,563,889	
第145回 利付国債(20年)	32,900,000	36,425,893	
第146回 利付国債(20年)	199,500,000	220,449,495	
第147回 利付国債(20年)	194,200,000	210,969,170	
第148回 利付国債(20年)	75,400,000	80,417,116	
第150回 利付国債(20年)	196,600,000	205,183,556	
第151回 利付国債(20年)	66,700,000	67,125,546	
第17回 物価連動国債(10年)	662,300,000	731,875,939	
国債証券 合計	21,637,800,000	22,963,800,808	
合計	21,637,800,000	22,963,800,808	

## 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26年11月20日現在)	(平成27年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	7,064,279	59,035,532
コール・ローン	48,815,190	546,028,419
国債証券	3,489,703,154	22,210,261,181
派生商品評価勘定	16,318,954	49,726,145
未収入金	188,647,239	1,384,705,478
未収利息	17,856,113	107,182,925
前払費用	21,937,587	106,991,973
流動資産合計	3,790,342,516	24,463,931,653
資産合計	3,790,342,516	24,463,931,653
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	19,282,440	32,332,015
未払金	188,891,107	1,594,887,183
未払解約金	11,727,498	1,868,348
流動負債合計	219,901,045	1,629,087,546
負債合計	219,901,045	1,629,087,546
純資産の部		
元本等		
元本	1,269,785,622	8,191,944,826
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,300,655,849	14,642,899,281
純資産合計	3,570,441,471	22,834,844,107
負債純資産合計	3,790,342,516	24,463,931,653

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27年5月20日現在）
1. 受益権総口数	1,269,785,622口	8,191,944,826口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.8118円 (28,118円)	2.7875円 (27,875円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自平成26年5月21日 至平成26年11月20日）	（自平成26年11月21日 至平成27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、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有して おります。</p>	同左



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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27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26年11月20日現在	平成27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	60,638,336	319,176,766

合計		60,638,336	319,176,766
----	--	------------	-------------

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成26年11月20日 現在）				（平成27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	863,391,508	-	882,649,383	19,257,875	7,310,755,523	-	7,313,904,104	3,148,581
アメリカ・ドル	41,598,045	-	41,955,369	357,324	1,589,291,135	-	1,600,128,470	10,837,335
イギリス・ポンド	51,195,927	-	51,985,640	789,713	112,870,022	-	112,800,844	69,178
オーストラリア・ドル	19,422,905	-	19,598,677	175,772	-	-	-	-
カナダ・ドル	1,243,411	-	1,269,898	26,487	23,065,991	-	23,056,320	9,671
スウェーデン・クローナ	23,250,531	-	23,806,479	555,948	52,849,232	-	52,912,816	63,584
デンマーク・クローネ	7,959	-	7,960	1	-	-	-	-
ノルウェー・クローネ	9,886,450	-	10,016,720	130,270	34,782,851	-	34,743,716	39,135
ポーランド・ズロチ	15,113,230	-	15,539,308	426,078	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	57,089,579	-	57,395,345	305,766	433,357,747	-	435,719,592	2,361,845
ユーロ	641,027,945	-	657,517,189	16,489,244	4,998,415,701	-	4,987,384,346	11,031,355
南アフリカ・ランド	3,555,526	-	3,556,798	1,272	66,122,844	-	67,158,000	1,035,156
買 建	891,902,642	-	908,197,031	16,294,389	7,611,921,008	-	7,632,463,719	20,542,711
アメリカ・ドル	590,065,924	-	602,073,232	12,007,308	4,725,686,775	-	4,761,687,854	36,001,079
イギリス・ポンド	-	-	-	-	383,210,385	-	382,601,100	609,285

オーストラリア・ドル	7,045,829	-	7,106,400	60,571	144,822,100	-	144,697,091	125,009
カナダ・ドル	80,816,502	-	82,397,644	1,581,142	67,266,739	-	66,661,980	604,759
シンガポール・ドル	2,793,735	-	2,832,024	38,289	7,659,876	-	7,723,576	63,700
スイス・フラン	11,549,741	-	11,893,832	344,091	72,403,157	-	72,107,552	295,605
スウェーデン・クローナ	6,140,703	-	6,303,359	162,656	26,856,009	-	26,675,056	180,953
デンマーク・クローネ	29,972,840	-	30,825,100	852,260	23,813,963	-	23,786,290	27,673
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	22,819,177	-	22,515,820	303,357
ポーランド・ズロチ	7,089,825	-	7,142,617	52,792	61,147,193	-	61,694,180	546,987
メキシコ・ペソ	42,989,825	-	43,048,595	58,770	45,659,397	-	45,665,136	5,739
ユーロ	103,964,862	-	104,860,570	895,708	1,939,531,067	-	1,924,528,980	15,002,087
南アフリカ・ランド	9,472,856	-	9,713,658	240,802	91,045,170	-	92,119,104	1,073,934
合計	1,755,294,150	-	1,790,846,414	2,963,486	14,922,676,531	-	14,946,367,823	17,394,130

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

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

項目	(平成26年11月20日現在)	(平成27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	1,584,136,138円	1,269,785,622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	4,152,907円	7,170,265,814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	318,503,423円	248,106,610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	59,583,624円	- 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）	1,193,716,141円	1,016,377,433円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	12,495,331円	10,632,260円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	3,990,526円	3,129,609円
ニッセイ外国債券アクティブ（適格機関投資家限定）	- 円	7,161,805,524円
計	1,269,785,622円	8,191,944,826円

附属明細表（平成27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 N/B 1.75 2022/05/15	90,000.00	88,614.00		
		US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	740,000.00	719,879.40		
		US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	7,730,000.00	8,077,231.60		
		US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	780,000.00	836,791.80		
		US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	25,520,000.00	27,830,580.80		
		US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	7,310,000.00	8,125,503.60		
		アメリカ・ドル 小計		42,170,000.00	45,678,601.20 (5,524,370,029)	
	イギリス・ポンド		TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	900,000.00	1,018,224.00	
			TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	1,490,000.00	1,868,951.70	
			TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	2,220,000.00	2,907,733.80	
			UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	2,670,000.00	2,749,592.70	
		イギリス・ポンド 小計		7,280,000.00	8,544,502.20 (1,601,837,827)	
	オーストラリア・ドル		AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	380,000.00	381,390.80	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	2,060,000.00	2,462,338.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	80,000.00	94,511.20	
オーストラリア・ドル 小計		2,520,000.00	2,938,240.60 (280,983,949)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	660,000.00	716,119.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	2,620,000.00	2,913,833.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	910,000.00	1,184,264.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	20,000.00	32,911.00	
カナダ・ドル 小計		4,210,000.00	4,847,128.70 (478,993,258)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	870,000.00	933,257.70	
シンガポール・ドル 小計		870,000.00	933,257.70 (84,506,485)	
スイス・フラン	Switzerland Government Bond 2.25 2020/07/06	10,000.00	11,409.80	
スイス・フラン 小計		10,000.00	11,409.80 (1,471,294)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	5,440,000.00	6,586,534.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 4.25 2019/03/12	3,920,000.00	4,572,327.20	
スウェーデン・クローナ 小計		9,360,000.00	11,158,861.60 (161,580,316)	
デンマーク・クロー ネ	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	80,000.00	86,191.20	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2019/11/15	3,870,000.00	4,558,898.70	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,780,000.00	2,954,693.20	
デンマーク・クローネ 小計		5,730,000.00	7,599,783.10 (137,100,087)	
ノルウェー・クロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	1,450,000.00	1,614,314.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	3,990,000.00	4,534,874.40	
ノルウェー・クローネ 小計		5,440,000.00	6,149,188.40 (98,509,998)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 3.75 2018/04/25	40,000.00	42,057.20	

	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	760,000.00	835,080.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	1,300,000.00	1,477,034.00	
ポーランド・ズロチ	小計	2,100,000.00	2,354,171.60 (78,182,039)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	2,010,000.00	2,046,461.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.734 2019/07/30	1,380,000.00	1,494,415.80	
マレーシア・リンギット	小計	3,390,000.00	3,540,877.20 (118,548,569)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	7,230,000.00	10,095,755.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	9,630,000.00	10,095,514.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	170,000.00	189,726.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2017/12/14	40,130,000.00	43,468,013.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2015/12/17	17,210,000.00	17,687,577.50	
メキシコ・ペソ	小計	74,370,000.00	81,536,587.00 (648,215,867)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	70,000.00	78,911.00	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	590,000.00	882,132.60	
	BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	960,000.00	1,551,004.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	3,120,000.00	3,631,087.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	830,000.00	1,137,100.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	340,000.00	492,860.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	170,000.00	218,642.10	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2017/07/30	1,920,000.00	2,147,808.00	
	BTPS 6.5 11/01/27 6.5 2027/11/01	430,000.00	631,369.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	80,000.00	130,969.60	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	1,060,000.00	1,879,952.40	

	BUONI POLIENNALI DEL TES 2.75 2015/12/01	8,050,000.00	8,172,118.50	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	690,000.00	797,115.60	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2017/02/01	25,170,000.00	26,851,607.70	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	4,080,000.00	4,709,870.40	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	3,180,000.00	4,296,847.80	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	3,570,000.00	4,577,132.70	
	FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	2,930,000.00	3,310,196.80	
	FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	5,200,000.00	6,146,244.00	
	FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	4,370,000.00	5,080,780.50	
	FRANCE (GOVT OF) 3.75 2017/04/25	3,140,000.00	3,377,698.00	
	FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	1,790,000.00	2,902,359.70	
	FRENCH OAT 5.5 2029/04/25	2,380,000.00	3,701,447.40	
	TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	4,990,000.00	5,975,525.00	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	2,170,000.00	3,000,893.00	
	ユーロ 小計	81,280,000.00	95,681,674.40 (12,873,969,291)	
	南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	7,110,000.00	5,520,204.00
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.25 2020/01/15	6,560,000.00	6,498,729.60
	南アフリカ・ランド 小計	13,670,000.00	12,018,933.60 (121,992,176)	
国債証券 合計			22,210,261,181 (22,210,261,181)	
合計			22,210,261,181 (22,210,261,181)	

(注) 1 . 通貨種類ごとの小計欄の ( ) 内は、邦貨換算額であります。

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

(注) 3 . 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
----	-----	--------------	-----------------

アメリカ・ドル	国債証券	6銘柄	24.19%	24.87%
イギリス・ポンド	国債証券	4銘柄	7.01%	7.21%
オーストラリア・ドル	国債証券	3銘柄	1.23%	1.27%
カナダ・ドル	国債証券	4銘柄	2.10%	2.16%
シンガポール・ドル	国債証券	1銘柄	0.37%	0.38%
スイス・フラン	国債証券	1銘柄	0.01%	0.01%
スウェーデン・クローナ	国債証券	2銘柄	0.71%	0.73%
デンマーク・クローネ	国債証券	3銘柄	0.60%	0.62%
ノルウェー・クローネ	国債証券	2銘柄	0.43%	0.44%
ポーランド・ズロチ	国債証券	3銘柄	0.34%	0.35%
マレーシア・リンギット	国債証券	2銘柄	0.52%	0.53%
メキシコ・ペソ	国債証券	5銘柄	2.84%	2.92%
ユーロ	国債証券	25銘柄	56.38%	57.96%
南アフリカ・ランド	国債証券	2銘柄	0.53%	0.55%

(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26年11月20日現在)	(平成27年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,239,063,428	9,323,403,847
投資証券	354,462,819,642	424,592,330,100
未収入金	590,203,169	417,174,743
未収配当金	1,502,851,492	2,152,397,633
流動資産合計	365,794,937,731	436,485,306,323
資産合計	365,794,937,731	436,485,306,323
負債の部		
流動負債		
未払金	1,810,356,226	1,232,366,374
未払解約金	2,451,852,262	1,167,032,514
流動負債合計	4,262,208,488	2,399,398,888
負債合計	4,262,208,488	2,399,398,888
純資産の部		
元本等		
元本	193,917,740,152	219,638,777,996
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	167,614,989,091	214,447,129,439
純資産合計	361,532,729,243	434,085,907,435
負債純資産合計	365,794,937,731	436,485,306,323

## 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26年11月20日現在）	（平成27年5月20日現在）
1. 受益権総口数	193,917,740,152口	219,638,777,996口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8644円 (18,644円)	1.9764円 (19,764円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成26年5月21日 至 平成26年11月20日）	（自 平成26年11月21日 至 平成27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26年11月20日現在）	（平成27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26年11月20日現在	平成27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	10,291,359,023	2,093,534,426
合計	10,291,359,023	2,093,534,426

## （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26年11月20日現在）	（平成27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	192,372,970,484円	193,917,740,152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	68,053,457,439円	80,431,206,099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	66,508,687,771円	54,710,168,255円

元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイJ-REITファンド（毎月決算型）	142,003,318,234円	162,141,488,667円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	37,514,601円	30,022,316円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	11,971,033円	8,840,967円
ニッセイJ-REITファンド（適格機関投資家限定）	9,556,268,778円	9,309,605,274円
ニッセイJリートオープン（毎月分配型）	37,886,968,913円	42,382,113,664円
ニッセイJリートオープン（年1回決算型）	2,854,338,266円	2,905,298,859円
ニッセイJ-REITファンド（年1回決算型）	1,567,360,327円	2,861,408,249円
計	193,917,740,152円	219,638,777,996円

附属明細表（平成27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	GLP投資法人	79,650	9,645,615,000	
	MIDリート投資法人	23	8,119,000	
	いちご不動産投資法人	58,486	5,252,042,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	13,339	14,632,883,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	59,324	17,702,281,600	
	イオンリート投資法人	42,894	6,888,776,400	
	インベスコ・オフィス・Jリート投資法人	5,256	549,777,600	
	インヴィンシブル投資法人	134,404	8,601,856,000	
	オリックス不動産投資法人	98,358	17,497,888,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	15,811	6,482,510,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	20,339	13,098,316,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	16,145	5,618,460,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	3,150	960,750,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8,238	2,133,642,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	172,395	14,912,167,500	
	ジャパンエクセレント投資法人	32,458	5,092,660,200	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	34,489	19,762,197,000	
トップリート投資法人	10,760	5,595,200,000		

ヒューリックリート投資法人	55,078	9,903,024,400	
フロンティア不動産投資法人	27,657	16,151,688,000	
プレミア投資法人	8,779	5,811,698,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	94,191	17,999,900,100	
阪急リート投資法人	32,227	4,956,512,600	
産業ファンド投資法人	26,803	15,518,937,000	
森トラスト総合リート投資法人	52,963	11,890,193,500	
森ヒルズリート投資法人	88,542	14,210,991,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,855	2,669,345,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	28,440	3,805,272,000	
積水ハウス・リート投資法人	21,555	2,965,968,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	28,271	7,746,254,000	
大和ハウスリート投資法人	15,646	8,261,088,000	
大和証券オフィス投資法人	14,915	9,053,405,000	
東急リアル・エステート投資法人	27,705	4,366,308,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	16,461	7,794,283,500	
日本ビルファンド投資法人	40,052	23,390,368,000	
日本プライムリアルティ投資法人	32,126	13,508,983,000	
日本プロロジスリート投資法人	58,536	14,692,536,000	
日本ヘルスケア投資法人	3,831	1,014,831,900	
日本リート投資法人	2,258	745,140,000	
日本リテールファンド投資法人	102,063	25,862,764,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	47,998	12,498,679,200	
日本賃貸住宅投資法人	60,236	4,722,502,400	
福岡リート投資法人	16,639	3,570,729,400	
平和不動産リート投資法人	37,804	3,663,207,600	
野村不動産オフィスファンド投資法人	21,197	11,637,153,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	77,726	11,464,585,000	
野村不動産レジデンシャル投資法人	413	280,840,000	
投資証券 合計	1,847,486	424,592,330,100	
合計	1,847,486	424,592,330,100	

## 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26年11月20日現在)	(平成27年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	13,373,148	52,873,815
コール・ローン	78,761,244	113,520,998
投資証券	3,883,879,055	4,692,667,569
未収入金	81,184,261	164,518
未収配当金	8,642,035	10,611,211
流動資産合計	4,065,839,743	4,869,838,111
資産合計	4,065,839,743	4,869,838,111
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	499,025	-
未払解約金	39,177,501	37,806,161
流動負債合計	39,676,526	37,806,161
負債合計	39,676,526	37,806,161
純資産の部		
元本等		
元本	3,845,244,746	4,302,006,364
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	180,918,471	530,025,586
純資産合計	4,026,163,217	4,832,031,950
負債純資産合計	4,065,839,743	4,869,838,111

## 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26年11月20日現在）	（平成27年5月20日現在）
1. 受益権総口数	3,845,244,746口	4,302,006,364口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0470円 (10,470円)	1.1232円 (11,232円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成26年5月21日 至 平成26年11月20日）	（自 平成26年11月21日 至 平成27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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27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	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
------------	--	---

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成26年11月20日現在	平成27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）
投資信託受益証券	192,399,732	178,537,483
合計	192,399,732	178,537,483

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## デリバティブ取引

## 通貨関連

種類	(平成26年11月20日 現在)				(平成27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	67,055,708	-	67,554,733	499,025	-	-	-	-
アメリカ・ドル	51,816,001	-	52,288,348	472,347	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	11,397,366	-	11,406,336	8,970	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	2,611,795	-	2,621,786	9,991	-	-	-	-
南アフリカ・ランド	1,230,546	-	1,238,263	7,717	-	-	-	-
合計	67,055,708	-	67,554,733	499,025	-	-	-	-

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

２．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27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	2,868,114,456円	3,845,244,746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	2,197,077,333円	2,057,077,821円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	1,219,947,043円	1,600,316,203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）	1,820,812,308円	1,549,110,962円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	33,296,857円	27,029,209円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	10,625,497円	7,953,947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	1,980,510,084円	2,717,837,861円
ニッセイターゲットデートファンド（適格機関投資家限定）	- 円	74,385円
計	3,845,244,746円	4,302,006,364円

附属明細表（平成27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	2,700.00	85,131.00	
		AGREE REALTY CORP	400.00	12,412.00	
		ALEXANDER'S INC	100.00	42,300.00	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,600.00	245,778.00	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,400.00	57,050.00	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	4,100.00	160,802.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2,800.00	46,900.00	
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	34,900.00	322,127.00	
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	900.00	17,271.00	
APARTMENT INVT & MGMT CO - A	7,400.00	280,386.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1,100.00	11,539.00	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1,900.00	30,761.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,600.00	50,288.00	
ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	2,800.00	79,912.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,800.00	804,576.00	
BIOMED REALTY TRUST INC	7,100.00	150,946.00	
BOSTON PROPERTIES INC	5,700.00	760,323.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	8,000.00	116,240.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5,300.00	131,334.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,300.00	250,206.00	
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	5,400.00	33,426.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,200.00	148,830.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	5,200.00	36,244.00	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	8,800.00	66,704.00	
CHATHAM LODGING TRUST	1,700.00	48,552.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,200.00	103,008.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,000.00	109,360.00	
CORESITE REALTY CORP	1,300.00	62,348.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,200.00	111,720.00	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	4,499.00	159,624.52	
COUSINS PROPERTIES INC	8,304.00	83,787.36	
CUBESMART	6,300.00	153,783.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	3,600.00	121,608.00	
DDR CORP	11,908.00	207,913.68	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	9,114.00	123,130.14	

DIGITAL REALTY TRUST INC	5,200.00	342,680.00	
DOUGLAS EMMETT INC	5,400.00	159,300.00	
DUKE REALTY CORP	14,100.00	283,128.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	2,700.00	86,265.00	
EASTGROUP PROPERTIES	1,200.00	69,432.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	1,666.00	55,427.82	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	4,700.00	85,070.00	
EPR PROPERTIES	2,300.00	136,804.00	
EQUITY COMMONWEALTH	4,000.00	106,280.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,900.00	157,673.00	
EQUITY ONE INC	2,200.00	55,572.00	
EQUITY RESIDENTIAL	13,400.00	999,908.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,400.00	537,720.00	
EXCEL TRUST INC	3,000.00	47,850.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,100.00	291,674.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,500.00	341,275.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,200.00	106,028.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2,500.00	27,025.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	2,600.00	30,550.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,900.00	144,963.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	24,281.00	694,679.41	
GEO GROUP INC/THE	3,100.00	117,459.00	
GETTY REALTY CORP	400.00	6,908.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	800.00	14,240.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	1,600.00	31,504.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	2,275.00	61,197.50	
HCP INC	16,700.00	665,161.00	
HEALTH CARE REIT INC	13,000.00	930,410.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,300.00	80,652.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	4,450.00	112,140.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,600.00	69,430.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,600.00	154,044.00	
HOME PROPERTIES INC	1,700.00	127,772.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	6,600.00	204,666.00	

HOST HOTELS AND RESORTS INC	30,465.00	627,883.65	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2,600.00	80,028.00	
INLAND REAL ESTATE CORP	4,000.00	41,560.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4,400.00	32,384.00	
KILROY REALTY CORP	3,100.00	219,015.00	
KIMCO REALTY CORP	16,200.00	396,738.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	3,000.00	81,270.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,600.00	208,936.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	8,953.00	83,621.02	
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,500.00	200,200.00	
LTC PROPERTIES INC	1,000.00	42,380.00	
MACERICH CO/THE	5,419.00	450,156.33	
MACK-CALI REALTY CORP	3,700.00	65,046.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,000.00	110,320.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,600.00	199,602.00	
MONMOUTH REIT -CL A	1,400.00	13,790.00	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	5,400.00	51,570.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4,700.00	181,984.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,100.00	74,415.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	4,300.00	69,832.00	
NEW YORK REIT INC	4,300.00	39,646.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,240.00	227,011.20	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	500.00	11,245.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	4,400.00	78,540.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,600.00	154,260.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	4,300.00	97,395.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	2,000.00	33,380.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	4,900.00	87,367.00	
POST PROPERTIES INC	1,500.00	86,370.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1,400.00	15,820.00	
PROLOGIS INC	19,728.00	799,970.40	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	400.00	30,508.00	
PUBLIC STORAGE	5,100.00	1,005,465.00	

RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3,000.00	52,590.00	
REALTY INCOME CORP	8,534.00	403,743.54	
REGENCY CENTERS CORP	3,600.00	234,252.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	3,700.00	61,013.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	7,500.00	116,775.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1,800.00	26,820.00	
RLJ LODGING TRUST	5,900.00	180,599.00	
ROUSE PROPERTIES INC	3,050.00	53,863.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	2,900.00	79,286.00	
SAUL CENTERS INC	600.00	31,608.00	
SELECT INCOME REIT	400.00	9,388.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	7,400.00	149,036.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	11,625.00	2,139,348.75	
SL GREEN REALTY CORP	3,700.00	445,369.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	1,200.00	110,460.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	15,600.00	174,408.00	
STAG INDUSTRIAL INC	2,500.00	55,400.00	
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	900.00	23,436.00	
STORE CAPITAL CORP	1,300.00	28,379.00	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC	13,500.00	168,885.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,900.00	65,905.00	
SUN COMMUNITIES INC	2,300.00	144,762.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	10,383.00	162,701.61	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3,000.00	102,930.00	
TAUBMAN CENTERS INC	2,500.00	187,800.00	
TERRENO REALTY CORP	1,100.00	22,902.00	
UDR INC	9,100.00	299,663.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	400.00	19,716.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	2,991.00	66,370.29	
URSTADT BIDDLE - CL A	500.00	10,325.00	
VENTAS INC	11,917.00	824,775.57	
VORNADO REALTY TRUST	6,582.00	671,824.74	
WASHINGTON REAL ESTATE INV	2,500.00	63,950.00	

	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	4,800.00	165,264.00	
	WHITESTONE REIT	700.00	10,150.00	
	WP CAREY INC	3,400.00	215,730.00	
	WP GLIMCHER INC	6,941.00	100,991.55	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,300.00	122,695.00	
アメリカ・ドル 小計		724,825.00	26,262,032.08 (3,176,130,160)	
イギリス・ポンド	ASSURA PLC	41,373.00	23,872.22	
	BIG YELLOW GROUP PLC	5,218.00	36,682.54	
	BRITISH LAND CO PLC	40,775.00	361,266.50	
	DERWENT LONDON PLC	3,965.00	146,784.30	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	12,635.00	110,619.42	
	HAMMERSON PLC	31,591.00	222,242.68	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	18,137.00	21,583.03	
	INTU PROPERTIES PLC	40,317.00	142,762.49	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	30,099.00	410,249.37	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	17,526.00	29,671.51	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	2,426.00	5,943.70	
	MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	1,367.00	6,479.58	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	2,337.00	9,207.78	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	32,426.00	18,936.78	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	13,266.00	37,940.76	
	SEGRO PLC	32,556.00	139,144.34	
SHAFTESBURY PLC	9,212.00	83,184.36		
WORKSPACE GROUP PLC	4,252.00	38,055.40		
イギリス・ポンド 小計		339,478.00	1,844,626.76 (345,812,179)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	15,793.00	45,483.84	
	ALE PROPERTY GROUP	4,432.00	16,620.00	
	ARENA REIT	15,368.00	27,355.04	
	BWP TRUST	27,504.00	83,887.20	
	CHARTER HALL GROUP	11,504.00	56,599.68	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	12,690.00	55,709.10	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	54,189.00	57,982.23	
	DEXUS PROPERTY GROUP	38,623.00	286,582.66	
	FEDERATION CENTRES	64,170.00	193,793.40	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	7,297.00	15,907.46	
	GOODMAN GROUP	63,047.00	391,521.87	
	GPT GROUP	62,254.00	275,785.22	



	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	4,632.00	14,776.08	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	13,153.00	34,986.98	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	75,847.00	30,338.80	
	INVESTA OFFICE FUND	26,170.00	100,231.10	
	MIRVAC GROUP	144,504.00	281,060.28	
	NATIONAL STORAGE REIT	11,236.00	17,809.06	
	NOVION PROPERTY GROUP	95,477.00	239,647.27	
	SCENTRE GROUP	209,745.00	813,810.60	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	33,821.00	70,685.89	
	STOCKLAND	94,656.00	405,127.68	
	TRAFALGAR CORPORATE GROUP	16,383.00	18,021.30	
	WESTFIELD CORP	76,066.00	691,439.94	
	オーストラリア・ドル 小計	1,178,561.00	4,225,162.68 (404,052,307)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	500.00	18,950.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1,900.00	27,341.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	200.00	11,950.00	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTI-U	600.00	16,530.00	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	1,400.00	41,454.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,100.00	58,464.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	300.00	13,272.00	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCE	3,500.00	40,320.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	1,000.00	11,140.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1,600.00	29,744.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1,800.00	23,130.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,800.00	47,934.00	
	Dream Global Real Estate Investment Trust	1,300.00	13,026.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	400.00	16,760.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	5,100.00	115,719.00	

	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	4,000.00	22,240.00	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1,400.00	18,984.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	500.00	8,570.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	500.00	12,645.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	2,800.00	13,916.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,800.00	139,344.00	
カナダ・ドル 小計		37,500.00	701,433.00 (69,315,609)	
シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	15,600.00	23,010.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	26,000.00	18,070.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	75,000.00	187,500.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	10,000.00	12,750.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	19,000.00	22,040.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	47,000.00	33,605.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	85,000.00	139,400.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	91,000.00	201,110.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	38,000.00	66,500.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	20,000.00	33,900.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	21,000.00	17,115.00	
	FIRST REAL ESTATE INV T TRUST	16,000.00	23,040.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	13,000.00	27,040.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	25,600.00	39,424.00	
	KEPPEL DC REIT	30,000.00	31,800.00	
	KEPPEL REIT	66,000.00	79,200.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	51,000.00	18,360.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	54,000.00	83,430.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	90,000.00	94,500.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	33,000.00	52,470.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	65,000.00	78,325.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	7,000.00	16,590.00	
STARHILL GLOBAL REIT	35,000.00	30,450.00		
SUNTEC REIT	98,000.00	174,930.00		

シンガポール・ドル 小計		1,031,200.00	1,504,559.00 (136,237,817)	
トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	103,952.00	340,962.56	
	HALK GAYRIMENKUL YATRM ORTAK	11,213.00	14,576.90	
	IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	64,878.00	120,024.30	
	SAF GAYRIMENKUL YATIRIM ORTA	32,035.00	35,558.85	
	SINPAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	42,450.00	33,960.00	
	TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	24,080.00	104,025.60	
	VAKIF GAYRIMENKUL YATIRIM	8,318.00	22,209.06	
トルコ・リラ 小計		286,926.00	671,317.27 (31,249,819)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	24,197.00	27,584.58	
ニュージーランド・ドル 小計		24,197.00	27,584.58 (2,452,269)	
メキシコ・ペソ	ASESOR DE ACTIVOS PRISMA SAP	16,200.00	239,436.00	
	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	10,500.00	390,075.00	
	CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA	30,700.00	612,772.00	
	FIBRA SHOP PORTAFOLIOS INMOB	35,400.00	611,712.00	
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	87,000.00	3,400,830.00	
	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	47,200.00	1,078,992.00	
	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIAL	35,500.00	1,078,490.00	
	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	14,400.00	377,136.00	
メキシコ・ペソ 小計		276,900.00	7,789,443.00 (61,926,072)	
ユーロ	AEDIFICA	1.00	60.16	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,773.00	22,538.37	
	BEFIMMO S.C.A.	398.00	24,329.74	
	BENI STABILI SPA	52,185.00	36,999.16	
	COFINIMMO	486.00	48,546.54	
	EUROCOMMERCIAL-CVA	1,682.00	66,943.60	
	FONCIERE DES REGIONS	1,972.00	166,910.08	

	GECINA SA	1,312.00	163,737.60	
	GREEN REIT PLC	20,000.00	33,340.00	
	HIBERNIA REIT PLC-W/I	19,000.00	24,415.00	
	ICADE	1,270.00	92,621.10	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	35,100.00	28,957.50	
	KLEPIERRE	8,281.00	359,478.21	
	MERCIALYS	1,671.00	36,862.26	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	2,300.00	27,347.00	
	NSI NV	6,889.00	27,142.66	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,834.00	950,448.60	
	VASTNED RETAIL NV	708.00	30,330.72	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	258.00	17,510.46	
	WERELDHAVE NV	1,385.00	78,418.70	
ユーロ 小計		160,505.00	2,236,937.46 (300,979,935)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	38,000.00	169,100.00	
	FORTUNE REIT	48,000.00	378,720.00	
	LINK REIT	82,000.00	3,858,100.00	
	PROSPERITY REIT	40,000.00	114,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	23,000.00	89,700.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	400.00	1,744.00	
香港・ドル 小計		231,400.00	4,612,164.00 (71,949,758)	
南アフリカ・ランド	CAPITAL PROPERTY FUND	55,993.00	824,216.96	
	DELTA PROPERTY FUND LTD	18,650.00	171,580.00	
	EMIRA PROPERTY FUND	16,616.00	302,909.68	
	FOUNTAINHEAD PROPERTY TRUST	6,044.00	56,209.20	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	93,049.00	2,436,022.82	
	HOSPITALITY PROPERTY FUND-A	6,489.00	100,579.50	
	HYPROP INVESTMENTS LTD- UTS	8,228.00	1,041,006.56	
	OCTODEC INVESTMENTS LTD	9,187.00	250,437.62	
	REBOSIS PROPERTY FUND LTD	19,070.00	237,421.50	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	147,983.00	1,673,687.73	
	RESILIENT PROPERTY INCOME	13,287.00	1,293,622.32	

	SA CORPORATE REAL ESTATE FUND	40,368.00	192,959.04	
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	28,073.00	538,720.87	
	南アフリカ・ランド 小計	463,037.00	9,119,373.80 (92,561,644)	
投資証券	合計		4,692,667,569 (4,692,667,569)	
合計			4,692,667,569 (4,692,667,569)	

(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 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 140銘柄	65.73%	67.68%
イギリス・ポンド	投資証券 18銘柄	7.16%	7.37%
オーストラリア・ドル	投資証券 24銘柄	8.36%	8.61%
カナダ・ドル	投資証券 21銘柄	1.43%	1.48%
シンガポール・ドル	投資証券 24銘柄	2.82%	2.90%
トルコ・リラ	投資証券 7銘柄	0.65%	0.67%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	0.05%	0.05%
メキシコ・ペソ	投資証券 8銘柄	1.28%	1.32%
ユーロ	投資証券 20銘柄	6.23%	6.41%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	1.49%	1.53%
南アフリカ・ランド	投資証券 13銘柄	1.92%	1.97%

(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

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。

## 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27年6月30日現在）

資産総額	258,640,158円
負債総額	78,070円
純資産総額（ - ）	258,562,088円
発行済数量	258,015,091口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0021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27年6月30日現在）

資産総額	78,408,353円
負債総額	1,368,750円
純資産総額（ - ）	77,039,603円
発行済数量	63,059,374口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2217円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

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

##### （1）資本金の額

平成27年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年間における資本金の増減はありません。

##### （2）委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

平成27年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	270	39,937
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	33	4,924
単位型公社債投資信託	3	278
合計	306	45,139

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26年4月1日 至平成27年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

固定資産合計	32,866,731	37,262,784
資産合計	45,848,971	51,445,314
負債の部		
流動負債		
預り金	29,930	33,209
未払償還金	137,842	137,094
未払手数料	711,826	995,185
未払運用委託報酬	508,934	655,766
未払投資助言報酬	310,490	410,223
その他未払金	248,117	324,326
未払費用	79,355	97,490
未払法人税等	1,283,286	1,556,244
賞与引当金	769,569	787,638
その他	168,940	498,615
流動負債合計	4,248,293	5,495,794
固定負債		
退職給付引当金	1,106,561	1,253,790
役員退職慰労引当金	19,950	25,400
繰延税金負債	-	13,483
固定負債合計	1,126,511	1,292,673
負債合計	5,374,805	6,788,467
純資産の部		
株主資本		
資本金	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000

繰越利益剰余金	20,276,469	23,998,814
利益剰余金合計	20,956,276	24,678,621
株主資本合計	39,238,116	42,960,461
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,236,049	1,696,385
評価・換算差額等合計	1,236,049	1,696,385
純資産合計	40,474,166	44,656,846
負債・純資産合計	45,848,971	51,445,314

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

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

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,857,904	3,857,904	3,857,904
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,722,344	3,722,344	3,722,344
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	3,857,904
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	460,336	460,336	460,336
当期変動額合計	460,336	460,336	4,182,680
当期末残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846

## 注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法(定額法)によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>



3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．リース取引の処理方法	平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## (貸借対照表関係)

1．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。		
	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	254,648千円	272,378千円
車両	6,004	6,425
器具備品	520,399	481,704
計	781,053	760,508

## (損益計算書関係)

1．役員報酬の限度額は以下のとおりであります。	
取締役	180,000千円
監査役	40,000千円
2．事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。	

## 3. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
器具備品	8,924千円	4,128千円
その他	-	3,914
計	8,924	8,042

## 4. 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
関係会社からの受取配当金	-	41,126千円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

平成25年6月24日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成26年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26日

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				

普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

平成26年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成26年3月31日

効力発生日 平成26年6月26日

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

平成27年6月25日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

## (リース取引関係)

## 1. ファイナンス・リース取引

## 所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

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

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

(単位：千円)

	当事業年度(平成27年3月31日)		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	-	-	-

未経過リース料期末残高相当額等

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1年内	107	-
1年超	-	-
合計	107	-

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

支払リース料	186	108
減価償却費相当額	172	100
支払利息相当額	6	1

## 減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

## 利息相当額の算定方法

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,509,845	1,509,845	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,626,076	4,632,360	6,283
その他有価証券	2,699,730	2,699,730	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,227,190	23,299,720	72,529
その他有価証券	7,864,894	7,864,894	-

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	3,488,730	3,488,730	-
有価証券			
満期保有目的の債券	5,209,385	5,215,010	5,624
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,414,879	22,498,520	83,640
その他有価証券	13,194,837	13,194,837	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 現金・預金

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

## 有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

## 投資有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成26年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	1,509,845	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,600,000	23,200,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
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。

当事業年度(平成27年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	3,488,730	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	5,200,000	22,400,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				

その他（注）	990,647	9,384,052	1,683,297	3,372
合計	9,679,377	31,784,052	1,683,297	3,372

（注）投資信託受益証券、国債であります。

（有価証券関係）

1．満期保有目的の債券

前事業年度（平成26年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
時価が貸借対照 表計上額を超え るもの	(1)国債・地方債等	26,554,298	26,634,680	80,381
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,554,298	26,634,680	80,381
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	1,298,967	1,297,400	1,567
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,298,967	1,297,400	1,567
合計		27,853,266	27,932,080	78,813

当事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
時価が貸借対照 表計上額を超え るもの	(1)国債・地方債等	26,620,113	26,710,130	90,016
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,620,113	26,710,130	90,016
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	1,004,151	1,003,400	751
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,004,151	1,003,400	751
合計		27,624,265	27,713,530	89,264

2．その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

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

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

当事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価または 償却原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	3,113,940	3,105,255	8,684
	国債・地方債等	3,113,940	3,105,255	8,684
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	7,809,441	5,421,939	2,387,501
	小計	10,923,381	8,527,195	2,396,186
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,900,070	1,902,293	2,223
	国債・地方債等	1,900,070	1,902,293	2,223
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	371,386	376,170	4,783
	小計	2,271,456	2,278,463	7,006
合計		13,194,837	10,805,658	2,389,179

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	1,249,329	366,068	-
合計	1,249,329	366,068	-

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

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。

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）



## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

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

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

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

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

## (2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	215,268 千円
----------------	------------

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,254千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	274,274 千円	260,708 千円
未払事業税	98,319	120,645
その他	33,928	36,064
繰延税金資産合計	406,523	417,418
繰延税金負債		
有価証券評価差額	19	-
繰延税金負債合計	19	-
繰延税金資産の純額	406,503	417,418
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	394,378	405,952

税務上の繰延資産償却超過額	7,110	4,573
役員退職慰労引当金	3,835	8,214
投資有価証券評価損	486,598	406,043
投資有価証券評価差額	4,898	2,266
その他	2,461	1,703
小計	899,283	828,753
評価性引当額	97,929	90,623
繰延税金資産合計	801,354	738,130
繰延税金負債		
特別分配金否認	92,089	56,555
投資有価証券評価差額	548,424	695,058
繰延税金負債合計	640,514	751,613
繰延税金資産(は負債)の純額	160,839	13,483

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、前事業年度の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%に、それぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が32,758千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が100,766千円、その他有価証券評価差額金が68,007千円、それぞれ増加しております。

#### （セグメント情報等）

##### 〔セグメント情報〕

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

##### 〔関連情報〕

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

#### 1. サービスごとの情報

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

#### 2. 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

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

##### （2）有形固定資産

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

#### 3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	3,851,374

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

#### 1. サービスごとの情報

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

#### 2. 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

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

##### （2）有形固定資産

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

#### 3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
-------	------

日本生命保険相互会社	4,553,051
------------	-----------

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引 )

## 1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	200,000	生命保険業	(被所有)直接90.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,829,599	未収運用受託報酬	767,087
								投資助言報酬の受取	676,352	未収投資助言報酬	158,782
								業務受託料の受取	47,100	-	-

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

## 2 親会社に関する注記

## 親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

## ( 1株当たり情報 )

	前事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	373,212円65銭	411,781円19銭

1株当たり当期純利益金額	19,727円63銭	35,573円77銭
--------------	------------	------------

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 5【その他】

### <訂正前>

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

### <訂正後>

定款の変更等

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

訴訟その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

平成27年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27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27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27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

Nippon Life Global Investors Americas, Inc.

##### b. 資本金の額

平成26年12月末現在 7,883,615米ドル(約950百万円、1米ドル=120.55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。

a. 名称

Nissay Schroders Asset Management Europe Limited

b. 資本金の額

平成26年12月末現在 1,750,000英ポンド(約327百万円、1英ポンド=187.03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。

a. 名称

Nippon Life Global Investors Singapore Limited

b. 資本金の額

平成26年12月末現在 1,000,000シンガポールドル(約91百万円、1シンガポールドル=91.15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。

## 2【関係業務の概要】

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」「2 関係業務の概要」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

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

(2) 販売会社

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

(3) その他の関係する法人(参考情報)

株式会社ニッセイ基礎研究所は委託会社に対し、「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。

Nippon Life Global Investors Americas, Inc. およびNissay Schroders Asset Management Europe Limited は委託会社に対し、「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。

Nippon Life Global Investors Singapore Limited は委託会社に対し、個別銘柄等に関する情報提供を行います



## 独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第20期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

平成27年7月13日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

松崎雅則

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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11月21日から平成27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27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27年7月13日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

松崎雅則

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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11月21日から平成27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27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](#)