

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年8月19日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 赤林 富二
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	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28年2月19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】

<訂正前>

委託会社の概況（平成27年12月末現在）

（略）

4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 宇治原 潔

（略）

（略）

<訂正後>

委託会社の概況（平成28年6月末現在）

（略）

4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 赤林 富二

（略）

（略）

2【投資方針】

（1）【投資方針】

<訂正前>

（略）

（参考）マザーファンドの概要

（略）

ニッセイJ-REITマザーファンド

（略）

（3）投資制限

（略）

デリバティブの直接利用は行いません。

ニッセイグローバルリートマザーファンド

(略)

(3) 投資制限

(略)

デリバティブの直接利用は行いません。

<訂正後>

(略)

(参考)マザーファンドの概要

(略)

ニッセイJ-REITマザーファンド

(略)

(3) 投資制限

(略)

デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対するエクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として35%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイグローバルリートマザーファンド

(略)

(3) 投資制限

(略)

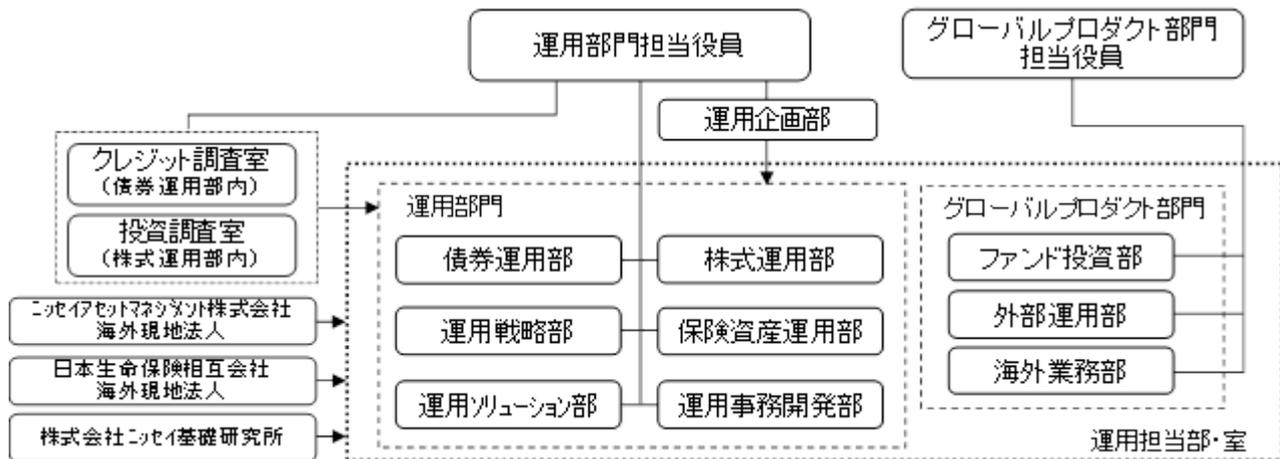
デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（３）【運用体制】

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

委託会社の組織体制



（略）

3【投資リスク】

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

（略）

（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28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	95.4	
ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド		89.9
ニッセイJ-REITマザーファンド		1.7
ニッセイグローバルリートマザーファンド		32.5

委託会社については実質保有比率が5%超のマザーファンドを記載しています。

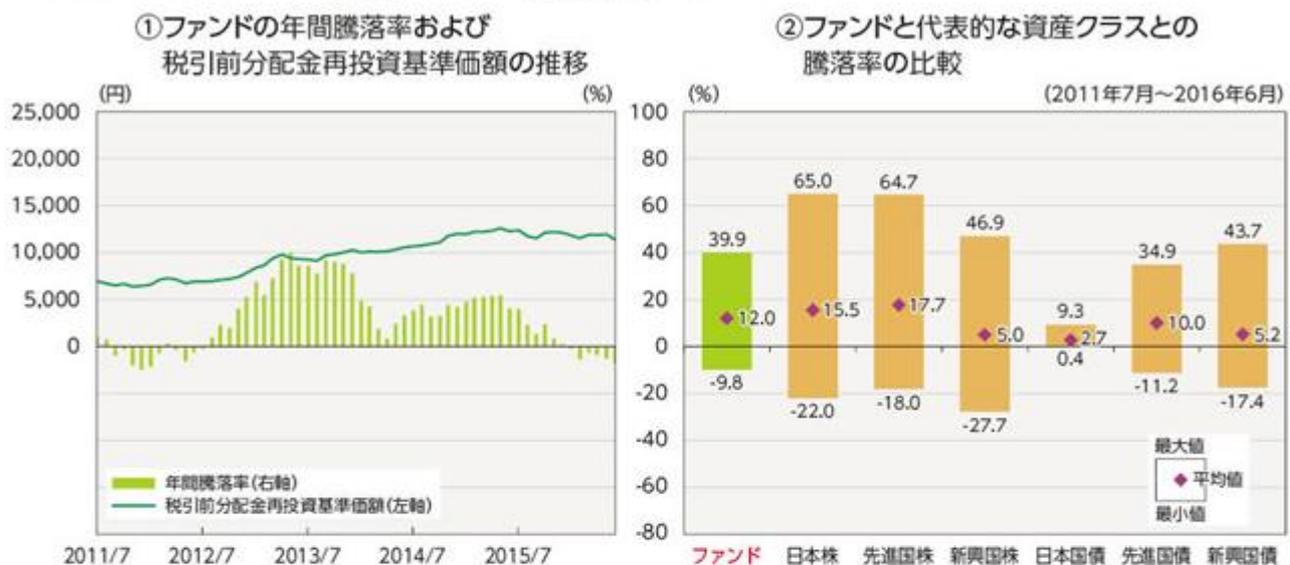
(2) 投資リスク管理体制

(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年間に於けるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

個人の課税の取扱い

（略）

<少額投資非課税制度について>

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）

<訂正後>

（略）

個人の課税の取扱い

（略）

<少額投資非課税制度について>

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）」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28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	181,167,157	100.00
内 日本	181,167,157	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,697	0.00
純資産総額	181,160,460	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28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	53,602,869	100.00
内 日本	53,602,869	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,777	0.00
純資産総額	53,601,092	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28年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	57,226,066,380	95.38
内 日本	57,226,066,380	95.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,770,669,095	4.62
純資産総額	59,996,735,475	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）	2,690,280,000	4.48
内 日本	2,690,280,000	4.48

（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28年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	512,834,650	92.45
内 アメリカ	316,296,185	57.02
内 イギリス	31,074,013	5.60
内 ドイツ	26,313,728	4.74
内 フランス	24,235,324	4.37
内 カナダ	18,694,497	3.37
内 スイス	16,148,992	2.91
内 オーストラリア	14,129,599	2.55
内 アイルランド	12,786,418	2.31
内 オランダ	9,683,125	1.75
内 シンガポール	9,251,830	1.67
内 イタリア	6,841,173	1.23
内 香港	6,731,304	1.21
内 オランダ領キュラソー	4,797,681	0.86
内 スペイン	3,987,168	0.72
内 バミューダ	3,088,320	0.56
内 スウェーデン	2,860,269	0.52
内 デンマーク	2,747,103	0.50
内 ジェージョー	1,672,316	0.30
内 イスラエル	863,766	0.16
内 ケイマン諸島	631,839	0.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	41,874,326	7.55
純資産総額	554,708,976	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）	31,903,386	5.75
内 アメリカ	31,903,386	5.75

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

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

（参考情報）

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

（平成28年6月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	18,231,566,842	94.29
内 日本	18,231,566,842	94.29

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,103,250,788	5.71
純資産総額	19,334,817,630	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）	917,520,000	4.75
内 日本	917,520,000	4.75

（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28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	19,336,221,371	98.51
内 アメリカ	7,042,506,342	35.88
内 フランス	4,403,148,378	22.43
内 ドイツ	1,862,577,914	9.49
内 イタリア	1,691,803,663	8.62
内 イギリス	1,258,120,627	6.41
内 スペイン	812,790,809	4.14
内 オーストラリア	430,550,981	2.19
内 カナダ	394,211,078	2.01
内 ベルギー	357,602,768	1.82
内 メキシコ	250,519,837	1.28
内 アイルランド	167,906,971	0.86
内 スウェーデン	143,220,288	0.73
内 デンマーク	121,993,389	0.62
内 南アフリカ	96,482,656	0.49
内 マレーシア	91,007,654	0.46
内 ノルウェー	78,142,630	0.40
内 シンガポール	72,293,411	0.37
内 ポーランド	60,149,925	0.31
内 スイス	1,192,050	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	291,635,536	1.49
純資産総額	19,627,856,907	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28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	364,495,733,400	95.75
内 日本	364,495,733,400	95.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	16,159,650,341	4.25
純資産総額	380,655,383,741	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28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	4,707,354,654	97.49
内 アメリカ	3,372,598,429	69.84
内 オーストラリア	414,014,568	8.57
内 イギリス	217,921,930	4.51
内 フランス	203,268,711	4.21
内 シンガポール	125,256,714	2.59
内 南アフリカ	71,063,979	1.47
内 香港	70,464,328	1.46
内 カナダ	63,499,396	1.32
内 メキシコ	57,249,586	1.19
内 トルコ	24,285,639	0.50
内 オランダ	22,964,047	0.48
内 ベルギー	21,481,851	0.44
内 スペイン	12,944,372	0.27
内 ドイツ	9,043,164	0.19
内 アイルランド	7,563,923	0.16
内 イタリア	6,074,782	0.13
内 ニュージーランド	3,618,219	0.07
内 ガーンジー	2,084,213	0.04
内 マン島	1,956,803	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	121,352,034	2.51
純資産総額	4,828,706,688	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28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	27,682,641	1.4677 40,629,842	1.4826 41,042,283	- -	22.66%
2	ニッセイJ-REITマ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	20,064,595	2.0270 40,672,909	2.0269 40,668,927	- -	22.45%
3	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	20,668,595	1.9886 41,103,570	1.9258 39,803,580	- -	21.97%
4	ニッセイグローバルリート マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	19,736,543	1.0257 20,245,728	1.0274 20,277,324	- -	11.19%
5	ニッセイ外国債券アクティ ブマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	7,962,035	2.5373 20,202,837	2.4875 19,805,562	- -	10.93%
6	ニッセイ外国株マザーファ ンド 日本	親投資信託 受益証券	17,412,120	1.1505 20,034,333	1.1239 19,569,481	- -	10.80%

(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28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	8,191,603	1.4607 11,965,925	1.4826 12,144,870	- -	22.66%
2	ニッセイJ-REITマ ザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	5,937,880	2.0704 12,294,252	2.0269 12,035,488	- -	22.45%
3	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	6,115,296	2.0804 12,722,653	1.9258 11,776,837	- -	21.97%
4	ニッセイグローバルリート マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	5,838,803	1.0364 6,051,901	1.0274 5,998,786	- -	11.19%
5	ニッセイ外国債券アクティ ブマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,354,138	2.6125 6,150,398	2.4875 5,855,918	- -	10.92%
6	ニッセイ外国株マザーファ ンド 日本	親投資信託 受益証券	5,152,567	1.1984 6,175,025	1.1239 5,790,970	- -	10.80%

(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)

「ニッセイ日本株 マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(平成28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	369,700	5,562.00 2,056,271,400	5,052.00 1,867,724,400	- -	3.11%
2	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	346,200	4,800.00 1,661,760,000	4,800.00 1,661,760,000	- -	2.77%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	197,800	6,100.58 1,206,695,400	5,789.00 1,145,064,200	- -	1.91%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	2,441,000	533.10 1,301,297,100	455.90 1,112,851,900	- -	1.85%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	350,700	3,146.00 1,103,302,200	3,113.00 1,091,729,100	- -	1.82%
6	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	608,500	1,487.50 905,143,750	1,600.00 973,600,000	- -	1.62%
7	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	52,200	19,270.00 1,005,894,000	18,125.00 946,125,000	- -	1.58%
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	314,400	3,430.00 1,078,392,000	2,926.00 919,934,400	- -	1.53%
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	5,900,700	170.80 1,007,839,560	148.30 875,073,810	- -	1.46%
10	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	312,600	2,676.50 836,673,900	2,766.50 864,807,900	- -	1.44%
11	中部電力 日本	株式 電気・ガス業	524,400	1,496.06 784,535,700	1,448.50 759,593,400	- -	1.27%
12	オリックス 日本	株式 その他金融業	558,300	1,534.50 856,711,350	1,308.00 730,256,400	- -	1.22%
13	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	169,800	4,397.00 746,610,600	4,103.00 696,689,400	- -	1.16%
14	TDK 日本	株式 電気機器	120,800	6,220.00 751,376,000	5,670.00 684,936,000	- -	1.14%
15	第一生命保険 日本	株式 保険業	582,700	1,378.00 802,960,600	1,127.00 656,702,900	- -	1.09%

16	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,523,000	500.00 761,500,000	423.90 645,599,700	- -	1.08%
17	A N Aホールディングス 日本	株式 空運業	2,137,000	324.50 693,456,500	291.20 622,294,400	- -	1.04%
18	ヤマダ電機 日本	株式 小売業	1,147,400	501.00 574,847,400	540.00 619,596,000	- -	1.03%
19	損保ジャパン日本興亜ホールディングス 日本	株式 保険業	220,300	3,044.00 670,593,200	2,698.50 594,479,550	- -	0.99%
20	日本軽金属ホールディングス 日本	株式 非鉄金属	2,604,100	215.00 559,881,500	226.00 588,526,600	- -	0.98%
21	花王 日本	株式 化学	97,800	6,035.00 590,223,000	5,929.00 579,856,200	- -	0.97%
22	田辺三菱製薬 日本	株式 医薬品	311,900	1,831.00 571,088,900	1,843.00 574,831,700	- -	0.96%
23	クラレ 日本	株式 化学	472,800	1,440.00 680,832,000	1,215.00 574,452,000	- -	0.96%
24	N I P P O 日本	株式 建設業	327,000	1,948.00 636,996,000	1,740.00 568,980,000	- -	0.95%
25	鹿島建設 日本	株式 建設業	800,000	733.00 586,400,000	708.00 566,400,000	- -	0.94%
26	日本製紙 日本	株式 パルプ・紙	310,200	1,949.00 604,579,800	1,787.00 554,327,400	- -	0.92%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	168,900	3,650.00 616,485,000	3,269.00 552,134,100	- -	0.92%
28	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	212,400	2,948.00 626,155,200	2,572.50 546,399,000	- -	0.91%
29	三菱UFJリース 日本	株式 その他金融業	1,395,900	473.00 660,260,700	390.00 544,401,000	- -	0.91%
30	小野薬品工業 日本	株式 医薬品	122,500	5,090.20 623,550,700	4,432.00 542,920,000	- -	0.90%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
株式	国内	電気機器	9.33
		銀行業	8.61
		情報・通信業	7.99
		輸送用機器	7.74
		化学	6.80
		建設業	5.11

	医薬品	4.80
	陸運業	4.70
	小売業	4.38
	食料品	3.57
	保険業	3.31
	電気・ガス業	2.94
	機械	2.61
	その他金融業	2.35
	卸売業	2.28
	空運業	1.93
	非鉄金属	1.93
	パルプ・紙	1.88
	サービス業	1.87
	石油・石炭製品	1.57
	繊維製品	1.54
	ゴム製品	1.39
	その他製品	1.35
	ガラス・土石製品	1.22
	不動産業	1.11
	倉庫・運輸関連業	0.93
	水産・農林業	0.79
	鉱業	0.65
	精密機器	0.61
	鉄鋼	0.06
	金属製品	0.03
	小計	95.38
合計（対純資産総額比）		95.38

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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 2809月	買建	216	2,883,268,640	2,690,280,000	4.48%

（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28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	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	2,682	4,978.78 13,353,103	4,833.68 12,963,937	- -	2.34%
2	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	163	71,662.84 11,681,044	70,401.75 11,475,486	- -	2.07%
3	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	902	11,715.29 10,567,198	12,280.24 11,076,785	- -	2.00%
4	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品 小売り	653	14,686.96 9,590,589	16,165.10 10,555,812	- -	1.90%
5	REYNOLDS AMERICAN INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバ コ	1,841	5,115.65 9,417,922	5,442.90 10,020,397	- -	1.81%
6	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	9,694.12 9,471,157	9,714.70 9,491,265	- -	1.71%
7	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバ コ	1,414	5,655.43 7,996,781	6,496.96 9,186,709	- -	1.66%
8	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	1,650	5,178.43 8,544,411	5,201.07 8,581,767	- -	1.55%
9	TORONTO-DOMINION BANK カナダ	株式 銀行	1,789	4,477.40 8,010,075	4,419.31 7,906,159	- -	1.43%
10	S&P GLOBAL INC アメリカ	株式 各種金融	695	11,070.03 7,693,674	10,908.45 7,581,379	- -	1.37%
11	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	742	9,273.21 6,880,729	9,515.05 7,060,173	- -	1.27%
12	BROADCOM LTD シンガポール	株式 半導体・半導体製 造装置	441	14,689.37 6,478,013	15,951.04 7,034,413	- -	1.27%
13	STARBUCKS CORP アメリカ	株式 消費者サービス	1,117	5,613.74 6,270,548	5,839.11 6,522,289	- -	1.18%

14	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	538	11,859.01 6,380,150	11,748.20 6,320,534	- -	1.14%
15	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	1,421	4,028.37 5,724,318	4,377.79 6,220,841	- -	1.12%
16	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	597	10,122.22 6,042,969	10,148.98 6,058,943	- -	1.09%
17	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC スイス	株式 食品・飲料・タバコ	10	641,149.40 6,411,494	605,203.20 6,052,032	- -	1.09%
18	CBOE HOLDINGS INC アメリカ	株式 各種金融	885	6,513.17 5,764,158	6,766.33 5,988,204	- -	1.08%
19	MSCI INC アメリカ	株式 各種金融	775	7,798.14 6,043,562	7,708.98 5,974,465	- -	1.08%
20	BCE INC カナダ	株式 電気通信サービス	1,158	4,773.40 5,527,602	4,843.42 5,608,687	- -	1.01%
21	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	1,763	3,021.43 5,326,794	3,143.90 5,542,696	- -	1.00%
22	BLACKROCK INC アメリカ	株式 各種金融	157	36,077.15 5,664,113	34,653.91 5,440,664	- -	0.98%
23	CMS ENERGY CORP アメリカ	株式 公益事業	1,152	4,201.81 4,840,491	4,614.48 5,315,886	- -	0.96%
24	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	933	5,362.48 5,003,197	5,666.22 5,286,587	- -	0.95%
25	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS イギリス	株式 エネルギー	1,821	2,302.44 4,192,761	2,793.80 5,087,519	- -	0.92%
26	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	375	13,320.32 4,995,120	13,107.64 4,915,367	- -	0.89%
27	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	616	7,911.72 4,873,620	7,897.31 4,864,745	- -	0.88%
28	SCHLUMBERGER LTD オランダ領キュラソー	株式 エネルギー	599	7,635.92 4,573,917	8,009.48 4,797,681	- -	0.86%
29	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	995	4,672.61 4,649,255	4,800.75 4,776,747	- -	0.86%
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	449	10,486.59 4,708,479	10,612.07 4,764,823	- -	0.86%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.83
		ソフトウェア・サービス	9.01
		銀行	8.70
		食品・飲料・タバコ	7.31
		資本財	6.98
		エネルギー	5.96
		各種金融	4.50
		電気通信サービス	4.38
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.33
		ヘルスケア機器・サービス	3.26
		半導体・半導体製造装置	3.24
		小売	3.23
		公益事業	3.12
		素材	3.02
		耐久消費財・アパレル	2.55
		メディア	2.15
		家庭用品・パーソナル用品	2.09
		食品・生活必需品小売り	2.05
		消費者サービス	1.96
	自動車・自動車部品	1.50	
運輸	1.36		
保険	1.18		
商業・専門サービス	0.51		
不動産	0.24		
	小計		92.45
合 計（対純資産総額比）			92.45

（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 500 EMIN I FUTURE 201609	買建	3	31,887,949	31,903,386	5.75%
----------	----------	--------------------------------	----	---	------------	------------	-------

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率です。

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

(参考情報)

「ニッセイ国内債券マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

(平成28年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362回 利付国債(2年) 日本	国債証券	1,956,400,000	100.64 1,969,029,377	100.69 1,969,899,160	0.100000 2018/3/15	10.19%
2	第156回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,007,900,000	105.10 1,059,331,355	106.62 1,074,643,138	0.400000 2036/3/20	5.56%
3	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	978,100,000	102.92 1,006,668,290	103.43 1,011,658,611	0.100000 2026/3/20	5.23%
4	第123回 利付国債(5年) 日本	国債証券	964,300,000	100.34 967,604,662	101.51 978,947,717	0.100000 2020/3/20	5.06%
5	第113回 利付国債(5年) 日本	国債証券	906,900,000	100.78 914,001,027	101.17 917,537,937	0.300000 2018/6/20	4.75%
6	第318回 利付国債(10年) 日本	国債証券	731,700,000	106.04 775,912,001	106.94 782,494,614	1.000000 2021/9/20	4.05%
7	第352回 利付国債(2年) 日本	国債証券	693,300,000	100.32 695,581,350	100.32 695,581,350	0.100000 2017/5/15	3.60%
8	第26回 利付国債(30年) 日本	国債証券	454,600,000	125.62 571,077,612	147.71 671,507,844	2.400000 2037/3/20	3.47%
9	第356回 利付国債(2年) 日本	国債証券	553,600,000	100.49 556,322,744	100.49 556,329,248	0.100000 2017/9/15	2.88%
10	第128回 利付国債(20年) 日本	国債証券	396,200,000	124.80 494,491,852	130.08 515,380,922	1.900000 2031/6/20	2.67%
11	第355回 利付国債(2年) 日本	国債証券	506,400,000	100.42 508,526,880	100.46 508,749,696	0.100000 2017/8/15	2.63%

12	第116回 利付国債（20年） 日本	国債証券	344,300,000	122.42 421,492,060	132.43 455,956,490	2.200000 2030/3/20	2.36%
13	第351回 利付国債（2年） 日本	国債証券	351,000,000	100.22 351,801,790	100.22 351,801,790	0.100000 2017/4/15	1.82%
14	第153回 利付国債（20年） 日本	国債証券	283,200,000	118.02 334,248,016	123.82 350,680,896	1.300000 2035/6/20	1.81%
15	第118回 利付国債（20年） 日本	国債証券	261,000,000	122.77 320,446,926	130.01 339,326,100	2.000000 2030/6/20	1.76%
16	第365回 利付国債（2年） 日本	国債証券	326,500,000	100.74 328,938,515	100.79 329,089,145	0.100000 2018/6/15	1.70%
17	第42回 利付国債（30年） 日本	国債証券	229,000,000	110.89 253,949,550	143.13 327,788,310	1.700000 2044/3/20	1.70%
18	第329回 利付国債（10年） 日本	国債証券	300,000,000	107.43 322,290,000	107.97 323,922,000	0.800000 2023/6/20	1.68%
19	第328回 利付国債（10年） 日本	国債証券	302,600,000	105.50 319,243,000	106.30 321,688,008	0.600000 2023/3/20	1.66%
20	第361回 利付国債（2年） 日本	国債証券	309,200,000	100.58 311,014,930	100.65 311,237,628	0.100000 2018/2/15	1.61%
21	第140回 利付国債（20年） 日本	国債証券	235,400,000	124.33 292,672,820	128.71 302,985,694	1.700000 2032/9/20	1.57%
22	第99回 利付国債（20年） 日本	国債証券	224,100,000	119.92 268,758,648	126.61 283,737,492	2.100000 2027/12/20	1.47%
23	第151回 利付国債（20年） 日本	国債証券	232,400,000	105.23 244,574,764	121.81 283,105,032	1.200000 2034/12/20	1.46%
24	第146回 利付国債（20年） 日本	国債証券	197,000,000	126.47 249,160,629	129.70 255,526,730	1.700000 2033/9/20	1.32%
25	第149回 利付国債（20年） 日本	国債証券	178,500,000	110.47 197,188,950	126.94 226,591,470	1.500000 2034/6/20	1.17%
26	第9回 利付国債（40年） 日本	国債証券	193,100,000	106.32 205,313,368	109.36 211,191,539	0.400000 2056/3/20	1.09%

27	第119回 利付国債(5年) 日本	国債証券	171,400,000	100.36 172,027,324	101.21 173,473,940	0.100000 2019/6/20	0.90%
28	第155回 利付国債(20年) 日本	国債証券	143,600,000	118.34 169,943,420	118.31 169,894,596	1.000000 2035/12/20	0.88%
29	第120回 利付国債(5年) 日本	国債証券	163,700,000	100.74 164,911,380	101.63 166,381,406	0.200000 2019/9/20	0.86%
30	第316回 利付国債(10年) 日本	国債証券	152,900,000	105.83 161,818,657	107.05 163,680,979	1.100000 2021/6/20	0.85%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	国内	国債証券	94.29
	小計		94.29
合計(対純資産総額比)			94.29

(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 先 2809月	買建	6	913,326,480	917,520,000	4.75%

(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28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	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,763,877,400	108.40 1,912,143,679	109.97 1,939,841,809	3.125000 2021/5/15	9.88%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,761,819,200	102.12 1,799,289,330	103.31 1,820,311,597	1.750000 2022/5/15	9.27%
3	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	1,499,652,900	115.34 1,729,723,093	115.17 1,727,195,234	3.500000 2020/4/25	8.80%
4	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	1,212,534,000	118.92 1,442,024,430	119.14 1,444,649,383	3.250000 2021/10/25	7.36%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,162,883,000	108.26 1,258,947,193	110.45 1,284,439,159	2.750000 2024/2/15	6.54%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	826,367,300	124.20 1,026,406,501	129.55 1,070,591,891	3.625000 2043/8/15	5.45%
7	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	422,099,100	169.76 716,589,463	176.28 744,080,514	4.000000 2037/1/4	3.79%
8	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	542,208,600	105.70 573,144,529	106.57 577,864,237	0.500000 2025/2/15	2.94%
9	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	474,718,500	113.77 540,120,467	113.88 540,633,163	3.250000 2020/1/4	2.75%
10	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	366,048,000	141.32 517,310,060	146.02 534,525,252	5.000000 2034/8/1	2.72%
11	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	436,969,800	116.07 507,203,921	118.27 516,843,509	2.250000 2024/5/25	2.63%

12	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	422,099,100	116.61 492,240,405	116.94 493,606,908	3.750000 2021/8/1	2.51%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	454,862,200	105.76 481,070,080	105.72 480,889,415	2.125000 2025/5/15	2.45%
14	TSY 4 1/4% 2040 イギリス	国債証券	298,965,600	137.80 411,989,545	149.91 448,182,320	4.250000 2040/12/7	2.28%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	296,380,800	144.27 427,604,778	150.62 446,432,471	4.750000 2041/2/15	2.27%
16	FRENCH OAT フランス	国債証券	268,816,500	157.36 423,017,708	164.84 443,119,806	5.500000 2029/4/25	2.26%
17	AUSTRALIAN GOVERNMENT オーストラリア	国債証券	289,309,800	121.81 352,409,410	123.36 356,915,714	5.500000 2023/4/21	1.82%
18	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	312,284,700	113.84 355,523,639	113.20 353,515,648	4.250000 2019/9/1	1.80%
19	UK TSY 2 3/4% 2024 イギリス	国債証券	289,276,900	110.92 320,882,588	114.91 332,437,013	2.750000 2024/9/7	1.69%
20	TSY 4 1/4% 2032 イギリス	国債証券	203,462,700	131.89 268,361,197	139.25 283,338,086	4.250000 2032/6/7	1.44%
21	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	193,319,100	127.72 246,914,887	131.06 253,371,745	5.400000 2023/1/31	1.29%
22	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	157,858,200	142.53 225,009,122	152.27 240,376,995	4.000000 2032/3/28	1.22%
23	CANADIAN GOVERNMENT カナダ	国債証券	208,473,400	110.60 230,592,427	109.24 227,746,765	3.750000 2019/6/1	1.16%
24	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	165,865,500	127.98 212,291,253	128.64 213,374,355	4.500000 2026/3/1	1.09%
25	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	181,880,100	114.10 207,530,650	114.23 207,779,826	4.300000 2019/10/31	1.06%
26	TSY 3 3/4% 2021 イギリス	国債証券	166,092,000	115.93 192,563,742	116.90 194,163,208	3.750000 2021/9/7	0.99%
27	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	76,641,300	164.69 126,223,622	182.13 139,587,566	4.500000 2041/4/25	0.71%
28	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	83,504,700	139.83 116,768,133	157.77 131,752,880	3.250000 2045/5/25	0.67%
29	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	115,466,100	105.97 122,361,735	104.95 121,190,909	7.750000 2017/12/14	0.62%
30	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	66,346,200	163.89 108,738,767	176.68 117,225,773	5.000000 2035/3/28	0.60%

(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	98.51
	小計		98.51
合 計 (対純資産総額比)			98.51

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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28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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	45,253	667,010.24 30,184,214,784	633,000.00 28,645,149,000	- -	7.53%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	43,073	668,010.07 28,773,198,073	634,000.00 27,308,282,000	- -	7.17%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	76,875	263,700.00 20,271,937,500	262,100.00 20,148,937,500	- -	5.29%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	107,458	182,656.12 19,627,862,266	185,100.00 19,890,475,800	- -	5.23%
5	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	112,469	169,830.12 19,100,624,140	162,700.00 18,298,706,300	- -	4.81%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	92,402	181,700.00 16,789,443,400	177,300.00 16,382,874,600	- -	4.30%
7	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	32,970	471,672.54 15,551,043,791	441,000.00 14,539,770,000	- -	3.82%
8	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	165,991	96,900.00 16,084,527,900	86,500.00 14,358,221,500	- -	3.77%
9	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	20,640	636,000.00 13,127,040,000	613,000.00 12,652,320,000	- -	3.32%
10	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	21,787	541,000.00 11,786,767,000	573,000.00 12,483,951,000	- -	3.28%
11	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	19,761	677,000.00 13,378,197,000	609,000.00 12,034,449,000	- -	3.16%
12	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	42,136	287,900.00 12,130,954,400	275,300.00 11,600,040,800	- -	3.05%
13	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	20,246	551,000.00 11,155,546,000	534,000.00 10,811,364,000	- -	2.84%

14	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	19,654	584,000.00 11,477,936,000	544,000.00 10,691,776,000	- -	2.81%
15	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	55,060	191,200.00 10,527,472,000	187,800.00 10,340,268,000	- -	2.72%
16	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	149,159	79,400.00 11,843,224,600	64,800.00 9,665,503,200	- -	2.54%
17	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	37,825	248,100.00 9,384,382,500	251,000.00 9,494,075,000	- -	2.49%
18	GLP投資法人 日本	投資証券	69,294	128,200.00 8,883,490,800	129,800.00 8,994,361,200	- -	2.36%
19	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	14,547	572,388.34 8,326,533,308	604,000.00 8,786,388,000	- -	2.31%
20	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	58,035	152,560.95 8,853,875,259	140,600.00 8,159,721,000	- -	2.14%
21	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	25,885	263,628.73 6,824,029,827	279,100.00 7,224,503,500	- -	1.90%
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	41,184	164,700.00 6,783,004,800	161,200.00 6,638,860,800	- -	1.74%
23	プレミア投資法人 日本	投資証券	48,518	139,300.00 6,758,557,400	135,100.00 6,554,781,800	- -	1.72%
24	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	26,727	240,600.00 6,430,516,200	239,700.00 6,406,461,900	- -	1.68%
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	12,967	462,000.00 5,990,754,000	468,000.00 6,068,556,000	- -	1.59%
26	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	54,279	85,700.00 4,651,710,300	84,200.00 4,570,291,800	- -	1.20%
27	いちごオフィスリート投資法人 日本	投資証券	55,664	83,912.39 4,670,899,380	80,100.00 4,458,686,400	- -	1.17%
28	ケネディクス商業リート投資法人 日本	投資証券	15,518	290,764.04 4,512,076,441	276,700.00 4,293,830,600	- -	1.13%
29	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	13,952	303,000.00 4,227,456,000	278,500.00 3,885,632,000	- -	1.02%
30	MCUBS MidCity投資法人 日本	投資証券	10,388	373,080.34 3,875,558,638	353,500.00 3,672,158,000	- -	0.96%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
投資証券	国内	投資証券	95.75
	小計		95.75
合 計 (対純資産総額比)			95.75

(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28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	12,925	19,949.10 257,842,162	22,118.44 285,880,918	- -	5.92%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	6,100	25,706.91 156,812,199	26,140.16 159,455,031	- -	3.30%
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	14,900	7,039.04 104,881,755	7,771.76 115,799,271	- -	2.40%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	4,134	26,452.68 109,355,410	26,601.39 109,970,164	- -	2.28%
5	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	21,128	4,787.37 101,147,620	5,053.91 106,779,012	- -	2.21%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	14,700	6,876.44 101,083,759	6,998.90 102,883,963	- -	2.13%
7	VENTAS INC アメリカ	投資証券	13,717	6,679.88 91,628,025	7,414.66 101,706,966	- -	2.11%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	5,500	18,452.79 101,490,356	18,333.41 100,833,790	- -	2.09%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	6,300	12,730.99 80,205,275	13,532.66 85,255,789	- -	1.77%
10	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券	229,676	359.91 82,662,826	370.65 85,130,374	- -	1.76%
11	GENERAL GROWTH PROPERTIES アメリカ	投資証券	24,781	2,696.24 66,815,573	3,073.92 76,174,853	- -	1.58%
12	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	7,282	9,535.64 69,438,534	10,193.23 74,227,140	- -	1.54%
13	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	10,234	6,076.83 62,190,334	7,045.21 72,100,767	- -	1.49%
14	HCP INC アメリカ	投資証券	19,800	3,319.87 65,733,556	3,639.92 72,070,548	- -	1.49%
15	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	6,100	9,538.72 58,186,240	11,134.86 67,922,658	- -	1.41%

16	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資証券	82,543	799.63 66,003,925	817.28 67,460,825	- -	1.40%
17	LINK REIT 香港	投資証券	90,000	607.30 54,657,720	715.37 64,383,930	- -	1.33%
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	2,700	22,776.04 61,495,311	23,105.35 62,384,453	- -	1.29%
19	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	17,400	2,796.06 48,651,525	3,181.97 55,366,403	- -	1.15%
20	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	31,465	1,508.66 47,470,005	1,651.70 51,970,913	- -	1.08%
21	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	35,258	1,583.41 55,827,883	1,414.55 49,874,210	- -	1.03%
22	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	5,300	9,236.17 48,951,714	9,401.85 49,829,845	- -	1.03%
23	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	2,800	15,501.33 43,403,733	16,875.18 47,250,509	- -	0.98%
24	MACERICH CO/THE アメリカ	投資証券	5,419	7,505.22 40,670,821	8,637.23 46,805,183	- -	0.97%
25	SL GREEN REALTY CORP アメリカ	投資証券	4,400	10,119.14 44,524,217	10,601.78 46,647,868	- -	0.97%
26	KLEPIERRE フランス	投資証券	8,816	4,543.57 40,056,120	4,559.01 40,192,262	- -	0.83%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	10,500	3,632.72 38,143,591	3,747.98 39,353,813	- -	0.81%
28	VEREIT アメリカ	投資証券	37,800	961.17 36,332,581	1,028.07 38,861,080	- -	0.80%
29	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	46,005	997.24 45,878,211	835.99 38,460,014	- -	0.80%
30	DUKE REALTY CORP アメリカ	投資証券	14,100	2,355.60 33,214,099	2,698.30 38,046,032	- -	0.79%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（%）
投資証券	外国	投資証券	97.49
	小計		97.49
合 計（対純資産総額比）			97.49

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

「ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）」

【純資産の推移】

平成28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
第18特定期間末 (平成27年11月20日)	221,866,966	222,090,314	0.9934	0.9944
第19特定期間末 (平成28年5月20日)	189,805,821	190,005,593	0.9501	0.9511
平成27年6月末日	258,562,088	-	1.0021	-
7月末日	258,765,358	-	1.0099	-
8月末日	243,002,324	-	0.9579	-
9月末日	220,133,479	-	0.9383	-
10月末日	232,461,666	-	0.9874	-
11月末日	221,361,141	-	0.9911	-
12月末日	200,896,641	-	0.9838	-
平成28年1月末日	195,805,087	-	0.9602	-
2月末日	187,147,801	-	0.9360	-
3月末日	192,944,177	-	0.9640	-
4月末日	191,861,031	-	0.9605	-
5月末日	193,669,262	-	0.9655	-
6月末日	181,160,460	-	0.9175	-

【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
第18特定期間	0.0060
第19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
第18特定期間	1.8
第19特定期間	3.8

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額により算出しております（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28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
第18計算期間末 (平成27年11月20日)	60,523,926	60,523,926	1.2172	1.2172

第19計算期間末 (平成28年5月20日)	56,212,121	56,212,121	1.1717	1.1717
平成27年6月末日	77,039,603	-	1.2217	-
7月末日	71,063,549	-	1.2324	-
8月末日	61,610,192	-	1.1700	-
9月末日	57,557,636	-	1.1474	-
10月末日	61,212,839	-	1.2086	-
11月末日	59,234,685	-	1.2144	-
12月末日	57,951,956	-	1.2067	-
平成28年1月末日	56,166,651	-	1.1791	-
2月末日	54,814,144	-	1.1507	-
3月末日	56,775,411	-	1.1863	-
4月末日	56,619,394	-	1.1833	-
5月末日	56,993,060	-	1.1906	-
6月末日	53,601,092	-	1.1327	-

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
第18計算期間	0.0000
第19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
第18計算期間	1.8
第19計算期間	3.7

(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
第18特定期間	1,912,049	43,105,950	223,348,093
第19特定期間	334,965	23,910,709	199,772,349

(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
第18計算期間	6,301,329	20,528,719	49,723,161
第19計算期間	1,755,665	3,502,207	47,976,619

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2016年6月末現在

● 基準価額・純資産の推移

【毎月分配型】



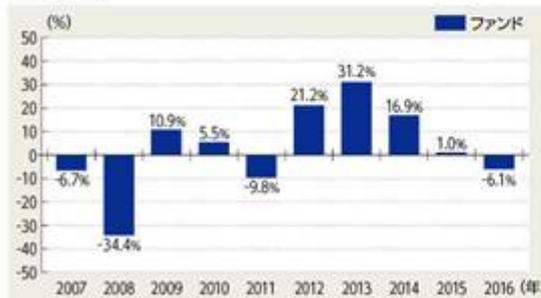
【成長重視型】



- ・ 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、2016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	9,175円	11,327円
純資産総額	181百万円	53百万円

● 分配の推移

【毎月分配型】 1万口当り(税引前)

【成長重視型】 1万口当り(税引前)

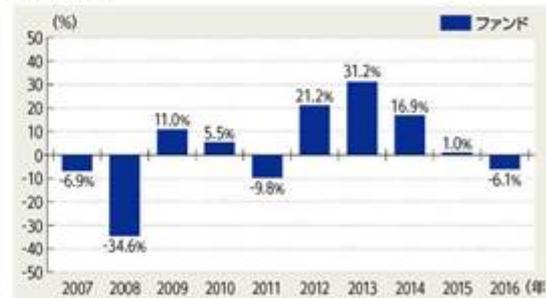
第108期	2016年2月	10円	第15期	2014年5月	0円
第109期	2016年3月	10円	第16期	2014年11月	0円
第110期	2016年4月	10円	第17期	2015年5月	0円
第111期	2016年5月	10円	第18期	2015年11月	0円
第112期	2016年6月	10円	第19期	2016年5月	0円
直近1年間累計	120円		直近1年間累計	0円	
設定来累計	1,560円		設定来累計	0円	

● 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	22.0%	22.0%
ニッセイ外国株マザーファンド	10.8%	10.8%
ニッセイ国内債券マザーファンド	22.7%	22.7%
ニッセイ外国債券アクティブマザーファンド	10.9%	10.9%
ニッセイJ-REITマザーファンド	22.4%	22.5%
ニッセイグローバルリートマザーファンド	11.2%	11.2%

- ・ 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。

2016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	3.3%
2	日本電信電話	2.9%
3	ソフトバンクグループ	2.0%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.9%
5	KDDI	1.9%
6	アステラス製薬	1.7%
7	東海旅客鉄道	1.7%
8	三井住友フィナンシャルグループ	1.6%
9	みずほフィナンシャルグループ	1.5%
10	NTTドコモ	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	ウェルズ・ファーゴ・アンド・カンパニー	アメリカ	金融	2.5%
2	アルファベット(C)	アメリカ	情報技術	2.2%
3	ジョンソン・エンド・ジョンソン	アメリカ	ヘルスケア	2.2%
4	コストコホールセール	アメリカ	生活必需品	2.1%
5	レイノルズ・アメリカン	アメリカ	生活必需品	2.0%
6	アップル	アメリカ	情報技術	1.9%
7	プリティッシュ・アメリカン・タバコ	イギリス	生活必需品	1.8%
8	マイクロソフト	アメリカ	情報技術	1.7%
9	トロント・ドミニオン銀行	カナダ	金融	1.5%
10	S&Pグローバル	アメリカ	金融	1.5%

・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362回 利付国債(2年)	10.3%
2	第156回 利付国債(20年)	5.6%
3	第342回 利付国債(10年)	5.3%
4	第123回 利付国債(5年)	5.1%
5	第113回 利付国債(5年)	4.8%
6	第318回 利付国債(10年)	4.1%
7	第352回 利付国債(2年)	3.6%
8	第26回 利付国債(30年)	3.5%
9	第356回 利付国債(2年)	2.9%
10	第128回 利付国債(20年)	2.7%

・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	アメリカ国債	10.0%
2	アメリカ国債	9.4%
3	フランス国債	8.9%
4	フランス国債	7.5%
5	アメリカ国債	6.6%
6	アメリカ国債	5.5%
7	ドイツ国債	3.8%
8	ドイツ国債	3.0%
9	ドイツ国債	2.8%
10	イタリア国債	2.8%

・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	日本ビルファンド投資法人	7.9%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	7.5%
3	日本リテールファンド投資法人	5.5%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	5.5%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	5.0%
6	オリックス不動産投資法人	4.5%
7	日本プライムリアルティ投資法人	4.0%
8	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3.9%
9	ケネディクス・オフィス投資法人	3.5%
10	産業ファンド投資法人	3.4%

・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	6.1%
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.4%
3	WELLTOWER INC	アメリカ	2.5%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.3%
5	PROLOGIS INC	アメリカ	2.3%
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.2%
7	VENTAS INC	アメリカ	2.2%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.1%
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	1.8%
10	SCENTRE GROUP	オーストラリア	1.8%

・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27年11月21日から平成28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19期計算期間（平成27年11月21日から平成28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18特定期間 (平成27年11月20日現在)	第19特定期間 (平成28年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,212
コール・ローン	237,635	189,264
親投資信託受益証券	221,874,249	189,812,901
未収入金	1,194,253	213,978
流動資産合計	223,306,137	190,219,355
資産合計	223,306,137	190,219,355
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	223,348	199,772
未払解約金	953,491	-
未払受託者報酬	10,404	8,480
未払委託者報酬	249,859	203,602
その他未払費用	2,069	1,680
流動負債合計	1,439,171	413,534
負債合計	1,439,171	413,534
純資産の部		
元本等		
元本	223,348,093	199,772,349
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,481,127	9,966,528
純資産合計	221,866,966	189,805,821
負債純資産合計	223,306,137	190,219,355

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18特定期間 （自平成27年5月21日 至平成27年11月20日）	第19特定期間 （自平成27年11月21日 至平成28年5月20日）
営業収益		
有価証券売買等損益	4,387,255	6,546,606
営業収益合計	4,387,255	6,546,606
営業費用		
受託者報酬	66,653	52,782
委託者報酬	1,600,628	1,267,770
その他費用	13,248	10,473
営業費用合計	1,680,529	1,331,025
営業利益又は営業損失（ ）	6,067,784	7,877,631
経常利益又は経常損失（ ）	6,067,784	7,877,631
当期純利益又は当期純損失（ ）	6,067,784	7,877,631
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（ ）	543,005	209,819
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,754,607	1,481,127
剰余金増加額又は欠損金減少額	798,356	844,922
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減 少額	798,356	844,922
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	35,490	15,560
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	35,490	15,560
分配金	1,473,821	1,227,313
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,481,127	9,966,528

(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18特定期間 (平成27年11月20日現在)	第19特定期間 (平成28年5月20日現在)
1. 受益権総口数	223,348,093口	199,772,349口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,481,127円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は9,966,528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)	0.9934円 (9,934円)	0.9501円 (9,501円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18特定期間 (自平成27年5月21日 至平成27年11月20日)	第19特定期間 (自平成27年11月21日 至平成28年5月20日)
1. 分配金の計算過程	<p>(自平成27年5月21日 至平成27年6月22日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(52,644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(2,926,713円)及び分配準備積立金(11,987,196円)より分配対象収益は14,966,553円(1口当たり0.057795円)であり、うち258,960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6月23日 至平成27年7月21日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(180,352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(2,914,566円)及び分配準備積立金(11,694,400円)より分配対象収益は14,789,318円(1口当たり0.057496円)であり、うち257,221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11月21日 至平成27年12月21日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(53,246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(2,598,356円)及び分配準備積立金(10,303,777円)より分配対象収益は12,955,379円(1口当たり0.058021円)であり、うち223,286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12月22日 至平成28年1月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(237,487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(2,373,055円)及び分配準備積立金(9,254,802円)より分配対象収益は11,865,344円(1口当たり0.058186円)であり、うち203,921円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。</p>

（自平成27年7月22日 至平成27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（92,340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（2,912,583円）及び分配準備積立金（11,482,257円）より分配対象収益は14,487,180円（1口当たり0.056860円）であり、うち254,785円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。

（自平成27年8月21日 至平成27年9月24日）
 計算期間末における費用控除後の配当等収益（152,787円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（2,790,158円）及び分配準備積立金（10,843,740円）より分配対象収益は13,786,685円（1口当たり0.056486円）であり、うち244,071円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。

（自平成27年9月25日 至平成27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（686,372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（2,738,153円）及び分配準備積立金（10,325,861円）より分配対象収益は13,750,386円（1口当たり0.058404円）であり、うち235,436円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。

（自平成27年10月21日 至平成27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（307,982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（2,598,550円）及び分配準備積立金（10,222,499円）より分配対象収益は13,129,031円（1口当たり0.058783円）であり、うち223,348円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。

（自平成28年1月21日 至平成28年2月22日）
 計算期間末における費用控除後の配当等収益（261,847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（2,327,168円）及び分配準備積立金（9,108,484円）より分配対象収益は11,697,499円（1口当たり0.058495円）であり、うち199,973円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。

（自平成28年2月23日 至平成28年3月22日）
 計算期間末における費用控除後の配当等収益（412,310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（2,339,264円）及び分配準備積立金（9,168,524円）より分配対象収益は11,920,098円（1口当たり0.059556円）であり、うち200,148円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。

（自平成28年3月23日 至平成28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（513,136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（2,343,537円）及び分配準備積立金（9,380,218円）より分配対象収益は12,236,891円（1口当たり0.061119円）であり、うち200,213円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。

（自平成28年4月21日 至平成28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（89,923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（2,339,959円）及び分配準備積立金（9,670,242円）より分配対象収益は12,100,124円（1口当たり0.060570円）であり、うち199,772円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。

（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18特定期間 （自平成27年5月21日 至平成27年11月20日）	第19特定期間 （自平成27年11月21日 至平成28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18特定期間 （平成27年11月20日現在）	第19特定期間 （平成28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18特定期間 (平成27年11月20日現在)	第19特定期間 (平成28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	5,558,134	1,982,801
合計	5,558,134	1,982,801

(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18特定期間 (平成27年11月20日現在)	第19特定期間 (平成28年5月20日現在)
期首元本額	264,541,994円	223,348,093円
期中追加設定元本額	1,912,049円	334,965円
期中一部解約元本額	43,105,950円	23,910,709円

(4) 【附属明細表】（平成28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	20,581,537	42,879,574	
	ニッセイ外国株 マザーファンド	17,723,625	21,241,764	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	28,858,881	42,154,167	
	ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド	8,089,773	21,138,576	
	ニッセイJ - R E I T マザーファンド	20,125,600	41,690,180	
	ニッセイグローバルリート マザーファンド	19,979,393	20,708,640	
親投資信託受益証券 合計		115,358,809	189,812,901	
合計		115,358,809	189,812,901	

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18期 （平成27年11月20日現在）	第19期 （平成28年5月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	6,276
コール・ローン	456,132	369,842
親投資信託受益証券	60,525,966	56,214,005
未収入金	4,466	4,189
流動資産合計	60,986,564	56,594,312
資産合計	60,986,564	56,594,312
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	18,317	15,115
未払委託者報酬	440,748	364,129
その他未払費用	3,573	2,947
流動負債合計	462,638	382,191
負債合計	462,638	382,191
純資産の部		
元本等		
元本	49,723,161	47,976,619
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,800,765	8,235,502
純資産合計	60,523,926	56,212,121
負債純資産合計	60,986,564	56,594,312

（２）【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期 (自平成27年5月21日 至平成27年11月20日)	第19期 (自平成27年11月21日 至平成28年5月20日)
営業収益		
受取利息	7	-
有価証券売買等損益	1,526,985	1,826,312
営業収益合計	1,526,978	1,826,312
営業費用		
受託者報酬	18,317	15,115
委託者報酬	440,748	364,129
その他費用	3,573	2,947
営業費用合計	462,638	382,191
営業利益又は営業損失()	1,989,616	2,208,503
経常利益又は経常損失()	1,989,616	2,208,503
当期純利益又は当期純損失()	1,989,616	2,208,503
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()	968,107	88,345
期首剰余金又は期首欠損金()	15,335,287	10,800,765
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,403,071	314,853
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	1,403,071	314,853
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,916,084	759,958
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	4,916,084	759,958
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()	10,800,765	8,235,502

(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18期 (平成27年11月20日現在)	第19期 (平成28年5月20日現在)
1. 受益権総口数	49,723,161口	47,976,619口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2172円 (12,172円)	1.1717円 (11,717円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期 (自平成27年5月21日 至平成27年11月20日)	第19期 (自平成27年11月21日 至平成28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(203,446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(4,760,570円)及び分配準備積立金(9,570,054円)より分配対象収益は14,534,070円(1口当たり0.292300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(341,666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(4,933,295円)及び分配準備積立金(9,092,075円)より分配対象収益は14,367,036円(1口当たり0.299459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18期 (自平成27年5月21日 至平成27年11月20日)	第19期 (自平成27年11月21日 至平成28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18期 (平成27年11月20日現在)	第19期 (平成28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 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18期 (平成27年11月20日現在) 最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	第19期 (平成28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)
親投資信託受益証券	534,483	1,742,840
合計	534,483	1,742,840

(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18期 （平成27年11月20日現在）	第19期 （平成28年5月20日現在）
期首元本額	63,950,551円	49,723,161円
期中追加設定元本額	6,301,329円	1,755,665円
期中一部解約元本額	20,528,719円	3,502,207円

（４）【附属明細表】（平成28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	6,095,614	12,699,602	
	ニッセイ外国株 マザーファンド	5,249,775	6,291,855	
	ニッセイ国内債券マザーファンド	8,546,111	12,483,304	
	ニッセイ外国債券アクティブ マザーファンド	2,395,147	6,258,519	
	ニッセイJ-REIT マザーファンド	5,959,639	12,345,392	
	ニッセイグローバルリート マザーファンド	5,919,280	6,135,333	
親投資信託受益証券 合計		34,165,566	56,214,005	
合計		34,165,566	56,214,005	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

（参考）

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

（参考）

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

「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27年11月20日現在)	(平成28年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	29,032,011
コール・ローン	2,163,899,992	1,710,797,366
株式	71,059,072,270	62,006,063,100
派生商品評価勘定	239,673,900	30,476,800
未収配当金	541,026,523	742,037,817
前払金	-	17,235,000
差入委託証拠金	89,100,000	109,980,000
流動資産合計	74,092,772,685	64,645,622,094
資産合計	74,092,772,685	64,645,622,094
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	31,833,320
前受金	238,113,000	-
未払解約金	174,857,576	49,001,717
その他未払費用	-	21,019
流動負債合計	412,970,576	80,856,056
負債合計	412,970,576	80,856,056
純資産の部		
元本等		
元本	29,832,775,786	30,990,831,116
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	43,847,026,323	33,573,934,922
純資産合計	73,679,802,109	64,564,766,038
負債純資産合計	74,092,772,685	64,645,622,094

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28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 1,680,528,000円	株式 1,187,532,000円
2 . 受益権総口数	29,832,775,786口	30,990,831,116口
3 . 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4698円 (24,698円)	2.0834円 (20,834円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成27年5月21日 至 平成27年11月20日）	（自 平成27年11月21日 至 平成28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27年11月20日現在)	(平成28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27年11月20日現在	平成28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	1,487,433,484	10,531,847,629
合計	1,487,433,484	10,531,847,629

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

株式関連

種類	（平成27年11月20日 現在）				（平成28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	2,406,837,000	-	2,646,600,000	239,763,000	2,527,035,000	-	2,525,780,000	1,255,000
合計	2,406,837,000	-	2,646,600,000	239,763,000	2,527,035,000	-	2,525,780,000	1,255,000

（注） 1．時価の算定方法

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28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	28,972,832,326円	28,972,832,326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	5,836,595,759円	10,169,636,997円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	4,976,652,299円	8,151,638,207円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイ日本株ファンド	29,807,291,905円	30,964,153,965円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	20,023,273円	20,581,537円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	5,460,608円	6,095,614円
計	29,832,775,786円	30,990,831,116円

附属明細表（平成28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	
マルハニチロ	206,100	2,493.00	513,807,300	
サカタのタネ	4,600	2,820.00	12,972,000	
ホクト	8,000	1,957.00	15,656,000	
日鉄鉱業	103,000	384.00	39,552,000	
国際石油開発帝石	446,400	856.90	382,520,160	
大成建設	421,000	800.00	336,800,000	
大林組	74,400	1,136.00	84,518,400	
鹿島建設	800,000	733.00	586,400,000	
前田建設工業	240,000	815.00	195,600,000	
戸田建設	264,000	498.00	131,472,000	
NIPPO	337,000	1,948.00	656,476,000	
前田道路	210,000	1,958.00	411,180,000	
住友林業	196,200	1,509.00	296,065,800	
パナホーム	164,000	872.00	143,008,000	
積水ハウス	49,900	1,976.50	98,627,350	
中電工	26,600	2,218.00	58,998,800	
関電工	102,000	873.00	89,046,000	
九電工	63,300	3,235.00	204,775,500	
森永乳業	209,000	664.00	138,776,000	
明治ホールディングス	36,800	9,890.00	363,952,000	
雪印メグミルク	47,200	3,185.00	150,332,000	
日本ハム	60,000	2,550.00	153,000,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	218,000	938.00	204,484,000	
サッポロホールディングス	222,000	590.00	130,980,000	
アサヒグループホールディングス	30,800	3,610.00	111,188,000	
双日	739,800	243.00	179,771,400	
味の素	31,000	2,500.50	77,515,500	
ニチレイ	104,000	959.00	99,736,000	
日本たばこ産業	169,800	4,397.00	746,610,600	
J・フロント リテイリング	283,200	1,232.00	348,902,400	
東洋紡	1,415,000	206.00	291,490,000	
セブン&アイ・ホールディングス	71,500	4,727.00	337,980,500	
帝人	1,714,000	387.00	663,318,000	

東レ	81,000	936.20	75,832,200	
クラレ	472,800	1,440.00	680,832,000	
旭化成	82,000	719.40	58,990,800	
ワコールホールディングス	214,000	1,191.00	254,874,000	
王子ホールディングス	1,169,000	423.00	494,487,000	
日本製紙	310,200	1,949.00	604,579,800	
レンゴー	30,000	631.00	18,930,000	
住友化学	689,000	491.00	338,299,000	
信越化学工業	39,900	6,340.00	252,966,000	
日本触媒	43,600	6,280.00	273,808,000	
三菱瓦斯化学	445,000	629.00	279,905,000	
三井化学	470,000	380.00	178,600,000	
三菱ケミカルホールディングス	856,100	563.40	482,326,740	
宇部興産	2,078,000	201.00	417,678,000	
日立化成	97,200	2,021.00	196,441,200	
電通	53,800	5,500.00	295,900,000	
花王	97,800	6,035.00	590,223,000	
武田薬品工業	40,800	4,690.00	191,352,000	
アステラス製薬	608,500	1,487.50	905,143,750	
塩野義製薬	60,100	6,100.00	366,610,000	
田辺三菱製薬	311,900	1,831.00	571,088,900	
エーザイ	42,700	6,802.00	290,445,400	
小野薬品工業	84,800	5,193.00	440,366,400	
みらかホールディングス	20,000	4,525.00	90,500,000	
第一三共	13,200	2,609.50	34,445,400	
D I C	521,000	255.00	132,855,000	
東洋インキS Cホールディングス	775,000	460.00	356,500,000	
オリエンタルランド	31,000	7,400.00	229,400,000	
フジ・メディア・ホールディングス	9,400	1,361.00	12,793,400	
ユー・エス・エス	171,200	1,672.00	286,246,400	
コニカミノルタ	437,800	917.00	401,462,600	
資生堂	6,000	2,784.00	16,704,000	
ライオン	59,000	1,698.00	100,182,000	
東燃ゼネラル石油	485,000	1,027.00	498,095,000	
J Xホールディングス	404,300	422.30	170,735,890	
横浜ゴム	11,300	1,579.00	17,842,700	
ブリヂストン	168,900	3,650.00	616,485,000	
住友ゴム工業	183,300	1,559.00	285,764,700	
日本電気硝子	823,000	525.00	432,075,000	

太平洋セメント	1,072,000	277.00	296,944,000	
日本軽金属ホールディングス	2,604,100	215.00	559,881,500	
三菱マテリアル	538,000	313.00	168,394,000	
住友電気工業	233,100	1,485.00	346,153,500	
リクルートホールディングス	21,300	3,675.00	78,277,500	
オークマ	151,000	811.00	122,461,000	
アマダホールディングス	216,200	1,158.00	250,359,600	
豊田自動織機	28,300	4,570.00	129,331,000	
小松製作所	6,900	1,808.50	12,478,650	
椿本チエイン	157,000	756.00	118,692,000	
平和	261,900	2,201.00	576,441,900	
ブラザー工業	55,800	1,261.00	70,363,800	
N T N	324,000	363.00	117,612,000	
ジェイテクト	38,100	1,458.00	55,549,800	
不二越	228,000	363.00	82,764,000	
ミネベア	40,500	855.00	34,627,500	
日立製作所	1,523,000	500.00	761,500,000	
三菱電機	530,000	1,296.00	686,880,000	
富士電機	242,000	448.00	108,416,000	
日本電産	1,700	8,382.00	14,249,400	
日本電気	665,000	244.00	162,260,000	
富士通	602,000	419.00	252,238,000	
パナソニック	354,500	965.70	342,340,650	
ソニー	171,200	2,917.00	499,390,400	
T D K	122,900	6,220.00	764,438,000	
キーエンス	7,500	68,760.00	515,700,000	
ファナック	16,700	16,070.00	268,369,000	
村田製作所	37,900	12,625.00	478,487,500	
三井造船	845,000	182.00	153,790,000	
三菱重工業	954,000	412.40	393,429,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	411,800	494.60	203,676,280	
日産自動車	583,000	1,045.50	609,526,500	
いすゞ自動車	186,100	1,209.00	224,994,900	
トヨタ自動車	369,700	5,562.00	2,056,271,400	
新明和工業	540,000	752.00	406,080,000	
トピー工業	884,000	212.00	187,408,000	
マツダ	98,400	1,796.50	176,775,600	
本田技研工業	212,400	2,948.00	626,155,200	
スズキ	41,800	2,724.50	113,884,100	
富士重工業	117,000	3,896.00	455,832,000	

シマノ	2,300	16,490.00	37,927,000	
良品計画	5,100	25,300.00	129,030,000	
ニコン	140,300	1,534.00	215,220,200	
H O Y A	38,100	3,851.00	146,723,100	
キヤノン	18,700	3,114.00	58,231,800	
リコー	220,000	945.00	207,900,000	
シチズンホールディングス	67,200	609.00	40,924,800	
バンダイナムコホールディングス	58,500	2,671.00	156,253,500	
トッパン・フォームズ	136,200	1,268.00	172,701,600	
共同印刷	59,000	335.00	19,765,000	
日本写真印刷	17,900	2,387.00	42,727,300	
タカラスタンダード	84,000	975.00	81,900,000	
コクヨ	185,200	1,488.00	275,577,600	
岡村製作所	113,800	1,081.00	123,017,800	
伊藤忠商事	189,800	1,382.00	262,303,600	
丸紅	801,400	507.30	406,550,220	
ファミリーマート	32,900	5,930.00	195,097,000	
三井物産	120,400	1,309.50	157,663,800	
東京エレクトロン	39,500	7,799.00	308,060,500	
住友商事	253,500	1,105.00	280,117,500	
三菱商事	71,000	1,878.00	133,338,000	
キヤノンマーケティングジャパン	60,200	2,004.00	120,640,800	
岩谷産業	222,000	635.00	140,970,000	
しまむら	1,200	14,300.00	17,160,000	
高島屋	439,000	766.00	336,274,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	99,300	1,614.00	160,270,200	
クレディセゾン	78,200	2,070.00	161,874,000	
ユニグループ・ホールディングス	589,900	813.00	479,588,700	
イズミ	19,400	4,385.00	85,069,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,441,000	533.10	1,301,297,100	
りそなホールディングス	1,286,300	426.50	548,606,950	
三井住友トラスト・ホールディングス	662,000	361.00	238,982,000	
三井住友フィナンシャルグループ	314,400	3,430.00	1,078,392,000	
千葉銀行	770,000	560.00	431,200,000	
常陽銀行	1,432,000	390.00	558,480,000	

ふくおかフィナンシャルグループ	1,315,000	379.00	498,385,000	
静岡銀行	130,000	797.00	103,610,000	
八十二銀行	88,000	492.00	43,296,000	
みずほフィナンシャルグループ	5,900,700	170.80	1,007,839,560	
オリックス	558,300	1,534.50	856,711,350	
三菱UFJリース	1,395,900	473.00	660,260,700	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	251,800	3,044.00	766,479,200	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	133,700	3,034.00	405,645,800	
第一生命保険	603,100	1,378.00	831,071,800	
東京海上ホールディングス	96,000	3,756.00	360,576,000	
T & Dホールディングス	71,500	1,032.50	73,823,750	
三井不動産	98,000	2,707.50	265,335,000	
三菱地所	68,000	2,125.50	144,534,000	
住友不動産	54,000	3,063.00	165,402,000	
レオパレス21	3,700	682.00	2,523,400	
イオンモール	102,200	1,475.00	150,745,000	
東日本旅客鉄道	44,600	9,868.00	440,112,800	
西日本旅客鉄道	80,400	6,548.00	526,459,200	
東海旅客鉄道	52,200	19,270.00	1,005,894,000	
阪急阪神ホールディングス	600,000	744.00	446,400,000	
福山通運	438,000	540.00	236,520,000	
セイノーホールディングス	258,200	1,108.00	286,085,600	
日本郵船	753,000	209.00	157,377,000	
日本航空	162,900	3,774.00	614,784,600	
A N Aホールディングス	2,137,000	324.50	693,456,500	
住友倉庫	454,000	574.00	260,596,000	
上組	218,000	1,016.00	221,488,000	
郵船ロジスティクス	71,100	1,140.00	81,054,000	
日本電信電話	346,200	4,800.00	1,661,760,000	
K D D I	350,700	3,146.00	1,103,302,200	
N T T ドコモ	312,600	2,676.50	836,673,900	
中部電力	502,600	1,496.50	752,140,900	
関西電力	346,400	1,006.00	348,478,400	
東北電力	341,500	1,408.00	480,832,000	
大阪瓦斯	1,398,000	417.20	583,245,600	
東京ドーム	412,000	453.00	186,636,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,000	3,405.00	20,430,000	
セコム	2,800	8,649.00	24,217,200	

ヤマダ電機	1,184,300	501.00	593,334,300	
ニトリホールディングス	6,100	10,460.00	63,806,000	
ソフトバンクグループ	181,000	6,105.00	1,105,005,000	
スズケン	29,600	3,495.00	103,452,000	
サンドラッグ	5,300	8,820.00	46,746,000	
合計	69,694,100		62,006,063,100	

(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27年11月20日現在)	(平成28年5月20日現在)
資産の部		

流動資産		
預金	1,994,986	5,883,322
金銭信託	-	488,848
コール・ローン	33,047,753	28,806,807
株式	637,391,827	548,989,796
投資証券	495,657	-
派生商品評価勘定	2,884,206	1,730,947
未収配当金	1,112,497	1,002,135
差入委託証拠金	5,237,635	5,562,985
流動資産合計	682,164,561	592,464,840
資産合計	682,164,561	592,464,840
負債の部		
流動負債		
未払解約金	166,239	53,378
その他未払費用	-	333
流動負債合計	166,239	53,711
負債合計	166,239	53,711
純資産の部		
元本等		
元本	495,982,658	494,296,384
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	186,015,664	98,114,745
純資産合計	681,998,322	592,411,129
負債純資産合計	682,164,561	592,464,840

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28年5月20日現在）
1. 受益権総口数	495,982,658口	494,296,384口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3750円 (13,750円)	1.1985円 (11,985円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成27年5月21日 至 平成27年11月20日）	（自 平成27年11月21日 至 平成28年5月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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いません。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28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あります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年11月20日現在	平成28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	4,902,758	15,283,302
投資証券	45,960	-
合計	4,948,718	15,283,302

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成27年11月20日 現在）				（平成28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	-	-	-	-	5,181,938	-	5,173,760	8,178
アメリカ カ・ドル	-	-	-	-	5,181,938	-	5,173,760	8,178
買 建	25,425,645	-	25,815,300	389,655	22,366,533	-	23,108,400	741,867
アメリカ カ・ドル	25,425,645	-	25,815,300	389,655	22,366,533	-	23,108,400	741,867
合計	25,425,645	-	25,815,300	389,655	27,548,471	-	28,282,160	750,045

（注） 1．時価の算定方法

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

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

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

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	（平成27年11月20日 現在）				（平成28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	35,855,136	-	38,349,687	2,494,551	32,685,996	-	33,666,898	980,902
合計	35,855,136	-	38,349,687	2,494,551	32,685,996	-	33,666,898	980,902

（注） 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2．株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

3．評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28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	502,168,997円	495,982,658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	2,191,543円	2,996,718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	8,377,882円	4,682,992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）	472,810,245円	471,322,984円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	18,208,082円	17,723,625円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	4,964,331円	5,249,775円
計	495,982,658円	494,296,384円

附属明細表（平成28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	215	165.11	35,498.65	
	ABBOTT LABORATORIES	397	37.24	14,784.28	
	ABBVIE INC	419	59.28	24,838.32	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	48	139.03	6,673.44	
	ALLERGAN PLC	84	226.89	19,058.76	
	ALPHABET INC-CL C	135	700.32	94,543.20	
	AMAZON.COM INC	63	698.52	44,006.76	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	218	56.36	12,286.48	
	AMGEN INC	83	148.67	12,339.61	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	274	49.22	13,486.28	
	APPLE INC	977	94.20	92,033.40	
	AT&T INC	1,145	38.44	44,013.80	
	AUTOLIV INC	154	119.97	18,475.38	
	BANK OF AMERICA CORP	1,590	14.53	23,102.70	
	BIOGEN INC	77	258.72	19,921.44	
	BLACKROCK INC	231	350.57	80,981.67	
	BOEING CO	115	128.08	14,729.20	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	471	70.33	33,125.43	
	BROADCOM LTD	441	142.74	62,948.34	
	CARDINAL HEALTH INC	136	77.33	10,516.88	
	CATERPILLAR INC	102	69.43	7,081.86	
	CBOE HOLDINGS INC	885	63.29	56,011.65	
	CELANESE CORP-SERIES A	324	69.50	22,518.00	
	CELGENE CORP	226	99.94	22,586.44	
	CHEVRON CORP	419	99.85	41,837.15	
	CISCO SYSTEMS INC	1,576	27.57	43,450.32	
	CMS ENERGY CORP	1,152	40.83	47,036.16	
	COACH INC	992	38.10	37,795.20	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	557	62.01	34,539.57	
	COMCAST CORP	575	60.25	34,643.75	
CORNING INC	1,324	18.94	25,076.56		

COSTCO WHOLESALE CORP	543	142.70	77,486.10	
CSX CORP	596	25.55	15,227.80	
DOW CHEMICAL CO	434	50.77	22,034.18	
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	150	64.41	9,661.50	
EOG RESOURCES INC	385	80.08	30,830.80	
ESTEE LAUDER COS INC	240	91.01	21,842.40	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	133	72.35	9,622.55	
EXXON MOBIL CORP	742	90.11	66,861.62	
FACEBOOK INC-A	367	116.81	42,869.27	
FEDEX CORP	91	159.11	14,479.01	
GENERAL ELECTRIC CO	1,763	29.36	51,761.68	
GILEAD SCIENCES INC	416	82.14	34,170.24	
HOME DEPOT INC	255	131.73	33,591.15	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	347	112.32	38,975.04	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	141	102.76	14,489.16	
INGERSOLL-RAND PLC	513	64.01	32,837.13	
JOHNSON & JOHNSON	619	112.85	69,854.15	
JPMORGAN CHASE & CO	564	63.39	35,751.96	
KANSAS CITY SOUTHERN	181	90.51	16,382.31	
LAM RESEARCH CORP	472	73.32	34,607.04	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	642	44.54	28,594.68	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	171	80.83	13,821.93	
MEDIVATION INC	203	60.73	12,328.19	
MEDTRONIC PLC	191	80.00	15,280.00	
MERCK & CO INC	525	54.58	28,654.50	
MICROSOFT CORP	1,650	50.32	83,028.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	734	43.27	31,760.18	
MONSANTO CO	100	100.55	10,055.00	
MORGAN STANLEY	1,870	26.61	49,760.70	
MYLAN NV	121	41.12	4,975.52	
NIKE INC	338	57.04	19,279.52	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	764	46.39	35,441.96	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	150	255.46	38,319.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	429	74.84	32,106.36	
ORACLE CORP	441	38.84	17,128.44	

PATTERSON COS INC	265	45.03	11,932.95	
PAYPAL HOLDINGS INC	672	37.65	25,300.80	
PFIZER INC	1,263	33.38	42,158.94	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	881	98.36	86,655.16	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	103	162.84	16,772.52	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	683	87.88	60,022.04	
PRAXAIR INC	91	110.06	10,015.46	
PROCTER & GAMBLE CO	314	80.19	25,179.66	
RED HAT INC	179	72.44	12,966.76	
REGENERON PHARMACEUTICALS	19	383.30	7,282.70	
REYNOLDS AMERICAN INC	1,841	49.71	91,516.11	
ROCKWELL AUTOMATION INC	88	110.23	9,700.24	
ROPER TECHNOLOGIES INC	103	179.99	18,538.97	
ROSS STORES INC	718	55.52	39,863.36	
SALESFORCE.COM INC	516	81.09	41,842.44	
SCHLUMBERGER LTD	599	74.20	44,445.80	
SEMPRA ENERGY	474	102.98	48,812.52	
SERVICENOW INC	363	69.75	25,319.25	
STARBUCKS CORP	1,117	54.55	60,932.35	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	167	51.25	8,558.75	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	131	148.42	19,443.02	
TIME WARNER INC	190	71.59	13,602.10	
TYCO INTERNATIONAL PLC	663	40.35	26,752.05	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	343	98.51	33,788.93	
UNITEDHEALTH GROUP INC	220	130.00	28,600.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	114	82.91	9,451.74	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	477	49.63	23,673.51	
VISA INC-CLASS A SHARES	616	76.88	47,358.08	
WALT DISNEY CO	357	98.41	35,132.37	
WELLS FARGO & CO	2,682	48.38	129,755.16	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	117	118.19	13,828.23	
アメリカ・ドル 小計	49,052		3,213,011.72 (353,720,460)	

イギリス・ポンド	ASTRAZENECA PLC	257	38.12	9,796.84	
	BHP BILLITON PLC	874	8.14	7,120.47	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,414	40.86	57,776.04	
	BT GROUP PLC	2,290	4.32	9,913.41	
	CAPITA PLC	402	10.62	4,269.24	
	CARNIVAL PLC	214	34.85	7,457.90	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	790	14.07	11,119.25	
	HSBC HOLDINGS PLC	5,288	4.26	22,553.32	
	NATIONAL GRID PLC	3,130	9.70	30,379.78	
	RIO TINTO PLC	746	19.39	14,468.67	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,821	16.63	30,292.33	
	STANDARD CHARTERED PLC	2,635	5.11	13,485.93	
	VODAFONE GROUP PLC	5,749	2.25	12,958.24	
	WHITBREAD PLC	271	40.80	11,056.80	
WPP PLC	778	15.60	12,136.80		
イギリス・ポンド 小計		26,659		254,785.02 (40,951,596)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	700	24.91	17,437.00	
	BHP BILLITON LTD	1,322	18.71	24,734.62	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	370	77.76	28,771.20	
	CSL LIMITED	160	114.23	18,276.80	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	610	27.28	16,640.80	
	RIO TINTO LTD	200	44.29	8,858.00	
	TELSTRA CORP LTD	4,070	5.64	22,954.80	
	TRANSURBAN GROUP	1,498	12.15	18,200.70	
	WESFARMERS LIMITED	173	42.48	7,349.04	
	WESTPAC BANKING CORP	670	30.14	20,193.80	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	210	27.00	5,670.00	
	WOOLWORTHS LTD	167	22.17	3,702.39	
オーストラリア・ドル 小計		10,150		192,789.15 (15,351,800)	
カナダ・ドル	BANK OF MONTREAL	190	82.25	15,627.50	
	BCE INC	1,158	59.99	69,468.42	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	320	75.38	24,121.60	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	68	168.02	11,425.36	

	MAGNA INTERNATIONAL INC	481	51.17	24,612.77	
	ROYAL BANK OF CANADA	280	77.57	21,719.60	
	TORONTO-DOMINION BANK	1,789	56.27	100,667.03	
カナダ・ドル 小計		4,286		267,642.28 (22,516,745)	
シンガポール・ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,000	15.01	15,010.00	
	KEPPEL CORP LTD	1,000	5.22	5,220.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,000	3.81	7,620.00	
シンガポール・ドル 小計		4,000		27,850.00 (2,223,823)	
スイス・フラン	ABB LTD	380	19.99	7,596.20	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	6,190.00	49,520.00	
	NOVARTIS AG	430	73.75	31,712.50	
	ROCHE HOLDING AG	146	242.10	35,346.60	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	4	2,124.00	8,496.00	
	SYNGENTA AG	23	394.70	9,078.10	
スイス・フラン 小計		991		141,749.40 (15,738,435)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	445	207.10	92,159.50	
	HENNES & MAURITZ AB	736	255.80	188,268.80	
スウェーデン・クローナ 小計		1,181		280,428.30 (3,696,044)	
デンマーク・クローネ	NOVO-NORDISK A/S	503	357.00	179,571.00	
デンマーク・クローネ 小計		503		179,571.00 (2,977,287)	
ユーロ	AIRBUS GROUP SE	130	53.33	6,932.90	
	ALLIANZ SE	220	136.65	30,064.54	
	AXA	2,463	20.85	51,365.86	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	3,514	5.57	19,580.00	
	BASF SE	300	66.71	20,013.60	
	BAYER AG	201	88.88	17,864.88	
	BNP PARIBAS	692	45.30	31,351.06	
	CAP GEMINI SA	235	80.21	18,849.35	
	CONTINENTAL AG	77	183.79	14,152.36	
	DAIMLER AG	324	56.50	18,306.00	
	DEUTSCHE POST AG	283	25.81	7,304.23	

	DEUTSCHE TELEKOM AG	669	15.80	10,576.22	
	ENEL SPA	4,114	3.94	16,209.16	
	GEA GROUP AG	147	40.91	6,014.50	
	HENKEL KGAA-VORZUG	354	102.37	36,238.98	
	HERMES INTERNATIONAL	116	318.05	36,893.80	
	IBERDROLA SA	5,868	6.02	35,366.43	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,475	12.28	18,120.37	
	ING GROEP NV	2,896	10.28	29,770.88	
	INTESA SANPAOLO	6,970	2.29	16,003.12	
	KERRY GROUP PLC-A	316	78.88	24,926.08	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	358	22.90	8,198.20	
	LINDE AG	40	126.90	5,076.20	
	LUXOTTICA GROUP SPA	388	48.88	18,965.44	
	ORANGE S.A.	1,167	14.95	17,446.65	
	RELX NV	861	14.92	12,850.42	
	RENAULT SA	173	79.05	13,675.65	
	SAFRAN SA	120	58.57	7,028.40	
	SANOFI	227	69.00	15,663.00	
	SAP SE	501	68.51	34,324.51	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	414	55.47	22,964.58	
	SIEMENS AG	160	92.85	14,856.00	
	SOCIETE GENERALE	552	34.46	19,024.68	
	TOTAL SA	380	42.13	16,009.40	
	VINCI SA	170	65.15	11,075.50	
	ユーロ 小計	36,875		683,062.95 (84,208,000)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	2,600	42.70	111,020.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,500	22.20	55,500.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	1,000	44.45	44,450.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,000	88.45	88,450.00	
	CLP HOLDINGS LTD	1,500	70.90	106,350.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,000	24.25	24,250.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,100	43.70	48,070.00	
	MTR CORP	1,500	39.10	58,650.00	
	香港・ドル 小計	12,200		536,740.00 (7,605,606)	

合計	145,897		548,989,796 (548,989,796)	
----	---------	--	------------------------------	--

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 97銘柄	59.71%	64.43%
イギリス・ポンド	株式 15銘柄	6.91%	7.46%
オーストラリア・ドル	株式 12銘柄	2.59%	2.80%
カナダ・ドル	株式 7銘柄	3.80%	4.10%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	0.38%	0.41%
スイス・フラン	株式 6銘柄	2.66%	2.87%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	0.62%	0.67%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	0.50%	0.54%
ユーロ	株式 35銘柄	14.21%	15.34%
香港・ドル	株式 8銘柄	1.28%	1.39%

(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27年11月20日現在)	(平成28年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	17,800,427
コール・ローン	960,599,882	1,048,942,944
国債証券	21,286,832,251	19,266,848,318
派生商品評価勘定	2,923,800	6,293,520
未収入金	1,069,531,128	1,567,166,796
未収利息	39,311,650	30,493,849
前払費用	14,278,923	8,964,468
差入委託証拠金	1,800,000	4,320,000
流動資産合計	23,375,277,634	21,950,830,322
資産合計	23,375,277,634	21,950,830,322
負債の部		
流動負債		
前受金	3,840,000	4,560,000
未払金	1,068,638,962	1,569,272,948
未払解約金	35,450,852	27,720,248
その他未払費用	-	12,101
流動負債合計	1,107,929,814	1,601,565,297
負債合計	1,107,929,814	1,601,565,297
純資産の部		
元本等		
元本	16,276,630,098	13,931,541,097
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,990,717,722	6,417,723,928
純資産合計	22,267,347,820	20,349,265,025
負債純資産合計	23,375,277,634	21,950,830,322

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28年5月20日現在）
1. 受益権総口数	16,276,630,098口	13,931,541,097口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3681円 (13,681円)	1.4607円 (14,607円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成27年5月21日 至 平成27年11月20日）	（自 平成27年11月21日 至 平成28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27年11月20日現在）	（平成28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27年11月20日現在	平成28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	28,738,872	657,188,083

合計	28,738,872	657,188,083
----	------------	-------------

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

債券関連

種類	（平成27年11月20日 現在）				（平成28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	887,400,000	-	890,340,000	2,940,000	904,560,000	-	910,860,000	6,300,000
合計	887,400,000	-	890,340,000	2,940,000	904,560,000	-	910,860,000	6,300,000

（注） 1．時価の算定方法

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28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	17,747,327,541円	16,276,630,098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	2,135,423,550円	1,362,491,709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	3,606,120,993円	3,707,580,710円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	755,266,094円	663,502,738円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	272,477,564円	241,383,094円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	62,821,159円	52,625,218円
ニッセイノパトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	72,125,249円	59,435,365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)	2,594,332,905円	2,008,984,273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)	3,421,058,274円	2,443,339,712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)	228,219,781円	203,951,900円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)	2,233,513,794円	2,137,951,709円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)	3,737,021,854円	3,430,636,606円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)	904,484,622円	801,922,219円
DCニッセイ国内債券アクティブ	1,172,211,690円	1,277,509,387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)	682,969,941円	439,990,314円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(毎月分配型)	35,433,653円	28,858,881円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド(成長重視型)	9,664,725円	8,546,111円
DCニッセイバランスアクティブ	95,028,793円	132,903,570円
計	16,276,630,098円	13,931,541,097円

附属明細表(平成28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350回 利付国債(2年)	205,900,000	206,303,133	
	第351回 利付国債(2年)	481,000,000	482,292,350	
	第352回 利付国債(2年)	910,700,000	914,095,611	
	第355回 利付国債(2年)	506,400,000	508,673,736	
	第356回 利付国債(2年)	673,500,000	676,779,945	
	第357回 利付国債(2年)	76,900,000	77,302,956	
	第358回 利付国債(2年)	49,000,000	49,272,930	
	第359回 利付国債(2年)	144,000,000	144,835,200	
	第361回 利付国債(2年)	235,800,000	237,233,664	
	第362回 利付国債(2年)	2,092,300,000	2,105,586,105	
	第364回 利付国債(2年)	11,500,000	11,577,510	
	第107回 利付国債(5年)	38,300,000	38,578,441	
	第113回 利付国債(5年)	906,900,000	917,293,074	
	第116回 利付国債(5年)	150,700,000	152,437,571	
	第118回 利付国債(5年)	158,000,000	160,151,960	
	第119回 利付国債(5年)	171,400,000	173,203,128	
	第120回 利付国債(5年)	163,700,000	166,086,746	
	第123回 利付国債(5年)	964,300,000	976,565,896	
	第125回 利付国債(5年)	71,700,000	72,717,423	
	第126回 利付国債(5年)	753,700,000	765,020,574	
	第1回 利付国債(40年)	7,900,000	12,793,497	
	第2回 利付国債(40年)	41,800,000	65,726,738	
	第7回 利付国債(40年)	2,100,000	3,067,386	
	第8回 利付国債(40年)	46,000,000	62,614,740	
	第297回 利付国債(10年)	800,000	833,776	
	第316回 利付国債(10年)	152,900,000	163,297,200	
	第318回 利付国債(10年)	731,700,000	780,014,151	
	第328回 利付国債(10年)	302,600,000	319,784,654	
	第329回 利付国債(10年)	1,300,000	1,394,770	
	第341回 利付国債(10年)	81,400,000	84,711,352	
	第342回 利付国債(10年)	38,100,000	38,894,385	

第26回 利付国債(30年)	454,600,000	648,682,378	
第27回 利付国債(30年)	40,200,000	58,572,204	
第28回 利付国債(30年)	67,500,000	98,927,325	
第29回 利付国債(30年)	74,500,000	108,255,205	
第30回 利付国債(30年)	124,100,000	178,639,468	
第34回 利付国債(30年)	5,500,000	7,978,630	
第37回 利付国債(30年)	1,900,000	2,657,929	
第39回 利付国債(30年)	127,500,000	179,706,150	
第40回 利付国債(30年)	83,500,000	115,716,805	
第42回 利付国債(30年)	229,000,000	312,527,750	
第44回 利付国債(30年)	47,400,000	64,893,918	
第45回 利付国債(30年)	159,000,000	209,768,700	
第46回 利付国債(30年)	44,600,000	58,875,568	
第47回 利付国債(30年)	46,500,000	62,748,960	
第48回 利付国債(30年)	42,800,000	55,490,200	
第49回 利付国債(30年)	84,400,000	109,619,564	
第50回 利付国債(30年)	481,600,000	543,789,008	
第84回 利付国債(20年)	138,800,000	167,059,680	
第92回 利付国債(20年)	51,300,000	63,193,905	
第99回 利付国債(20年)	224,100,000	280,194,471	
第102回 利付国債(20年)	49,600,000	64,283,088	
第105回 利付国債(20年)	71,500,000	90,340,965	
第107回 利付国債(20年)	15,300,000	19,389,078	
第109回 利付国債(20年)	35,900,000	44,731,759	
第112回 利付国債(20年)	16,700,000	21,298,846	
第113回 利付国債(20年)	218,000,000	278,819,820	
第114回 利付国債(20年)	41,200,000	52,837,764	
第116回 利付国債(20年)	428,400,000	557,125,632	
第117回 利付国債(20年)	1,500,000	1,930,050	
第118回 利付国債(20年)	261,000,000	333,291,780	
第123回 利付国債(20年)	1,500,000	1,947,765	
第127回 利付国債(20年)	44,300,000	56,357,574	
第128回 利付国債(20年)	396,200,000	505,103,494	
第131回 利付国債(20年)	120,000,000	149,659,200	
第132回 利付国債(20年)	113,000,000	141,269,210	
第133回 利付国債(20年)	26,800,000	33,917,276	
第134回 利付国債(20年)	800,000	1,014,984	
第136回 利付国債(20年)	400,000	494,992	
第137回 利付国債(20年)	196,700,000	246,878,170	
第138回 利付国債(20年)	111,000,000	135,798,510	
第139回 利付国債(20年)	95,500,000	118,348,375	

第140回 利付国債(20年)	400,400,000	503,310,808	
第143回 利付国債(20年)	56,000,000	69,665,680	
第145回 利付国債(20年)	2,500,000	3,155,600	
第146回 利付国債(20年)	51,300,000	64,837,044	
第147回 利付国債(20年)	1,600,000	1,997,264	
第149回 利付国債(20年)	178,500,000	220,127,985	
第150回 利付国債(20年)	179,900,000	218,641,465	
第151回 利付国債(20年)	232,400,000	274,266,860	
第152回 利付国債(20年)	58,800,000	69,402,816	
第153回 利付国債(20年)	555,600,000	666,658,884	
第154回 利付国債(20年)	2,800,000	3,305,596	
第155回 利付国債(20年)	213,200,000	243,721,712	
第156回 利付国債(20年)	366,800,000	376,479,852	
国債証券 合計	17,246,200,000	19,266,848,318	
合計	17,246,200,000	19,266,848,318	

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

	（平成27年11月20日現在）	（平成28年5月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	71,649,030	59,248,340
金銭信託	-	2,805,908
コール・ローン	86,107,432	165,346,479
国債証券	22,089,775,307	20,207,679,068
派生商品評価勘定	18,885,737	75,030,670
未収入金	750,391,483	1,953,083,573
未収利息	148,730,099	133,537,739
前払費用	49,117,586	64,965,873
流動資産合計	23,214,656,674	22,661,697,650
資産合計	23,214,656,674	22,661,697,650
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,178,171	38,302,266
未払金	617,284,665	1,957,569,824
未払解約金	37,029,199	1,871,648
その他未払費用	-	2,158
流動負債合計	668,492,035	1,997,745,896
負債合計	668,492,035	1,997,745,896
純資産の部		
元本等		
元本	8,043,434,293	7,908,115,585
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,502,730,346	12,755,836,169
純資産合計	22,546,164,639	20,663,951,754
負債純資産合計	23,214,656,674	22,661,697,650

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27年11月20日現在）	（平成28年5月20日現在）
1. 受益権総口数	8,043,434,293口	7,908,115,585口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.8031円 (28,031円)	2.6130円 (26,130円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成27年5月21日 至 平成27年11月20日）	（自 平成27年11月21日 至 平成28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27年11月20日現在）	（平成28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27年11月20日現在	平成28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	183,668,760	56,818,606

合計	183,668,760	56,818,606
----	-------------	------------

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

通貨関連

種類	(平成27年11月20日 現在)				(平成28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	5,121,175,016	-	5,120,610,648	564,368	7,107,395,005	-	7,114,820,392	7,425,387
アメリカ カ・ドル	580,036,612	-	578,994,677	1,041,935	1,072,290,300	-	1,077,977,644	5,687,344
イギリ ス・ボン ド	170,616,295	-	171,517,806	901,511	1,661,383,475	-	1,684,151,333	22,767,858
オースト ラリア・ ドル	45,681,696	-	46,149,520	467,824	292,481,855	-	292,676,049	194,194
カナダ・ ドル	67,046,295	-	67,180,701	134,406	40,877,689	-	40,938,552	60,863
シンガ ポール・ ドル	43,243,992	-	43,527,879	283,887	41,079,335	-	41,262,650	183,315
スウェー デン・ク ローナ	56,447,603	-	56,355,205	92,398	54,752,338	-	54,114,704	637,634
ノル ウェー・ クローネ	29,680,611	-	30,044,047	363,436	62,907,649	-	62,416,244	491,405
ポーラン ド・ズロ チ	-	-	-	-	21,619,901	-	21,552,102	67,799
メキシ コ・ペソ	678,291,459	-	683,140,887	4,849,428	499,880,814	-	495,312,793	4,568,021
ユーロ	3,406,075,337	-	3,398,669,846	7,405,491	3,311,020,295	-	3,296,874,388	14,145,907
南アフリ カ・ラン ド	44,055,116	-	45,030,080	974,964	49,101,354	-	47,543,933	1,557,421
買 建	5,287,971,352	-	5,292,114,550	4,143,198	7,266,179,513	-	7,310,333,304	44,153,791
アメリカ カ・ドル	3,845,832,291	-	3,848,709,177	2,876,886	5,430,359,984	-	5,477,807,118	47,447,134

イギリス・ポンド	52,387,084	-	52,682,640	295,556	699,085,155	-	699,719,300	634,145
オーストラリア・ドル	180,509,558	-	182,374,432	1,864,874	219,988,943	-	219,825,463	163,480
カナダ・ドル	78,906,287	-	79,013,298	107,011	134,139,578	-	133,712,424	427,154
スイス・フラン	68,467,640	-	67,754,500	713,140	59,587,210	-	59,033,226	553,984
デンマーク・クローネ	18,997,684	-	18,919,158	78,526	12,689,033	-	12,602,458	86,575
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	123,745,191	-	122,535,392	1,209,799
ポーランド・ズロチ	89,334,859	-	88,704,980	629,879	57,362,477	-	57,254,574	107,903
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	128,246,947	-	128,755,585	508,638
ユーロ	923,513,976	-	923,284,730	229,246	381,766,297	-	379,889,608	1,876,689
南アフリカ・ランド	30,021,973	-	30,671,635	649,662	19,208,698	-	19,198,156	10,542
合計	10,409,146,368	-	10,412,725,198	4,707,566	14,373,574,518	-	14,425,153,696	36,728,404

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	(平成27年11月20日現在)	(平成28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	8,191,944,826円	8,043,434,293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	3,801,415円	3,998,664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	152,311,948円	139,317,372円
元本の内訳		

ファンド名		
ニッセイ外国債券アクティブS A（適格機関投資家限定）	879,941,557円	780,877,171円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	8,723,860円	8,089,773円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	2,380,287円	2,395,147円
ニッセイ外国債券アクティブ（適格機関投資家限定）	7,152,388,589円	7,116,753,494円
計	8,043,434,293円	7,908,115,585円

附属明細表（平成28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 2016/09/30	11,230,000.00	11,255,604.40	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	3,180,000.00	3,217,365.00	
		US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	4,930,000.00	5,052,264.00	
		US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	6,300,000.00	6,772,941.00	
		US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	3,680,000.00	3,986,028.80	
		US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	10,760,000.00	13,036,816.00	
		US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	2,090,000.00	2,964,853.10	
	アメリカ・ドル	小計	42,170,000.00	46,285,872.30 (5,095,611,682)	
	イギリス・ポンド	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	1,470,000.00	1,924,156.50	
		TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	2,860,000.00	3,932,871.80	
		TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	2,670,000.00	3,080,886.30	
		UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	4,410,000.00	4,898,098.80	
	イギリス・ポンド	小計	11,410,000.00	13,836,013.40 (2,223,862,434)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	380,000.00	407,477.80	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	3,770,000.00	4,591,596.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	450,000.00	533,115.00	
オーストラリア・ドル 小計		4,600,000.00	5,532,188.90 (440,528,202)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	660,000.00	730,837.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	2,620,000.00	2,861,904.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	910,000.00	1,267,293.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	20,000.00	33,313.80	
カナダ・ドル 小計		4,210,000.00	4,893,349.50 (411,677,493)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	870,000.00	938,295.00	
シンガポール・ドル 小計		870,000.00	938,295.00 (74,922,856)	
スイス・フラン	Switzerland Government Bond 2.25 2020/07/06	10,000.00	11,305.60	
スイス・フラン 小計		10,000.00	11,305.60 (1,255,261)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	5,990,000.00	7,202,256.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 4.25 2019/03/12	3,920,000.00	4,440,576.00	
スウェーデン・クローナ 小計		9,910,000.00	11,642,832.20 (153,452,528)	
デンマーク・クロー ネ	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	80,000.00	88,089.60	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2019/11/15	3,870,000.00	4,457,233.80	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	1,780,000.00	3,105,975.40	
デンマーク・クローネ 小計		5,730,000.00	7,651,298.80 (126,858,534)	
ノルウェー・クロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	1,650,000.00	1,870,374.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	3,990,000.00	4,451,323.80	
ノルウェー・クローネ 小計		5,640,000.00	6,321,697.80 (83,256,760)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 3.75 2018/04/25	40,000.00	41,696.00	

	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	760,000.00	824,258.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	1,300,000.00	1,458,340.00	
ポーランド・ズロチ	小計	2,100,000.00	2,324,294.00 (64,964,017)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	2,010,000.00	2,068,410.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 5.734 2019/07/30	1,380,000.00	1,481,402.40	
マレーシア・リンギット	小計	3,390,000.00	3,549,813.00 (95,951,445)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	6,540,000.00	8,923,895.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	13,620,000.00	14,094,657.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	170,000.00	186,265.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2017/12/14	20,730,000.00	21,872,844.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2018/12/13	36,710,000.00	39,789,234.80	
メキシコ・ペソ	小計	77,770,000.00	84,866,897.70 (507,504,048)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	1,020,000.00	1,565,139.00	
	BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	2,280,000.00	3,283,291.20	
	BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	960,000.00	1,587,052.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	1,590,000.00	1,813,554.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	700,000.00	890,099.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	660,000.00	927,887.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	590,000.00	870,173.30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	1,690,000.00	2,184,544.70	
	BTPS 6.5 11/01/27 6.5 2027/11/01	410,000.00	610,002.10	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	2,010,000.00	2,093,595.90	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	950,000.00	1,551,815.50	

	BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	4,380,000.00	5,098,451.40	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2017/02/01	11,920,000.00	12,265,560.80	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	2,730,000.00	3,095,574.30	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	2,810,000.00	3,481,421.40	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	150,000.00	213,132.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	2,780,000.00	3,913,878.60	
	BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2017/08/01	8,370,000.00	8,904,591.90	
	FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	3,820,000.00	4,449,345.00	
	FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	10,600,000.00	12,559,304.00	
	FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	720,000.00	1,021,730.40	
	FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	5,300,000.00	6,097,120.00	
	FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	1,480,000.00	2,466,997.20	
	FRENCH OAT 5.5 2029/04/25	2,350,000.00	3,731,682.50	
	IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	400,000.00	495,332.00	
	SPANISH GVOT 5.75 07 5.75 2032/07/30	400,000.00	596,456.00	
	TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	500,000.00	589,810.00	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	1,100,000.00	1,534,940.00	
	ユーロ 小計	72,670,000.00	87,892,482.40 (10,835,385,230)	
	南アフリカ・ランド			
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	10,270,000.00	7,009,480.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.25 2020/01/15	6,560,000.00	6,254,304.00	
	南アフリカ・ランド 小計	16,830,000.00	13,263,784.40 (92,448,577)	
国債証券 合計			20,207,679,068 (20,207,679,068)	
合計			20,207,679,068 (20,207,679,068)	

（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 7銘柄	24.66%	25.22%
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	10.76%	11.01%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	2.13%	2.18%
カナダ・ドル	国債証券 4銘柄	1.99%	2.04%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	0.36%	0.37%
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	0.74%	0.76%
デンマーク・クローネ	国債証券 3銘柄	0.61%	0.63%
ノルウェー・クローネ	国債証券 2銘柄	0.40%	0.41%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	0.31%	0.32%
マレーシア・リングgit	国債証券 2銘柄	0.46%	0.47%
メキシコ・ペソ	国債証券 5銘柄	2.46%	2.51%
ユーロ	国債証券 28銘柄	52.44%	53.62%
南アフリカ・ランド	国債証券 2銘柄	0.45%	0.46%

（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」- R E I T マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成27年11月20日現在)	(平成28年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	231,302,989
コール・ローン	20,107,347,456	13,630,214,780
投資証券	404,396,320,240	379,691,019,500
未収入金	848,364,782	2,621,049,953
未収配当金	1,890,839,821	1,891,622,436
流動資産合計	427,242,872,299	398,065,209,658
資産合計	427,242,872,299	398,065,209,658
負債の部		
流動負債		
未払金	207,623,418	733,787,433
未払解約金	1,574,993,175	2,176,428,005
その他未払費用	-	192,521
流動負債合計	1,782,616,593	2,910,407,959
負債合計	1,782,616,593	2,910,407,959
純資産の部		
元本等		
元本	224,310,628,257	190,759,205,954
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	201,149,627,449	204,395,595,745
純資産合計	425,460,255,706	395,154,801,699
負債純資産合計	427,242,872,299	398,065,209,658

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27年11月20日現在）	（平成28年5月20日現在）
1. 受益権総口数	224,310,628,257口	190,759,205,954口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8967円 (18,967円)	2.0715円 (20,715円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成27年5月21日 至 平成27年11月20日）	（自 平成27年11月21日 至 平成28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27年11月20日現在）	（平成28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27年11月20日現在	平成28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	8,449,128,192	3,530,408,162
合計	8,449,128,192	3,530,408,162

(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27年11月20日現在）	（平成28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	219,638,777,996円	224,310,628,257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	41,343,046,224円	30,559,667,442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	36,671,195,963円	64,111,089,745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）	165,107,442,969円	132,331,215,608円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	26,078,131円	20,125,600円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	7,116,006円	5,959,639円
ニッセイJ-REITファンド（適格機関投資家限定）	8,964,446,984円	7,914,540,262円
ニッセイJリートオープン（毎月分配型）	43,969,716,584円	45,552,773,641円
ニッセイJリートオープン（年1回決算型）	2,892,965,274円	2,564,692,739円
ニッセイJ-REITファンド（年1回決算型）	3,342,862,309円	2,369,898,465円
計	224,310,628,257円	190,759,205,954円

附属明細表（平成28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	69,705	8,852,535,000	
	MCUBS MidCity投資法人	9,584	3,570,040,000	
	いちごオフィスリート投資法人	51,292	4,118,747,600	
	いちごホテルリート投資法人	1,975	348,982,500	
	いちご不動産投資 新	4,372	351,071,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	20,729	12,085,007,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	45,217	12,751,194,000	
	イオンリート投資法人	13,119	1,844,531,400	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	2,353	227,064,500	
	インヴィンシブル投資法人	150,784	10,931,840,000	
	オリックス不動産投資法人	92,887	16,496,731,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	7,382	3,100,440,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	20,987	13,431,680,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	14,276	4,161,454,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	14,433	4,136,497,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,517	1,290,978,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	167,870	15,930,863,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	56,655	8,537,908,500	
ジャパンリアルエステイト投資法人	42,979	28,624,014,000		
トップリート投資法人	3,646	1,638,877,000		

ヒューリックリート投資法人	55,060	10,461,400,000	
フロンティア不動産投資法人	20,709	11,244,987,000	
プレミア投資法人	48,518	6,622,707,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	97,022	17,677,408,400	
ラサールロジポート投資法人	809	81,466,300	
阪急リート投資法人	16,151	2,204,611,500	
産業ファンド投資法人	24,579	13,862,556,000	
森トラスト総合リート投資法人	18,336	3,788,217,600	
森ヒルズリート投資法人	42,036	6,885,496,800	
星野リゾート・リート投資法人	1,721	2,182,228,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	18,682	2,202,607,800	
積水ハウス・リート投資 新	3,924	525,031,200	
積水ハウス・リート投資法人	1,338	179,024,400	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	24,858	6,612,228,000	
大和ハウスリート投資法人	14,051	8,135,529,000	
大和証券オフィス投資法人	20,670	14,117,610,000	
東急リアル・エステート投資法人	16,510	2,578,862,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	13,523	6,213,818,500	
日本ビルファンド投資法人	44,885	29,803,640,000	
日本プライムリアルティ投資法人	31,638	14,933,136,000	
日本プロロジスリート投資法人	40,996	10,285,896,400	
日本ヘルスケア投資法人	3,435	623,109,000	
日本リート投資法人	7,459	2,079,569,200	
日本リテールファンド投資法人	76,925	19,869,727,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	29,941	7,269,674,800	
日本賃貸住宅投資法人	58,006	4,936,310,600	
福岡リート投資法人	10,520	2,076,648,000	
平和不動産リート投資法人	17,656	1,555,493,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	111,494	18,251,567,800	
投資証券 合計	1,667,214	379,691,019,500	
合計	1,667,214	379,691,019,500	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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27年11月20日現在)	(平成28年5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	101,299,181	70,838,273
金銭信託	-	1,097,619
コール・ローン	90,018,372	64,680,447
投資証券	4,893,355,253	4,723,129,608
派生商品評価勘定	41,728	-
未収入金	9,136,310	181,009
未収配当金	13,568,013	11,311,199
流動資産合計	5,107,418,857	4,871,238,155
資産合計	5,107,418,857	4,871,238,155
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	134,809	-
未払解約金	40,949,247	31,691,593
その他未払費用	-	396
流動負債合計	41,084,056	31,691,989
負債合計	41,084,056	31,691,989
純資産の部		
元本等		
元本	4,568,889,817	4,669,034,413
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	497,444,984	170,511,753
純資産合計	5,066,334,801	4,839,546,166
負債純資産合計	5,107,418,857	4,871,238,155

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27年11月20日現在）	（平成28年5月20日現在）
1 . 受益権総口数	4,568,889,817口	4,669,034,413口
2 . 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1089円 (11,089円)	1.0365円 (10,365円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成27年5月21日 至 平成27年11月20日）	（自 平成27年11月21日 至 平成28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27年11月20日現在)	(平成28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27年11月20日現在	平成28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	136,317,595	109,953,129
合計	136,317,595	109,953,129

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成27年11月20日 現在）				（平成28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	28,921,417	-	29,014,498	93,081	-	-	-	-
アメリカ・ドル	20,082,578	-	20,040,850	41,728	-	-	-	-
南アフリカ・ランド	8,838,839	-	8,973,648	134,809	-	-	-	-
合計	28,921,417	-	29,014,498	93,081	-	-	-	-

（注） 1．時価の算定方法

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

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

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

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成27年11月20日現在）	（平成28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	4,302,006,364円	4,568,889,817円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	1,182,475,717円	830,420,210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	915,592,264円	730,275,614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）	1,522,156,926円	1,492,429,210円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（毎月分配型）	22,537,322円	19,979,393円
ニッセイセカンドライフ応援ファンド（成長重視型）	6,152,027円	5,919,280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	3,017,969,166円	3,150,639,750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）	74,376円	66,780円
計	4,568,889,817円	4,669,034,413円

附属明細表（平成28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	89,532.00	
		AGREE REALTY CORP	400.00	16,328.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,800.00	261,884.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,400.00	54,222.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5,400.00	248,886.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	8,021.00	140,287.29	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	7,100.00	292,378.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	8,100.00	146,691.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	2,000.00	23,580.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2,129.00	22,333.21	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,600.00	32,736.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,500.00	986,205.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	700.00	8,092.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,300.00	779,373.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	8,800.00	129,712.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8,800.00	217,360.00			

CAMDEN PROPERTY TRUST	3,300.00	275,979.00	
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	4,079.00	100,547.35	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,200.00	82,902.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	5,200.00	34,736.00	
CHATHAM LODGING TRUST	1,700.00	34,969.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,200.00	72,128.00	
COLONY STARWOOD HOMES	1,300.00	32,994.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5,200.00	105,040.00	
CORESITE REALTY CORP	1,800.00	132,984.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,700.00	120,602.00	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	5,099.00	162,709.09	
COUSINS PROPERTIES INC	9,404.00	97,707.56	
CUBESMART	6,900.00	213,279.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	3,600.00	149,544.00	
DDR CORP	12,708.00	213,748.56	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	10,014.00	83,616.90	
DIGITAL REALTY TRUST INC	6,100.00	565,409.00	
DOUGLAS EMMETT INC	6,300.00	202,419.00	
DUKE REALTY CORP	14,100.00	322,749.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3,000.00	123,750.00	
EASTGROUP PROPERTIES	1,200.00	74,232.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	2,466.00	102,486.96	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	4,700.00	88,313.00	
EPR PROPERTIES	2,600.00	179,738.00	
EQUITY COMMONWEALTH	4,700.00	128,545.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,300.00	237,864.00	
EQUITY ONE INC	3,400.00	97,478.00	
EQUITY RESIDENTIAL	14,700.00	982,254.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,700.00	597,564.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,300.00	475,675.00	

FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,800.00	421,764.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,200.00	125,476.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2,500.00	21,125.00	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	9,800.00	212,072.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4,063.00	76,831.33	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	2,600.00	27,690.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	4,200.00	136,920.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	24,781.00	649,262.20	
GEO GROUP INC/THE	3,500.00	109,270.00	
GETTY REALTY CORP	402.00	7,863.12	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	800.00	12,888.00	
GLOBAL NET LEASE INC	3,900.00	32,175.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3,400.00	64,668.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	18,456.00	160,567.20	
HCP INC	19,800.00	638,748.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,900.00	118,248.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	4,450.00	130,073.50	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,650.00	46,030.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,200.00	190,344.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7,000.00	175,070.00	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	31,465.00	461,276.90	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	3,300.00	89,628.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	1,400.00	10,626.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	5,900.00	35,459.00	
KILROY REALTY CORP	4,100.00	248,706.00	
KIMCO REALTY CORP	17,400.00	472,758.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	3,500.00	92,120.00	

LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,200.00	114,452.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	10,253.00	92,277.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	6,200.00	221,650.00	
LTC PROPERTIES INC	1,000.00	45,630.00	
MACERICH CO/THE	5,419.00	395,207.67	
MACK-CALI REALTY CORP	4,500.00	111,600.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	10,300.00	142,346.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,100.00	307,179.00	
MONMOUTH REIT -CL A	2,300.00	26,496.00	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	7,600.00	73,872.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	5,100.00	225,930.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,500.00	51,800.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,100.00	72,941.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	5,000.00	53,000.00	
NEW YORK REIT INC	6,000.00	57,360.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,800.00	24,714.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	6,766.00	76,049.84	
NORTHSTAR REALTY FINANCE	11,000.00	137,170.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,640.00	204,976.80	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	500.00	11,175.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	4,400.00	74,140.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,600.00	85,572.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	4,300.00	89,913.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	4,100.00	76,301.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	5,400.00	105,624.00	
POST PROPERTIES INC	1,700.00	101,048.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1,400.00	18,326.00	
PROLOGIS INC	21,128.00	982,874.56	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	500.00	48,795.00	
PUBLIC STORAGE	6,100.00	1,523,780.00	

RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3,500.00	60,725.00	
REALTY INCOME CORP	10,234.00	604,317.70	
REGENCY CENTERS CORP	3,800.00	286,406.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	3,700.00	73,093.50	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	9,800.00	153,664.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	2,400.00	46,248.00	
RLJ LODGING TRUST	5,900.00	113,280.00	
ROUSE PROPERTIES INC	3,050.00	55,571.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	2,900.00	56,463.00	
SAUL CENTERS INC	600.00	32,772.00	
SELECT INCOME REIT	1,700.00	40,392.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	10,100.00	184,426.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	500.00	21,455.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	1,500.00	21,165.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	12,925.00	2,505,511.25	
SL GREEN REALTY CORP	4,400.00	432,652.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	1,600.00	165,392.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,800.00	202,564.00	
STAG INDUSTRIAL INC	3,100.00	63,085.00	
STORE CAPITAL CORP	4,100.00	102,705.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,900.00	56,448.00	
SUN COMMUNITIES INC	2,300.00	156,952.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	10,705.00	125,248.50	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3,700.00	127,132.00	
TAUBMAN CENTERS INC	2,500.00	171,400.00	
TERRENO REALTY CORP	1,600.00	37,488.00	
UDR INC	10,500.00	370,650.00	
UMH PROPERTIES INC	1,100.00	10,560.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	400.00	20,924.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	5,691.00	147,396.90	
URSTADT BIDDLE - CL A	500.00	10,270.00	

	VENTAS INC	13,717.00	890,370.47	
	VEREIT	37,800.00	353,052.00	
	VORNADO REALTY TRUST	7,282.00	674,750.12	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	2,500.00	70,225.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	4,800.00	175,392.00	
	WELLTOWER INC	14,900.00	1,019,160.00	
	WHITESTONE REIT	2,200.00	28,270.00	
	WP CAREY INC	3,400.00	210,970.00	
	WP GLIMCHER INC	9,741.00	93,708.42	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	6,000.00	89,820.00	
アメリカ・ドル 小計		837,938.00	29,923,497.40 (3,294,277,829)	
イギリス・ポンド	ASSURA PLC	65,416.00	37,287.12	
	BIG YELLOW GROUP PLC	6,682.00	55,126.50	
	BRITISH LAND CO PLC	46,005.00	331,466.02	
	DERWENT LONDON PLC	4,971.00	164,341.26	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	12,635.00	97,479.02	
	HAMMERSON PLC	32,965.00	183,944.70	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	24,628.00	25,884.02	
	INTU PROPERTIES PLC	40,317.00	113,693.94	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	35,258.00	403,351.52	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	17,526.00	28,532.32	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	2,426.00	5,543.41	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	17,979.00	18,698.16	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	32,426.00	14,397.14	
	REGIONAL REIT LTD	14,763.00	15,205.89	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	13,266.00	45,860.56	
	SEGRO PLC	32,556.00	137,060.76	
	SHAFTESBURY PLC	9,212.00	84,796.46	
WORKSPACE GROUP PLC	4,901.00	40,335.23		
イギリス・ポンド 小計		413,932.00	1,803,004.03 (289,796,838)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	15,793.00	51,011.39	
	ALE PROPERTY GROUP	4,432.00	19,678.08	

	ARENA REIT	15,368.00	30,351.80	
	BWP TRUST	27,504.00	98,739.36	
	CHARTER HALL GROUP	11,504.00	60,626.08	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	15,910.00	74,936.10	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	116,638.00	120,137.14	
	DEXUS PROPERTY GROUP	41,969.00	365,549.99	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	7,297.00	19,482.99	
	GOODMAN GROUP	68,916.00	491,371.08	
	GPT GROUP	78,140.00	412,579.20	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	4,632.00	15,007.68	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	13,153.00	37,354.52	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	12,641.00	34,130.70	
	INVESTA OFFICE FUND	26,170.00	110,699.10	
	MIRVAC GROUP	168,982.00	322,755.62	
	NATIONAL STORAGE REIT	22,295.00	41,580.17	
	SCENTRE GROUP	229,676.00	1,077,180.44	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	43,334.00	98,368.18	
	STOCKLAND	105,978.00	480,080.34	
	TRAFALGAR CORPORATE GROUP	16,383.00	15,563.85	
	VICINITY CENTRES	142,699.00	472,333.69	
	WESTFIELD CORP	82,543.00	860,098.06	
	オーストラリア・ドル 小計	1,271,957.00	5,309,615.56 (422,804,687)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	500.00	18,575.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1,900.00	25,764.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	600.00	30,780.00	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTI-U	600.00	17,400.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,100.00	64,092.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	300.00	13,872.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	1,000.00	13,170.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1,600.00	27,632.00	

	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1,800.00	26,352.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	3,400.00	63,512.00	
	Dream Global Real Estate Investment Trust	1,300.00	11,622.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	900.00	35,100.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	5,100.00	109,956.00	
	INVEST REAL ESTATE INVESTME	4,000.00	28,160.00	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1,400.00	25,774.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	500.00	7,480.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	500.00	10,285.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1,500.00	14,295.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	2,800.00	14,028.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800.00	161,762.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,400.00	48,090.00	
	カナダ・ドル 小計	39,000.00	767,701.00 (64,586,685)	
	シンガポール・ドル			
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	15,600.00	21,528.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	26,000.00	17,290.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	95,000.00	215,650.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	20,000.00	22,500.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	35,000.00	30,450.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	47,000.00	25,380.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	85,000.00	117,300.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	110,000.00	225,500.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	38,000.00	55,290.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	20,000.00	27,200.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	21,000.00	12,495.00	

	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	16,000.00	20,240.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	13,000.00	25,740.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	25,600.00	32,384.00	
	KEPPEL DC REIT	30,000.00	32,250.00	
	KEPPEL REIT	66,000.00	67,650.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	51,000.00	17,340.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	54,000.00	76,680.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	90,000.00	88,200.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	33,000.00	52,470.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	65,000.00	63,375.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	7,000.00	17,010.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	20,000.00	14,000.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	56,000.00	42,280.00	
	SUNTEC REIT	106,000.00	170,130.00	
シンガポール・ドル	小計	1,145,200.00	1,490,332.00 (119,003,010)	
トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	136,227.00	370,537.44	
	IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	64,895.00	108,374.65	
	SAF GAYRIMENKUL YATIRIM ORTA	32,035.00	25,948.35	
	TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	31,117.00	164,297.76	
トルコ・リラ	小計	264,274.00	669,158.20 (24,651,788)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	24,197.00	33,028.90	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	8,334.00	18,084.78	
ニュージーランド・ドル	小計	32,531.00	51,113.68 (3,804,391)	
メキシコ・ペソ	ASESOR DE ACTIVOS PRISMA SAP	16,200.00	211,896.00	
	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	26,600.00	911,050.00	

	CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA	30,700.00	452,518.00	
	FIBRA SHOP PORTAFOLIOS INMOB	35,400.00	556,134.00	
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	124,900.00	4,842,373.00	
	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	58,100.00	1,324,680.00	
	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIAL	49,300.00	1,487,874.00	
	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	14,400.00	395,424.00	
メキシコ・ペソ 小計		355,600.00	10,181,949.00 (60,888,055)	
ユーロ	AEDIFICA	284.00	17,372.28	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,686.00	53,500.06	
	BEFIMMO S.C.A.	398.00	22,646.20	
	BENI STABILI SPA	52,185.00	32,354.70	
	COFINIMMO	696.00	73,671.60	
	EUROCOMMERCIAL-CVA	2,055.00	83,330.25	
	FONCIERE DES REGIONS	2,101.00	164,529.31	
	GECINA SA	1,312.00	166,886.40	
	GREEN REIT PLC	20,000.00	28,700.00	
	HAMBORNER REIT AG	2,297.00	21,800.82	
	HIBERNIA REIT PLC-W/I	19,000.00	24,016.00	
	ICADE	1,660.00	112,216.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	35,100.00	27,623.70	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	13,000.00	14,755.00	
	KLEPIERRE	8,816.00	350,171.52	
	MERCIALYS	1,671.00	30,988.69	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	12,300.00	113,971.80	
	NSI NV	6,889.00	25,978.41	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,134.00	955,987.50	
	VASTNED RETAIL NV	708.00	27,983.70	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	562.00	45,578.20		
WERELDHAVE NV	1,752.00	76,702.56		
ユーロ 小計		191,606.00	2,470,764.70 (304,595,872)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	53,000.00	208,290.00	
	FORTUNE REIT	48,000.00	409,440.00	

	LINK REIT	90,000.00	4,122,000.00	
	PROSPERITY REIT	40,000.00	118,400.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	23,000.00	94,760.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	400.00	1,696.00	
香港・ドル 小計		254,400.00	4,954,586.00 (70,206,484)	
南アフリカ・ランド	DELTA PROPERTY FUND LTD	18,650.00	129,617.50	
	EMIRA PROPERTY FUND LTD	16,616.00	256,384.88	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	111,972.00	2,621,264.52	
	HOSPITALITY PROPERTY FUND-A	6,489.00	77,868.00	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	12,043.00	1,411,439.60	
	OCTODEC INVESTMENTS LTD	9,187.00	204,410.75	
	REBOSIS PROPERTY FUND LTD	19,070.00	196,421.00	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	196,891.00	2,218,961.57	
	RESILIENT REIT LTD	16,119.00	2,053,077.03	
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUND	40,368.00	195,784.80	
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	28,073.00	464,608.15	
南アフリカ・ランド 小計		475,478.00	9,829,837.80 (68,513,969)	
投資証券 合計			4,723,129,608 (4,723,129,608)	
合計			4,723,129,608 (4,723,129,608)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 144銘柄	68.07%	69.75%
イギリス・ポンド	投資証券 18銘柄	5.99%	6.14%
オーストラリア・ドル	投資証券 23銘柄	8.74%	8.95%
カナダ・ドル	投資証券 21銘柄	1.33%	1.37%

シンガポール・ドル	投資証券	25銘柄	2.46%	2.52%
トルコ・リラ	投資証券	4銘柄	0.51%	0.52%
ニュージーランド・ドル	投資証券	2銘柄	0.08%	0.08%
メキシコ・ペソ	投資証券	8銘柄	1.26%	1.29%
ユーロ	投資証券	22銘柄	6.29%	6.45%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	1.45%	1.49%
南アフリカ・ランド	投資証券	11銘柄	1.42%	1.45%

(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28年6月30日現在）

資産総額	181,317,450円
負債総額	156,990円
純資産総額（ - ）	181,160,460円
発行済数量	197,445,696口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9175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28年6月30日現在）

資産総額	53,685,678円
負債総額	84,586円
純資産総額（ - ）	53,601,092円
発行済数量	47,321,825口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1327円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

（1）資本金の額

平成28年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28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	290	46,958
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	51	10,015
単位型公社債投資信託	4	206
合計	345	57,181

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し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27年4月1日 至平成28年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		3,488,730		9,619,679
有価証券		5,209,385		7,602,477
前払費用		499,710		390,202
未収委託者報酬		2,778,650		3,426,935
未収運用受託報酬		1,519,030		1,649,081
未収投資助言報酬		216,814		208,775
繰延税金資産		417,418		480,820
その他		52,788		19,980
流動資産合計		14,182,529		23,397,951
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	88,529	1	80,574
車両	1	588	1	294
器具備品	1	90,111	1	114,079
有形固定資産合計		179,229		194,948
無形固定資産				
ソフトウェア		854,449		742,019
ソフトウェア仮勘定		17,421		88,417
その他		8,075		8,043
無形固定資産合計		879,946		838,479
投資その他の資産				
投資有価証券		35,677,217		35,476,609
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		175,262		-
差入保証金		284,888		285,819
繰延税金資産		-		170,956
その他		17		793
投資その他の資産合計		36,203,608		36,000,401

固定資産合計	37,262,784	37,033,830
資産合計	51,445,314	60,431,781

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

負債合計

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

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金

利益準備金	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000
繰越利益剰余金	23,998,814	31,277,901
利益剰余金合計	24,678,621	31,957,708

株主資本合計	42,960,461	50,239,548
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,696,385	1,309,858
評価・換算差額等合計	1,696,385	1,309,858
純資産合計	44,656,846	51,549,407
負債・純資産合計	51,445,314	60,431,781

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	15,670,934	23,796,732
運用受託報酬	7,825,480	10,253,108
投資助言報酬	872,448	887,392
業務受託料	47,100	-
営業収益計	24,415,963	34,937,233
営業費用		
支払手数料	6,834,391	10,915,789
広告宣伝費	28,551	59,346
調査費	4,581,959	5,358,400
支払運用委託報酬	1,811,448	2,043,036
支払投資助言報酬	1,722,179	2,189,966
委託調査費	80,518	90,937
調査費	967,812	1,034,460
委託計算費	148,832	189,969
営業雑経費	581,870	712,706
通信費	53,825	47,397
印刷費	170,610	207,694
協会費	21,379	22,682
その他営業雑経費	336,053	434,931
営業費用計	12,175,604	17,236,212
一般管理費		
役員報酬	1 62,272	1 69,958
給料・手当	2,905,979	2,984,319
賞与引当金繰入額	782,365	864,968
賞与	237,611	245,495
福利厚生費	532,618	581,952
退職給付費用	283,064	298,054
役員退職慰労引当金繰入額	7,250	7,450
役員退職慰労金	-	100
その他人件費	101,498	134,593
不動産賃借料	544,587	544,913

その他不動産経費		25,737		25,766
交際費		20,059		24,568
旅費交通費		100,791		114,715
固定資産減価償却費		440,227		401,740
租税公課		104,874		183,280
業務委託費		194,856		225,301
器具備品費		156,991		173,657
保険料		56,700		57,047
諸経費		135,187		146,268
一般管理費計		6,692,676		7,084,153
営業利益		5,547,682		10,616,866
営業外収益				
受取利息		274		747
有価証券利息		70,792		66,047
受取配当金	4	177,354	4	214,632
為替差益		31,164		-
その他営業外収益		6,906		32,180
営業外収益計		286,492		313,608
営業外費用				
為替差損		-		18,136
控除対象外消費税		19,444		10,447
その他営業外費用		6,244		499
営業外費用計		25,689		29,083
経常利益		5,808,485		10,901,391
特別利益				
投資有価証券売却益		366,068		100,523
投資有価証券償還益		15,343		17,323
事故受取保険金		-	5	5,609
特別利益計		381,411		123,456
特別損失				
投資有価証券売却損		-		726
固定資産除却損	3	8,042	3	6,419
事故損失賠償金	2	25,550		-
特別損失計		33,593		7,145
税引前当期純利益		6,156,304		11,017,702
法人税、住民税及び事業税		2,284,237		3,740,258
法人税等調整額		14,162		137,203

法人税等合計	2,298,400	3,603,055
当期純利益	3,857,904	7,414,647

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年4月 1 日 至 平成27年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	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	39,238,111
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	42,960,466

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

当事業年度(自 平成27年4月 1 日 至 平成28年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,46
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,56
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,64
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,279,087	7,279,087	7,279,08
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,54

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証 券評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,414,647
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	386,526	386,526	386,526
当期変動額合計	386,526	386,526	6,892,580
当期末残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407

注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5. 消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。		
取締役	180,000千円	
監査役	40,000千円	
2. 事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。		
3. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。		
	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	4,128千円	6,419千円
その他	3,914	-
計	8,042	6,419
4. 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。		
	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
関係会社からの受取配当金	41,126千円	51,062千円
5. 事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。		

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成26年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成26年3月31日

効力発生日 平成26年6月26日

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

平成27年6月25日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成27年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

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

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

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

（リース取引関係）

1．ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

該当するものはありません。

未経過リース料期末残高相当額等

該当するものはありません。

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
支払リース料	108	-
減価償却費相当額	100	-
支払利息相当額	1	-

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	9,619,679	9,619,679	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,602,477	7,619,170	16,692
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,118,488	22,356,870	238,381
その他有価証券	13,290,620	13,290,620	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

預金はすべて短期であるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

決算日の市場価格等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(平成27年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	3,488,730	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	5,200,000	22,400,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	990,647	9,384,052	1,683,297	3,372
合計	9,679,377	31,784,052	1,683,297	3,372

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(平成28年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	9,619,679	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	7,600,000	22,100,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	995,984	11,352,737	851,097	1,017
合計	18,215,663	33,452,737	851,097	1,017

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

（有価証券関係）

1．満期保有目的の債券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照 表計上額を超え るもの	(1)国債・地方債等	29,720,965	29,976,040	255,074
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,720,965	29,976,040	255,074
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,720,965	29,976,040	255,074

2. その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,882,680	5,808,946	73,733
	国債・地方債等	5,882,680	5,808,946	73,733
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,418,711	4,470,989	1,947,721
	小計	12,301,391	10,279,936	2,021,454
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	989,229	1,118,670	129,440
	小計	989,229	1,118,670	129,440
	合計	13,290,620	11,398,606	1,892,014

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

（2）退職給付費用

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,254千円であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

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

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	1,253,790 千円
退職給付費用	220,314
退職給付の支払額	70,046
退職給付引当金の期末残高	1,404,058

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	220,314 千円
----------------	------------

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、46,819千円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
-----------------------	-----------------------

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.63%に、それぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が33,334千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,097千円、その他有価証券評価差額金が29,763千円、それぞれ増加しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

〔関連情報〕

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	4,553,051

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	4,199,085

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等
前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	200,000	生命保険業	(被所有)直接90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,829,599	未収運用受託報酬	767,0
								投資助言報酬の受取	676,352	未収投資助言報酬	158,7
								業務受託料の受取	47,100	-	

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	200,000	生命保険業	(被所有)直接90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,566,369	未収運用受託報酬	600,6
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,2

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（ 1株当たり情報 ）

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

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

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26年4月1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
期中平均株式数	108千株	108千株

（ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

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28年3月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

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

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

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

(2) 販売会社

(平成28年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
高木証券株式会社	11,069百万円	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。
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
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) 投資助言会社（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28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J-REITマザーファンド」の運用に関する助言を行います。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月3日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	牧野あや子	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第21期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- 1．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
 - 2．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28年7月11日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

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27年11月21日から平成28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28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28年7月11日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

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27年11月21日から平成28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28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](#)