

【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25年11月14日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 宇治原 潔
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	DCニッセイ安定収益追求ファンド
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	当初設定額 5億円 継続募集額 上限5,000億円
【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25年1月30日をもって提出した有価証券届出書（平成25年7月8日および平成25年9月30日をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み、以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、半期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>

（略）

委託会社の概況（平成24年11月末現在）

1. 委託会社の名称：ニッセイアセットマネジメント株式会社

（略）

<訂正後>

（略）

委託会社の概況（平成25年9月末現在）

1. 委託会社の名称：ニッセイアセットマネジメント株式会社

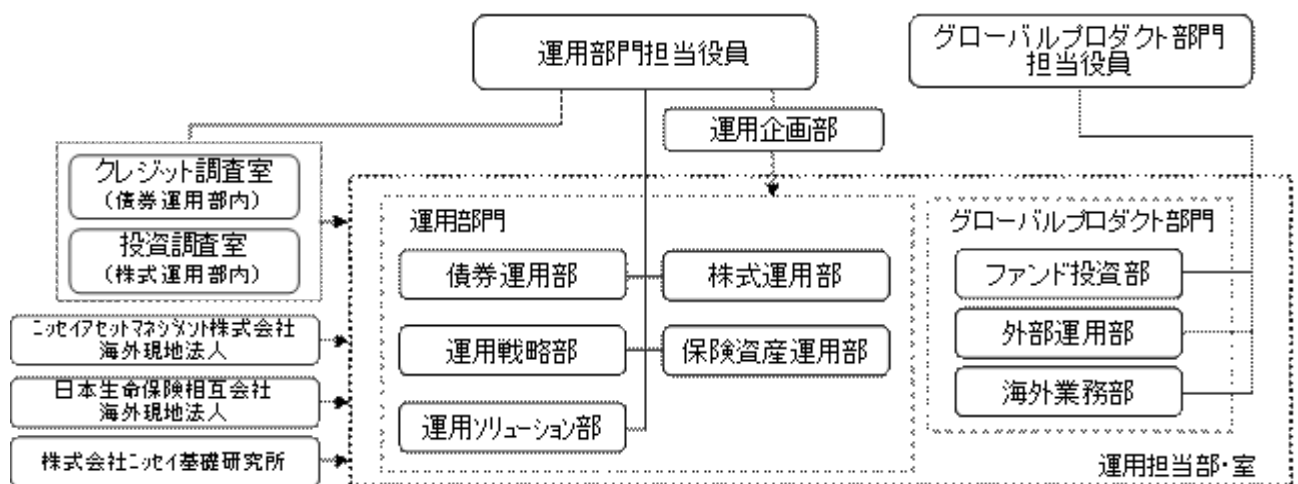
（略）

2【投資方針】

（3）【運用体制】

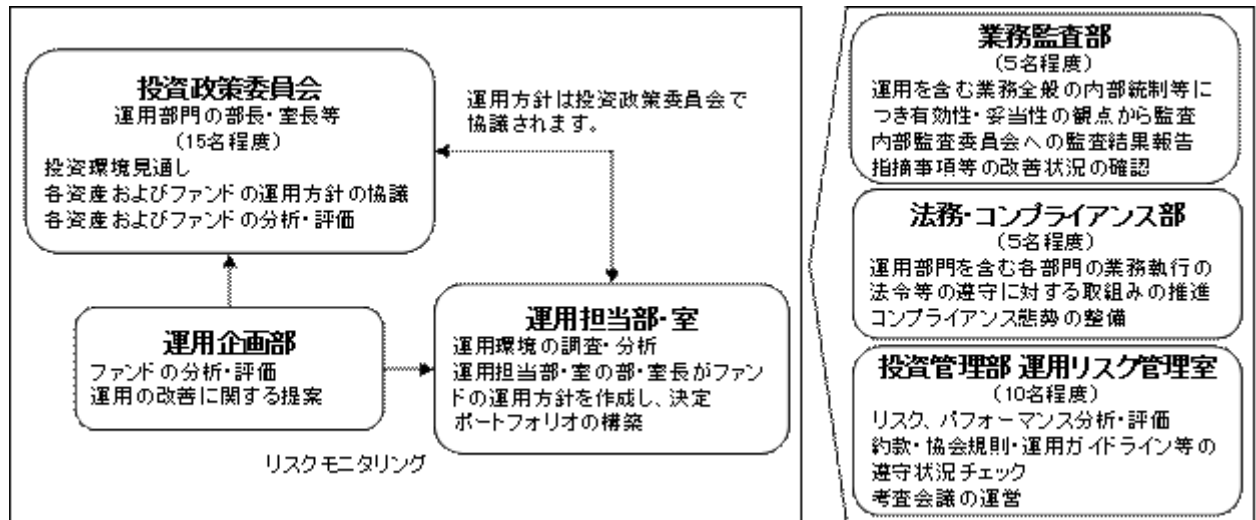
原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」「（3）運用体制」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。

委託会社の組織体制



（略）

内部管理体制および意思決定を監督する組織



(略)

4 【手数料等及び税金】

(3) 【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.6825% (税込) の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分 (税込)	
委託会社	年0.3150%
販売会社	年0.3150%
受託会社	年0.0525%

(略)

<訂正後>

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.6825% (税抜0.65%) の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

消費税率が8%になった場合は、年0.702%となります。

信託報酬の配分 (年率・税抜)		
委託会社	販売会社	受託会社
0.30%	0.30%	0.05%

(略)

(4) 【その他の手数料等】

<訂正前>

(略)

監査費用

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

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

(略)

< 訂正後 >

(略)

監査費用

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

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

消費税率が8%になった場合は、以下の通りとなります。

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

(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。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。

当ファンドは、以下の通り2回の約款変更を行っています。

- ・第1回の約款変更（平成25年8月15日）

当ファンドの投資対象を、4つの投資信託証券¹に2つの投資信託証券²を追加し、6つの投資信託証券とする変更

- ・第2回の約款変更（平成25年9月30日）

追加した2つの投資信託証券（マザーファンド）に投資するファミリーファンド方式に変更

- 1 「ニッセイ円金利資産マザーファンド」、「ニッセイクレジットキャリーファンドアロケーション専用（適格機関投資家限定）」、「ニッセイ国内株式配当利回り重視型マザーファンド」および「ニッセイ外国株式/外国債券マザーファンド」
- 2 「ニッセイ安定収益追求マザーファンド」および「ニッセイクレジットキャリーマザーファンド」

「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」は、第1回の約款変更後、第2回の約款変更前の内容を記載しています。

（1）【投資状況】

（平成25年8月30日現在）

資産の種類	国名又は地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	505,624,991	96.37
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		19,071,003	3.63
純資産総額		524,695,994	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）

「ニッセイ円金利資産マザーファンド」

（平成25年8月30日現在）

資産の種類	国名又は地域	時価合計（円）	投資比率（％）
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		26,213,704	100.00
純資産総額		26,213,704	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）

「ニッセイ安定収益追求マザーファンド」

（平成25年8月30日現在）

資産の種類	国名又は地域	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	--------	---------	---------

国債証券	日本	544,231,565	59.75
	ドイツ	89,165,430	9.79
	イギリス	68,294,076	7.50
	アメリカ	53,879,247	5.91
	オーストラリア	1,844,554	0.20
	小計	757,414,872	83.15
投資証券	アイルランド	44,044,716	4.83
	アメリカ	25,209,865	2.77
	日本	22,362,340	2.46
	小計	91,616,921	10.06
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		61,852,135	6.79
純資産総額		910,883,928	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）

「ニッセイクレジットキャリマザーファンド」

（平成25年8月30日現在）

資産の種類	国名又は地域	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	日本	308,520,196	0.50
社債券	アメリカ	19,069,133,664	30.86
	オランダ	9,681,312,231	15.67
	フランス	6,927,511,773	11.21
	イギリス	6,143,980,027	9.94
	日本	3,455,057,933	5.59
	スウェーデン	2,926,937,787	4.74
	カナダ	2,099,809,428	3.40
	アイルランド	1,758,217,564	2.85
	ドイツ	996,892,567	1.61
	デンマーク	881,006,526	1.43
	スイス	869,556,737	1.41
	ベルギー	322,237,724	0.52
	小計	55,131,653,961	89.23
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		6,349,071,553	10.27
純資産総額		61,789,245,710	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】

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成25年8月30日現在）

順位	国名	銘柄名	種類	口数（口）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	ニッセイ安定収益 追求マザーファン ド	親投資信託 受益証券	318,713,137	9,852	314,000,000	9,866	314,442,380	59.93
2	日本	ニッセイクレジッ トキャリアマザー ファンド	親投資信託 受益証券	161,195,780	10,236	165,000,000	10,234	164,967,761	31.44
3	日本	ニッセイ円金利資 産マザーファンド	親投資信託 受益証券	26,706,245	10,016	26,750,021	9,816	26,214,850	5.00
								投資比率：合計	96.37

（注1）投資有価証券は3銘柄のみで、簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額であります。

（注2）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	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	-	96.37
合計		96.37

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額の比率であります。

（参考情報）

「ニッセイ安定収益追求マザーファンド」

（平成25年8月30日現在）

順位	国名	銘柄名	利率 （％）	償還日	種類 / 業種	額面又は 数量	上段：帳簿価額（円）		投資 比率 （％）
							単価	金額	
1	日本	第316回 利付国債(2 年)	0.100	2014/5/15	国債証券	406,000,000	100.00	406,004,045	44.57
							100.00	406,004,045	
2	日本	第145回 利付国債(20 年)	1.700	2033/6/20	国債証券	137,000,000	99.95	136,925,410	15.18
							100.90	138,227,520	
3	ドイツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.750	2022/7/4	国債証券	680,000	13,322	90,590,776	9.79
							13,113	89,165,430	
4	イギリス	UK TSY 1.75% 2022	1.750	2022/9/7	国債証券	480,000	14,420	69,214,362	7.50
							14,228	68,294,076	
5	アメリカ	US TREASURY N/B	1.625	2022/11/15	国債証券	600,000	9,060	54,360,806	5.91
							8,980	53,879,247	
6	アイルラ ンド	ISHARES MSCI NORTH AMERICA	-	-	投資証券	8,030	3,226	25,908,551	2.77
							3,145	25,257,857	
7	アメリカ	ISHARES MSCI PACIFIC EX JAPA	-	-	投資証券	5,800	4,396	25,498,872	2.77
							4,347	25,209,865	

8	日本	TOPIX 連動型上場 投資信託 / 野村	-	-	投資証券	20,020	1,195 1,117	23,928,619 22,362,340	2.46
9	アイルラ ンド	ISHARES MSCI EUROPE- INC	-	-	投資証券	7,600	2,492 2,472	18,941,346 18,786,860	2.06
10	オースト リア	Australia Government Bond	4.750	2027/4/21	国債証券	20,000	9,484 9,223	1,896,701 1,844,554	0.20
								投資比率：合計	93.21

(注1) 投資有価証券の評価金額の全銘柄について記載しております。

(注2) 平成25年8月30日現在の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(注3) 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	業種	投資比率 (%)
国債証券	-	83.15
投資証券	-	10.06
合計		93.21

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額(平成25年8月30日現在の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額)の比率であります。

(参考情報)

「ニッセイクレジットキャリーマザーファンド」

(平成25年8月30日現在)

順位	国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面	上段：帳簿価額(円)		投資 比率 (%)	
							下段：評価額(円)			
							単価	金額		
1	ドイツ	DEUTSCHE BANK AG LONDON	3.250	2016/1/11	社債券	9,700,000	10,432 10,277	1,011,947,155 996,892,567	1.61	
2	フランス	BNP PARIBAS	3.600	2016/2/23	社債券	9,200,000	10,405 10,331	957,287,151 950,429,074	1.54	
3	アメリカ	BB&T CORPORATION	3.200	2016/3/15	社債券	9,200,000	10,485 10,276	964,643,471 945,415,861	1.53	
4	アメリカ	AMER EXPRESS CREDIT CO	5.375	2014/10/1	社債券	5,600,000	16,200 15,936	907,222,065 892,419,669	1.44	
5	デンマー ク	CARLSBERG BREWERIES A/S	6.000	2014/5/28	社債券	6,500,000	13,894 13,554	903,091,974 881,006,526	1.43	
6	日本	BK TOKYO-MITSUBISHI UFJ	1.000	2016/2/26	社債券	9,000,000	9,826 9,770	884,373,484 879,308,892	1.42	
7	オランダ	BASF FINANCE EUROPE NV	5.125	2015/6/9	社債券	6,100,000	14,401 14,076	878,431,551 858,640,802	1.39	
8	スウェー デン	SKANDINAVISKA ENSKILDA	6.625	2014/7/9	社債券	5,300,000	16,396 15,989	868,990,247 847,409,485	1.37	

9	オランダ	LINDE FINANCE BV	6.750	2015/12/8	社債券	5,700,000	15,117 14,802	861,659,895 843,701,232	1.37
10	アメリカ	PEPSICO INC	2.500	2016/5/10	社債券	8,000,000	10,309 10,179	824,712,207 814,294,899	1.32
11	アメリカ	BANK OF NEW YORK MELLON	2.300	2016/7/28	社債券	8,000,000	10,193 10,133	815,450,629 810,635,907	1.31
12	アメリカ	IBM CORP	1.950	2016/7/22	社債券	8,000,000	10,152 10,093	812,138,848 807,456,912	1.31
13	フランス	BANQUE FED CRED MUTUEL	3.000	2015/10/29	社債券	5,800,000	13,719 13,616	795,685,000 789,717,012	1.28
14	オランダ	Deutsche Telekom International Finance BV	5.750	2015/4/14	社債券	5,300,000	14,391 14,086	762,738,708 746,542,973	1.21
15	イギリス	GLAXOSMITHKLINE CAPITAL	3.875	2015/7/6	社債券	5,200,000	13,987 13,803	727,313,558 717,740,658	1.16
16	オランダ	NOMURA EUROPE FINANCE NV	6.300	2014/9/29	社債券	8,000,000	8,985 8,911	718,789,136 712,887,632	1.15
17	イギリス	BAT INTL FINANCE PLC	5.875	2015/3/12	社債券	5,000,000	14,308 14,058	715,377,583 702,885,744	1.14
18	イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	3.875	2016/3/16	社債券	5,000,000	14,140 13,950	707,006,407 697,506,832	1.13
19	日本	mitsubishi corp	2.750	2015/9/16	社債券	6,850,000	10,219 10,135	700,019,710 694,268,699	1.12
20	イギリス	STANDARD CHARTERED PLC	3.200	2016/5/12	社債券	6,700,000	10,428 10,271	698,649,506 688,146,921	1.11
21	オランダ	VOLKSWAGEN INTL FIN NV	7.000	2016/2/9	社債券	4,300,000	15,253 14,926	655,882,909 641,807,873	1.04
22	オランダ	SHELL INTERNATIONAL FIN	4.500	2016/2/9	社債券	4,400,000	14,476 14,251	636,946,013 627,026,414	1.01
23	アメリカ	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	6.625	2016/2/3	社債券	4,200,000	15,170 14,866	637,135,382 624,360,401	1.01
24	スウェー デン	Svenska Handelsbanken AB	1.500	2015/7/6	社債券	4,700,000	13,270 13,231	623,684,977 621,879,199	1.01
25	オランダ	BAYER CAPITAL CORP BV	4.625	2014/9/26	社債券	4,500,000	13,958 13,606	628,119,518 612,277,776	0.99
26	アメリカ	FHLMC GOLD Q00500	4.500	2041/4/1	特殊債券	1,005,934	10,516 10,350	105,783,480 104,118,064	0.96
27	アメリカ	FNMA MA1436	3.500	2043/5/1	特殊債券	994,354	10,343 9,779	102,844,295 97,236,539	0.90

28	アメリカ	JPMCC 2005-LDP1 B	5.069	2046/3/1	社債券	950,000	10,309 10,185	97,938,225 96,753,958	0.89
29	アメリカ	FNMA TBA	3.000	2043/8/1	特殊債券	1,000,000	9,556 9,487	95,559,038 94,872,784	0.88
30	アメリカ	MHL 2004-1 A2	1.090	2034/11/25	社債券	1,043,247	8,618 8,343	89,901,877 87,033,800	0.80
								投資比率：合計	36.28

（注1）投資有価証券の評価金額の上位30銘柄について記載しております。

（注2）平成25年8月30日現在の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

（注3）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	業種	投資比率（％）
社債券	-	89.23
特殊債券	-	0.50
合計		89.73

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額（平成25年8月30日現在の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額）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】

【純資産の推移】

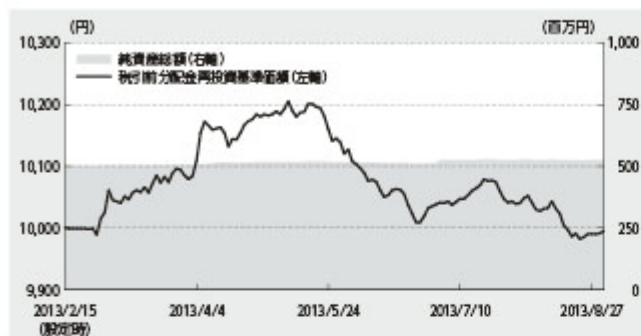
平成25年8月30日現在、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額（円）	1万口当たり純資産総額（円）
平成25年2月末日	500,733,500	10,015
3月末日	504,690,894	10,094
4月末日	516,667,160	10,184
5月末日	516,684,156	10,127
6月末日	511,955,658	10,032
7月末日	525,241,551	10,039
平成25年8月30日	524,695,994	9,995

〈参考情報〉

2013年8月末現在

● 基準価額・純資産の推移



- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 基準価額および純資産総額

基準価額	9,995円
純資産総額	524百万円

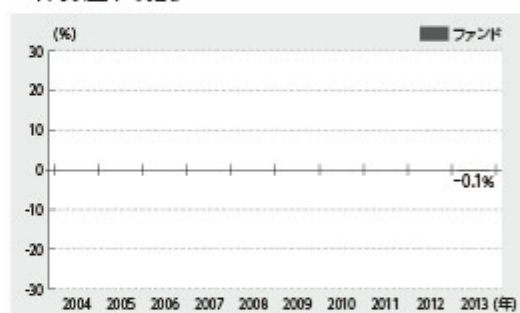
- 分配の推移
第1期決算日は2013年12月24日であり、該当事項はありません。

● 組入比率

	比率
円金利資産	93.2%
日本国債・短期資金等	51.2%
外国国債(為替ヘッジあり)	13.4%
国内社債・外国社債(為替ヘッジあり)	28.7%
内外株式	6.0%
外国国債(為替ヘッジなし)	0.7%
合計	100.0%

- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンドの収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2013年はファンド設定時から上記作成基準日までの収益率です。

● 各マザーファンドの組入上位銘柄(各マザーファンドの比率は対純資産総額比です)

1. ニッセイ安定収益追求マザーファンド

	銘柄	種別	比率
1	第316回 利付国債(2年)	国債	44.6%
2	第145回 利付国債(20年)	国債	15.2%
3	ドイツ国債	国債	9.8%
4	イギリス国債	国債	7.5%
5	アメリカ国債	国債	5.9%

2. ニッセイクレジットキャリマザーファンド

	銘柄	種別	比率
1	ドイツ銀行AG ロンドン	社債	1.6%
2	BNPパリバ	社債	1.5%
3	BB&T	社債	1.5%
4	アメリカン・エクスプレス・クレジット	社債	1.4%
5	カールズバーグプルワーズ	社債	1.4%

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

■ 最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」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。

1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期中間計算期間（平成25年2月15日から平成25年8月14日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

当ファンドは、以下の通り2回の約款変更を行っています。

・第1回の約款変更（平成25年8月15日）

当ファンドの投資対象を、4つの投資信託証券¹に2つの投資信託証券²を追加し、6つの投資信託証券とする変更

・第2回の約款変更（平成25年9月30日）

追加した2つの投資信託証券（マザーファンド）に投資するファミリーファンド方式に変更

- 1 「ニッセイ円金利資産マザーファンド」、「ニッセイクレジットキャリーファンドアロケーション専用（適格機関投資家限定）」、「ニッセイ国内株式配当利回り重視型マザーファンド」および「ニッセイ外国株式/外国債券マザーファンド」
- 2 「ニッセイ安定収益追求マザーファンド」および「ニッセイクレジットキャリーマザーファンド」

「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」は、第1回の約款変更前の内容を記載しています。

DCニッセイ安定収益追求ファンド 中間財務諸表
(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		第1期中間計算期間 (平成25年8月14日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		172,715,404
投資信託受益証券		181,378,873
親投資信託受益証券		173,847,430
流動資産合計		527,941,707
資産合計		527,941,707
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		133,053
未払委託者報酬		1,597,031
その他未払費用		106,387
流動負債合計		1,836,471
負債合計		1,836,471
純資産の部		
元本等		
元本		524,463,585
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		1,641,651
純資産合計		526,105,236
負債純資産合計		527,941,707

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 （自平成25年2月15日 至平成25年8月14日）
営業収益	
受取利息	18,965
有価証券売買等損益	3,226,303
営業収益合計	3,245,268
営業費用	
受託者報酬	133,053
委託者報酬	1,597,031
その他費用	106,387
営業費用合計	1,836,471
営業利益又は営業損失（ ）	1,408,797
経常利益又は経常損失（ ）	1,408,797
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,408,797
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	47,259
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	281,141
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	281,141
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,028
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,028
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,641,651

(3) 【中間注記表】

(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>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、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。</p> <p>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。</p>
2. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>ファンドの中間計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年12月25日から翌年12月24日までとしておりますが、第1期中間計算期間は期首が設定日のため、平成25年2月15日から平成25年8月14日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間 (平成25年8月14日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総口数	524,463,585口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0031円 (10,031円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期中間計算期間 (平成25年8月14日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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 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>

3. 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。
----------------------------	--

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

1. 当ファンドの約款変更について	当ファンドは、主要投資対象等について、平成25年8月15日付及び平成25年9月30日付で約款変更を実施しております。 （1）平成25年8月15日付約款変更 投資対象に「ニッセイ安定収益追求マザーファンド」及び「ニッセイクレジットキャリマザーファンド」の2つの投資信託証券を追加しております。 （2）平成25年9月30日付約款変更 平成25年8月15日付約款変更にて追加した2つの投資信託証券（親投資信託受益証券）によるファミリーファンド方式の運用へ変更しております。
2. 主要対象等の償還について	「ニッセイ円金利資産マザーファンド」は、信託約款第46条第1項の規定に基づき信託契約の解約を行い、平成25年9月27日をもって期限前償還いたします。

（その他の注記）

開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第1期中間計算期間 (平成25年8月14日現在)
期首元本額	500,000,000円
期中追加設定元本額	28,123,766円
期中一部解約元本額	3,660,181円

<参考>

開示対象ファンド（DCニッセイ安定収益追求ファンド）は、「ニッセイクレジットキャリマザーファンドアロケーション専用（適格機関投資家限定）」受益証券、「ニッセイ外国株式/外国債券マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内株式配当利回り重視型マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ円金利資産マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている投資信託受益証券及び親投資信託受益証券は、すべて同ファンドの投資信託の受益証券及び各マザーファンドの受益証券であります。

なお、「ニッセイクレジットキャリマザーファンドアロケーション専用（適格機関投資家限定）」受益証券は、ニッセイアセットマネジメント株式会社の設定・運用する追加型証券投資信託であり、「ニッセイクレジットキャリマザーファンド」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た「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。それらの計算期間は原則として、毎年12月21日から翌年の12月20日までであります。開示対象ファンドの中間計算期間末日（「ニッセイクレジットキャリマザーファンドアロケーション専用（適格機関投資家限定）」受益証券及び「ニッセイクレジットキャリマザーファンド」受益証券については中間計算期間末日の前営業日）（以下、「計算日」という。）における上記の各投資信託の状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイクレジットキャリアファンドアロケーション専用（適格機関投資家限定）」の状況

貸借対照表

(単位：円)

(平成25年8月13日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,358,636,803
国債証券	4,554,786,210
親投資信託受益証券	52,390,953,185
未収利息	1,337,785
前払費用	268,708
流動資産合計	58,305,982,691
資産合計	58,305,982,691
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	3,812,462
未払委託者報酬	1,270,813
その他未払費用	414,138
流動負債合計	5,497,413
負債合計	5,497,413
純資産の部	
元本等	
元本	57,833,520,206
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	466,965,072
純資産合計	58,300,485,278
負債純資産合計	58,305,982,691

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>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。</p> <p>国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
--------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年8月13日現在)
----	----------------

1. 計算日における受益権総口数	57,833,520,206口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0081円 (10,081円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年8月13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。
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。
3. 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。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(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。

(その他の注記)

「ニッセイクレジットキャリアファンドアロケーション専用(適格機関投資家限定)」の期首から計算日までの期間における元本額の変動

項目	(平成25年8月13日現在)
期首元本額	17,160,463,407円
期首から計算日までの追加設定元本額	41,066,074,255円
期首から計算日までの一部解約元本額	393,017,456円

「ニッセイクレジットキャリアマザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

	(平成25年8月13日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	458,542,310
コール・ローン	2,598,940,730

特殊債券	307,606,283
社債券	54,891,699,049
派生商品評価勘定	480,732,308
未収利息	691,383,579
前払費用	200,426,355
流動資産合計	59,629,330,614
資産合計	59,629,330,614
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	65,399,246
未払金	456,409,506
流動負債合計	521,808,752
負債合計	521,808,752
純資産の部	
元本等	
元本	57,688,959,697
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,418,562,165
純資産合計	59,107,521,862
負債純資産合計	59,629,330,614

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年8月13日現在）
1. 計算日における受益権総口数	57,688,959,697口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0246円 (10,246円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成25年8月13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。
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。
3. 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。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成25年8月13日 現在）			
	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	57,422,863,228	-	56,999,196,407	423,666,821
アメリカ・ドル	20,495,552,927	-	20,280,751,390	214,801,537
イギリス・ポンド	5,402,118,504	-	5,447,027,701	44,909,197
オーストラリア・ドル	2,157,699,893	-	2,169,856,183	12,156,290
ユーロ	29,367,491,904	-	29,101,561,133	265,930,771
買 建	942,751,116	-	934,417,357	8,333,759
ユーロ	942,751,116	-	934,417,357	8,333,759
合計	58,365,614,344	-	57,933,613,764	415,333,062

（注） 時価の算定方法

1. 国内における計算日の対顧客先物売買取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取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取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。

（その他の注記）

「ニッセイクレジットキャリアファンドアロケーション専用（適格機関投資家限定）」の期首から計算日までの期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成25年8月13日現在）
同期間の期首元本額	23,582,186,209円
同期間中の追加設定元本額	35,952,806,482円
同期間中の一部解約元本額	1,846,032,994円
同期間末日の元本額	57,688,959,697円
上記元本額の内訳	
ニッセイクレジットキャリアファンド（適格機関投資家限定）	6,250,977,404円
ニッセイクレジットキャリアファンドアロケーション専用（適格機関投資家限定）	51,133,079,431円
ニッセイ・リスクコントロール・プロファンド（適格機関投資家限定）	304,598,263円
ニッセイ安定収益追求ファンド	304,599円
計	57,688,959,697円

「ニッセイ外国株式/外国債券マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年8月14日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	149,126,604
コール・ローン	150,401,759
株式	3,877,936,925
国債証券	551,367,898
派生商品評価勘定	78,821
未収入金	52,650,479
未収配当金	4,607,092
未収利息	2,869,395
前払費用	2,430,164
流動資産合計	4,791,469,137
資産合計	4,791,469,137
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	4,966
未払金	111,132,216
流動負債合計	111,137,182
負債合計	111,137,182
純資産の部	
元本等	
元本	3,370,151,848
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,310,180,107
純資産合計	4,680,331,955
負債純資産合計	4,791,469,137

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。 国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年8月14日現在)
1. 計算日における受益権総口数	3,370,151,848口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3888円 (13,888円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成25年8月14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。
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。
3. 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。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成25年8月14日 現在）			
	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	10,302,995	-	10,306,387	3,392
アメリカ・ドル	109,448	-	109,482	34
イギリス・ポンド	10,193,547	-	10,196,905	3,358
買 建	15,951,052	-	16,028,299	77,247
インドネシア・ルピア	5,697,369	-	5,776,190	78,821
ユーロ	10,253,683	-	10,252,109	1,574
合計	26,254,047	-	26,334,686	73,855

（注） 時価の算定方法

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

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

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

（その他の注記）

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

項目	（平成25年8月14日現在）
同中間計算期間の期首元本額	3,578,302,153円
同中間計算期間中の追加設定元本額	3,414,588,619円
同中間計算期間中の一部解約元本額	3,622,738,924円
同中間計算期間末日の元本額	3,370,151,848円
上記元本額の内訳	
ニッセイリスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	422,672,524円
ニッセイリスク抑制型バランスDB（適格機関投資家限定）	1,903,779,861円
ニッセイリスク抑制型バランスファンド（一般投資家私募）	281,362,987円
ニッセイリスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	316,989,821円
ニッセイリスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	423,545,876円
DCニッセイ安定収益追求ファンド	21,800,779円
計	3,370,151,848円

「ニッセイ国内株式配当利回り重視型マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年8月14日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,964,994
株式	1,698,835,100
未収配当金	2,652,600
流動資産合計	1,727,452,694
資産合計	1,727,452,694
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	1,067,482,941
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	659,969,753

純資産合計	1,727,452,694
負債純資産合計	1,727,452,694

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年8月14日現在）
1. 計算日における受益権総口数	1,067,482,941口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6182円 (16,182円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成25年8月14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。
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。
3. 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。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

(その他の注記)

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

項目	(平成25年8月14日現在)
同中間計算期間の期首元本額	814,277,144円
同中間計算期間中の追加設定元本額	410,930,081円
同中間計算期間中の一部解約元本額	157,724,284円
同中間計算期間末日の元本額	1,067,482,941円
上記元本額の内訳	
ニッセイリスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	155,439,731円
ニッセイリスク抑制型バランスDB（適格機関投資家限定）	566,536,134円
ニッセイリスク抑制型バランスファンド（一般投資家私募）	68,255,765円
ニッセイリスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	117,509,105円
ニッセイリスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	154,935,776円
DCニッセイ安定収益追求ファンド	4,806,430円
計	1,067,482,941円

「ニッセイ円金利資産マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年8月14日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,091,594
国債証券	128,542,520
派生商品評価勘定	141,004
未収利息	354,013
前払費用	212,822
流動資産合計	136,341,953
資産合計	136,341,953
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	546,547
流動負債合計	546,547
負債合計	546,547
純資産の部	
元本等	
元本	137,692,907
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	1,897,501
純資産合計	135,795,406

負債純資産合計	136,341,953
---------	-------------

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>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25年8月14日現在）
1. 計算日における受益権総口数	137,692,907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1,897,501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）	0.9862円 (9,862円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成25年8月14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。
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>

3. 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。
----------------------------	--

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成25年8月14日 現在）			
	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	92,512,848	-	92,918,391	405,543
アメリカ・ドル	18,321,487	-	18,296,283	25,204
イギリス・ポンド	31,427,652	-	31,974,199	546,547
ユーロ	42,763,709	-	42,647,909	115,800
合計	92,512,848	-	92,918,391	405,543

（注） 時価の算定方法

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

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

（その他の注記）

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

項目	（平成25年8月14日現在）
同中間計算期間の期首元本額	225,000,000円
同中間計算期間中の追加設定元本額	18,603,741円
同中間計算期間中の一部解約元本額	105,910,834円
同中間計算期間末日の元本額	137,692,907円
上記元本額の内訳	
DCニッセイ安定収益追求ファンド	137,692,907円

計	137,692,907円
---	--------------

(重要な後発事象に関する注記)

当ファンドは、信託約款第46条第1項の規定に基づき信託契約の解約を行い、平成25年9月27日をもって期限前償還いたします。

2【ファンドの現況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「2 ファンドの現況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

【純資産額計算書】

(平成25年8月30日現在)

資産総額	524,862,557 円
負債総額	166,563 円
純資産総額(-)	524,695,994 円
発行済数量	524,937,390 口
1万口当たり純資産額(/ ×10000)	9,995 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25年9月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間ににおける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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25年9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	200	23,870
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	16	2,547
単位型公社債投資信託	0	0
合計	216	26,418

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24年4月1日 至平成25年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

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

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金

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

評価・換算差額等

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

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

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

負債・純資産合計

40,162,198

41,987,127

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

旅費交通費		90,473		74,226
固定資産減価償却費		654,122		583,306
租税公課		79,628		80,741
業務委託費		179,945		163,637
器具備品費		151,259		134,449
保守料		87,228		88,640
保険料		60,291		60,440
寄付金		5,000		-
諸経費		56,644		41,887
一般管理費計		6,754,291		6,706,012
営業利益		586,642		1,127,480
営業外収益				
受取利息		1,966		172
有価証券利息		93,236		86,415
受取配当金		45,856		79,789
補助金収入		-		9,500
その他営業外収益		17,359		10,147
営業外収益計		158,419		186,025
営業外費用				
為替差損		6,419		15,251
賃貸借契約解約損		4,124		-
控除対象外消費税		-		5,693
その他営業外費用		1,248		646
営業外費用計		11,792		21,591
経常利益		733,269		1,291,913
特別利益				
投資有価証券売却益		25,290		125,271
投資有価証券償還益		-		1,755
事故受取保険金	3	14,136		-
清算配当金	5	59,327		-
特別利益計		98,754		127,026
特別損失				
投資有価証券売却損		1,778		400,864
投資有価証券償還損		87,378		4,005
固定資産除却損	4	19,104	4	8,268
事故損失賠償金	2	39,244	2	58
特別損失計		147,506		413,196
税引前当期純利益		684,516		1,005,743
法人税、住民税及び事業税		263,157		557,322
法人税等調整額		77,232		125,815
法人税等合計		340,390		431,507
当期純利益		344,126		574,236

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

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

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

（重要な会計方針）**1．有価証券の評価基準及び評価方法**

満期保有目的の債券

償却原価法（定額法）によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

…移動平均法に基づく原価法によっております。

関係会社株式

移動平均法に基づく原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定率法によっております。

主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。

無形固定資産

定額法によっております。

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

3．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4．引当金の計上基準

賞与引当金

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

退職給付引当金

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

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

役員退職慰労引当金

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

5．リース取引の処理方法

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

6．消費税及び地方消費税の会計処理

税抜方式によっております。

（会計方針の変更）

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

(注記事項)

(貸借対照表関係)

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

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

2. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

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

(損益計算書関係)

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。

取締役	180,000千円
監査役	40,000千円

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

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

4. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

5. 清算配当金は、会社型投資信託の清算配当であります。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成23年6月27日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成23年3月31日

効力発生日 平成23年6月27日

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

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

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成24年3月31日

効力発生日 平成24年6月25日

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成24年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成24年3月31日

効力発生日 平成24年6月25日

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

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

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成25年3月31日

効力発生日 平成25年6月24日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

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

	前事業年度（平成24年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	417	445
（単位：千円）			
	当事業年度（平成25年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	589	273
未経過リース料期末残高相当額等（単位：千円）			
	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）	
1年内	174	186	
1年超	287	108	
合計	462	295	
支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額（単位：千円）			
	前事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	当事業年度 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）	
支払リース料	361	186	
減価償却費相当額	330	172	
支払利息相当額	19	12	
<p>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。</p> <p>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。</p>			

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

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

有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成24年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

当事業年度(平成25年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度（平成24年3月31日）

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

当事業年度（平成25年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日）

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

当事業年度（平成25年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自平成23年 4月 1日 至平成24年 3月31日)

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

当事業年度(自平成24年 4月 1日 至平成25年 3月31日)

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

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

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

(注) 当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

3. 退職給付費用に関する事項

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

(注) 福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

(税効果会計関係)

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,205,257

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,745,589

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等
前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（1株当たり情報）

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

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

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小 暮 和 敏 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大 竹 新 印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成25年10月2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 岩本 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイ安定収益追求ファンドの平成25年2月15日から平成25年8月14日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイ安定収益追求ファンドの平成25年8月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年2月15日から平成25年8月14日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)