

【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】	2017年6月7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】	DCニッセイ日本債券インデックス
【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 1百万円 継続募集額 上限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】

2016年7月13日をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、有価証券報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

(7)【申込期間】

<訂正前>

当初設定日：平成28年7月29日(金)に委託会社の資金により設定されます。当初申込期間は設けません。

継続申込期間：平成28年7月29日(金)～平成29年6月22日(木)

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

<訂正後>

当初設定日：2016年7月29日(金)に委託会社の資金により設定されます。当初申込期間は設けません。

継続申込期間：2016年7月29日(金)～2017年6月22日(木)

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

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】

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成28年7月13日 有価証券届出書提出

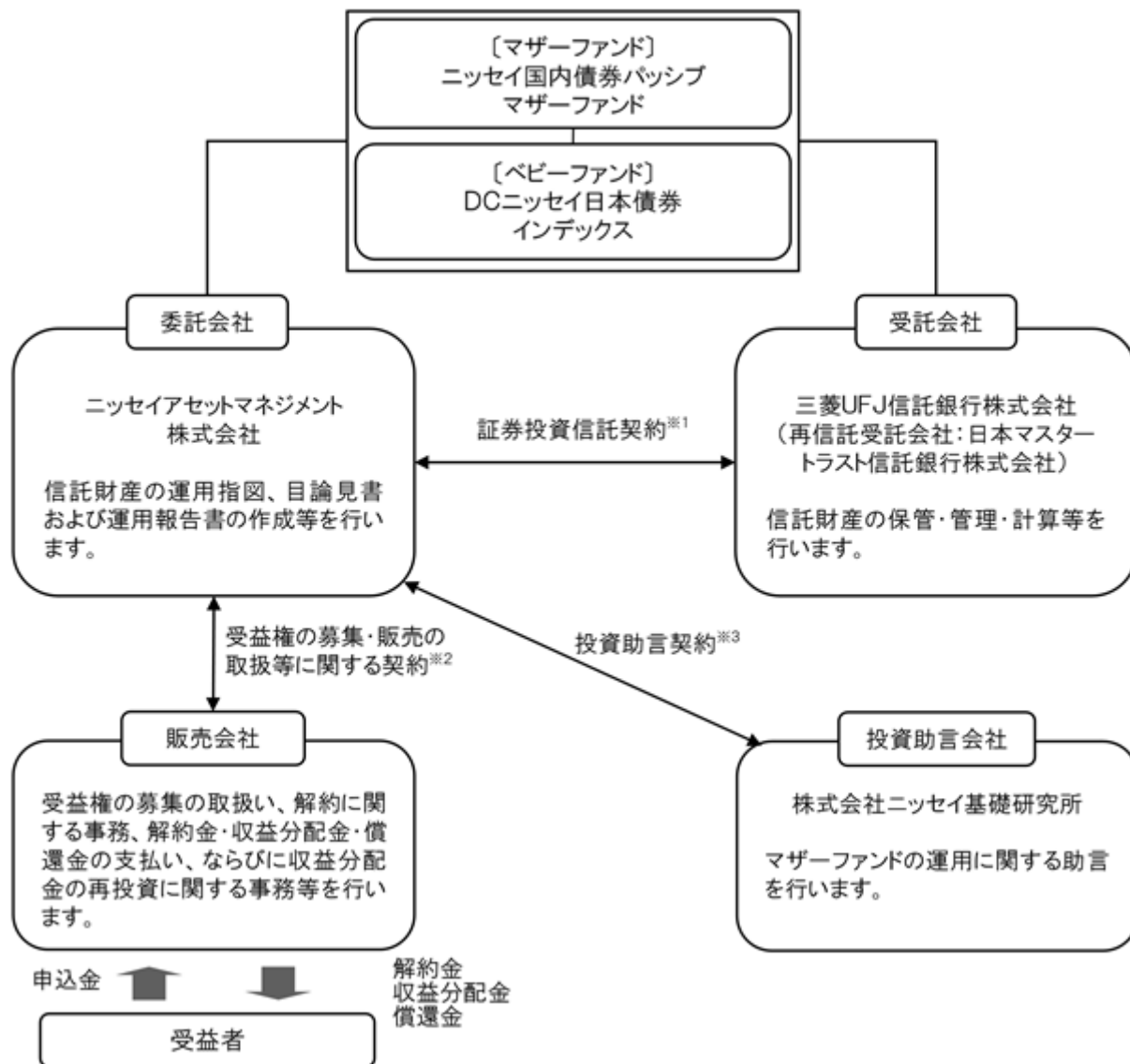
平成28年7月29日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始(予定)

<訂正後>

2016年7月29日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（平成28年5月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 赤林 富二
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 平成7年4月4日
7. 沿革

昭和60年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。

平成7年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。

平成10年7月1日

ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。

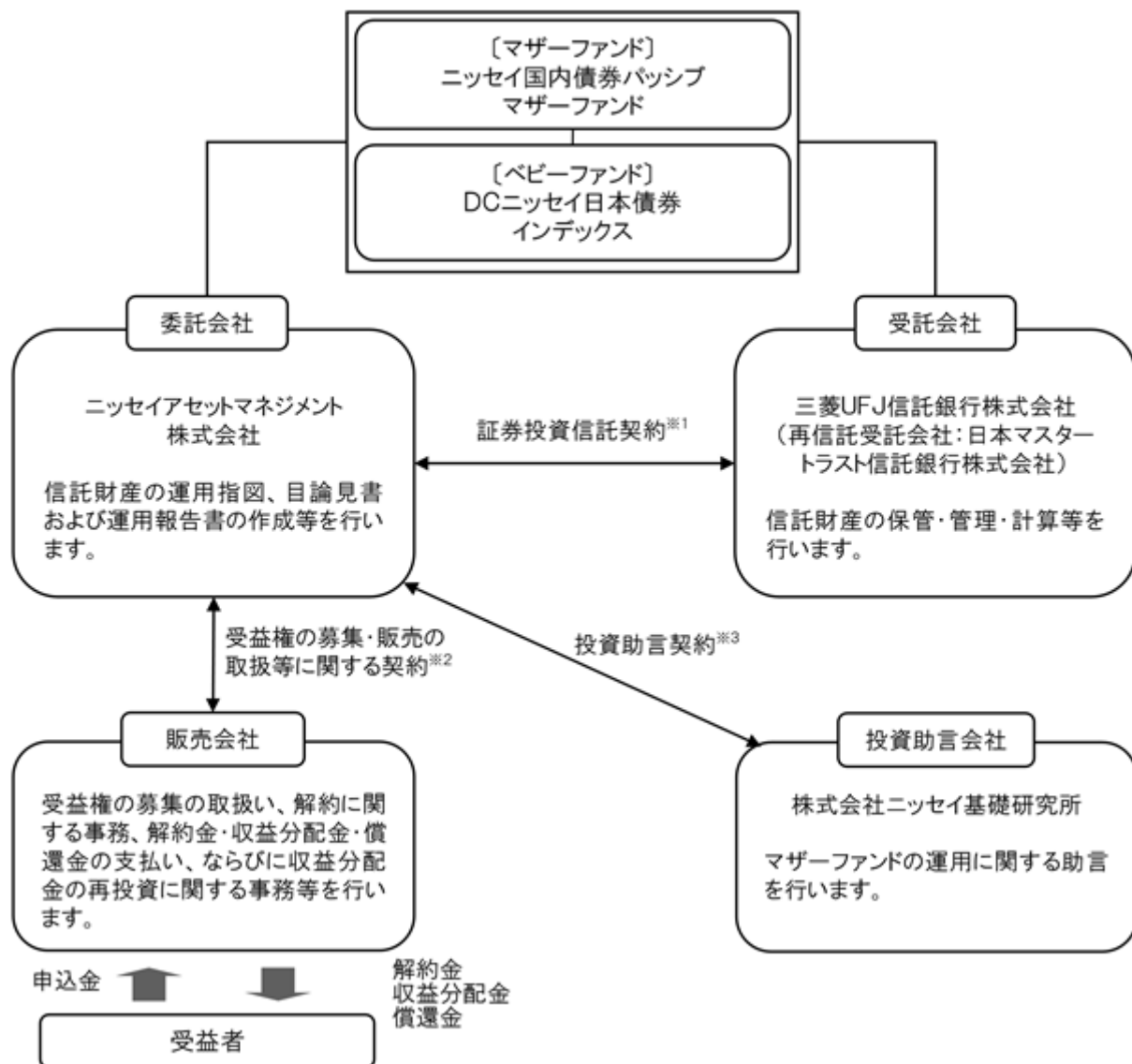
平成12年5月8日

定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

8. 大株主の状況

名 称	住 所	保有株数	比 率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号	97,604株	90.00%
パトナム・ユーエス・ホールディングス・エルエルシー	アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市ワン・ポスト・オフィス・スクエア	10,844株	10.00%

<訂正後>



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（2017年3月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 赤林 富二
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 1995年4月4日
7. 沿革
 - 1985年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
 - 1995年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
 - 1998年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
 - 2000年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

8. 大株主の状況

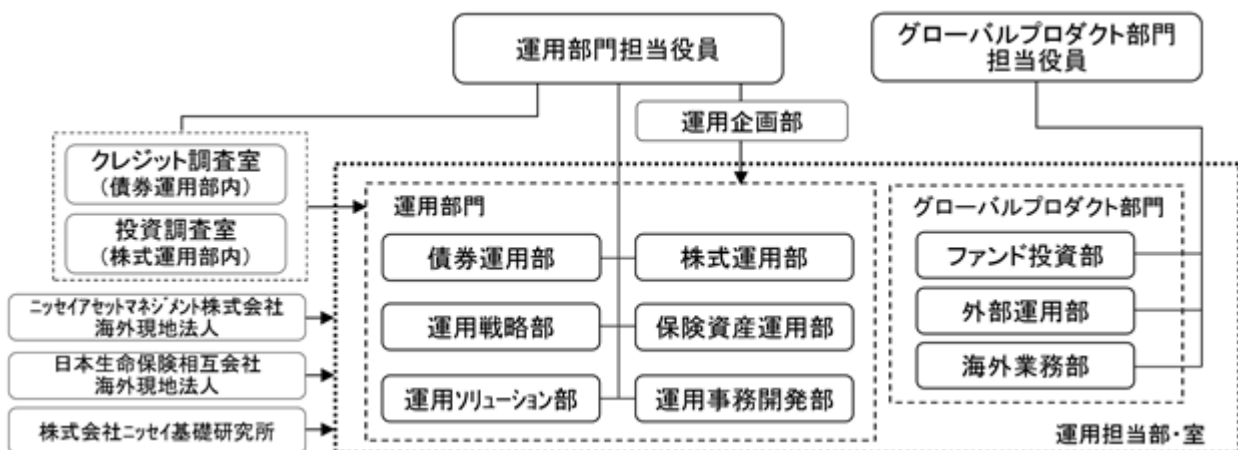
名 称	住 所	保有株数	比 率
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号	97,604株	90.00%
パトナム・ユーエス・ホールディングス・エルエルシー	アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市ワン・ポスト・オフィス・スクエア	10,844株	10.00%

2【投資方針】

(3)【運用体制】

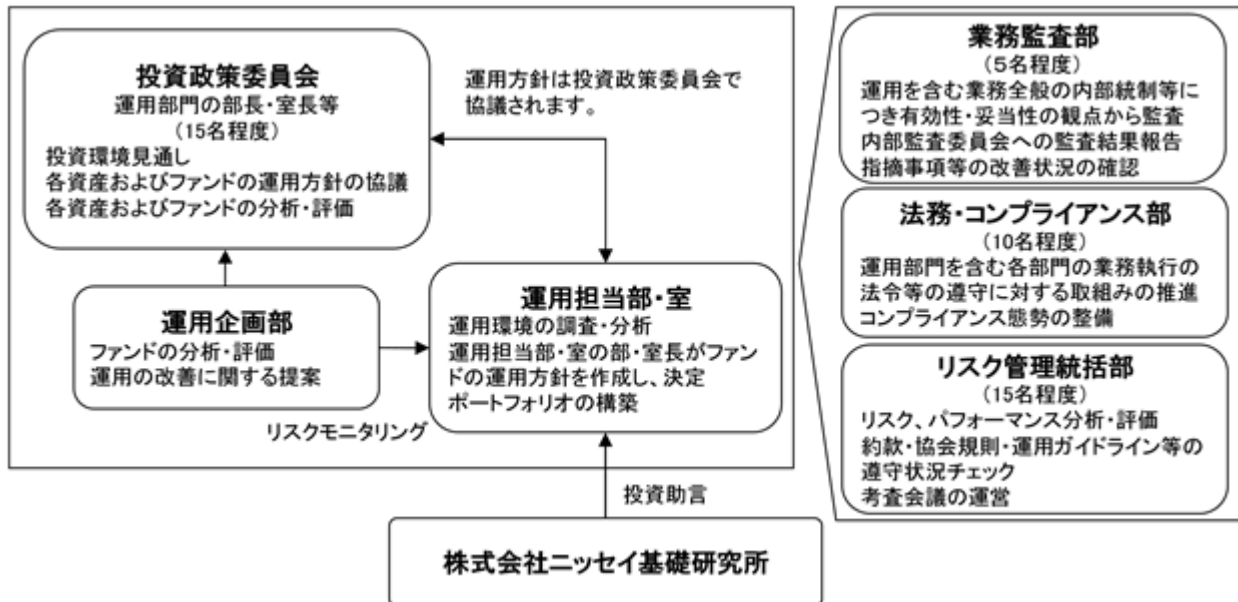
< 訂正前 >

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



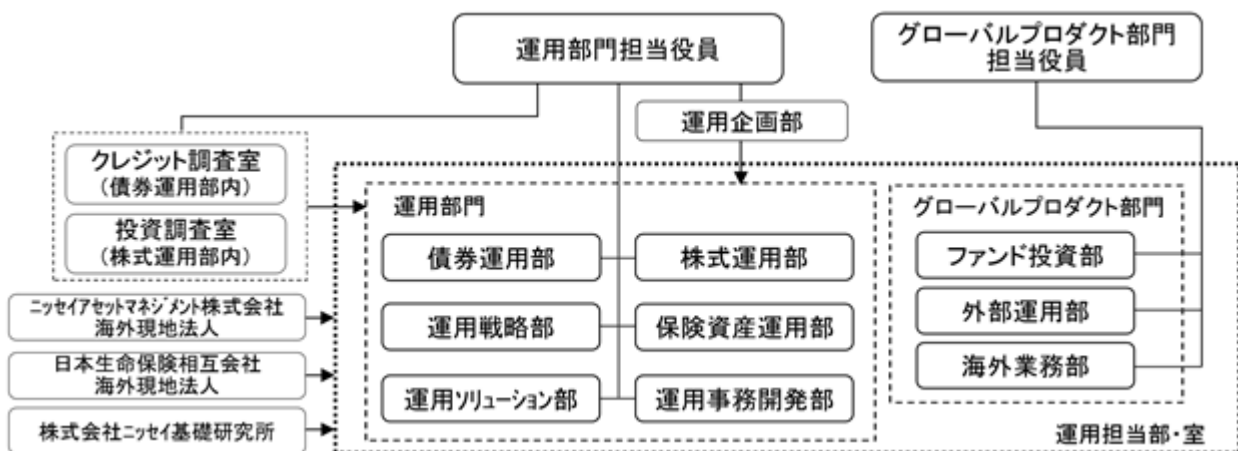
< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

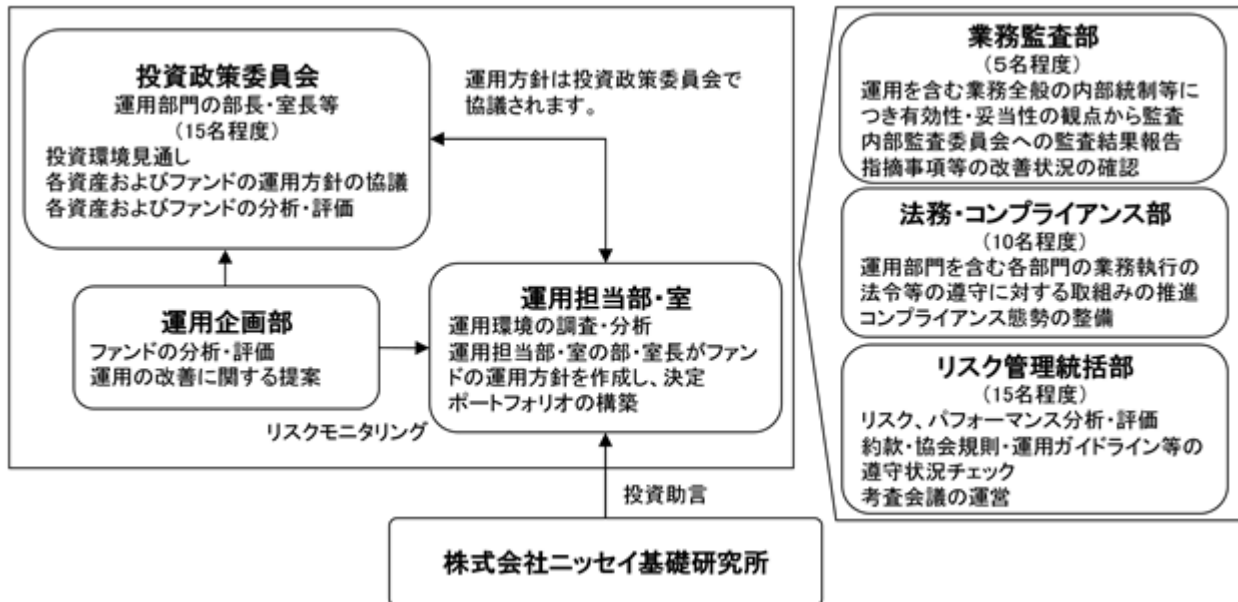
< 訂正後 >

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、NOMURA-BPI総合の動きに連動することを目標に運用しますので、NOMURA-BPI総合の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。

ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の6の規定）の適用はありません。

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・債券投資リスク

金利変動リスク

金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。

信用リスク

債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。

・流動性リスク

市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはNOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担することなどから基準価額と当該指数との動きが完全に一致しないことがあります。

・収益分配金に関する留意点

収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

・短期金融資産の運用に関する留意点

コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。

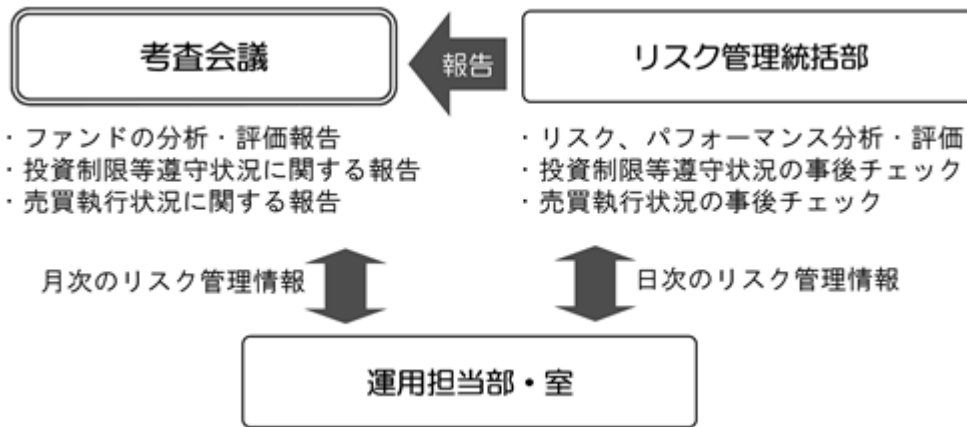
・ファミリーファンド方式に関する留意点

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・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

設定日におけるファンドの信託財産（1百万円（受益権口数1百万口））は、委託会社の資金によるものです。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

（2）投資リスク管理体制

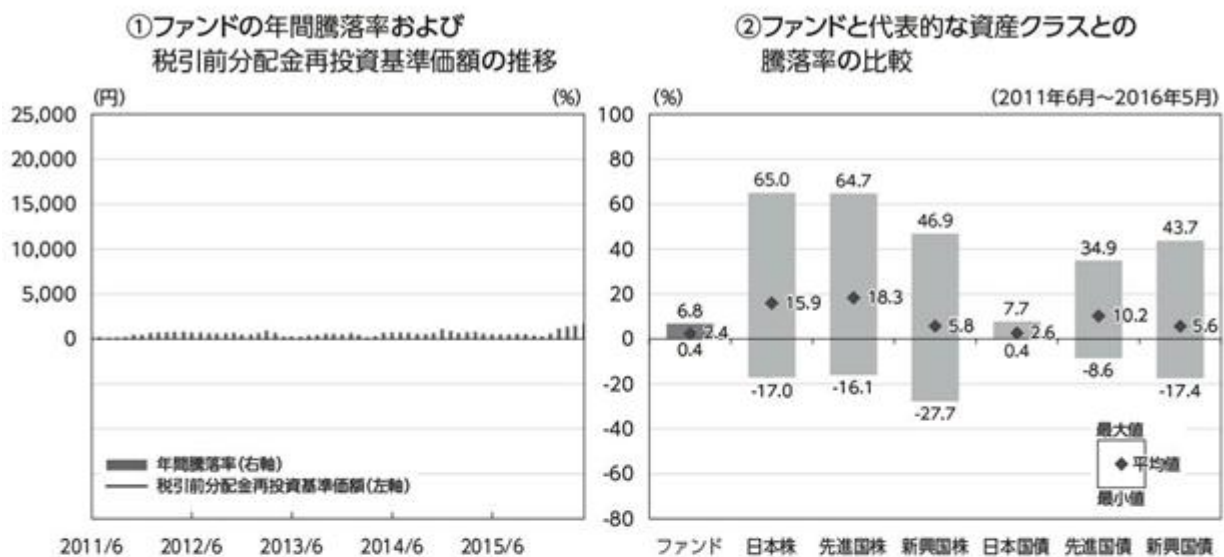


1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
 - ・ 運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
 - ・ 売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

上記投資リスク管理体制は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(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。



グラフは次に記載の基準で作成しています。なお、ファンドについては平成28年7月29日から運用を開始する予定のため記載できるデータはありませんが、グラフにおいては、参考としてファンドの騰落率に代えファンドのベンチマーク(NOMURA-BPI総合)の騰落率を記載しています。

- ・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。
- ・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・ディバースファイド(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・ディバースファイドは、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。

<訂正後>

ファンド(マザーファンドを含みます)は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、NOMURA-BPI総合の動きに連動することを目標に運用しますので、NOMURA-BPI総合の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果(損益)はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。

ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ(金融商品取引法第37条の6の規定)の適用はありません。

(1) 投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・債券投資リスク

金利変動リスク

金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。

信用リスク

債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合(債務不履行)、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。

・流動性リスク

市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはNOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担することなどから基準価額と当該指数との動きが完全に一致しないことがあります。

・収益分配金に関する留意点

収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

収益分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

・短期金融資産の運用に関する留意点

コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。

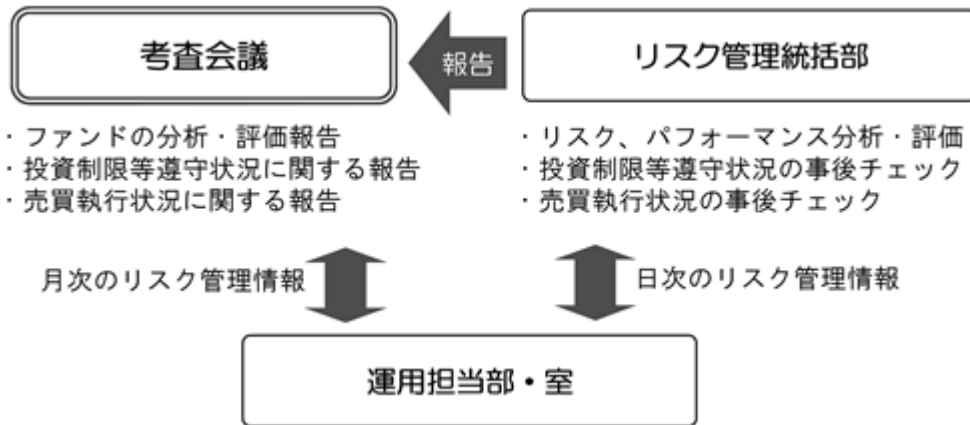
・ファミリーファンド方式に関する留意点

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・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

委託会社は2017年3月10日現在、ファンドを0.9百万円(受益権口数1百万口、ファンド全体の1.0%)保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

(2) 投資リスク管理体制

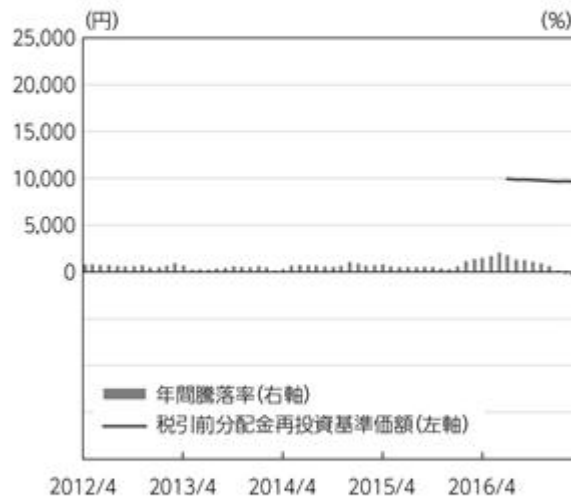


1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
 - ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
 - ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

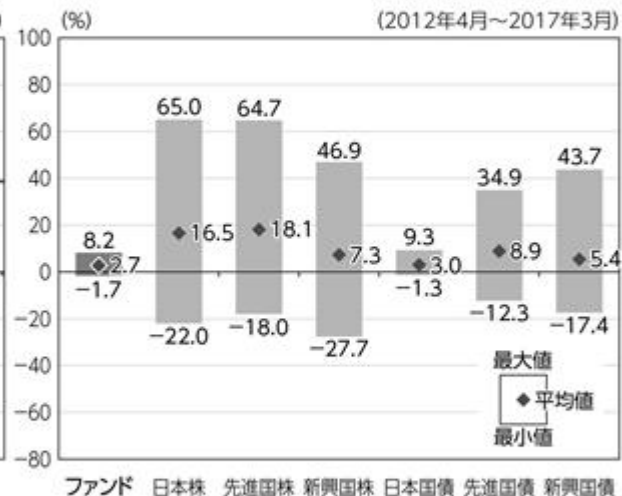
上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

(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。

① ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



② ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の月末データが1年に満たないためファンドの騰落率を記載できません。参考としてファンドの騰落率に代えファンドのベンチマーク(NOMURA-BPI総合)の騰落率を記載しています。

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

<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。

❶ 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(以下「東証」といいます)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・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の商標または標章に関するすべての権利は東証が有しています。
- ・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。

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」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

「DCニッセイ日本債券インデックス」

(2017年3月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	125,243,593	100.00
内 日本	125,243,593	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	701	0.00
純資産総額	125,242,892	100.00

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

(参考情報)

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

(2017年3月31日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	109,498,883,330	70.86
内 日本	109,498,883,330	70.86
地方債証券	14,376,694,463	9.30
内 日本	14,376,694,463	9.30
特殊債券	17,933,072,365	11.60
内 日本	17,933,072,365	11.60
社債券	11,537,315,000	7.47
内 日本	10,409,454,500	6.74
内 スウェーデン	413,636,400	0.27
内 オーストラリア	401,491,000	0.26
内 アメリカ	212,303,600	0.14
内 オランダ	100,429,500	0.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,183,233,740	0.77
純資産総額	154,529,198,898	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】

「DCニッセイ日本債券インデックス」

【投資有価証券の主要銘柄】

(2017年3月31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	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	130,421,320	0.9587 125,035,434	0.9603 125,243,593	- -	100.00%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	100.00
	小計		100.00
合計（対純資産総額比）			100.00

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考情報）

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（2017年3月31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340回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,361,000,000	103.10 1,403,191,000	103.29 1,405,872,170	0.400000 2025/9/20	0.91%
2	第343回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,397,000,000	100.41 1,402,783,580	100.59 1,405,326,120	0.100000 2026/6/20	0.91%
3	第342回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,365,000,000	100.44 1,371,006,000	100.67 1,374,145,500	0.100000 2026/3/20	0.89%
4	第341回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,324,000,000	102.22 1,353,392,800	102.43 1,356,239,400	0.300000 2025/12/20	0.88%
5	第339回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,312,000,000	103.09 1,352,593,280	103.28 1,355,086,080	0.400000 2025/6/20	0.88%
6	第123回 利付国債 （5年） 日本	国債証券	1,326,000,000	100.84 1,337,138,400	100.83 1,337,032,320	0.100000 2020/3/20	0.87%
7	第344回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,325,000,000	100.33 1,329,385,750	100.51 1,331,863,500	0.100000 2026/9/20	0.86%
8	第334回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,270,000,000	104.51 1,327,315,100	104.66 1,329,258,200	0.600000 2024/6/20	0.86%
9	第116回 利付国債 （5年） 日本	国債証券	1,242,000,000	100.86 1,252,681,200	100.75 1,251,389,520	0.200000 2018/12/20	0.81%
10	第117回 利付国債 （5年） 日本	国債証券	1,204,000,000	100.92 1,215,100,880	100.81 1,213,824,640	0.200000 2019/3/20	0.79%
11	第312回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,151,000,000	105.11 1,209,908,180	105.02 1,208,780,200	1.200000 2020/12/20	0.78%
12	第124回 利付国債 （5年） 日本	国債証券	1,190,000,000	100.88 1,200,555,300	100.87 1,200,364,900	0.100000 2020/6/20	0.78%
13	第345回 利付国債 （10年） 日本	国債証券	1,189,000,000	100.24 1,191,877,380	100.43 1,194,160,260	0.100000 2026/12/20	0.77%

14	第338回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	1,139,000,000	103.08 1,174,081,200	103.26 1,176,188,350	0.400000 2025/3/20	0.76%
15	第335回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	1,094,000,000	103.79 1,135,462,600	103.96 1,137,366,160	0.500000 2024/9/20	0.74%
16	第122回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	1,121,000,000	100.83 1,130,360,350	100.77 1,129,698,960	0.100000 2019/12/20	0.73%
17	第133回 住宅金融支 援機構債券 日本	特殊債券	1,000,000,000	104.60 1,046,054,000	104.51 1,045,149,000	0.828000 2023/5/19	0.68%
18	第127回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	1,008,000,000	100.98 1,017,969,120	100.99 1,018,029,600	0.100000 2021/3/20	0.66%
19	第310回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	959,000,000	104.08 998,203,920	104.02 997,561,390	1.000000 2020/9/20	0.65%
20	第305回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	934,000,000	104.17 973,013,180	104.04 971,808,320	1.300000 2019/12/20	0.63%
21	第296回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	943,000,000	102.73 968,743,900	102.55 967,084,220	1.500000 2018/9/20	0.63%
22	第113回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	948,000,000	100.76 955,242,720	100.66 954,266,280	0.300000 2018/6/20	0.62%
23	第309回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	879,000,000	104.15 915,540,030	104.08 914,889,570	1.100000 2020/6/20	0.59%
24	第306回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	868,000,000	104.77 909,455,680	104.68 908,657,120	1.400000 2020/3/20	0.59%
25	第325回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	857,000,000	104.99 899,815,720	104.97 899,610,040	0.800000 2022/9/20	0.58%
26	第333回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	835,000,000	104.53 872,825,500	104.61 873,510,200	0.600000 2024/3/20	0.57%
27	第115回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	862,000,000	100.74 868,378,800	100.64 867,559,900	0.200000 2018/9/20	0.56%
28	第320回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	773,000,000	105.34 814,332,310	105.33 814,216,360	1.000000 2021/12/20	0.53%
29	第301回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	778,000,000	103.93 808,598,740	103.77 807,369,500	1.500000 2019/6/20	0.52%
30	第147回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	668,000,000	117.74 786,556,640	118.61 792,328,160	1.600000 2033/12/20	0.51%

(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	70.86
		地方債証券	9.30
		特殊債券	11.60
		社債券	6.74
	小計		98.50
	外国	社債券	0.73
	小計		0.73
合 計 (対純資産総額比)			99.23

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

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

「DCニッセイ日本債券インデックス」

【純資産の推移】

2017年3月31日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年3月10日)	98,055,353	98,055,353	0.9641	0.9641
2016年7月末日	993,855	-	0.9939	-
8月末日	984,707	-	0.9847	-
9月末日	985,145	-	0.9851	-
10月末日	982,154	-	0.9822	-
11月末日	976,250	-	0.9763	-
12月末日	970,548	-	0.9705	-
2017年1月末日	24,667,336	-	0.9650	-
2月末日	77,473,992	-	0.9678	-
3月末日	125,242,892	-	0.9662	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.6

(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】

「DCニッセイ日本債券インデックス」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	102,144,776	439,453	101,705,323

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >



3.運用実績

2017年3月末現在

●基準価額・純資産の推移



基準価額	9.662円
純資産総額	125百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2017年3月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

- ・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。

●種別構成比

種別	比率
国債	70.9%
政府保証債	5.5%
地方債	9.3%
金融債	1.2%
事業債	9.2%
国債先物	-

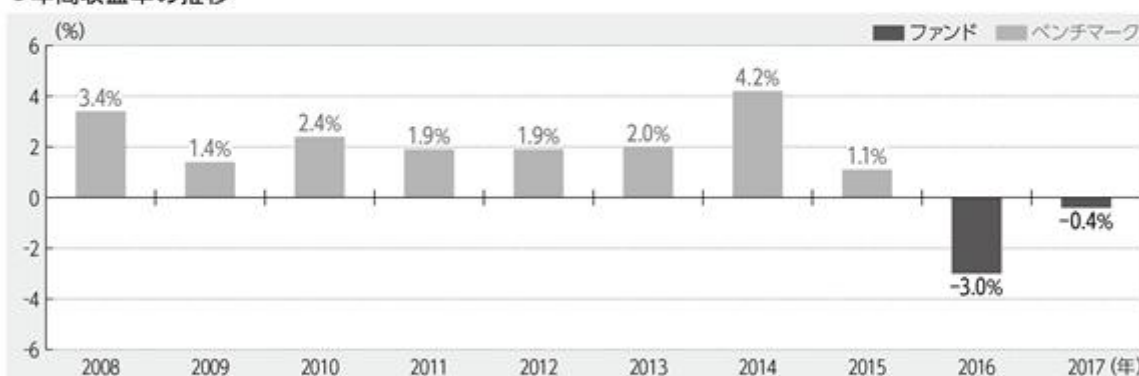
- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●組入上位銘柄

順位	銘柄	比率
1	第340回 利付国債(10年)	0.9%
2	第343回 利付国債(10年)	0.9%
3	第342回 利付国債(10年)	0.9%
4	第341回 利付国債(10年)	0.9%
5	第339回 利付国債(10年)	0.9%
6	第123回 利付国債(5年)	0.9%
7	第344回 利付国債(10年)	0.9%
8	第334回 利付国債(10年)	0.9%
9	第116回 利付国債(5年)	0.8%
10	第117回 利付国債(5年)	0.8%

- ・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。
- ・2016年はファンド設定時から年末まで、2017年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
- ・2015年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

■ ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。
最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

（4）【計算期間】

<訂正前>

毎年3月11日から翌年3月10日までとします。ただし、第1計算期間は、平成28年7月29日から平成29年3月10日までとします。

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

<訂正後>

毎年3月11日から翌年3月10日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年7月29日から2017年3月10日までとします。

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

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」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である2016年7月29日を期首としております。

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1期計算期間（2016年7月29日から2017年3月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCニッセイ日本債券インデックス】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2017年3月10日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		764
コール・ローン		10,330
親投資信託受益証券		98,055,887
未収入金		1,538
流動資産合計		98,068,519
資産合計		
		98,068,519
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,382
未払委託者報酬		11,109
その他未払費用		675
流動負債合計		13,166
負債合計		
		13,166
純資産の部		
元本等		
元本		101,705,323
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		3,649,970
純資産合計		98,055,353
負債純資産合計		98,068,519

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 (自2016年7月29日 至2017年3月10日)
営業収益	
有価証券売買等損益	145,405
営業収益合計	145,405
営業費用	
受託者報酬	1,536
委託者報酬	13,134
その他費用	738
営業費用合計	15,408
営業利益又は営業損失()	160,813
経常利益又は経常損失()	160,813
当期純利益又は当期純損失()	160,813
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()	1,267
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	14,686
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,686
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	3,505,110
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	3,505,110
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	3,649,970

(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1期 (2017年3月10日現在)
1 . 受益権総口数	101,705,323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	3,649,970円
3 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9641円 (9,641円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 (自2016年7月29日 至2017年3月10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(0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(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は0円(1口当たり0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1期 (自2016年7月29日 至2017年3月10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。
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。
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。
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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2017年3月10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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (2017年3月10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	144,260
合計	144,260

（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1期 (2017年3月10日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	101,144,776円
期中一部解約元本額	439,453円

（４）【附属明細表】（2017年3月10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	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	102,344,106	98,055,887	
親投資信託受益証券	合計	102,344,106	98,055,887	
合計		102,344,106	98,055,887	

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（DCニッセイ日本債券インデックス）は、「ニッセイ国内債券パッシブ 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、すべて同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。）における同マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（2017年3月10日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	66,221,830
コール・ローン	895,829,338
国債証券	112,152,074,250
地方債証券	14,387,353,180
特殊債券	17,949,474,097
社債券	11,551,698,900
未収利息	550,576,934
前払費用	5,789,143
流動資産合計	157,559,017,672
資産合計	157,559,017,672
負債の部	
流動負債	
未払解約金	464,712
その他未払費用	3,517
流動負債合計	468,229
負債合計	468,229
純資産の部	
元本等	
元本	164,455,758,041
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,897,208,598
純資産合計	157,558,549,443
負債純資産合計	157,559,017,672

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、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日まででは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>
--------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2017年3月10日現在)
1. 受益権総口数	164,455,758,041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	6,897,208,598円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9581円 (9,581円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 2016年7月29日 至 2017年3月10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。
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。
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。
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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2017年3月10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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2017年3月10日現在)
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	7,168,740,570
地方債証券	249,152,241
特殊債券	289,061,248
社債券	145,729,700
合計	7,852,683,759

(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	(2017年3月10日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	181,217,492,585円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	4,596,875,383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	21,358,609,927円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	164,353,303,886円
DCニッセイ日本債券インデックス	102,344,106円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	110,049円
計	164,455,758,041円

附属明細表(2017年3月10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363回 利付国債(2年)	116,000,000	116,511,560	
	第364回 利付国債(2年)	111,000,000	111,520,590	
	第366回 利付国債(2年)	595,000,000	598,153,500	
	第112回 利付国債(5年)	152,000,000	153,354,320	
	第113回 利付国債(5年)	948,000,000	955,242,720	
	第114回 利付国債(5年)	496,000,000	500,468,960	
	第115回 利付国債(5年)	1,057,000,000	1,064,906,360	
	第116回 利付国債(5年)	1,259,000,000	1,269,852,580	
	第117回 利付国債(5年)	1,204,000,000	1,215,100,880	
	第118回 利付国債(5年)	643,000,000	649,230,670	
	第119回 利付国債(5年)	148,000,000	149,096,680	
	第120回 利付国債(5年)	617,000,000	623,484,670	
	第121回 利付国債(5年)	192,000,000	193,532,160	
	第122回 利付国債(5年)	1,121,000,000	1,130,360,350	
	第123回 利付国債(5年)	1,543,000,000	1,556,100,070	
	第124回 利付国債(5年)	1,190,000,000	1,200,555,300	
	第125回 利付国債(5年)	300,000,000	302,760,000	
	第126回 利付国債(5年)	700,000,000	706,762,000	
	第127回 利付国債(5年)	1,008,000,000	1,017,969,120	
	第128回 利付国債(5年)	624,000,000	630,427,200	
	第129回 利付国債(5年)	77,000,000	77,822,360	
	第1回 利付国債(40年)	144,000,000	203,531,040	
	第2回 利付国債(40年)	209,000,000	285,395,770	
	第3回 利付国債(40年)	210,000,000	288,292,200	
	第4回 利付国債(40年)	309,000,000	425,814,360	
	第5回 利付国債(40年)	300,000,000	397,386,000	
	第6回 利付国債(40年)	313,000,000	406,424,240	
	第7回 利付国債(40年)	330,000,000	408,978,900	
	第8回 利付国債(40年)	385,000,000	440,771,100	
	第9回 利付国債(40年)	397,000,000	325,575,730	
	第293回 利付国債(10年)	450,000,000	462,033,000	
	第294回 利付国債(10年)	397,000,000	407,107,620	
	第295回 利付国債(10年)	479,000,000	489,978,680	
	第296回 利付国債(10年)	1,153,000,000	1,184,511,490	
	第297回 利付国債(10年)	489,000,000	503,567,310	
	第298回 利付国債(10年)	446,000,000	458,492,460	
	第299回 利付国債(10年)	819,000,000	844,806,690	
	第300回 利付国債(10年)	458,000,000	474,291,060	
	第301回 利付国債(10年)	778,000,000	808,598,740	
	第302回 利付国債(10年)	272,000,000	282,077,600	
	第303回 利付国債(10年)	534,000,000	555,851,280	
	第304回 利付国債(10年)	200,000,000	207,678,000	
	第305回 利付国債(10年)	934,000,000	973,013,180	
	第306回 利付国債(10年)	868,000,000	909,455,680	
	第307回 利付国債(10年)	263,000,000	274,761,360	
	第308回 利付国債(10年)	494,000,000	517,781,160	
	第309回 利付国債(10年)	879,000,000	915,540,030	
	第310回 利付国債(10年)	959,000,000	998,203,920	
	第311回 利付国債(10年)	525,000,000	542,745,000	
	第312回 利付国債(10年)	1,151,000,000	1,209,908,180	
	第313回 利付国債(10年)	744,000,000	787,271,040	

第314回	利付国債(10年)	341,000,000	358,077,280
第315回	利付国債(10年)	742,000,000	784,524,020
第316回	利付国債(10年)	323,000,000	340,125,460
第317回	利付国債(10年)	278,000,000	293,481,820
第318回	利付国債(10年)	716,000,000	752,616,240
第319回	利付国債(10年)	396,000,000	419,074,920
第320回	利付国債(10年)	773,000,000	814,332,310
第321回	利付国債(10年)	500,000,000	527,995,000
第322回	利付国債(10年)	78,000,000	81,973,320
第323回	利付国債(10年)	37,000,000	38,969,880
第324回	利付国債(10年)	371,000,000	388,785,740
第325回	利付国債(10年)	857,000,000	899,815,720
第326回	利付国債(10年)	17,000,000	17,778,770
第327回	利付国債(10年)	310,000,000	325,999,100
第328回	利付国債(10年)	103,000,000	107,233,300
第329回	利付国債(10年)	49,000,000	51,699,900
第330回	利付国債(10年)	16,000,000	16,906,240
第331回	利付国債(10年)	14,000,000	14,609,560
第332回	利付国債(10年)	419,000,000	437,645,500
第333回	利付国債(10年)	1,230,000,000	1,285,829,700
第334回	利付国債(10年)	1,270,000,000	1,327,315,100
第335回	利付国債(10年)	1,173,000,000	1,217,562,270
第336回	利付国債(10年)	545,000,000	565,949,800
第337回	利付国債(10年)	939,000,000	960,512,490
第338回	利付国債(10年)	1,299,000,000	1,339,035,180
第339回	利付国債(10年)	1,312,000,000	1,352,593,280
第340回	利付国債(10年)	1,384,000,000	1,426,904,000
第341回	利付国債(10年)	1,350,000,000	1,380,064,500
第342回	利付国債(10年)	1,405,000,000	1,411,294,400
第343回	利付国債(10年)	1,397,000,000	1,402,783,580
第344回	利付国債(10年)	1,325,000,000	1,329,385,750
第345回	利付国債(10年)	1,189,000,000	1,191,877,380
第1回	利付国債(30年)	78,000,000	102,708,060
第2回	利付国債(30年)	82,000,000	104,424,540
第3回	利付国債(30年)	87,000,000	109,902,750
第4回	利付国債(30年)	118,000,000	159,068,720
第5回	利付国債(30年)	89,000,000	112,081,260
第6回	利付国債(30年)	121,000,000	156,305,380
第7回	利付国債(30年)	126,000,000	161,422,380
第8回	利付国債(30年)	116,000,000	140,290,400
第9回	利付国債(30年)	95,000,000	109,011,550
第10回	利付国債(30年)	165,000,000	181,701,300
第11回	利付国債(30年)	129,000,000	154,026,000
第12回	利付国債(30年)	123,000,000	154,564,260
第13回	利付国債(30年)	158,000,000	196,187,020
第14回	利付国債(30年)	212,000,000	277,122,160
第15回	利付国債(30年)	226,000,000	299,515,540
第16回	利付国債(30年)	197,000,000	261,523,410
第17回	利付国債(30年)	196,000,000	257,193,160
第18回	利付国債(30年)	248,000,000	321,246,800
第19回	利付国債(30年)	187,000,000	242,531,520
第20回	利付国債(30年)	260,000,000	346,382,400
第21回	利付国債(30年)	182,000,000	236,186,860
第22回	利付国債(30年)	309,000,000	412,375,950
第23回	利付国債(30年)	219,000,000	292,634,370
第24回	利付国債(30年)	204,000,000	272,680,680
第25回	利付国債(30年)	208,000,000	270,730,720
第26回	利付国債(30年)	372,000,000	491,218,560
第27回	利付国債(30年)	323,000,000	433,937,580
第28回	利付国債(30年)	422,000,000	568,982,600

第29回	利付国債(30年)	435,000,000	580,363,950
第30回	利付国債(30年)	460,000,000	606,767,600
第31回	利付国債(30年)	434,000,000	565,593,140
第32回	利付国債(30年)	538,000,000	714,297,220
第33回	利付国債(30年)	608,000,000	769,952,960
第34回	利付国債(30年)	546,000,000	717,334,800
第35回	利付国債(30年)	599,000,000	762,766,600
第36回	利付国債(30年)	547,000,000	697,638,330
第37回	利付国債(30年)	611,000,000	767,263,250
第38回	利付国債(30年)	385,000,000	475,586,650
第39回	利付国債(30年)	354,000,000	445,781,580
第40回	利付国債(30年)	315,000,000	389,453,400
第41回	利付国債(30年)	334,000,000	405,188,760
第42回	利付国債(30年)	359,000,000	435,614,190
第43回	利付国債(30年)	354,000,000	429,646,260
第44回	利付国債(30年)	348,000,000	422,451,120
第45回	利付国債(30年)	396,000,000	461,605,320
第46回	利付国債(30年)	465,000,000	541,976,100
第47回	利付国債(30年)	436,000,000	518,805,120
第48回	利付国債(30年)	458,000,000	522,417,700
第49回	利付国債(30年)	449,000,000	512,003,680
第50回	利付国債(30年)	449,000,000	443,257,290
第51回	利付国債(30年)	446,000,000	382,676,920
第52回	利付国債(30年)	419,000,000	380,795,580
第53回	利付国債(30年)	403,000,000	375,934,520
第40回	利付国債(20年)	36,000,000	37,420,920
第41回	利付国債(20年)	22,000,000	22,780,120
第42回	利付国債(20年)	65,000,000	68,753,750
第43回	利付国債(20年)	15,000,000	16,182,000
第44回	利付国債(20年)	5,000,000	5,404,750
第45回	利付国債(20年)	30,000,000	32,337,600
第46回	利付国債(20年)	87,000,000	93,772,950
第47回	利付国債(20年)	85,000,000	92,090,700
第48回	利付国債(20年)	81,000,000	89,109,720
第49回	利付国債(20年)	147,000,000	160,253,520
第50回	利付国債(20年)	211,000,000	228,316,770
第51回	利付国債(20年)	25,000,000	27,275,250
第52回	利付国債(20年)	16,000,000	17,611,360
第53回	利付国債(20年)	10,000,000	11,059,600
第54回	利付国債(20年)	16,000,000	17,772,160
第55回	利付国債(20年)	8,000,000	8,851,920
第56回	利付国債(20年)	13,000,000	14,449,630
第57回	利付国債(20年)	14,000,000	15,487,080
第58回	利付国債(20年)	14,000,000	15,549,940
第59回	利付国債(20年)	14,000,000	15,453,340
第60回	利付国債(20年)	15,000,000	16,296,150
第61回	利付国債(20年)	15,000,000	15,984,150
第62回	利付国債(20年)	16,000,000	16,876,320
第63回	利付国債(20年)	14,000,000	15,643,320
第64回	利付国債(20年)	14,000,000	15,791,020
第65回	利付国債(20年)	13,000,000	14,721,980
第66回	利付国債(20年)	14,000,000	15,759,240
第68回	利付国債(20年)	14,000,000	16,212,140
第69回	利付国債(20年)	15,000,000	17,264,550
第70回	利付国債(20年)	15,000,000	17,642,250
第71回	利付国債(20年)	16,000,000	18,585,440
第72回	利付国債(20年)	257,000,000	297,588,010
第73回	利付国債(20年)	169,000,000	195,110,500
第74回	利付国債(20年)	48,000,000	55,788,480
第75回	利付国債(20年)	124,000,000	144,700,560

第76回	利付国債(20年)	197,000,000	226,731,240
第77回	利付国債(20年)	139,000,000	161,091,270
第78回	利付国債(20年)	200,000,000	231,038,000
第79回	利付国債(20年)	170,000,000	197,784,800
第80回	利付国債(20年)	205,000,000	240,198,500
第81回	利付国債(20年)	235,000,000	274,228,550
第82回	利付国債(20年)	339,000,000	398,467,380
第83回	利付国債(20年)	237,000,000	279,664,740
第84回	利付国債(20年)	373,000,000	436,887,440
第85回	利付国債(20年)	253,000,000	299,552,000
第86回	利付国債(20年)	230,000,000	276,448,500
第87回	利付国債(20年)	211,000,000	251,718,780
第88回	利付国債(20年)	360,000,000	434,725,200
第89回	利付国債(20年)	225,000,000	269,628,750
第90回	利付国債(20年)	384,000,000	461,790,720
第91回	利付国債(20年)	209,000,000	253,316,360
第92回	利付国債(20年)	553,000,000	661,929,940
第93回	利付国債(20年)	230,000,000	273,879,400
第94回	利付国債(20年)	651,000,000	781,668,720
第95回	利付国債(20年)	370,000,000	452,735,700
第96回	利付国債(20年)	230,000,000	276,754,400
第97回	利付国債(20年)	365,000,000	444,336,400
第98回	利付国債(20年)	282,000,000	340,362,720
第99回	利付国債(20年)	485,000,000	586,786,950
第100回	利付国債(20年)	361,000,000	441,918,150
第101回	利付国債(20年)	208,000,000	259,138,880
第102回	利付国債(20年)	233,000,000	291,252,330
第103回	利付国債(20年)	225,000,000	278,759,250
第104回	利付国債(20年)	189,000,000	229,965,750
第105回	利付国債(20年)	343,000,000	418,271,350
第106回	利付国債(20年)	208,000,000	255,998,080
第107回	利付国債(20年)	242,000,000	295,721,580
第108回	利付国債(20年)	392,000,000	469,980,560
第109回	利付国債(20年)	278,000,000	333,847,420
第110回	利付国債(20年)	350,000,000	428,536,500
第111回	利付国債(20年)	239,000,000	296,238,110
第112回	利付国債(20年)	401,000,000	492,231,510
第113回	利付国債(20年)	617,000,000	758,798,940
第114回	利付国債(20年)	427,000,000	526,379,980
第115回	利付国債(20年)	233,000,000	290,122,280
第116回	利付国債(20年)	272,000,000	339,504,960
第117回	利付国債(20年)	439,000,000	542,406,450
第118回	利付国債(20年)	257,000,000	314,758,180
第119回	利付国債(20年)	234,000,000	280,397,520
第120回	利付国債(20年)	301,000,000	352,958,620
第121回	利付国債(20年)	413,000,000	500,812,060
第122回	利付国債(20年)	266,000,000	319,085,620
第123回	利付国債(20年)	440,000,000	546,172,000
第124回	利付国債(20年)	258,000,000	316,834,320
第125回	利付国債(20年)	275,000,000	345,743,750
第126回	利付国債(20年)	245,000,000	301,225,050
第127回	利付国債(20年)	217,000,000	263,878,510
第128回	利付国債(20年)	404,000,000	491,769,000
第129回	利付国債(20年)	234,000,000	281,640,060
第130回	利付国債(20年)	409,000,000	492,648,680
第131回	利付国債(20年)	226,000,000	269,086,900
第132回	利付国債(20年)	299,000,000	356,186,740
第133回	利付国債(20年)	384,000,000	462,842,880
第134回	利付国債(20年)	293,000,000	353,358,000
第135回	利付国債(20年)	216,000,000	257,415,840

第136回	利付国債(20年)	221,000,000	260,039,650
第137回	利付国債(20年)	239,000,000	285,143,730
第138回	利付国債(20年)	256,000,000	297,804,800
第139回	利付国債(20年)	219,000,000	257,929,440
第140回	利付国債(20年)	635,000,000	757,847,100
第141回	利付国債(20年)	463,000,000	552,692,360
第142回	利付国債(20年)	257,000,000	310,602,490
第143回	利付国債(20年)	428,000,000	504,166,880
第144回	利付国債(20年)	280,000,000	325,623,200
第145回	利付国債(20年)	651,000,000	777,294,000
第146回	利付国債(20年)	633,000,000	755,833,650
第147回	利付国債(20年)	668,000,000	786,556,640
第148回	利付国債(20年)	630,000,000	731,663,100
第149回	利付国債(20年)	678,000,000	787,022,400
第150回	利付国債(20年)	673,000,000	769,952,380
第151回	利付国債(20年)	667,000,000	739,576,270
第152回	利付国債(20年)	658,000,000	729,300,880
第153回	利付国債(20年)	653,000,000	733,691,210
第154回	利付国債(20年)	626,000,000	692,061,780
第155回	利付国債(20年)	675,000,000	721,156,500
第156回	利付国債(20年)	597,000,000	572,708,070
第157回	利付国債(20年)	616,000,000	567,071,120
第158回	利付国債(20年)	607,000,000	589,694,430
第159回	利付国債(20年)	596,000,000	588,198,360
国債証券 合計		101,008,000,000	112,152,074,250
地方債証券			
第665回	東京都公募公債	200,000,000	205,232,000
第667回	東京都公募公債	100,000,000	103,250,800
第682回	東京都公募公債	300,000,000	311,919,900
第697回	東京都公募公債	200,000,000	209,363,800
第707回	東京都公募公債	200,000,000	208,453,200
第708回	東京都公募公債	300,000,000	313,698,600
第719回	東京都公募公債	300,000,000	314,640,300
第730回	東京都公募公債	300,000,000	312,282,000
平成22年度第12回	北海道公募公債	200,000,000	209,818,000
平成27年度第1回	北海道公募公債	300,000,000	306,286,800
第205回	神奈川県公募公債	300,000,000	312,063,900
第30回	神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	107,880,600
第360回	大阪府公募公債(10年)	300,000,000	313,490,100
第378回	大阪府公募公債(10年)	144,000,000	149,877,792
第384回	大阪府公募公債(10年)	118,000,000	122,603,652
平成25年度第9回	京都府公募公債	300,000,000	312,209,400
平成24年度第1回	兵庫県公募公債	300,000,000	314,980,200
平成21年度第1回	静岡県公募公債	150,000,000	155,240,550
平成24年度第3回	静岡県公募公債	300,000,000	313,553,400
平成20年度第1回	愛知県公募公債	104,000,000	106,370,264
平成20年度第6回	愛知県公募公債	200,000,000	205,998,600
平成21年度第1回	愛知県公募公債	212,000,000	219,368,484
平成24年度第19回	愛知県公募公債	300,000,000	310,518,300
平成21年度第2回	埼玉県公募公債	300,000,000	310,453,200
平成25年度第4回	埼玉県公募公債	100,000,000	105,467,200
平成25年度第10回	埼玉県公募公債	119,000,000	123,821,523
平成21年度第1回	福岡県公募公債	100,000,000	103,782,000
平成24年度第9回	福岡県公募公債	300,000,000	311,427,300
平成23年度第9回	千葉県公募公債	300,000,000	314,539,500
平成21年度第2回	新潟県公募公債	300,000,000	312,610,500
平成24年度第2回	新潟県公募公債	300,000,000	313,120,200
第10回	群馬県公募公債	300,000,000	311,916,600
平成21年度第1回	岐阜県公募公債	300,000,000	310,650,300
第110回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,342,800
第123回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,298,500

第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,502,500	
平成22年度第1回 福島県公募公債	200,000,000	207,678,000	
平成20年度第1回 栃木県公募公債	100,000,000	103,039,100	
平成25年度第1回 熊本市公募公債	300,000,000	311,639,700	
平成21年度第1回 新潟市公募公債	300,000,000	311,183,400	
平成25年度第2回 大阪市公募公債	150,000,000	157,202,250	
平成25年度第6回 大阪市公募公債	200,000,000	208,258,000	
第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	92,734,100	
第464回 名古屋市公募公債	300,000,000	307,580,700	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	346,395,000	
平成25年度第11回 神戸市公募公債	100,000,000	104,171,900	
平成22年度第1回 横浜市公募公債	300,000,000	312,918,600	
平成23年度第4回 横浜市公募公債	200,000,000	209,421,600	
平成24年度第3回 横浜市公募公債	200,000,000	207,847,000	
平成22年度第7回 札幌市公募公債	200,000,000	207,273,000	
平成25年度第3回 北九州市公募公債	150,000,000	156,592,350	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	153,607,350	
平成23年度第6回 福岡市公募公債	200,000,000	208,941,800	
平成24年度第4回 福岡市公募公債	100,000,000	104,250,300	
平成20年度第1回 広島市公募公債	100,000,000	102,857,000	
平成22年度第6回 広島市公募公債	200,000,000	210,028,400	
平成24年度第2回 千葉市公募公債	300,000,000	313,021,500	
平成25年度第1回 高知県公募公債	100,000,000	103,839,500	
平成22年度第1回 相模原市公募公債	100,000,000	104,806,800	
平成21年度第1回 福井県公募公債	300,000,000	311,183,400	
平成19年度第1回 山梨県公募公債	300,000,000	310,831,800	
平成20年度第2回 岡山県公募公債	110,790,000	114,324,865	
平成22年度第1回 岡山県公募公債	200,000,000	207,693,000	
地方債証券 合計	13,807,790,000	14,387,353,180	
特殊債券			
第1回 政保新関西空港債券	200,000,000	208,686,000	
第22回 政保日本政策投資銀行債券	300,000,000	341,166,900	
第104回 道路機構債券	300,000,000	311,370,900	
第62回 政保道路機構債券	100,000,000	102,467,200	
第66回 政保道路機構債券	100,000,000	102,436,100	
第67回 政保道路機構債券	100,000,000	102,742,900	
第69回 政保道路機構債券	300,000,000	308,578,500	
第78回 政保道路機構債券	101,000,000	104,118,880	
第80回 政保道路機構債券	200,000,000	206,824,800	
第93回 政保道路機構債券	233,000,000	242,040,866	
第100回 政保道路機構債券	200,000,000	208,414,800	
第107回 政保道路機構債券	315,000,000	328,298,670	
第137回 政保道路機構債券	400,000,000	420,745,200	
第139回 政保道路機構債券	500,000,000	524,162,500	
第155回 政保道路機構債券	300,000,000	313,085,400	
第163回 政保道路機構債券	300,000,000	314,071,200	
第180回 政保道路機構債券	500,000,000	520,903,000	
第190回 政保道路機構債券	500,000,000	518,358,500	
第211回 政保道路機構債券	500,000,000	521,663,500	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	521,546,500	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	91,553,800	
第1回 政保地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,673,900	
第3回 政保地方公営企業等金融機構債券	101,000,000	103,603,376	
第8回 政保地方公営企業等金融機構債券	124,000,000	128,209,552	
第4回 地方公営企業等金融機構債券	400,000,000	413,865,200	
第5回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,201,000	
第8回 地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,102,800	
第12回 政保地方公共団体金融機構債券	313,000,000	326,146,000	
第12回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,629,000	
第25回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,269,600	
第36回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,309,400	

第48回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,921,200	
第48回	地方公共団体金融機構債券	400,000,000	418,068,800	
第72回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,672,000	
第5回	政保阪神高速道路債券	140,000,000	145,556,180	
第35回	日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,296,300	
第23回	政保日本政策金融公庫債券	300,000,000	312,488,700	
第21回	都市基盤整備債券	200,000,000	205,274,600	
第41回	都市再生債券	100,000,000	106,678,700	
第56回	政保関西国際空港債券	108,000,000	112,531,140	
第18回	政保中部空港債券	190,000,000	197,431,660	
第21回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,946,700	
第37回	住宅金融支援機構債券	500,000,000	517,327,500	
第133回	住宅金融支援機構債券	1,000,000,000	1,046,054,000	
第37回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,633,000	47,690,360	
第42回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	120,064,000	127,111,756	
第46回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	153,276,000	165,338,821	
第54回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	120,024,000	127,333,461	
第55回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	128,068,000	135,508,750	
第60回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	130,588,000	137,691,986	
第61回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,845,000	66,986,174	
第62回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	528,496,000	553,071,064	
第63回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	335,255,000	348,966,929	
第73回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	215,025,000	226,636,350	
第78回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	198,102,000	206,263,802	
第9回	私学振興債券	100,000,000	103,345,200	
第19回	沖縄振興開発金融公庫債券	300,000,000	314,750,700	
い第764号	利付商工債券	100,000,000	100,572,100	
い第765号	利付商工債券	200,000,000	200,967,800	
い第767号	利付商工債券	300,000,000	301,539,300	
い第778号	利付農林債券	300,000,000	302,211,000	
い第779号	利付農林債券	300,000,000	302,328,900	
第293回	利付しんきん中金債券	300,000,000	301,539,300	
第300回	利付しんきん中金債券	300,000,000	301,873,800	
第4回	広島高速道路債券	200,000,000	210,619,800	
第24回	国際協力機構債券	300,000,000	310,953,900	
第19回	政保西日本高速道路債券	110,000,000	113,342,020	
第95回	名古屋高速道路債券	100,000,000	103,007,200	
第98回	名古屋高速道路債券	100,000,000	103,464,600	
第115回	福岡北九州高速道路債券	100,000,000	102,706,400	
第45回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	209,498,800	
第55回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,552,000	
第1回	森林総合研究所債券	200,000,000	207,108,400	
特殊債券 合計		17,272,376,000	17,949,474,097	
社債券				
第3回	ノルデア・バンク	200,000,000	212,801,400	
第5回	スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	200,743,600	
第12回	首都高速道路債券	300,000,000	301,506,000	
第15回	ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	200,000,000	212,734,000	
第9回	ナショナル・オーストラリア銀行	200,000,000	201,026,000	
第8回	オーストラリア・コモンウェルス銀行	200,000,000	200,828,000	
第21回	ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	100,525,600	
第16回	中日本高速道路債券	500,000,000	521,015,000	
第33回	中日本高速道路債券	300,000,000	313,702,200	
第56回	中日本高速道路債券	200,000,000	208,638,000	
第20回	西日本高速道路債券	100,000,000	104,228,900	
第22回	西日本高速道路債券	300,000,000	312,887,400	

第8回 旭化成	200,000,000	206,792,600	
第14回 武田薬品	100,000,000	101,170,200	
第12回 オリエンタルランド	100,000,000	101,378,300	
第3回 富士フィルムホールディングス	300,000,000	312,053,400	
第68回 新日本製鐵	200,000,000	208,560,800	
第11回 YKK	200,000,000	202,201,400	
第19回 豊田自動織機	200,000,000	209,021,000	
第24回 豊田自動織機	100,000,000	104,070,200	
第71回 伊藤忠商事	200,000,000	207,559,000	
第39回 住友商事	100,000,000	107,685,900	
第45回 住友商事	100,000,000	104,813,400	
第46回 住友商事	100,000,000	103,900,100	
第79回 三菱商事	100,000,000	104,577,000	
第1回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	102,629,400	
第7回 みずほコーポレート銀行劣後特約付	200,000,000	211,106,400	
第57回 三菱東京UFJ銀行	100,000,000	112,126,000	
第127回 三菱東京UFJ銀行	200,000,000	210,640,800	
第7回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	211,629,000	
第1回 三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	102,652,300	
第9回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	200,000,000	212,763,400	
第20回 三井住友銀行劣後特約付	100,000,000	105,215,700	
第23回 三井住友銀行劣後特約付	100,000,000	105,659,300	
第14回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	105,303,700	
第20回 みずほ銀行劣後特約付	100,000,000	106,669,400	
第36回 みずほ銀行	100,000,000	100,572,400	
第43回 NTTファイナンス	300,000,000	301,769,700	
第139回 オリックス	100,000,000	105,169,100	
第173回 オリックス	100,000,000	102,166,600	
第27回 三菱UFJリース	100,000,000	101,449,800	
第21回 野村ホールディングス	100,000,000	105,151,500	
第43回 野村ホールディングス	100,000,000	100,764,300	
第46回 三井不動産	100,000,000	104,386,000	
第111回 三菱地所	100,000,000	104,331,100	
第75回 東京急行電鉄	100,000,000	104,471,200	
第77回 東京急行電鉄	100,000,000	105,243,000	
第13回 東日本旅客鉄道	300,000,000	323,262,900	
第26回 東日本旅客鉄道	100,000,000	106,411,600	
第82回 東日本旅客鉄道	100,000,000	105,270,400	
第87回 東日本旅客鉄道	200,000,000	208,858,600	
第16回 西日本旅客鉄道	100,000,000	106,047,700	
第27回 西日本旅客鉄道	100,000,000	104,433,300	
第11回 三菱倉庫	100,000,000	102,657,600	
第19回 KDDI	100,000,000	103,645,800	
第424回 中部電力	100,000,000	103,469,200	
第483回 関西電力	200,000,000	207,391,800	
第381回 中国電力	200,000,000	210,049,600	
第304回 北陸電力	100,000,000	105,160,600	
第306回 北陸電力	100,000,000	104,452,500	
第416回 東北電力	400,000,000	404,361,200	
第448回 東北電力	300,000,000	310,721,400	
第253回 四国電力	200,000,000	210,221,200	
第290回 北海道電力	200,000,000	216,005,200	
第18回 沖縄電力	300,000,000	309,497,700	
第13回 電源開発	100,000,000	113,955,800	
第31回 東京瓦斯	100,000,000	103,965,400	
第19回 大阪瓦斯	100,000,000	105,569,900	
社債券 合計	11,100,000,000	11,551,698,900	

合計	143,188,166,000	156,040,600,427	
----	-----------------	-----------------	--

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】

「DCニッセイ日本債券インデックス」

(2017年3月31日現在)

資産総額	125,283,266円
負債総額	40,374円
純資産総額(-)	125,242,892円
発行済数量	129,622,621口
1口当たり純資産額(/)	0.9662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】

<訂正前>

(1) 資本金の額

平成28年5月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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。

<訂正後>

(1) 資本金の額

2017年3月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

「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5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	291	48,026
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	49	9,349
単位型公社債投資信託	4	202
合計	344	57,578

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

<訂正後>

「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。

2017年3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	325	53,152
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	57	10,829
単位型公社債投資信託	3	112
合計	385	64,093

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

3【委託会社等の経理状況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第21期事業年度（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。

また、第22期事業年度に係る中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

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

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									
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金				利益剰余 金合計	株主資本 合計
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,647
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	7,279,087
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	50,239,548

	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）

	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)
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。		
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

該当するものではありません。

未経過リース料期末残高相当額等

該当するものではありません。

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
其他有価証券	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
其他有価証券	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 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せん。

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	37.33	その他 0.00
		税効果会計適用後の法人税等の負担率 32.70

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	767,087
								投資助言報酬の受取	676,352	未収投資助言報酬	158,782
								業務受託料の受取	47,100	-	-

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	600,637
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,284

(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
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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第22期中間会計期間末
		(平成28年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		15,063,257
有価証券		6,100,434
前払費用		332,057
未収委託者報酬		3,387,820
未収運用受託報酬		1,987,018
未収投資助言報酬		77,619
繰延税金資産		235,224
その他		12,300
流動資産合計		27,195,731
固定資産		
有形固定資産	1	177,912
無形固定資産		939,013
投資その他の資産		
投資有価証券		32,061,699
関係会社株式		66,222
差入保証金		285,884
繰延税金資産		358,138
その他		56
投資その他の資産合計		32,772,001
固定資産合計		33,888,927
資産合計		61,084,658

負債の部

流動負債

預り金		34,656
未払収益分配金		2,498
未払償還金		83,820
未払手数料		1,148,447
未払運用委託報酬		732,230
未払投資助言報酬		460,615
その他未払金		205,555
未払費用		162,124
未払法人税等		1,392,159
前受投資助言報酬		46,905
賞与引当金		412,947
その他	2	203,375
流動負債合計		<u>4,885,336</u>

固定負債

退職給付引当金		1,473,953
役員退職慰労引当金		20,525
固定負債合計		<u>1,494,478</u>

負債合計

6,379,815

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金

利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		34,819,634
利益剰余金合計		<u>35,499,441</u>

株主資本合計

53,781,281

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		923,561
評価・換算差額等合計		<u>923,561</u>

純資産合計

54,704,843

負債・純資産合計

61,084,658

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第22期中間会計期間	
(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	12,190,330
運用受託報酬	4,378,762
投資助言報酬	282,418
営業収益計	16,851,511
営業費用	8,389,290
一般管理費	1 3,636,282
営業利益	4,825,938
営業外収益	2 156,270
営業外費用	3 17,987
経常利益	4,964,221
特別利益	4 277,431
特別損失	5 7,077
税引前中間純利益	5,234,575
法人税、住民税及び事業税	1,327,094
法人税等調整額	238,395
法人税等合計	1,565,490
中間純利益	3,669,085

(3)中間株主資本等変動計算書

第22期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	8,207	8,207	8,207
遡及処理後当期首残 高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,286,108	31,965,915	50,247,755
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,669,085	3,669,085	3,669,085
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,533,525	3,533,525	3,533,525
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	34,819,634	35,499,441	53,781,281

	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	1,309,858	1,309,858	51,549,407
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	8,207
遡及処理後当期首残 高	1,309,858	1,309,858	51,557,614
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	3,669,085
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	386,296	386,296	386,296
当中間期変動額合計	386,296	386,296	3,147,228
当中間期末残高	923,561	923,561	54,704,843

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第22期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30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 ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</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（ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備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、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間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。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間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、内規に基づく中間会計期間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、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</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>

（会計方針の変更）

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日。以下「回収可能性適用指針」という。）を当中間会計期間から適用し、繰延税金資産の回収可能性に関する会計処理の方法の一部を見直しております。

回収可能性適用指針の適用については、回収可能性適用指針第49項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点において回収可能性適用指針第49項(3) から に該当する定めを適用した場合の繰延税金資産の額と、前事業年度末の繰延税金資産の額との差額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加算しております。

この結果、当中間会計期間の期首において、繰延税金資産（投資その他の資産）が8,207千円、繰越利益剰余金が8,207千円増加しております。

当中間会計期間の期首の純資産に影響額が反映されたことにより、中間株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は8,207千円増加しております。

（平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ74千円増加しております。

(中間貸借対照表関係)

第22期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	767,987千円
2.消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第22期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1.減価償却の実施額	
有形固定資産	24,369千円
無形固定資産	155,387千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	90,866千円
時効成立収益分配金・償還金	34,943千円
有価証券利息	28,471千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	11,944千円
為替差損	5,980千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	195,321千円
投資有価証券売却益	82,110千円
5.特別損失のうち主要なもの	
事故損失賠償金	4,746千円
投資有価証券売却損	2,080千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第22期中間会計期間
(自 平成28年4月1日
至 平成28年9月30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)	当中間会計期間増加 株式数(千株)	当中間会計期間減少 株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月24日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成28年3月31日	平成28年6月24日

(金融商品関係)

第22期中間会計期間末(平成28年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日(中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

(単位:千円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	15,063,257	15,063,257	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,100,434	6,120,410	19,975
投資有価証券			
満期保有目的の債券	19,015,969	19,219,090	203,120
その他有価証券	12,978,229	12,978,229	-

(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

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

中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間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

非上場株式(中間貸借対照表計上額67,500千円)については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「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(中間貸借対照表計上額66,222千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(有価証券関係)

第22期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	25,116,403	25,339,500	223,096
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	25,116,403	25,339,500	223,096
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		25,116,403	25,339,500	223,096

2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,807,626	5,876,090	68,463
	国債・地方債等	5,807,626	5,876,090	68,463
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	2,505,459	4,016,701	1,511,241
小計		8,313,086	9,892,791	1,579,705
中間貸借対照表 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)	3,331,200	3,085,438	245,761
小計		3,331,200	3,085,438	245,761
合計		11,644,286	12,978,229	1,333,943

(注1) 投資信託受益証券等であります。

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

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

(デリバティブ取引関係)

第22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. サービスごとの情報

当社のサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

該当事項はありません。

（ 1 株当たり情報）

	第22期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）
1株当たり純資産額	504,433円86銭
1株当たり中間純利益金額	33,832円67銭

（注）1．潜在株式調整後1株当たり中間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株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	3,669,085千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>3,669,085千円</u>
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第22期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

<訂正前>

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成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
日本生命保険相互会社	1,300,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

(3) 投資助言会社（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。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

(3) 投資助言会社（参考情報）

委託会社に対し、「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」の運用に関する投資助言を行います。

3【資本関係】

(1) 日本生命保険相互会社（販売会社）は、委託会社の株式を97,604株（持株比率90.00%）保有しています。

(2) 委託会社は、株式会社ニッセイ基礎研究所(投資助言会社)の株式を1,350株(持株比率15.0%)保有しています(参考情報)。

委託会社が所有する関係法人の株式または関係法人が所有する委託会社の株式のうち、持株比率が5%以上のものを記しています。

<訂正後>

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2016年9月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

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

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2016年9月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

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

(2) 販売会社

(2016年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
日本生命保険相互会社	1,300,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

(3) 投資助言会社(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

2016年9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。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

(3) 投資助言会社(参考情報)

委託会社に対し、「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」の運用に関する投資助言を行います。

3【資本関係】

- (1) 日本生命保険相互会社（販売会社）は、委託会社の株式を97,604株（持株比率90.00%）保有しています。
- (2) 委託会社は、株式会社ニッセイ基礎研究所（投資助言会社）の株式を1,350株（持株比率15.0%）保有しています（参考情報）。
委託会社が所有する関係法人の株式または関係法人が所有する委託会社の株式のうち、持株比率が5%以上のものを記しています。

独立監査人の監査報告書

2017年4月18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 青木 裕 晃 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DCニッセイ日本債券インデックスの2016年7月29日から2017年3月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイ日本債券インデックスの2017年3月10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. XBR 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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月29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28年4月1日から平成29年3月31日までの第22期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- 1．上記は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（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 データは中間監査の対象には含まれておりません。