

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年9月19日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 大関 洋
【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】	投資信託業務部 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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型） DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型） DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）
【届出の対象とした募集内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額 各ファンドにつき以下を上限とします。 DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型） 1兆円 DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型） 1兆円 DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型） 1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）  
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）  
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

上記3ファンドを総称した愛称として「ゆめ計画（確定拠出年金）」ということがあります。また、各ファンドの愛称として、DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）を「ゆめ計画30（確定拠出年金）」、DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）を「ゆめ計画50（確定拠出年金）」、DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）を「ゆめ計画70（確定拠出年金）」ということがあります。

以下、上記3ファンドのそれぞれをまたは総称して「ファンド」、「ベビーファンド」または「DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス」ということがあります。また、DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）を「債券重視型」、DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）を「標準型」、DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）を「株式重視型」ということがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。基準価額は日々変動します。なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示されます。

基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは後記「（8）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

継続申込期間：2024年9月20日から2025年3月19日まで

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。

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

**( 9 ) 【払込期日】**

取得申込者は、各販売会社が定める期日(詳しくは販売会社にお問合せください)までに、申込代金を各販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に各々の販売会社より、委託会社の指定する口座を經由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座(受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座)に払込まれます。

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

当ファンドは確定拠出年金法(平成13年法律第88号)に基づく確定拠出年金制度向けのファンドであり、受益権の取得申込みの勧誘は、資産管理機関および国民年金基金連合会(国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関も含みます)に対してのみ行われます。

ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

「DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）／（標準型）／（株式重視型）」  
＜愛称：ゆめ計画（確定拠出年金）＞（以下、これら3ファンドを総称して「当ファンド」、それぞれの  
ファンドを「債券重視型」、「標準型」、「株式重視型」または「各ファンド」ということがあります）  
につきまして、下記の通り信託約款の変更を予定しておりますのでお知らせいたします。

各ファンドのご購入に際しては、当記載を十分にご認識のうえ、お申込みいただきますようお願い  
申し上げます。

## 記

### 1. 予定している信託約款の変更の理由

当ファンドは2001年11月30日の設定以来、投資信託財産の中長期的な成長をめざして運用を  
行ってまいりましたが、長期にわたり運用成績が振るわない状況が継続していることから、抜本的な  
運用方針の見直しを行うことで受益者の皆様の投資収益の向上をめざしてまいります。

また、投資対象の変更にともない各ファンドの名称を変更するとともに、受益者の皆様の利益に  
資するため運用管理費用（以下「信託報酬」といいます）を引下げいたします。

なお、運用方針の見直しとあわせ、当ファンドのお申込みにかかる約定基準価額のプラインドを  
一層確保することを目的に、当ファンドの主要な外国投資対象資産にかかる取引所の休業日または  
当該国の休日と同日を購入・換金の申込受付不可日とする変更も行います。

## 2. 信託約款変更の内容（変更内容の詳細は投資信託約款変更新旧対照表をご参照ください）

変更事項	変更の内容											
	債券重視型				標準型				株式重視型			
運用方針の変更	当ファンドにおける投資対象資産の配分比率に変更はありません。投資対象の各資産における変更は以下のとおりです。 (1) 国内株式運用部分 投資対象マザーファンドを「ニッセイ国内株式マザーファンド」から投資環境に応じて適宜マザーファンドを変更するマルチマネージャー方式へ変更し、マザーファンドの組入比率を適切に調整します。 (2) 国内債券運用部分 投資対象マザーファンドを「ニッセイ国内債券マザーファンド」から「ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド」および「ニッセイ国内債券アクティブ(金利戦略重視型)マザーファンド」に変更し、両マザーファンドの組入比率を適切に調整します。 (3) 外国株式運用部分 投資対象マザーファンドを「ニッセイ/バトナム・海外株式マザーファンド」から投資環境に応じて適宜マザーファンドを変更するマルチマネージャー方式へ変更し、マザーファンドの組入比率を適切に調整します。 (4) 外国債券運用部分 投資対象マザーファンド(ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド)に変更はありません。											
各ファンドの名称変更	【変更後】 DCニッセイグローバルバランス (債券重視型)				【変更後】 DCニッセイグローバルバランス (標準型)				【変更後】 DCニッセイグローバルバランス (株式重視型)			
信託報酬の引下げ [信託報酬の内訳は参考情報]	【変更前 [税抜:年率]】				【変更前 [税抜:年率]】				【変更前 [税抜:年率]】			
	総額	委託	販社	受託	総額	委託	販社	受託	総額	委託	販社	受託
	1.10%	0.60%	0.40%	0.10%	1.30%	0.70%	0.50%	0.10%	1.50%	0.80%	0.60%	0.10%
	【変更後 [税抜:年率]】				【変更後 [税抜:年率]】				【変更後 [税抜:年率]】			
	総額	委託	販社	受託	総額	委託	販社	受託	総額	委託	販社	受託
	0.65%	0.35%	0.23%	0.07%	0.89%	0.48%	0.34%	0.07%	1.16%	0.62%	0.47%	0.07%
申込受付不可日の追加	ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、購入・換金の申込みの受け付けを行いません。											

## 3. 今後の日程および手続き（④以降の日程は予定です）

① 公告日	2024年9月24日
② 異議申立期間	2024年9月24日から2024年10月29日まで
③ 信託約款変更の決定日	2024年10月30日
④ 異議申立受益者の買取請求期間	2024年11月8日から2024年11月27日まで
⑤ 信託約款変更日	2024年12月23日（マザーファンド入替開始）
⑥ 信託約款変更効力発生日	2025年3月20日

- 公告日現在の受益者は、異議申立期間中に委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）に対し、書面により、この信託約款の変更に関する異議を申し立てることができます。

したがって、2024年9月20日以降に各ファンドのご購入をお申込みいただき、これにともない取得された受益権につきましては、上記の異議を申し立てることはできません。

- 各ファンドの異議申立てされた受益者の受益権の合計口数が2024年9月24日現在の各ファンドの受益権総口数の2分の1を超えない場合、信託約款の変更の実施を決定いたします。なお、この場合、信託約款の変更を行う旨を委託会社のホームページ（<https://www.nam.co.jp/>）にてお知らせいたします。  
2分の1を超えた場合は、信託約款の変更は行わず運用を継続いたします。その場合は、信託約款の変更を行わない旨を異議申立期間終了後速やかに委託会社のホームページにて電子公告し、かつ受益者の皆様に書面にてお知らせいたします。
- 信託約款の変更が行われる場合、信託約款変更効力発生日は、2025年3月20日となります。

以上

## 追加型証券投資信託「DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）」

## 投資信託約款変更新旧対照表

新	旧
<p>(ファンド名称) DCニッセイグローバルバランス (債券重視型)</p> <p style="text-align: center;"><b>運用の基本方針</b></p> <p style="text-align: center;">(略)</p> <p><b>2. 運用方法</b></p> <p>(1) 投資対象</p> <p>下記の各親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内債券アクティブ(金利戦略重視型)マザーファンド</u></p> <p>(削除)</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド</u></p> <p><u>その他、別に定める親投資信託（以下「投資対象ファンド」といいます。＊）の受益証券を主要投資対象とします。</u>なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p><u>※ 今後、投資対象ファンドが追加または変更になる場合があります。</u></p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① 主として上記各親投資信託の受益証券および投資対象ファンドの受益証券に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>② 基準ポートフォリオは、下記の比率で基準配分します。ただし、市況動向等によっては内外の株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p><u>国内株式を投資対象とするマザーファンド</u> …20%</p> <p><u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド、</u> <u>ニッセイ国内債券アクティブ(金利戦略重視型)マザーファンド</u> …55%</p> <p><u>海外株式を投資対象とするマザーファンド</u></p>	<p>(ファンド名称) DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス (債券重視型)</p> <p style="text-align: center;"><b>運用の基本方針</b></p> <p style="text-align: center;">(略)</p> <p><b>2. 運用方法</b></p> <p>(1) 投資対象</p> <p>下記の各親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド</u></p> <p>なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① 主として上記各親投資信託の受益証券に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を旨とします。</p> <p>② 基準ポートフォリオは、下記の比率で基準配分します。ただし、市況動向等によっては内外の株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p><u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u> …20%</p> <p><u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u> …55%</p> <p><u>ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド</u></p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

新	旧
<p>…10%</p> <p>ニッセイ／パトナム・海外債券 マザーファンド …10%</p> <p>短期金融資産 …5%</p> <p>③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%（ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンドおよびニッセイ国内債券アクティブ（金利戦略重視型）マザーファンドの合計は±10%）以内に変動幅を抑制します。</p> <p>④ 各投資対象ファンドへの投資割合は、上記基準ポートフォリオの範囲内でリターン特性等を基に決定します。各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。</p> <p>⑤ 投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されること、もしくは新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。</p> <p>⑥ (略)</p> <p>⑦ (略)</p> <p>(略)</p>	<p>…10%</p> <p>ニッセイ／パトナム・海外債券 マザーファンド …10%</p> <p>短期金融資産 …5%</p> <p>③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%（ニッセイ国内債券マザーファンドは±10%）以内に変動幅を抑制します。</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>(略)</p>
<p style="text-align: center;"><b>追加型証券投資信託</b> DCニッセイグローバルバランス (債券重視型) 約 款</p>	<p style="text-align: center;"><b>追加型証券投資信託</b> DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス (債券重視型) 約 款</p>
<p>(受益権の申込単位、価額および手数料等)</p>	<p>(受益権の申込単位、価額および手数料等)</p>
<p>第13条 (略)</p>	<p>第13条 (略)</p>
<p>② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該</p>	<p>② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）



新	旧
<p>取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。</p> <p>③ <u>第1項の場合の取得申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、原則として受益権の取得申込の受付は行いません。ただし、第52条第2項に規定する収益分配金の再投資に係る取得申込に限ってこれを受けけるものとします。</u></p> <p>④ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、<u>第3条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。</u></p> <p>⑤ （略）</p> <p>⑥ 別に定めるDCニッセイグローバルバランス自動けいぞく（累積）投資約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者が、第52条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第46条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。</p> <p>⑦ （略）</p>	<p>取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。</p> <p>（新設）</p> <p>③ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、<u>第4条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。</u></p> <p>④ （略）</p> <p>⑤ 別に定めるDCニッセイ／パトナム・グローバルバランス自動けいぞく（累積）投資約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者が、第52条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第46条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。</p> <p>⑥ （略）</p>
<p>（運用の指図範囲等）</p> <p>第22条 委託者は、信託金を、主としてニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された「<u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド</u>」、「<u>ニッセイ国内債券アクティブ（金利戦略重視型） マザーファンド</u>」、「<u>ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド</u>」の受益証券および別に定める親投資信託（以下「<u>投資対象ファンド</u>」<u>と</u>いいます。）（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。</p> <p>（削除）</p> <p>（削除）</p> <p>（削除）</p>	<p>（運用の指図範囲等）</p> <p>第22条 委託者は、信託金を、主として第1号から第4号までのニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の第5号から第26号までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。</p> <p>1. <u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u></p> <p>2. <u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u></p> <p>3. <u>ニッセイ／パトナム・海外株式</u></p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

新	旧
<p>(削除)</p> <p>1. (略)</p> <p>2. (略)</p> <p>3. (略)</p> <p>4. (略)</p> <p>5. (略)</p> <p>6. (略)</p> <p>7. (略)</p> <p>8. (略)</p> <p>9. (略)</p> <p>10. (略)</p> <p>11. (略)</p> <p>12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、<u>前各号の証券または証書の性質を有するもの</u></p> <p>13. (略)</p> <p>14. (略)</p> <p>15. (略)</p> <p>16. (略)</p> <p>17. (略)</p> <p>18. (略)</p> <p>19. (略)</p> <p>20. (略)</p> <p>21. (略)</p> <p>22. (略)</p> <p>なお、<u>第1号の証券または証書、第12号および第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。</u></p> <p>② (略)</p> <p>③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。</p> <p>④～⑩ (略)</p> <p>(信託報酬等の総額および支弁の方法)</p>	<p><u>マザーファンド</u></p> <p>4. <u>ニッセイ/バトナム・海外債券</u></p> <p><u>マザーファンド</u></p> <p>5. (略)</p> <p>6. (略)</p> <p>7. (略)</p> <p>8. (略)</p> <p>9. (略)</p> <p>10. (略)</p> <p>11. (略)</p> <p>12. (略)</p> <p>13. (略)</p> <p>14. (略)</p> <p>15. (略)</p> <p>16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、<u>第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの</u></p> <p>17. (略)</p> <p>18. (略)</p> <p>19. (略)</p> <p>20. (略)</p> <p>21. (略)</p> <p>22. (略)</p> <p>23. (略)</p> <p>24. (略)</p> <p>25. (略)</p> <p>26. (略)</p> <p>なお、<u>第5号の証券または証書、第16号および第21号の証券または証書のうち第5号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券ならびに第16号および第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。</u></p> <p>② (略)</p> <p>③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項<u>第1号から第4号までに</u>掲げる金融商品により運用することの指図ができます。</p> <p>④～⑩ (略)</p> <p>(信託報酬等の総額および支弁の方法)</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス（債券重視型）

新	旧
<p>第49条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第46条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の<u>65</u>の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。</p> <p>②～③ (略)</p> <p>④ 委託者は、主要投資対象とする「<u>ニッセイ/ブラウン・グローバル・リーダーズ株式 マザーファンド</u>」、「<u>ニッセイ/サンダース・グローバルバリュース株式II マザーファンド</u>」および「<u>ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド</u>」の運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を次のとおり支弁するものとします。</p> <p>投資信託財産に属する「<u>ニッセイ/ブラウン・グローバル・リーダーズ株式 マザーファンド</u>」の時価総額に毎日、年10,000分の49の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年3月、6月、9月および12月の各末日後または投資一任契約終了時に支弁します。</p> <p>投資信託財産に属する「<u>ニッセイ/サンダース・グローバルバリュース株式II マザーファンド</u>」の時価総額に年10,000分の40以内の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年3月および9月の各末日後または投資一任契約終了時に支弁します。</p> <p>投資信託財産に属する「<u>ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド</u>」の時価総額に毎日、年10,000分の14.5の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年6月および12月の各20日（休業日の場合は翌営業日）または投資一任契約終了時に支弁します。</p>	<p>第49条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第46条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の<u>110</u>の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。</p> <p>②～③ (略)</p> <p>④ 委託者は、第22条第1項第3号に規定する「<u>ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド</u>」および第4号に規定する「<u>ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド</u>」の運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎計算期末または投資一任契約終了時に支弁するものとし、その報酬額は当該計算期間を通じて毎日、投資信託財産に属する「<u>ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド</u>」の時価総額に年10,000分の50の率を乗じて得た金額、および「<u>ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド</u>」の時価総額に年10,000分の40の率を乗じて得た金額とします。</p>
<p>(一部解約)</p> <p>第54条 (略)</p> <p>② 前項の場合の一部解約請求申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、原則として受益権の一部解約の実行の請求の受付は行いません。</p> <p>③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信</p>	<p>(一部解約)</p> <p>第54条 (略)</p> <p>(新設)</p> <p>② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

新	旧
<p>託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>⑥ (略)</p> <p>⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、<u>第4項</u>の規定に準じて算出した価額とします。</p>	<p>託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。</p> <p>③ (略)</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、<u>第3項</u>の規定に準じて算出した価額とします。</p>
<p>附則第1条 約款第13条第6項の「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとし、</p>	<p>附則第1条 約款第13条第5項の「DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合「DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとし、</p>
<p>附則第4条 (略)</p> <p>② (略)</p>	<p>附則第4条 (略)</p> <p>② (略)</p>
<p>1. 別に定める親投資信託</p> <p><u>運用の基本方針および投資信託約款第22条第1項の「別に定める親投資信託(投資対象ファンド)」とは、次の親投資信託をいいます。</u></p> <p>・国内株式を投資対象とするマザーファンド</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内株式配当利回り重視型 マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイJ P X日経400アクティブ マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内株式リサーチ・バリ</u></p>	<p>(新設)</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス(債券重視型)

新	旧
<p data-bbox="391 206 619 235"><u>ユー マザーファンド</u></p> <p data-bbox="220 280 694 309">・海外株式を投資対象とするマザーファンド</p> <p data-bbox="252 315 742 414"><u>親投資信託 ニッセイ/ブラウン・グローバ ル・リーダーズ株式 マザーファ ンド</u></p> <p data-bbox="252 421 742 519"><u>親投資信託 ニッセイ/サンダース・グローバ ルバリュウ株式II マザーファン ド</u></p>	

追加型証券投資信託 DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス (債券重視型)

## 追加型証券投資信託「DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（標準型）」

## 投資信託約款変更新旧対照表

新	旧
<p>(ファンド名称) DCニッセイグローバルバランス (標準型)</p> <p>運用の基本方針</p> <p>(略)</p> <p>2. 運用方法</p> <p>(1) 投資対象</p> <p>下記の各親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内債券アクティブ(金利戦略重視型)マザーファンド</u></p> <p>(削除)</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド</u></p> <p><u>その他、別に定める親投資信託（以下「投資対象ファンド」といいます。②）の受益証券を主要投資対象とします。</u>なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p><u>※ 今後、投資対象ファンドが追加または変更になる場合があります。</u></p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① 主として上記各親投資信託の受益証券および<u>投資対象ファンドの受益証券</u>に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>② 基準ポートフォリオは、下記の比率で基準配分します。ただし、市況動向等によっては内外の株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p><u>国内株式を投資対象とするマザーファンド</u> …30%</p> <p><u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド、</u> <u>ニッセイ国内債券アクティブ(金利戦略重視型)マザーファンド</u> …35%</p> <p><u>海外株式を投資対象とするマザーファンド</u></p>	<p>(ファンド名称) DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス (標準型)</p> <p>運用の基本方針</p> <p>(略)</p> <p>2. 運用方法</p> <p>(1) 投資対象</p> <p>下記の各親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド</u></p> <p>なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① 主として上記各親投資信託の受益証券に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を<u>目指</u>します。</p> <p>② 基準ポートフォリオは、下記の比率で基準配分します。ただし、市況動向等によっては内外の株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p><u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u> …30%</p> <p><u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u> …35%</p> <p><u>ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド</u></p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（標準型）

新	旧
<p>…20%</p> <p>ニッセイ/バトナム・海外債券 マザーファンド …10%</p> <p>短期金融資産 …5%</p> <p>③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%（<u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンドおよびニッセイ国内債券アクティブ（金利戦略重視型）マザーファンドの合計は±10%</u>）以内に変動幅を抑制します。</p> <p>④ <u>各投資対象ファンドへの投資割合は、上記基準ポートフォリオの範囲内でリターン特性等を基に決定します。各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。</u></p> <p>⑤ <u>投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されること、もしくは新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。</u></p> <p>⑥ (略)</p> <p>⑦ (略)</p> <p>(略)</p>	<p>…20%</p> <p>ニッセイ/バトナム・海外債券 マザーファンド …10%</p> <p>短期金融資産 …5%</p> <p>③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%（<u>ニッセイ国内債券マザーファンドは±10%</u>）以内に変動幅を抑制します。</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>(略)</p>
<p align="center"><b>追加型証券投資信託</b> <b>DCニッセイグローバルバランス</b> <b>(標準型)</b> <b>約 款</b></p>	<p align="center"><b>追加型証券投資信託</b> <b>DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス</b> <b>(標準型)</b> <b>約 款</b></p>
<p>(受益権の申込単位、価額および手数料等)</p> <p>第13条 (略)</p> <p>② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（<u>第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。</u>）の支払いと引き換えに、当該口座に当該</p>	<p>(受益権の申込単位、価額および手数料等)</p> <p>第13条 (略)</p> <p>② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（<u>第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。</u>）の支払いと引き換えに、当該口座に当該</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス (標準型)



新	旧
<p>取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。</p> <p>③ <u>第1項の場合の取得申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、原則として受益権の取得申込の受付は行いません。ただし、第52条第2項に規定する収益分配金の再投資に係る取得申込に限ってこれを受けけるものとします。</u></p> <p>④ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、<u>第3条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。</u></p> <p>⑤ （略）</p> <p>⑥ 別に定めるDCニッセイグローバルバランス自動けいぞく（累積）投資約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者が、第52条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第46条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。</p> <p>⑦ （略）</p>	<p>取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。</p> <p>（新設）</p> <p>③ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、<u>第4条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。</u></p> <p>④ （略）</p> <p>⑤ 別に定めるDCニッセイ／バトナム・グローバルバランス自動けいぞく（累積）投資約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者が、第52条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第46条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。</p> <p>⑥ （略）</p>
<p>（運用の指図範囲等）</p> <p>第22条 委託者は、信託金を、主としてニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、<u>三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された「ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド」、「ニッセイ国内債券アクティブ（金利戦略重視型） マザーファンド」、「ニッセイ／バトナム・海外債券マザーファンド」の受益証券および別に定める親投資信託（以下「投資対象ファンド」といいます。）（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。</u></p> <p>（削除）</p> <p>（削除）</p> <p>（削除）</p>	<p>（運用の指図範囲等）</p> <p>第22条 委託者は、信託金を、主として第1号から第4号までのニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、<u>三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の第5号から第26条までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。</u></p> <p>1. <u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u></p> <p>2. <u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u></p> <p>3. <u>ニッセイ／バトナム・海外株式</u></p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／バトナム・グローバルバランス（標準型）



新	旧
(削除)	<u>マザーファンド</u>
	<u>4. ニッセイ/パトナム・海外債券</u>
	<u>マザーファンド</u>
<u>1.</u> (略)	<u>5.</u> (略)
<u>2.</u> (略)	<u>6.</u> (略)
<u>3.</u> (略)	<u>7.</u> (略)
<u>4.</u> (略)	<u>8.</u> (略)
<u>5.</u> (略)	<u>9.</u> (略)
<u>6.</u> (略)	<u>10.</u> (略)
<u>7.</u> (略)	<u>11.</u> (略)
<u>8.</u> (略)	<u>12.</u> (略)
<u>9.</u> (略)	<u>13.</u> (略)
<u>10.</u> (略)	<u>14.</u> (略)
<u>11.</u> (略)	<u>15.</u> (略)
<u>12.</u> 外国または外国の者の発行する証券または証書で、 <u>前各号</u> の証券または証書の性質を有するもの	<u>16.</u> 外国または外国の者の発行する証券または証書で、 <u>第5号から第15号</u> までの証券または証書の性質を有するもの
<u>13.</u> (略)	<u>17.</u> (略)
<u>14.</u> (略)	<u>18.</u> (略)
<u>15.</u> (略)	<u>19.</u> (略)
<u>16.</u> (略)	<u>20.</u> (略)
<u>17.</u> (略)	<u>21.</u> (略)
<u>18.</u> (略)	<u>22.</u> (略)
<u>19.</u> (略)	<u>23.</u> (略)
<u>20.</u> (略)	<u>24.</u> (略)
<u>21.</u> (略)	<u>25.</u> (略)
<u>22.</u> (略)	<u>26.</u> (略)
<p>なお、<u>第1号</u>の証券または証書、<u>第12号</u>および<u>第17号</u>の証券または証書のうち<u>第1号</u>の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、<u>第2号</u>から<u>第6号</u>までの証券ならびに<u>第12号</u>および<u>第17号</u>の証券または証書のうち<u>第2号</u>から<u>第6号</u>までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、<u>第13号</u>および<u>第14号</u>の証券を以下「投資信託証券」といいます。</p>	<p>なお、<u>第5号</u>の証券または証書、<u>第16号</u>および<u>第21号</u>の証券または証書のうち<u>第5号</u>の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、<u>第6号</u>から<u>第10号</u>までの証券ならびに<u>第16号</u>および<u>第21号</u>の証券または証書のうち<u>第6号</u>から<u>第10号</u>までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、<u>第17号</u>および<u>第18号</u>の証券を以下「投資信託証券」といいます。</p>
② (略)	② (略)
③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。	③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項 <u>第1号</u> から <u>第4号</u> までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
④～⑩ (略)	④～⑩ (略)
(信託報酬等の総額および支弁の方法)	(信託報酬等の総額および支弁の方法)

追加型証券投資信託 DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス (標準型)

新	旧
<p>第49条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第46条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の89の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。</p> <p>②～③ (略)</p> <p>④ 委託者は、主要投資対象とする「ニッセイ/ブラウン・グローバル・リーダーズ株式 マザーファンド」、「ニッセイ/サンダース・グローバルバリュース株式Ⅱ マザーファンド」および「ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド」の運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を次のとおり支弁するものとします。</p> <p>投資信託財産に属する「ニッセイ/ブラウン・グローバル・リーダーズ株式 マザーファンド」の時価総額に毎日、年10,000分の49の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年3月、6月、9月および12月の各末日後または投資一任契約終了時に支弁します。</p> <p>投資信託財産に属する「ニッセイ/サンダース・グローバルバリュース株式Ⅱ マザーファンド」の時価総額に年10,000分の40以内の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年3月および9月の各末日後または投資一任契約終了時に支弁します。</p> <p>投資信託財産に属する「ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド」の時価総額に毎日、年10,000分の14.5の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年6月および12月の各20日（休業日の場合は翌営業日）または投資一任契約終了時に支弁します。</p>	<p>第49条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第46条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の130の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。</p> <p>②～③ (略)</p> <p>④ 委託者は、第22条第1項第3号に規定する「ニッセイ/バトナム・海外株式マザーファンド」および第4号に規定する「ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド」の運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎計算期末または投資一任契約終了時に支弁するものとし、その報酬額は当該計算期間を通じて毎日、投資信託財産に属する「ニッセイ/バトナム・海外株式マザーファンド」の時価総額に年10,000分の50の率を乗じて得た金額、および「ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド」の時価総額に年10,000分の40の率を乗じて得た金額とします。</p>
<p>(一部解約)</p> <p>第54条 (略)</p> <p>② 前項の場合の一部解約請求申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、原則として受益権の一部解約の実行の請求の受付は行いません。</p> <p>③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信</p>	<p>(一部解約)</p> <p>第54条 (略)</p> <p>(新設)</p> <p>② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス（標準型）

新	旧
<p>託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。</p> <p>④ (略) ⑤ (略) ⑥ (略) ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、<u>第4項</u>の規定に準じて算出した価額とします。</p>	<p>託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。</p> <p>③ (略) ④ (略) ⑤ (略) ⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、<u>第3項</u>の規定に準じて算出した価額とします。</p>
<p>附則第1条 約款第13条第6項の「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとし、</p>	<p>附則第1条 約款第13条第5項の「DCニッセイ／バトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイ／バトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合「DCニッセイ／バトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとし、</p>
<p>附則第4条 (略) ② (略)</p>	<p>附則第4条 (略) ② (略)</p>
<p><u>1. 別に定める親投資信託</u> <u>運用の基本方針および投資信託約款第22条第1項の「別に定める親投資信託(投資対象ファンド)」とは、次の親投資信託をいいます。</u></p> <p>・<u>国内株式を投資対象とするマザーファンド</u> <u>親投資信託 ニッセイ国内株式配当利回り重視型 マザーファンド</u> <u>親投資信託 ニッセイJ P X日経400アクティブ マザーファンド</u> <u>親投資信託 ニッセイ国内株式リサーチ・バリ</u></p>	<p>(新設)</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／バトナム・グローバルバランス(標準型)

新	旧
<p style="text-align: center;"><u>ニュー マザーファンド</u></p> <p>・海外株式を投資対象とするマザーファンド</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ/ブラウン・グローバル・リーダーズ株式 マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ/サンダース・グローバルバリュース株式II マザーファンド</u></p>	

追加型証券投資信託 DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）

## 追加型証券投資信託「DCニッセイ／バトナム・グローバルバランス（株式重視型）」

## 投資信託約款変更新旧対照表

新	旧
<p>(ファンド名称) DCニッセイグローバルバランス (株式重視型)</p> <p>運用の基本方針</p> <p>(略)</p> <p>2. 運用方法</p> <p>(1) 投資対象</p> <p>下記の各親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内債券アクティブ（金利戦略重視型）マザーファンド</u></p> <p>(削除)</p> <p>親投資信託 ニッセイ／バトナム・海外債券マザーファンド</p> <p><u>その他、別に定める親投資信託（以下「投資対象ファンド」といいます。*</u>）の受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p>※ 今後、投資対象ファンドが追加または変更になる場合があります。</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① 主として上記各親投資信託の受益証券および投資対象ファンドの受益証券に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>② 基準ポートフォリオは、下記の比率で基準配分します。ただし、市況動向等によっては内外の株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p><u>国内株式を投資対象とするマザーファンド</u> …40%</p> <p><u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド、</u> <u>ニッセイ国内債券アクティブ（金利戦略重視型）マザーファンド</u> …15%</p> <p>海外株式を投資対象とするマザーファンド</p>	<p>(ファンド名称) DCニッセイ／バトナム・グローバルバランス (株式重視型)</p> <p>運用の基本方針</p> <p>(略)</p> <p>2. 運用方法</p> <p>(1) 投資対象</p> <p>下記の各親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ／バトナム・海外株式マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ／バトナム・海外債券マザーファンド</u></p> <p>なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① 主として上記各親投資信託の受益証券に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>② 基準ポートフォリオは、下記の比率で基準配分します。ただし、市況動向等によっては内外の株式、公社債等に投資を行う場合があります。</p> <p><u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u> …40%</p> <p><u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u> …15%</p> <p><u>ニッセイ／バトナム・海外株式マザーファンド</u></p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／バトナム・グローバルバランス（株式重視型）

新	旧
<p>…30%</p> <p>ニッセイ／パトナム・海外債券</p> <p>マザーファンド …10%</p> <p>短期金融資産 …5%</p> <p>③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%（<u>ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンドおよびニッセイ国内債券アクティブ（金利戦略重視型）マザーファンドの合計は±10%</u>）以内に変動幅を抑制します。</p> <p>④ 各投資対象ファンドへの投資割合は、<u>上記基準ポートフォリオの範囲内でリターン特性等を基に決定します。各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。</u></p> <p>⑤ <u>投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されること、もしくは新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。</u></p> <p>⑥ (略)</p> <p>⑦ (略)</p> <p>(略)</p>	<p>…30%</p> <p>ニッセイ／パトナム・海外債券</p> <p>マザーファンド …10%</p> <p>短期金融資産 …5%</p> <p>③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%（<u>ニッセイ国内債券マザーファンドは±10%</u>）以内に変動幅を抑制します。</p> <p>(新設)</p> <p>(新設)</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>(略)</p>
<p align="center"><b>追加型証券投資信託</b></p> <p align="center"><b>DCニッセイグローバルバランス</b></p> <p align="center"><b>(株式重視型)</b></p> <p align="center"><b>約 款</b></p>	<p align="center"><b>追加型証券投資信託</b></p> <p align="center"><b>DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス</b></p> <p align="center"><b>(株式重視型)</b></p> <p align="center"><b>約 款</b></p>
<p>(受益権の申込単位、価額および手数料等)</p> <p>第13条 (略)</p> <p>② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（<u>第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。</u>）の支払いと引き換えに、当該口座に当該</p>	<p>(受益権の申込単位、価額および手数料等)</p> <p>第13条 (略)</p> <p>② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（<u>第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。</u>）の支払いと引き換えに、当該口座に当該</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

新	旧
<p>取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。</p> <p>③ <u>第1項の場合の取得申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、原則として受益権の取得申込の受付は行いません。ただし、第52条第2項に規定する収益分配金の再投資に係る取得申込に限ってこれを受付けるものとします。</u></p> <p>④ <u>第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、第3条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。</u></p> <p>⑤ （略）</p> <p>⑥ <u>別に定めるDCニッセイグローバルバランス自動けいぞく（累積）投資約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者が、第52条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第46条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。</u></p> <p>⑦ （略）</p>	<p>取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。</p> <p>（新設）</p> <p>③ <u>第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、第4条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。</u></p> <p>④ （略）</p> <p>⑤ <u>別に定めるDCニッセイ／パトナム・グローバルバランス自動けいぞく（累積）投資約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者が、第52条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第46条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。</u></p> <p>⑥ （略）</p>
<p>（運用の指図範囲等）</p> <p>第22条 <u>委託者は、信託金を、主としてニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された「ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド」、「ニッセイ国内債券アクティブ（金利戦略重視型） マザーファンド」、「ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド」の受益証券および別に定める親投資信託（以下「投資対象ファンド」といいます。）（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。</u></p> <p>（削除）</p> <p>（削除）</p> <p>（削除）</p>	<p>（運用の指図範囲等）</p> <p>第22条 <u>委託者は、信託金を、主として第1号から第4号までのニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の第5号から第26号までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。</u></p> <p>1. <u>ニッセイ国内株式マザーファンド</u></p> <p>2. <u>ニッセイ国内債券マザーファンド</u></p> <p>3. <u>ニッセイ／パトナム・海外株式</u></p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス（株式重視型）



新	旧
<p>(削除)</p> <p>1. (略)</p> <p>2. (略)</p> <p>3. (略)</p> <p>4. (略)</p> <p>5. (略)</p> <p>6. (略)</p> <p>7. (略)</p> <p>8. (略)</p> <p>9. (略)</p> <p>10. (略)</p> <p>11. (略)</p> <p>12. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、<u>前各号</u>の証券または証券の性質を有するもの</p> <p>13. (略)</p> <p>14. (略)</p> <p>15. (略)</p> <p>16. (略)</p> <p>17. (略)</p> <p>18. (略)</p> <p>19. (略)</p> <p>20. (略)</p> <p>21. (略)</p> <p>22. (略)</p> <p>なお、<u>第1号</u>の証券または証券、<u>第12号</u>および<u>第17号</u>の証券または証券のうち<u>第1号</u>の証券または証券の性質を有するものを以下「株式」といい、<u>第2号</u>から<u>第6号</u>までの証券ならびに<u>第12号</u>および<u>第17号</u>の証券または証券のうち<u>第2号</u>から<u>第6号</u>までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、<u>第13号</u>および<u>第14号</u>の証券を以下「投資信託証券」といいます。</p> <p>② (略)</p> <p>③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。</p> <p>④～⑩ (略)</p> <p>(信託報酬等の総額および支弁の方法)</p>	<p style="text-align: center;"><u>マザーファンド</u></p> <p>4. <u>ニッセイ/バトナム・海外債券</u></p> <p style="text-align: center;"><u>マザーファンド</u></p> <p>5. (略)</p> <p>6. (略)</p> <p>7. (略)</p> <p>8. (略)</p> <p>9. (略)</p> <p>10. (略)</p> <p>11. (略)</p> <p>12. (略)</p> <p>13. (略)</p> <p>14. (略)</p> <p>15. (略)</p> <p>16. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、<u>第5号</u>から<u>第15号</u>までの証券または証券の性質を有するもの</p> <p>17. (略)</p> <p>18. (略)</p> <p>19. (略)</p> <p>20. (略)</p> <p>21. (略)</p> <p>22. (略)</p> <p>23. (略)</p> <p>24. (略)</p> <p>25. (略)</p> <p>26. (略)</p> <p>なお、<u>第5号</u>の証券または証券、<u>第16号</u>および<u>第21号</u>の証券または証券のうち<u>第5号</u>の証券または証券の性質を有するものを以下「株式」といい、<u>第6号</u>から<u>第10号</u>までの証券ならびに<u>第16号</u>および<u>第21号</u>の証券または証券のうち<u>第6号</u>から<u>第10号</u>までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、<u>第17号</u>および<u>第18号</u>の証券を以下「投資信託証券」といいます。</p> <p>② (略)</p> <p>③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項<u>第1号</u>から<u>第4号</u>までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。</p> <p>④～⑩ (略)</p> <p>(信託報酬等の総額および支弁の方法)</p>



新	旧
<p>第49条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第46条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の116の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。</p> <p>②～③ (略)</p> <p>④ 委託者は、主要投資対象とする「ニッセイ/ブラウン・グローバル・リーダーズ株式 マザーファンド」、「ニッセイ/サンダース・グローバルバリュース株式Ⅱ マザーファンド」および「ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド」の運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を次のとおり支弁するものとします。</p> <p>投資信託財産に属する「ニッセイ/ブラウン・グローバル・リーダーズ株式 マザーファンド」の時価総額に毎日、年10,000分の49の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年3月、6月、9月および12月の各末日後または投資一任契約終了時に支弁します。</p> <p>投資信託財産に属する「ニッセイ/サンダース・グローバルバリュース株式Ⅱ マザーファンド」の時価総額に年10,000分の40以内の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年3月および9月の各末日後または投資一任契約終了時に支弁します。</p> <p>投資信託財産に属する「ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド」の時価総額に毎日、年10,000分の14.5の率を乗じて得た金額を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎年6月および12月の各20日（休業日の場合は翌営業日）または投資一任契約終了時に支弁します。</p> <p>(一部解約)</p>	<p>第49条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第46条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の150の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。</p> <p>②～③ (略)</p> <p>④ 委託者は、第22条第1項第3号に規定する「ニッセイ/バトナム・海外株式マザーファンド」および第4号に規定する「ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド」の運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を、第1項に基づいて委託者が受ける報酬から毎計算期末または投資一任契約終了時に支弁するものとし、その報酬額は当該計算期間を通じて毎日、投資信託財産に属する「ニッセイ/バトナム・海外株式マザーファンド」の時価総額に年10,000分の50の率を乗じて得た金額、および「ニッセイ/バトナム・海外債券マザーファンド」の時価総額に年10,000分の40の率を乗じて得た金額とします。</p> <p>(一部解約)</p>
<p>第54条 (略)</p> <p>② 前項の場合の一部解約請求申込日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、原則として受益権の一部解約の実行の請求の受付は行いません。</p> <p>③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信</p>	<p>第54条 (略)</p> <p>(新設)</p> <p>② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス（株式重視型）

新	旧
<p>託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>⑥ (略)</p> <p>⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、<u>第4項</u>の規定に準じて算出した価額とします。</p>	<p>託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。</p> <p>③ (略)</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、<u>第3項</u>の規定に準じて算出した価額とします。</p>
<p>附則第1条 約款第13条第6項の「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合「DCニッセイグローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとし、</p>	<p>附則第1条 約款第13条第5項の「DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合「DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス自動けいぞく(累積)投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとし、</p>
<p>附則第4条 (略)</p> <p>② (略)</p>	<p>附則第4条 (略)</p> <p>② (略)</p>
<p><u>1. 別に定める親投資信託</u></p> <p><u>運用の基本方針および投資信託約款第22条第1項の「別に定める親投資信託(投資対象ファンド)」とは、次の親投資信託をいいます。</u></p> <p>・国内株式を投資対象とするマザーファンド</p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内株式配当利回り重視型 マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイJPIX日経400アクティブ マザーファンド</u></p> <p>親投資信託 <u>ニッセイ国内株式リサーチ・バリ</u></p>	<p>(新設)</p>

追加型証券投資信託 DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス(株式重視型)

新	旧
<p data-bbox="389 210 619 241"><u>ユー マザーファンド</u></p> <p data-bbox="217 282 692 313">・海外株式を投資対象とするマザーファンド</p> <p data-bbox="252 318 740 421"><u>親投資信託 ニッセイ/ブラウン・グローバ ル・リーダーズ株式 マザーファ ンド</u></p> <p data-bbox="245 425 740 528"><u>親投資信託 ニッセイ/サンダース・グローバ ルバリュウ株式II マザーファン ド</u></p>	

追加型証券投資信託 DCニッセイ/バトナム・グローバルバランス（株式重視型）

## 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】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

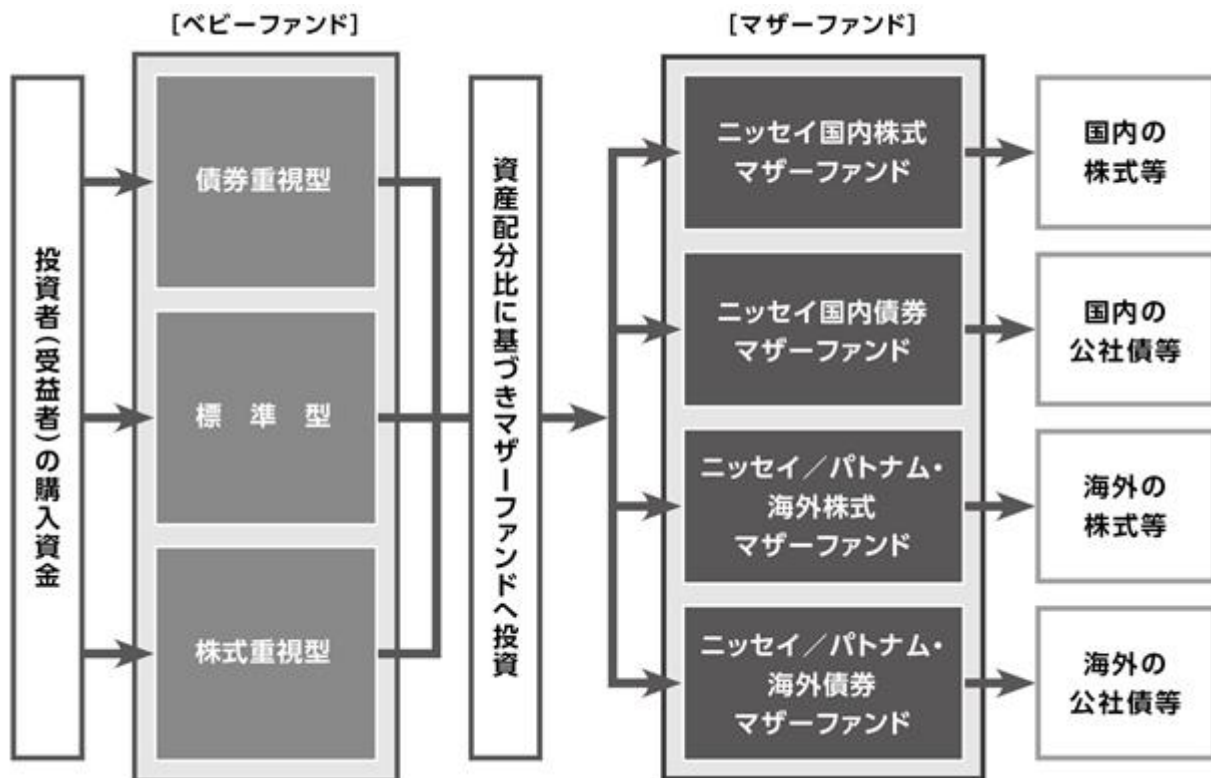
###### 基本方針

各ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度向けのファンドとして、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

###### ファンドの特色

マザーファンドへの投資を通じて、国内株式・国内債券・海外株式・海外債券に分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざします。

- ・各ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。ファミリーファンド方式とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



投資資金の目的や投資可能期間などによって3つのファンドからご選択いただけます。

- ・株式や外貨建資産の組入比率が高くなるほど、ファンドのリスク（価格の変動）が大きくなる傾向があります。
- ・各ファンドの資産配分比は、原則としてその変動幅を±5%以内（国内債券は±10%以内）に抑制します。
- ・外貨建資産には、原則として為替ヘッジを行いません。

#### DCニッセイ／パトナム・ グローバルバランス(債券重視型)

収益性よりも安定性を重視し、債券へ重点的に投資するファンドです。株式の実質組入比率を30%程度に、外貨建資産の実質組入比率を20%程度にそれぞれ抑制し、比較的安定した収益の獲得をめざします。



#### DCニッセイ／パトナム・ グローバルバランス(標準型)

安定性と収益性を共に追求し、株式・債券へ概ね50%ずつ投資するファンドです。株式の実質組入比率を50%程度に、外貨建資産の実質組入比率を30%程度に保ち、中位のリスク・リターンをめざします。



#### DCニッセイ／パトナム・ グローバルバランス(株式重視型)

より積極的に収益を追求し、株式へ重点的に投資するファンドです。株式の実質組入比率を70%程度に、外貨建資産の実質組入比率を40%程度に保ち、積極的な運用で値上り益を追求します。



・上記の各資産の組入比率は、各マザーファンドへの基準資産配分比を表しています。

国内株式マザーファンドおよび国内債券マザーファンドの運用をニッセイアセットマネジメントが、海外株式マザーファンドおよび海外債券マザーファンドの運用をザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシーが行います。

#### ニッセイ国内株式マザーファンド（運用：ニッセイアセットマネジメント）

- ・アナリストチームが徹底した企業調査・分析に基づき、組入候補銘柄を厳選します。
- ・ポートフォリオ・マネジャーが投資環境分析等に基づき運用戦略を決定し、ポートフォリオを構築します。
- ・グロース投資（成長株投資）、バリュー投資（割安株投資）などの投資スタイルをあらかじめ限定せず、運用環境から最も効率的と考えられる運用戦略を決定します。

#### ニッセイ国内債券マザーファンド（運用：ニッセイアセットマネジメント）

- ・投資環境分析、期間別金利水準の動向、個別債券銘柄の分析等に基づき、債券の利回り変化に対する価格変動性のコントロールを行うとともに、長期・中期・短期債のウエイト、投資銘柄を決定し、ポートフォリオを構築します。

- ・原則として、投資適格債への投資により、信用リスクを抑制します。

投資適格債とは、債券格付（債券の元本、利息支払いの確実性の度合いを示す尺度）がBBB格相当以上の債券です。

#### ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド（運用：ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシー）

- ・グローバルな視点に立った企業調査分析・投資環境分析を徹底し、世界各国の優良銘柄に分散投資します。
- ・アナリストとポートフォリオ・マネジャーが投資哲学と情報を共有しつつ、国・セクター（業種等）・銘柄固有要素の3つの側面を統合した銘柄選択とポートフォリオ構築を行います。
- ・外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド（運用：ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシー）

- ・各国の経済・政治情勢や金融政策等の環境分析に基づき、国別配分を決定します。
- ・投資環境分析に基づく国別の金利・為替見通しにより、債券の利回り変化に対する価格変動性のコントロールを行うとともに為替戦略を決定し、ポートフォリオを構築します。
- ・外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシーは、フランクリン・templton・グループの運用会社です。

### フランクリン・templton・グループについて

フランクリン・templton・グループは米国カリフォルニア州サンマテオに本部を置く、独立系の資産運用会社グループです。150か国以上のお客様にサービスを提供し、複数の資産クラスにおいて数多くの投資プロフェッショナルと約1.647兆米ドル(約265兆円)\*の運用資産残高を有し、世界中の個人投資家や機関投資家の皆様に多種多様な運用商品と質の高いサービスを提供しています。

\*2024年6月末現在、1米ドル=161.07円で円換算。

○ 2024年7月末現在でニッセイアセットマネジメント株式会社が知り得る情報をもとに作成しています。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

#### 信託金の上限

各ファンドにつき、5,000億円とします。ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

#### ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

ファンドの商品分類表・属性区分表は以下の通りです（該当区分を網掛け表示していません）。

#### 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
	海 外	債 券
追 加 型	内 外	不動産投信
		その他資産
		( )
		資産複合

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株		グローバル (日本含む)		
債券 一般	年1回	日本		
公債	年2回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
社債	年4回	欧州		
その他債券 ( )	年6回 (隔月)	アジア		
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分固定型))	日々	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( )	その他 ( )	アフリカ		
資産配分固定型		中近東 (中東)		
資産配分変更型		エマー ジング		

## 商品分類表

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## 属性区分表

その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

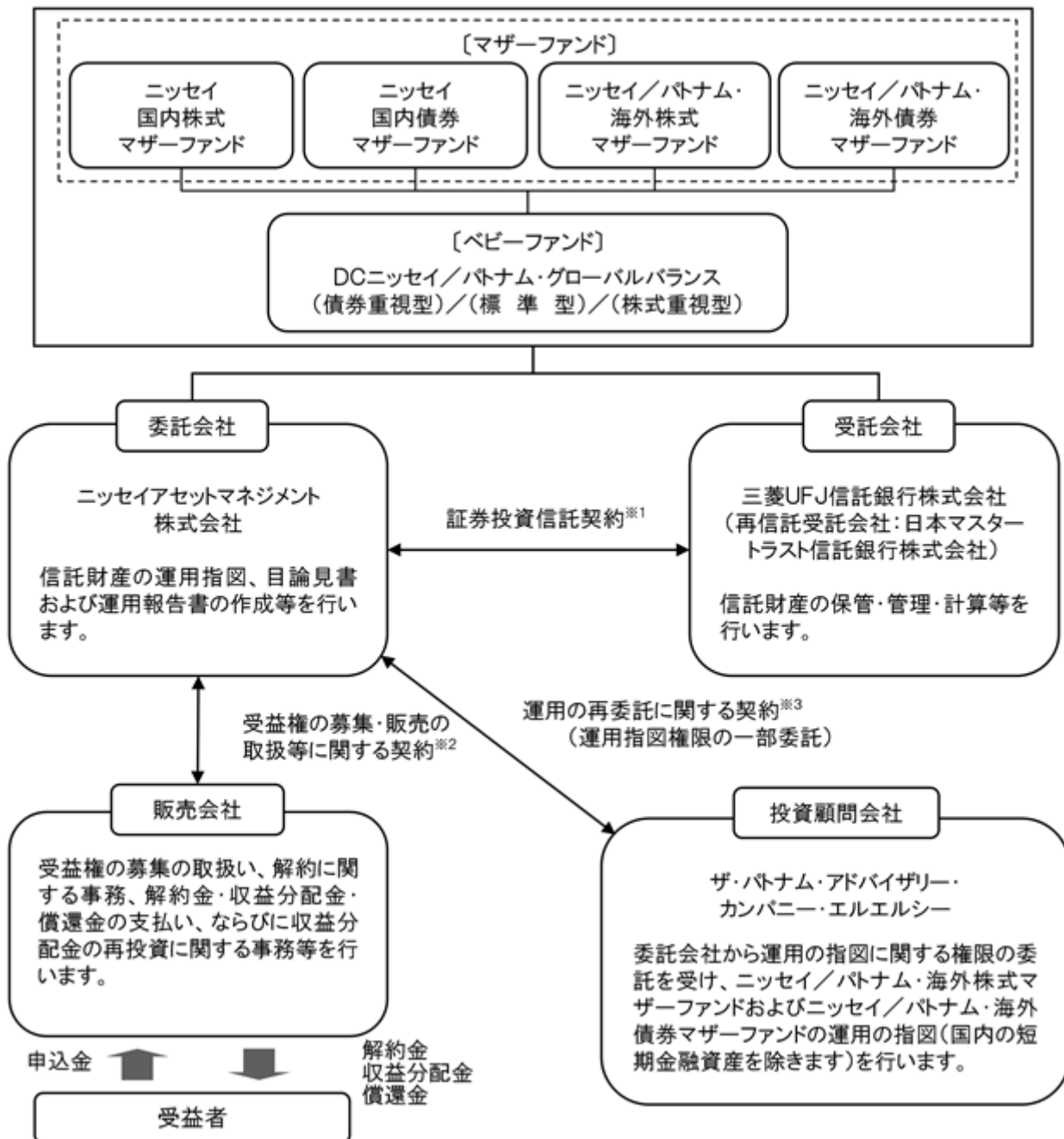
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、  
一般社団法人 投資信託協会ホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。



## (2) 【ファンドの沿革】

2001年11月30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】



- 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、信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62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 委託会社と投資顧問会社との間で結ばれ、委託会社が投資顧問会社へ運用指図権限の一部を委託するにあたり委託する業務の内容、業務を遂行する際の両者間の取決めの内容を定めた契約です。



## 委託会社の概況（2024年6月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
- ・設立年月日：1995年4月4日
- ・資本金の額：100億円
- ・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。
- ・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	108,448株	100%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

主としてニッセイ国内株式マザーファンド、ニッセイ国内債券マザーファンド、ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド、ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンドに投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指します。

基準ポートフォリオは、下記の比率で基準配分します。ただし、市況動向等によっては内外の株式、公社債等に投資を行う場合があります。

	国内株式 マザーファンド	国内債券 マザーファンド	海外株式 マザーファンド	海外債券 マザーファンド	短期金融資産
債券重視型	20%	55%	10%	10%	5%
標準型	30%	35%	20%	10%	5%
株式重視型	40%	15%	30%	10%	5%

基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%（ニッセイ国内債券マザーファンドは±10%）以内に変動幅を抑制します。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損の可能性が大きいと判断されるときには、一時的に為替ヘッジを行う場合があります。

(参考)マザーファンドの概要

## ニッセイ国内株式マザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所上場株式および店頭登録銘柄を主要投資対象とします。

## b 投資態度

国内の証券取引所上場株式および店頭登録銘柄に投資し、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標にアクティブ運用を行います。

TOPIX(東証株価指数)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。

TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

銘柄選択は幅広く企業訪問を行い、徹底した調査・分析に基づくボトムアップ・アプローチにより、成長性・割安度といった株価指標はもとより、企業経営を全体的に評価する形で組入候補銘柄を厳選します。

投資スタイルはあらかじめ限定せず、投資環境分析に基づくトップダウン・アプローチにより最も効率的と考えられる運用戦略を決定します。

上記運用戦略に基づき組入銘柄・組入比率を最終的に決定し、ポートフォリオを組成します。

ファンドのリスク状況を随時モニターし、運用戦略との整合性を維持します。

株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

私募により発行された有価証券(短期社債等を除く)および上場予定・登録予定株式への投資は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

## ニッセイ国内債券マザーファンド

### (1) 基本方針

このマザーファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

### (2) 運用方法

#### a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

#### b 投資態度

国内の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI 国債 をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標にアクティブ運用を行います。

NOMURA-BPI 国債とは、日本国内で発行される国債の流通市場動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

デュレーションコントロールに加え、銘柄分析、イールドカーブ分析に基づき、ポートフォリオ・マネージャーが運用戦略を決定し、ポートフォリオを構築します。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちますが、資金動向、市況動向およびその見通し等によってはそのような運用を行わない場合があります。

### (3) 投資制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

私募により発行された有価証券(短期社債等を除く)および上場予定・登録予定株式への投資は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

## ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

主として日本を除く世界主要先進国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標にアクティブ運用を行います。

MSCI コクサイ・インデックス（配当込み）は、MSCI Inc. が公表している指数であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。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。

なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

運用にあたっては、ザ・パトナム・アドバイザリー・カンパニー・エルエルシー(The Putnam Advisory Company, LLC.)に運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の運用の指図に関する権限を除きます）を委託します。

運用スタイルを限定せず、幅広い企業訪問等に基づくファンダメンタル分析やクオンツ分析を通じて、世界各国の投資魅力が高い企業を抽出します。

組入れ銘柄の決定に際しては、国・セクターの要素を同時に分析し、分散したポートフォリオを構築します。

株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

私募により発行された有価証券（短期社債等を除く）および上場予定・登録予定株式への投資は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

## ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

主として日本を除く世界主要先進国の公社債に分散投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標にアクティブ運用を行います。

FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

運用にあたっては、ザ・パトナム・アドバイザリー・カンパニー・エルエルシー(The Putnam Advisory Company, LLC.)に運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の運用の指図に関する権限を除きます）を委託します。

各国の市況動向や政治・経済情勢を勘案して国別配分比率およびデュレーションの調整を行います。

債券の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

為替については、公社債とは独立した投資対象と考え、エクスポージャーのコントロールを行うことにより、運用効率の向上、収益の確保を図ります。ただし、為替エクスポージャーは原則として信託財産の純資産総額の範囲内とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

私募により発行された有価証券（短期社債等を除く）および上場予定・登録予定株式への投資は、その投資額の合計が、信託財産の純資産総額の15%以下の範囲で行います。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

下記の各マザーファンドを主要投資対象とします。

- ニッセイ国内株式マザーファンド
- ニッセイ国内債券マザーファンド
- ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド
- ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。

## b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ)

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記「(5)投資制限 b 約款に定めるその他の投資制限 先物取引等、スワップ取引 および 金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限り)

ハ. 金銭債権(イ. およびニ. に掲げるものに該当するものを除きます)

ニ. 約束手形(イ. に掲げるものを除きます)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

主にニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された下記1. から4. までのマザーファンドならびに次の5. から26. までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます)に投資します。

1. ニッセイ国内株式マザーファンド

2. ニッセイ国内債券マザーファンド

3. ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド

4. ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

5. 株券または新株引受権証券

6. 国債証券

7. 地方債証券

8. 特別の法律により法人の発行する債券

9. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます)の新株引受権証券を除きます)

10. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます)

11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます)

12. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます)

13. 特定目的会社にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます)

14. コマーシャル・ペーパー

15. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ)および新株予約権証券

16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5. から15. までの証券または証書の性質を有するもの

17. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます)

18. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます)

19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます）
  20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります）
  21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）
  22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
  24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
  25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  26. 外国の者に対する権利で25.の有価証券の性質を有するもの
- なお、5.の証券または証書、16.および21.の証券または証書のうち5.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、6.から10.までの証券ならびに16.および21.の証券または証書のうち6.から10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、17.の証券および18.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品

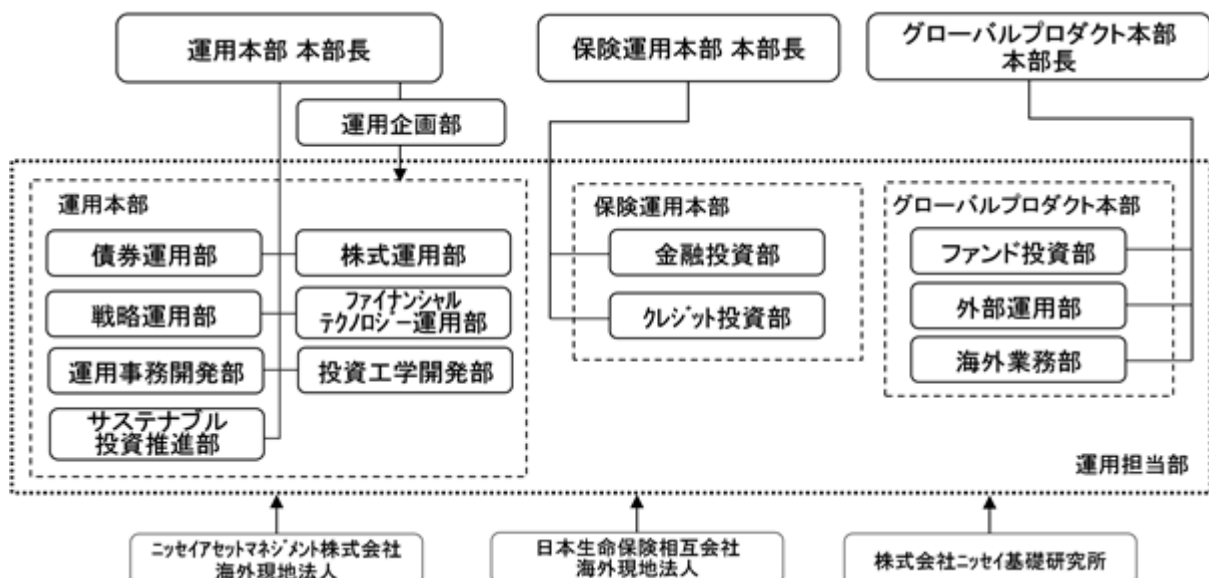
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

前記 にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記 の1.から4.までに掲げる金融商品により運用することができます。

### （3）【運用体制】

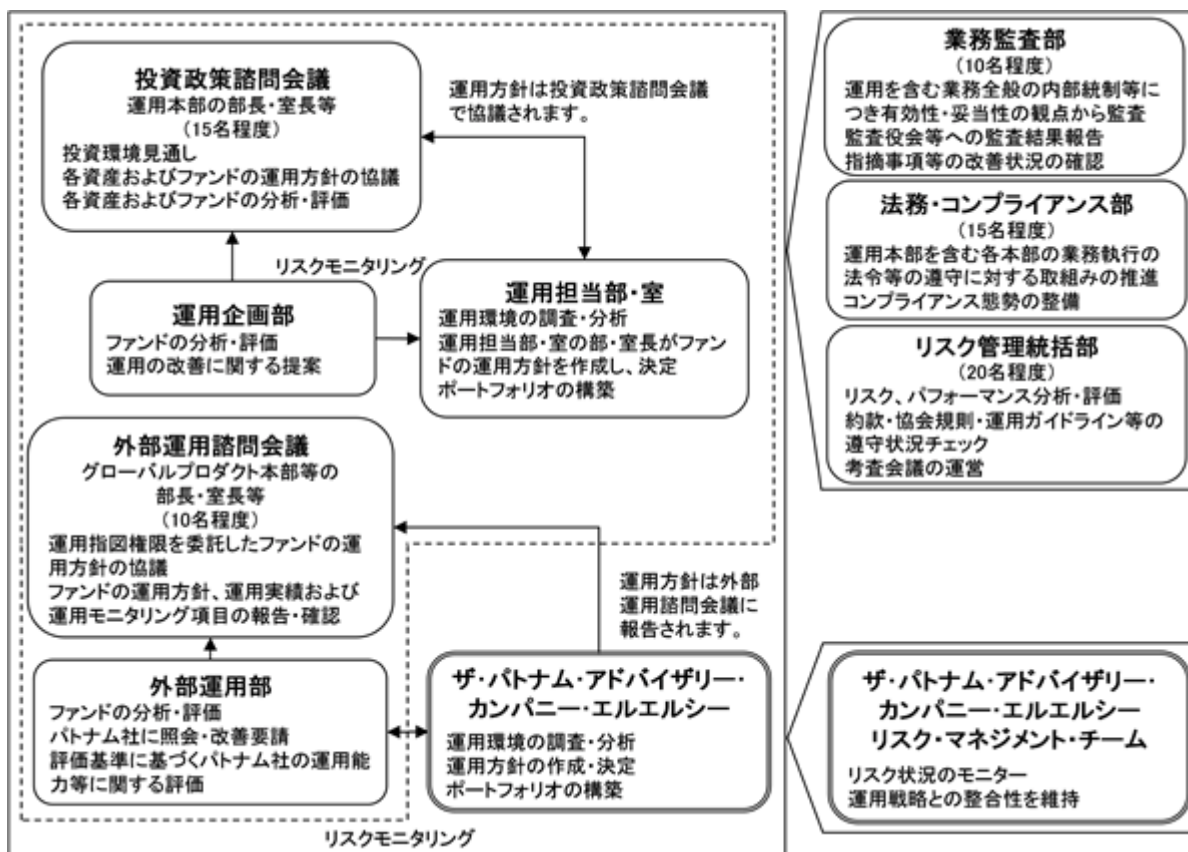
#### 委託会社の組織体制



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・マネージャー／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



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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。

## (4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲  
経費控除後の利息・配当収入および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。
2. 分配対象額についての分配方針  
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
3. 留保益の運用方針  
特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

## 分配時期

毎決算日とし、決算日は12月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

## 支払方法

## &lt; 分配金受取コースの場合 &gt;

原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。

## &lt; 分配金再投資コースの場合 &gt;

自動的に再投資されます。

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

## (5) 【投資制限】

## a 約款に定める主な投資制限

## 株式への実質投資割合

債券重視型	信託財産の純資産総額の45%以内
標準型	信託財産の純資産総額の65%以内
株式重視型	制限を設けません

## 外貨建資産への実質投資割合

債券重視型	信託財産の純資産総額の35%以内
標準型	信託財産の純資産総額の45%以内
株式重視型	信託財産の純資産総額の55%以内

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

## b 約款に定めるその他の投資制限

## 投資する株式等の範囲

1. 投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。

2. 前記1.にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、投資することができます。

## 信用取引の範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

2. 前記1.の信用取引は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

## 先物取引等

1. 国内の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ）。

2. 国内の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことができます。

3. 国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

#### スワップ取引

1. 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます)を行うことができます。

2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ)が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとし、

4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。

5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、

6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとし、

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

1. 信託財産を効率的に運用するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

2. 金利先渡取引および為替先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、

4. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとし、

#### 有価証券の貸付けおよび範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。

・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとし、

・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとし、

2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する契約の一部を解約するものとし、

3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとし、

#### 公社債の空売り

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属さない公社債を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます)の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

2. 前記1.の売付けは、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとし、

#### 公社債の借入れ

- 1．信託財産を効率的に運用するため、公社債の借入れを行うことができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとします。
- 2．前記1．は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するものとします。
- 4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

#### 外国為替予約等

- 1．信託財産を効率的に運用するため、外国為替の売買の予約取引を行うことができます。
- 2．前記1．の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。
- 3．前記2．の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。
- 4．予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
- 5．外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 資金の借入れ

- 1．信託財産を効率的に運用ならびに安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て（一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- 3．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

#### c 法令に定める投資制限

##### デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

信用リスク集中回避(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)

信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを内容とした運用を行わないものとします。

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

### 3【投資リスク】

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(外貨建資産には為替変動リスクもあります)に投資しますので、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。

##### ・株式投資リスク

株式は国内および国際的な景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、また業績悪化(倒産に至る場合も含む)等により、価格が下落することがあります。

##### ・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。

##### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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。

##### ・為替変動リスク

原則として対円での為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、為替変動の影響を直接的に受けます。一般に円高局面ではファンドの資産価値が減少します。

##### ・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。

##### ・収益分配金に関する留意点

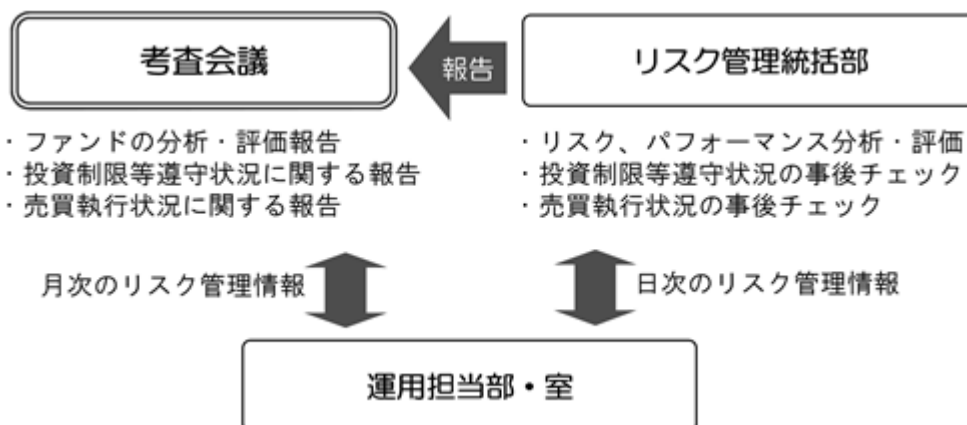
収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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。

- ・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。
- ・流動性に関する留意点  
ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。  
これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消する可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

## （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、月次の考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、月次の考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。

### < 流動性リスクに関する管理体制 >

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行っています。そして取締役会等においては、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢などを監督しています。



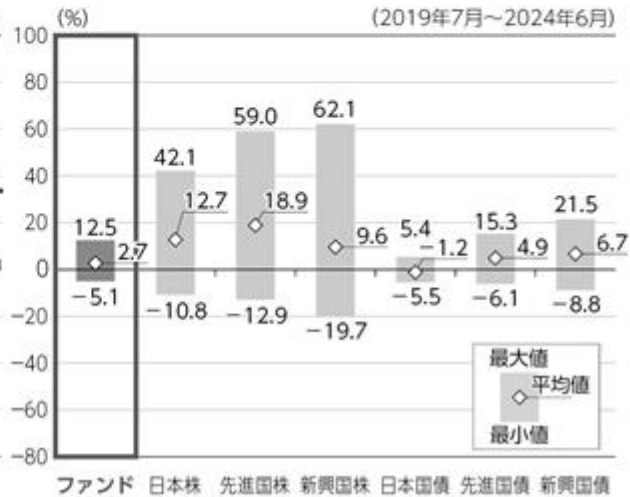
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

### ●DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス(債券重視型)

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

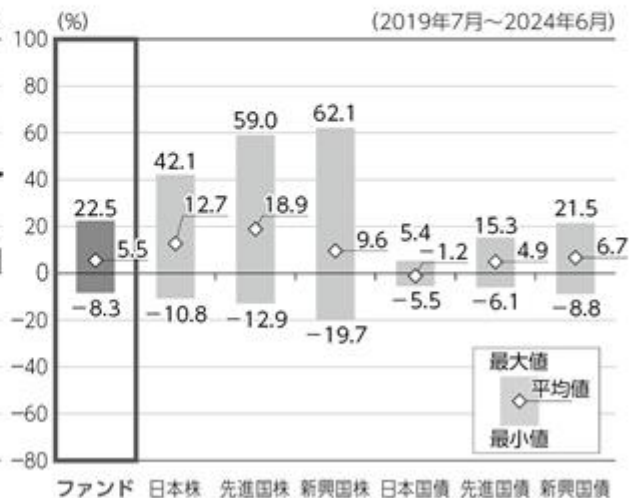


### ●DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス(標準型)

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

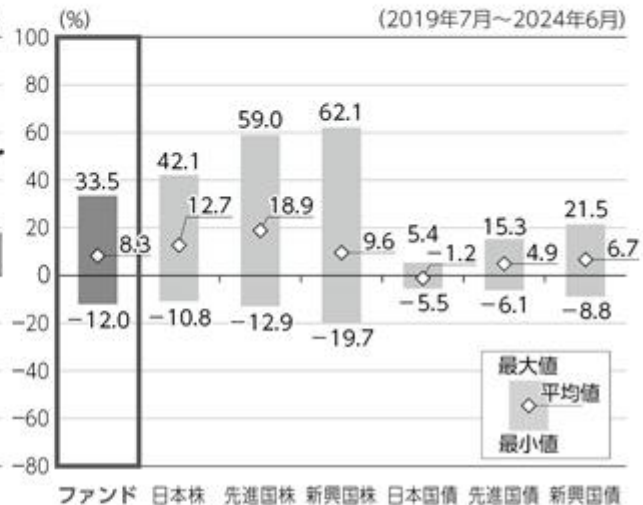


## ◎DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス(株式重視型)

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 … MSCIE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 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(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)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・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。
- ・MSCIE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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイドは、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財産権は同社に帰属します。



#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

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以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

ファンド	信託報酬率	配分（税抜）		
		委託会社	販売会社	受託会社
債券重視型	1.21%（税抜 1.1%）	0.6%	0.4%	0.1%
標準型	1.43%（税抜 1.3%）	0.7%	0.5%	0.1%
株式重視型	1.65%（税抜 1.5%）	0.8%	0.6%	0.1%

・表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

委託会社の報酬には、ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシーへの運用指図権限の一部委託に関する報酬（信託財産に属するニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンドの時価総額に年率0.5%をかけた額およびニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンドの時価総額に年率0.4%をかけた額）が含まれます。

前記の信託報酬については、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払います。

##### (4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および税金等は、信託財産中から支払います。この他に、先物取引・オプション取引等に要する費用についても信託財産中から支払います。

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 0.0044% （税抜0.004%）
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.0055% （税抜0.005%）
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.0077% （税抜0.007%）
10億円以下 の部分	年 0.0110% （税抜0.010%）

信託事務の諸費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支払います。

借入金の利息

信託財産において一部解約金の支払資金の手当て、または再投資に関する収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入を行った場合、当該借入金の利息は、借入れのつど信託財産中から支払います。

信託財産留保額

ありません。

上記の、およびの費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「4 手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

## &lt;ご参考&gt;

「4 手数料等及び税金」の「(1) 申込手数料」から「(4) その他の手数料等」までに記載の主な手数料において、当該手数料を対価とする役務の内容・收受先等は次の通りです。

申込手数料	投資者のファンドの取得時に、販売会社からの商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売会社における当該取得にかかる事務手続き等の対価として販売会社が收受
信託報酬のうち「委託会社」の報酬	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価として委託会社が收受
信託報酬のうち「販売会社」の報酬	投資者（受益者）へのファンド購入後の情報提供・運用報告書等各種書類の送付、また口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価として販売会社が收受
信託報酬のうち「受託会社」の報酬	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価として受託会社が收受
証券取引の手数料	有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
監査費用	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
借入金の利息	受託会社等から一時的に資金を借入れた場合に発生する利息

## (5) 【課税上の取扱い】

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

なお、委託会社または販売会社が取得した場合には、上記の税制は適用されません。

税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めします。

**(参考情報)ファンドの総経費率****債券重視型**

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
1.22%	1.21%	0.01%

**標準型**

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
1.44%	1.43%	0.01%

**株式重視型**

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
1.66%	1.65%	0.01%

・対象期間:2022年12月21日～2023年12月20日

・対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

・費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

・①運用管理費用の比率、②その他費用の比率および総経費率は、表示桁数未満を四捨五入しているため、①と②の合計が総経費率の数字と一致しないことがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

2024年6月28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	6,280,661,842	95.04
内 日本	6,280,661,842	95.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	327,550,878	4.96
純資産総額	6,608,212,720	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の比率です。

## DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）

2024年6月28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	19,663,085,413	95.13
内 日本	19,663,085,413	95.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,007,025,803	4.87
純資産総額	20,670,111,216	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の比率です。

## DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

2024年6月28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	14,691,597,567	95.21
内 日本	14,691,597,567	95.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	738,950,838	4.79
純資産総額	15,430,548,405	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の比率です。

（参考）

## ニッセイ国内株式マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	18,791,316,670	96.17
内 日本	18,791,316,670	96.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	749,147,137	3.83
純資産総額	19,540,463,807	100.00

## その他資産の投資状況

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	702,625,000	3.60
内 日本	702,625,000	3.60

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## ニッセイ国内債券マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	18,775,790,157	90.10
内 日本	18,775,790,157	90.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,063,021,826	9.90
純資産総額	20,838,811,983	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の比率です。

## ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	67,723,808,164	92.50
内 アメリカ	57,209,399,201	78.14
内 イギリス	2,676,907,037	3.66
内 フランス	2,204,752,883	3.01
内 デンマーク	2,008,747,908	2.74
内 カナダ	1,587,239,410	2.17
内 ドイツ	943,782,262	1.29
内 スイス	702,299,346	0.96
内 アイルランド	390,680,117	0.53
投資証券	1,711,929,917	2.34
内 アメリカ	1,711,929,917	2.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,779,207,020	5.16
純資産総額	73,214,945,101	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の比率です。

## ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	8,449,150,416	76.58
内 アメリカ	4,188,034,492	37.96
内 フランス	785,594,667	7.12
内 イタリア	770,192,726	6.98
内 イギリス	690,791,990	6.26
内 スペイン	518,665,612	4.70
内 ドイツ	417,733,261	3.79
内 ベルギー	223,415,882	2.03
内 オランダ	174,784,701	1.58
内 オーストラリア	139,400,113	1.26
内 オーストリア	119,360,531	1.08
内 メキシコ	82,704,531	0.75
内 マレーシア	58,557,858	0.53
内 アイルランド	57,129,428	0.52
内 ポーランド	52,964,856	0.48
内 フィンランド	39,110,035	0.35
内 ニュージーランド	30,178,810	0.27
内 デンマーク	28,422,124	0.26
内 カナダ	24,954,344	0.23
内 ノルウェー	23,818,959	0.22
内 スウェーデン	23,335,496	0.21
地方債証券	169,670,571	1.54
内 カナダ	169,670,571	1.54
特殊債券	926,579,195	8.40
内 アメリカ	851,425,049	7.72
内 ルクセンブルグ	75,154,146	0.68
社債券	823,698,148	7.47
内 アメリカ	747,389,625	6.77
内 オーストラリア	76,308,523	0.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	663,355,145	6.01
純資産総額	11,032,453,475	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

2024年6月28日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,657,128,481	1.4050 3,733,306,665	1.3552 3,600,940,517	- -	54.49
2	ニッセイ国内株式マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	627,247,434	1.8249 1,144,677,793	2.0910 1,311,574,384	- -	19.85
3	ニッセイ/パトナム・海外 株式マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	120,703,083	4.3574 525,952,041	5.7392 692,739,133	- -	10.48
4	ニッセイ/パトナム・海外 債券マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	180,527,573	3.4089 615,403,348	3.7413 675,407,808	- -	10.22

(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の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年6月28日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内		95.04
	小計		95.04
合計(対純資産総額比)			95.04

(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の比率です。

DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）

2024年6月28日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,265,785,068	1.4044 7,395,482,660	1.3552 7,136,191,924	- -	34.52
2	ニッセイ国内株式マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,926,086,701	1.8233 5,335,365,408	2.0910 6,118,447,291	- -	29.60
3	ニッセイ/パトナム・海外 株式マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	750,660,342	4.3523 3,267,113,089	5.7392 4,308,189,834	- -	20.84
4	ニッセイ/パトナム・海外 債券マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	561,370,744	3.4091 1,913,799,336	3.7413 2,100,256,364	- -	10.16

(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の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年6月28日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内		95.13
	小計		95.13
合計(対純資産総額比)			95.13

(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の比率です。

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(株式重視型)

2024年6月28日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内株式マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,902,996,111	1.8305 5,313,998,880	2.0910 6,070,164,868	- -	39.34
2	ニッセイノパトナム・海外 株式マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	835,602,041	4.3719 3,653,209,075	5.7392 4,795,687,233	- -	31.08
3	ニッセイ国内債券マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,672,880,783	1.4027 2,346,630,319	1.3552 2,267,088,037	- -	14.69
4	ニッセイノパトナム・海外 債券マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	416,608,513	3.4157 1,423,047,635	3.7413 1,558,657,429	- -	10.10

(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の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年6月28日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内		95.21
	小計		95.21
合計(対純資産総額比)			95.21

(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の比率です。

(参考)

## ニッセイ国内株式マザーファンド

2024年6月28日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	57,200	12,962.17 741,436,199	13,640.00 780,208,000	- -	3.99
2	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	235,300	2,644.00 622,133,200	3,290.00 774,137,000	- -	3.96
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	403,500	1,187.50 479,156,250	1,729.00 697,651,500	- -	3.57
4	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	56,500	6,703.00 378,719,500	10,725.00 605,962,500	- -	3.10



5	日立製作所 日本	株式 電気機器	152,500	1,986.60 302,956,500	3,601.00 549,152,500	- -	2.81
6	三菱商事 日本	株式 卸売業	158,200	2,237.66 353,998,890	3,148.00 498,013,600	- -	2.55
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	3,204,800	169.30 542,572,640	151.80 486,488,640	- -	2.49
8	ミスミグループ本社 日本	株式 卸売業	155,500	2,189.23 340,425,270	2,750.50 427,702,750	- -	2.19
9	ニデック 日本	株式 電気機器	56,900	5,627.00 320,176,300	7,185.00 408,826,500	- -	2.09
10	I H I 日本	株式 機械	80,600	2,617.00 210,930,200	4,805.00 387,283,000	- -	1.98
11	京セラ 日本	株式 電気機器	207,800	2,021.23 420,012,739	1,851.50 384,741,700	- -	1.97
12	マブチモーター 日本	株式 電気機器	149,700	2,344.50 350,971,650	2,387.50 357,408,750	- -	1.83
13	パナソニック ホールディングス 日本	株式 電気機器	265,400	1,377.17 365,503,278	1,317.00 349,531,800	- -	1.79
14	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	33,300	6,073.00 202,230,900	10,390.00 345,987,000	- -	1.77
15	富士フイルムホールディングス 日本	株式 化学	86,700	2,901.66 251,574,516	3,762.00 326,165,400	- -	1.67
16	スクウェア・エニックス・ホールディングス 日本	株式 情報・通信業	65,200	4,995.57 325,711,606	4,832.00 315,046,400	- -	1.61
17	旭化成 日本	株式 化学	302,300	1,073.16 324,416,695	1,030.50 311,520,150	- -	1.59
18	日揮ホールディングス 日本	株式 建設業	243,700	1,547.83 377,206,184	1,260.50 307,183,850	- -	1.57
19	サントリー食品インターナショナル 日本	株式 食料品	53,100	4,707.00 249,941,700	5,707.00 303,041,700	- -	1.55
20	デンソー 日本	株式 輸送用機器	120,900	2,136.00 258,242,400	2,498.00 302,008,200	- -	1.55
21	日本航空 日本	株式 空運業	117,600	2,765.00 325,164,000	2,538.50 298,527,600	- -	1.53
22	日本新薬 日本	株式 医薬品	91,200	4,457.19 406,496,104	3,255.00 296,856,000	- -	1.52
23	三菱電機 日本	株式 電気機器	114,700	2,036.50 233,586,550	2,567.50 294,492,250	- -	1.51
24	帝人 日本	株式 繊維製品	217,300	1,378.47 299,542,321	1,336.50 290,421,450	- -	1.49
25	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	144,800	1,830.00 264,984,000	1,960.00 283,808,000	- -	1.45

26	マキタ 日本	株式 機械	64,000	3,939.00 252,096,000	4,372.00 279,808,000	- -	1.43
27	東レ 日本	株式 繊維製品	367,100	737.60 270,772,960	761.50 279,546,650	- -	1.43
28	花王 日本	株式 化学	42,600	5,852.00 249,295,200	6,524.00 277,922,400	- -	1.42
29	東京都競馬 日本	株式 サービス業	67,400	4,435.00 298,919,000	4,055.00 273,307,000	- -	1.40
30	エイチ・アイ・エス 日本	株式 サービス業	167,400	1,896.00 317,390,400	1,627.00 272,359,800	- -	1.39

（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の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

2024年6月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	19.87
		輸送用機器	9.13
		銀行業	7.88
		化学	7.21
		サービス業	7.14
		情報・通信業	6.48
		卸売業	6.18
		小売業	5.64
		陸運業	3.90
		機械	3.41
		繊維製品	2.92
		電気・ガス業	2.60
		医薬品	2.59
		保険業	2.16
		精密機器	2.11
		建設業	2.05
		食料品	1.55
空運業	1.53		
その他金融業	0.91		
金属製品	0.90		
	小計		96.17
合計（対純資産総額比）			96.17

（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の比率です。

#### ニッセイ国内債券マザーファンド

2024年6月28日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第457回 利付国債(2年) 日本	国債証券	1,500,000,000	100.02 1,500,360,000	99.73 1,495,965,000	0.1 2026/2/1	7.18
2	第146回 利付国債(5年) 日本	国債証券	1,030,700,000	100.16 1,032,441,883	99.80 1,028,731,363	0.1 2025/12/20	4.94
3	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,000,000,000	100.09 1,000,970,000	99.28 992,860,000	0.1 2027/3/20	4.76

4	第450回 利付国債（2年） 日本	国債証券	943,400,000	99.86 942,119,296	99.83 941,843,390	0.005 2025/7/1	4.52
5	第367回 利付国債（10年） 日本	国債証券	637,900,000	97.04 619,024,048	95.07 606,496,183	0.2 2032/6/20	2.91
6	第82回 利付国債（30年） 日本	国債証券	625,800,000	96.25 602,361,114	92.31 577,701,012	1.8 2054/3/20	2.77
7	第188回 利付国債（20年） 日本	国債証券	569,200,000	96.42 548,827,981	96.17 547,450,868	1.6 2044/3/20	2.63
8	第365回 利付国債（10年） 日本	国債証券	530,500,000	96.76 513,336,574	94.99 503,964,390	0.1 2031/12/20	2.42
9	第351回 利付国債（10年） 日本	国債証券	506,900,000	99.73 505,541,508	98.53 499,489,122	0.1 2028/6/20	2.40
10	第24回 物価連動国債（10年） 日本	国債証券	396,000,000	112.58 445,822,546	113.28 448,595,603	0.1 2029/3/10	2.15
11	第147回 利付国債（20年） 日本	国債証券	409,100,000	109.89 449,588,627	105.41 431,269,129	1.6 2033/12/20	2.07
12	第151回 利付国債（5年） 日本	国債証券	394,400,000	99.78 393,567,816	99.03 390,578,264	0.005 2027/3/20	1.87
13	第80回 利付国債（30年） 日本	国債証券	404,600,000	101.09 409,040,201	92.55 374,477,530	1.8 2053/9/20	1.80
14	第454回 利付国債（2年） 日本	国債証券	361,700,000	99.90 361,360,250	99.84 361,121,280	0.1 2025/11/1	1.73
15	第452回 利付国債（2年） 日本	国債証券	322,700,000	99.79 322,026,318	99.78 322,002,968	0.005 2025/9/1	1.55
16	第81回 利付国債（30年） 日本	国債証券	358,100,000	96.84 346,808,422	88.16 315,733,189	1.6 2053/12/20	1.52
17	第186回 利付国債（20年） 日本	国債証券	328,500,000	97.10 318,984,862	95.10 312,416,640	1.5 2043/9/20	1.50
18	第155回 利付国債（20年） 日本	国債証券	313,500,000	102.92 322,654,200	97.68 306,248,745	1 2035/12/20	1.47
19	第364回 利付国債（10年） 日本	国債証券	314,800,000	95.94 302,024,108	95.31 300,061,064	0.1 2031/9/20	1.44
20	第438回 利付国債（2年） 日本	国債証券	297,100,000	100.00 297,103,541	100.00 297,103,541	0.005 2024/7/1	1.43

21	第156回 利付国債（5年） 日本	国債証券	298,500,000	100.29 299,389,530	99.21 296,150,805	0.2 2027/12/20	1.42
22	第451回 利付国債（2年） 日本	国債証券	279,900,000	99.83 279,448,494	99.81 279,368,190	0.005 2025/8/1	1.34
23	第169回 利付国債（20年） 日本	国債証券	298,600,000	87.50 261,286,906	83.69 249,907,298	0.3 2039/6/20	1.20
24	第78回 利付国債（30年） 日本	国債証券	258,800,000	97.37 251,993,560	84.21 217,951,008	1.4 2053/3/20	1.05
25	第370回 利付国債（10年） 日本	国債証券	225,200,000	96.36 217,008,483	96.57 217,477,892	0.5 2033/3/20	1.04
26	第118回 利付国債（20年） 日本	国債証券	200,000,000	111.04 222,088,000	107.94 215,888,000	2 2030/6/20	1.04
27	第164回 利付国債（20年） 日本	国債証券	238,900,000	92.97 222,116,733	88.62 211,720,347	0.5 2038/3/20	1.02
28	第162回 利付国債（20年） 日本	国債証券	200,000,000	96.38 192,776,000	90.72 181,440,000	0.6 2037/9/20	0.87
29	第151回 利付国債（20年） 日本	国債証券	174,100,000	105.69 184,021,959	100.84 175,569,404	1.2 2034/12/20	0.84
30	第440回 利付国債（2年） 日本	国債証券	175,100,000	100.01 175,128,215	100.01 175,128,215	0.005 2024/9/1	0.84

（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の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

2024年6月28日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	90.10
	小計		90.10
合計（対純資産総額比）			90.10

（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の比率です。

#### ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド

2024年6月28日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	47,700	60,651.15 2,893,060,111	72,940.54 3,479,264,211	- -	4.75

2	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハード ウェアおよび機器	98,700	31,027.07 3,062,372,000	34,485.08 3,403,678,086	- -	4.65
3	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	163,800	8,164.02 1,337,267,737	19,971.06 3,271,261,151	- -	4.47
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	91,600	25,025.70 2,292,354,605	31,867.69 2,919,081,274	- -	3.99
5	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	208,300	8,464.71 1,763,200,913	10,933.43 2,277,433,802	- -	3.11
6	BOSTON SCIENTIFIC CORP アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	158,100	9,162.18 1,448,541,405	12,402.39 1,960,817,859	- -	2.68
7	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サー ビス	38,700	42,056.42 1,627,583,621	42,939.65 1,661,764,505	- -	2.27
8	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	10,800	95,345.68 1,029,733,413	146,419.07 1,581,325,986	- -	2.16
9	APPLIED MATERIALS INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	40,000	26,545.60 1,061,824,056	37,453.60 1,498,144,284	- -	2.05
10	INGERSOLL-RAND INC アメリカ	株式 資本財	99,800	12,459.71 1,243,479,258	14,652.53 1,462,323,282	- -	2.00
11	ASML HOLDING NV アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	8,600	121,659.59 1,046,272,551	165,581.57 1,424,001,508	- -	1.94
12	OTIS WORLDWIDE CORP アメリカ	株式 資本財	90,600	14,541.62 1,317,471,652	15,462.72 1,400,922,432	- -	1.91
13	LINDE PLC アメリカ	株式 素材	19,100	66,699.93 1,273,968,678	70,906.23 1,354,309,096	- -	1.85
14	CONSTELLATION ENERGY アメリカ	株式 公益事業	41,000	20,162.24 826,652,047	32,983.91 1,352,340,498	- -	1.85

15	NOVO-NORDISK A/S デンマーク	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	58,200	16,101.55 937,110,223	23,160.06 1,347,915,492	- -	1.84
16	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	211,400	5,440.22 1,150,063,543	6,321.99 1,336,470,271	- -	1.83
17	REGENERON PHARMACEUTICALS アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	7,455	138,332.04 1,031,265,400	169,262.02 1,261,848,360	- -	1.72
18	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	24,600	44,081.45 1,084,403,799	49,596.67 1,220,078,190	- -	1.67
19	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	13,800	96,331.05 1,329,368,574	88,066.63 1,215,319,538	- -	1.66
20	UNILEVER PLC イギリス	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	135,316	7,744.93 1,048,013,468	8,906.31 1,205,167,542	- -	1.65
21	MERCK & CO INC アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	57,200	17,399.56 995,255,007	20,910.10 1,196,058,143	- -	1.63
22	FORTIVE CORP アメリカ	株式 資本財	100,300	12,027.71 1,206,379,922	11,849.91 1,188,546,965	- -	1.62
23	INTUITIVE SURGICAL INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	16,200	62,273.85 1,008,836,470	71,693.86 1,161,440,656	- -	1.59
24	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	35,900	27,403.31 983,779,156	32,080.31 1,151,683,197	- -	1.57
25	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	20,700	56,355.37 1,166,556,312	55,003.79 1,138,578,542	- -	1.56

26	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	114,300	8,307.18 949,511,324	9,913.85 1,133,154,026	- -	1.55
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	11,700	85,646.05 1,002,058,868	88,714.13 1,037,955,374	- -	1.42
28	CASELLA WASTE SYSTEMS INC-A アメリカ	株式 商業・専 門サービ ス	63,300	14,062.32 890,145,029	16,073.17 1,017,431,996	- -	1.39
29	AXA SA フランス	株式 保険	194,391	5,102.06 991,795,790	5,233.66 1,017,376,809	- -	1.39
30	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC アメリカ	株式 消費者 サービス	100,000	7,496.29 749,629,444	10,052.37 1,005,237,870	- -	1.37

(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の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

2024年6月28日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	13.07
		ソフトウェア・サービス	13.01
		半導体・半導体製造装置	8.71
		金融サービス	6.79
		資本財	6.43
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.54
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.18
		銀行	4.95
		素材	4.90
		ヘルスケア機器・サービス	4.85
		公益事業	3.62
		生活必需品流通・小売り	3.11
		保険	2.43
		耐久消費財・アパレル	2.27
		家庭用品・パーソナル用品	1.65
		商業・専門サービス	1.39
		消費者サービス	1.37
		メディア・娯楽	1.14
電気通信サービス	1.05		
運輸	1.03		
	小計		92.50
投資証券	外国		2.34
	小計		2.34
合計(対純資産総額比)			94.84

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

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	777,968,100	96.24 748,748,077	95.07 739,645,391	3.125 2028/11/15	6.70
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	901,992,000	80.85 729,269,551	77.98 703,445,520	2.75 2042/8/15	6.38
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	612,066,000	96.52 590,784,465	96.57 591,096,618	2.625 2026/1/31	5.36
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	579,852,000	95.30 552,645,344	94.86 550,065,002	2.625 2027/5/31	4.99
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	547,638,000	92.86 508,574,981	93.21 510,475,285	1.375 2026/8/31	4.63
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	475,156,500	96.81 460,046,523	97.95 465,425,294	2 2025/2/15	4.22
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	386,568,000	83.06 321,106,574	82.06 317,256,357	1.125 2031/2/15	2.88
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	459,049,500	71.53 328,358,661	67.66 310,625,025	2.375 2049/11/15	2.82
9	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証 券	282,621,200	113.11 319,698,275	109.86 310,513,086	6.5 2027/11/1	2.81
10	UNITED KINGDOM GILT イギリス	国債証 券	315,394,000	96.42 304,107,269	96.96 305,821,792	2 2025/9/7	2.77
11	GNMA MA8723 アメリカ	特殊債 券	318,745,068	92.56 295,036,809	92.94 296,273,539	4 2053/3/1	2.69
12	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証 券	306,747,400	86.41 265,078,833	84.77 260,057,378	- 2031/8/15	2.36
13	UNITED KINGDOM GILT イギリス	国債証 券	286,906,800	87.93 252,294,363	83.13 238,514,230	3.25 2044/1/22	2.16
14	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証 券	265,388,200	85.28 226,338,980	82.66 219,377,847	- 2030/11/25	1.99
15	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証 券	237,815,400	87.77 208,747,706	86.33 205,327,438	1.65 2032/3/1	1.86
16	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証 券	163,713,500	111.63 182,766,477	108.63 177,848,523	5.15 2028/10/31	1.61
17	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証 券	167,160,100	101.57 169,794,543	99.14 165,729,209	2.75 2027/10/25	1.50
18	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証 券	127,524,200	122.72 156,504,074	112.53 143,508,083	4.5 2041/4/25	1.30
19	GNMA MA7590 アメリカ	特殊債 券	159,768,035	87.17 139,284,174	87.72 140,153,312	3 2051/9/1	1.27
20	FNMA FM9958 アメリカ	特殊債 券	153,916,204	91.06 140,171,486	89.20 137,293,254	3.5 2051/11/1	1.24
21	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証 券	122,354,300	109.33 133,771,179	104.59 127,981,374	4.75 2044/9/1	1.16
22	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証 券	130,970,800	104.05 136,277,736	97.51 127,717,485	2.5 2044/7/4	1.16
23	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証 券	101,674,700	117.79 119,765,679	110.61 112,469,502	4.25 2041/3/28	1.02



24	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券	112,014,500	96.52 108,117,808	96.24 107,803,874	1 2026/6/22	0.98
25	ONTARIO (PROVINCE OF) カナダ	地方債証券	93,936,000	113.52 106,638,025	111.36 104,609,008	6.5 2029/3/8	0.95
26	GNMA BX9597 アメリカ	特殊債券	121,640,899	83.48 101,550,688	81.51 99,159,227	2 2051/1/1	0.90
27	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	105,121,300	91.01 95,675,099	88.76 93,307,768	0.5 2029/5/25	0.85
28	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	84,441,700	119.02 100,510,404	106.01 89,523,401	4 2055/4/25	0.81
29	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券	92,927,484	88.72 82,452,190	88.99 82,704,531	7.75 2031/5/29	0.75
30	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	91,334,900	90.95 83,076,398	89.61 81,848,857	1.25 2030/10/31	0.74

（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の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

2024年6月28日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	外国	国債証券	76.58
		特殊債券	8.40
		社債券	7.47
		地方債証券	1.54
	小計		93.99
合計(対純資産総額比)			93.99

（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の比率です。

#### 【投資不動産物件】

DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

該当事項はありません。

DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）

該当事項はありません。

DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

該当事項はありません。

DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）

該当事項はありません。

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス(株式重視型)

該当事項はありません。

(参考)

## ニッセイ国内株式マザーファンド

2024年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物 0 609月	買建	25	689,293,750	702,625,000	3.60

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## ニッセイ国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

## ニッセイノパトナム・海外株式マザーファンド

該当事項はありません。

## ニッセイノパトナム・海外債券マザーファンド

該当事項はありません。

( 3 ) 【運用実績】  
【純資産の推移】

DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）

直近日（2024年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	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14計算期間末 (2014年12月22日)	4,963,714,265	4,963,714,265	1.3247	1.3247
第15計算期間末 (2015年12月21日)	5,587,253,032	5,587,253,032	1.3561	1.3561
第16計算期間末 (2016年12月20日)	6,025,341,775	6,025,341,775	1.3814	1.3814
第17計算期間末 (2017年12月20日)	6,446,154,578	6,446,154,578	1.4608	1.4608
第18計算期間末 (2018年12月20日)	6,088,532,109	6,088,532,109	1.3904	1.3904
第19計算期間末 (2019年12月20日)	6,254,063,379	6,254,063,379	1.4819	1.4819
第20計算期間末 (2020年12月21日)	6,108,409,128	6,108,409,128	1.4779	1.4779
第21計算期間末 (2021年12月20日)	6,285,882,385	6,285,882,385	1.5436	1.5436
第22計算期間末 (2022年12月20日)	6,062,968,052	6,062,968,052	1.5047	1.5047
第23計算期間末 (2023年12月20日)	6,459,302,129	6,459,302,129	1.6137	1.6137
2023年6月末日	6,468,869,987	-	1.6099	-
7月末日	6,398,881,630	-	1.5984	-
8月末日	6,436,083,400	-	1.6028	-
9月末日	6,369,639,718	-	1.5893	-
10月末日	6,254,043,237	-	1.5581	-
11月末日	6,452,560,631	-	1.6049	-
12月末日	6,435,281,313	-	1.6081	-
2024年1月末日	6,530,936,657	-	1.6345	-
2月末日	6,589,924,645	-	1.6587	-
3月末日	6,672,557,400	-	1.6781	-
4月末日	6,643,279,698	-	1.6728	-
5月末日	6,576,730,505	-	1.6626	-
6月末日	6,608,212,720	-	1.6798	-

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）

直近日（2024年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	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14計算期間末 （2014年12月22日）	13,227,927,812	13,227,927,812	1.3846	1.3846
第15計算期間末 （2015年12月21日）	14,480,919,031	14,480,919,031	1.4245	1.4245
第16計算期間末 （2016年12月20日）	15,435,532,394	15,435,532,394	1.4483	1.4483
第17計算期間末 （2017年12月20日）	16,766,129,556	16,766,129,556	1.5881	1.5881
第18計算期間末 （2018年12月20日）	15,555,555,957	15,555,555,957	1.4695	1.4695
第19計算期間末 （2019年12月20日）	16,540,261,328	16,540,261,328	1.6210	1.6210
第20計算期間末 （2020年12月21日）	16,252,582,203	16,252,582,203	1.6194	1.6194
第21計算期間末 （2021年12月20日）	17,182,372,140	17,182,372,140	1.7528	1.7528
第22計算期間末 （2022年12月20日）	17,139,897,528	17,139,897,528	1.7300	1.7300
第23計算期間末 （2023年12月20日）	19,072,623,775	19,072,623,775	1.9356	1.9356
2023年6月末日	18,912,177,507	-	1.9090	-
7月末日	18,857,646,459	-	1.9060	-
8月末日	19,047,239,415	-	1.9217	-
9月末日	18,821,298,686	-	1.9019	-
10月末日	18,352,351,285	-	1.8578	-
11月末日	19,062,530,688	-	1.9284	-
12月末日	19,061,181,827	-	1.9328	-
2024年1月末日	19,641,390,809	-	1.9945	-
2月末日	20,088,401,999	-	2.0426	-
3月末日	20,434,200,199	-	2.0832	-
4月末日	20,355,397,040	-	2.0835	-
5月末日	20,409,044,212	-	2.0839	-
6月末日	20,670,111,216	-	2.1175	-

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）

直近日（2024年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	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14計算期間末 （2014年12月22日）	7,516,524,514	7,516,524,514	1.4233	1.4233
第15計算期間末 （2015年12月21日）	8,148,309,314	8,148,309,314	1.4707	1.4707
第16計算期間末 （2016年12月20日）	8,720,727,104	8,720,727,104	1.4894	1.4894
第17計算期間末 （2017年12月20日）	9,677,246,721	9,677,246,721	1.6933	1.6933
第18計算期間末 （2018年12月20日）	8,830,207,726	8,830,207,726	1.5200	1.5200
第19計算期間末 （2019年12月20日）	9,918,232,676	9,918,232,676	1.7330	1.7330
第20計算期間末 （2020年12月21日）	9,736,764,614	9,736,764,614	1.7245	1.7245
第21計算期間末 （2021年12月20日）	10,988,668,543	10,988,668,543	1.9350	1.9350
第22計算期間末 （2022年12月20日）	11,341,061,518	11,341,061,518	1.9319	1.9319
第23計算期間末 （2023年12月20日）	13,426,525,241	13,426,525,241	2.2544	2.2544
2023年6月末日	13,016,514,725	-	2.1983	-
7月末日	13,033,741,942	-	2.2073	-
8月末日	13,277,153,481	-	2.2378	-
9月末日	13,066,135,525	-	2.2105	-
10月末日	12,794,020,598	-	2.1512	-
11月末日	13,419,877,208	-	2.2503	-
12月末日	13,459,001,129	-	2.2559	-
2024年1月末日	14,141,200,781	-	2.3639	-
2月末日	14,563,365,867	-	2.4434	-
3月末日	14,932,771,799	-	2.5119	-
4月末日	14,962,612,484	-	2.5205	-
5月末日	15,115,153,829	-	2.5370	-
6月末日	15,430,548,405	-	2.5925	-

## 【分配の推移】

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）

	1口当たりの分配金（円）
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
2023年12月21日～2024年6月20日	-

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）

	1口当たりの分配金（円）
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
2023年12月21日～2024年6月20日	-

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）

	1口当たりの分配金（円）
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
2023年12月21日～2024年6月20日	-

## 【収益率の推移】

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）

	収益率（％）
第14計算期間	8.0
第15計算期間	2.4
第16計算期間	1.9
第17計算期間	5.7
第18計算期間	4.8
第19計算期間	6.6
第20計算期間	0.3
第21計算期間	4.4
第22計算期間	2.5
第23計算期間	7.2
2023年12月21日～2024年6月20日	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を乗じて得た数により算出しています（第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）

	収益率（％）
第14計算期間	10.5
第15計算期間	2.9
第16計算期間	1.7
第17計算期間	9.7
第18計算期間	7.5
第19計算期間	10.3
第20計算期間	0.1
第21計算期間	8.2
第22計算期間	1.3
第23計算期間	11.9
2023年12月21日～2024年6月20日	8.3

（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を乗じて得た数により算出しています（第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。



## D C ニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）

	収益率（％）
第14計算期間	13.0
第15計算期間	3.3
第16計算期間	1.3
第17計算期間	13.7
第18計算期間	10.2
第19計算期間	14.0
第20計算期間	0.5
第21計算期間	12.2
第22計算期間	0.2
第23計算期間	16.7
2023年12月21日～2024年6月20日	13.3

（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を乗じて得た数により算出しています（第1計算期間については、前期末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】

## D C ニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第14計算期間	817,633,672	444,555,634	3,747,178,535
第15計算期間	897,423,787	524,641,170	4,119,961,152
第16計算期間	691,752,841	449,856,701	4,361,857,292
第17計算期間	647,574,577	596,689,587	4,412,742,282
第18計算期間	548,977,000	582,749,497	4,378,969,785
第19計算期間	533,951,919	692,682,528	4,220,239,176
第20計算期間	545,651,743	632,605,406	4,133,285,513
第21計算期間	501,063,269	562,141,866	4,072,206,916
第22計算期間	425,432,365	468,412,424	4,029,226,857
第23計算期間	396,230,578	422,629,471	4,002,827,964
2023年12月21日～ 2024年6月20日	220,375,762	283,741,174	3,939,462,552

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第14計算期間	1,710,868,114	1,041,735,921	9,553,451,235
第15計算期間	1,678,265,108	1,066,148,574	10,165,567,769
第16計算期間	1,374,224,323	881,935,845	10,657,856,247
第17計算期間	1,018,677,514	1,119,478,585	10,557,055,176
第18計算期間	983,660,917	955,074,931	10,585,641,162
第19計算期間	899,647,401	1,281,610,342	10,203,678,221
第20計算期間	938,700,502	1,106,185,062	10,036,193,661
第21計算期間	927,600,726	1,160,924,856	9,802,869,531
第22計算期間	906,262,073	801,694,109	9,907,437,495
第23計算期間	859,809,249	913,609,739	9,853,637,005
2023年12月21日～ 2024年6月20日	419,839,417	502,410,442	9,771,065,980

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第14計算期間	1,132,699,688	841,393,296	5,280,949,468
第15計算期間	1,079,021,340	819,371,204	5,540,599,604
第16計算期間	851,282,022	536,564,151	5,855,317,475
第17計算期間	752,490,211	892,922,645	5,714,885,041
第18計算期間	738,580,557	644,120,372	5,809,345,226
第19計算期間	716,153,007	802,341,904	5,723,156,329
第20計算期間	802,382,669	879,473,642	5,646,065,356
第21計算期間	816,412,625	783,694,124	5,678,783,857
第22計算期間	768,434,684	576,866,446	5,870,352,095
第23計算期間	780,917,555	695,497,247	5,955,772,403
2023年12月21日～ 2024年6月20日	407,492,196	414,021,101	5,949,243,498

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

&lt; 参考情報 &gt;

## 3. 運用実績

2024年6月末現在

### DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス(債券重視型)

#### ● 基準価額・純資産の推移



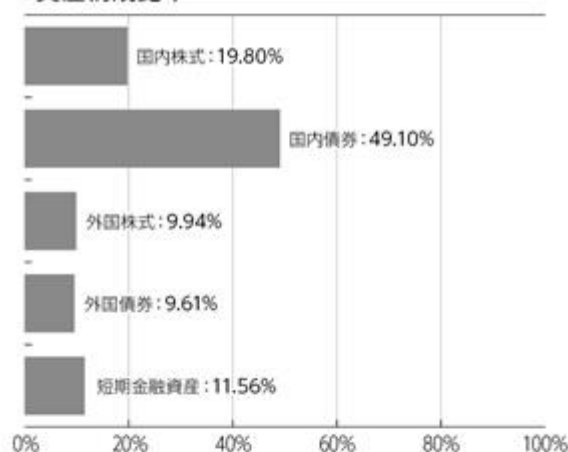
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

・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。

#### ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

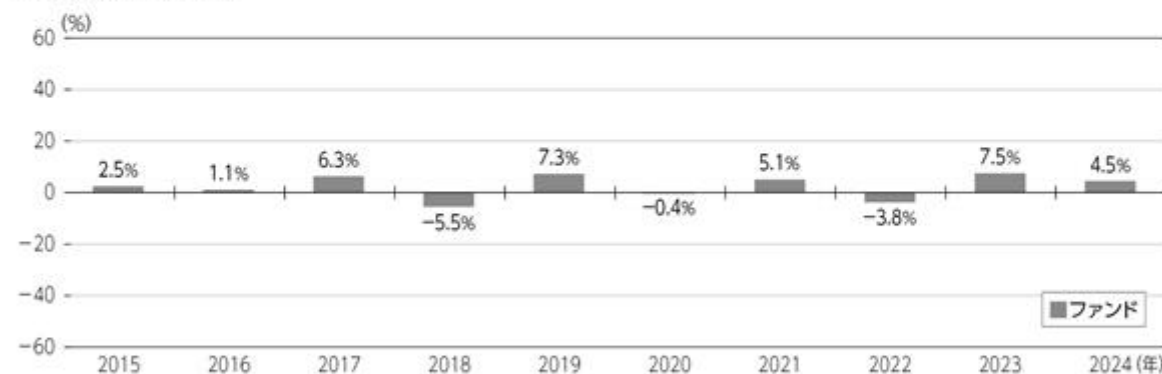
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
2023年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

#### ● 資産構成比率



・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。

・2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

最新の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。

2024年6月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス(標準型)

## ●基準価額・純資産の推移



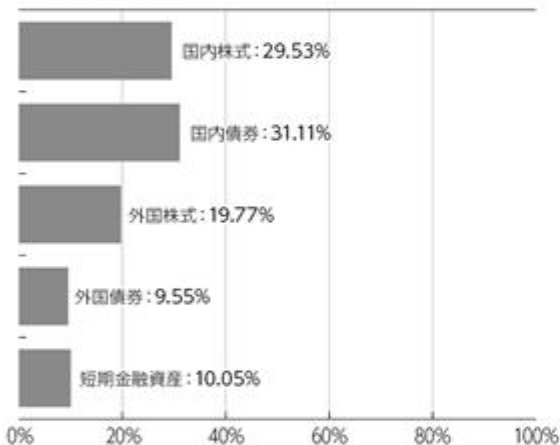
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

・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。

## ●分配の推移 1万口当たり(税引前)

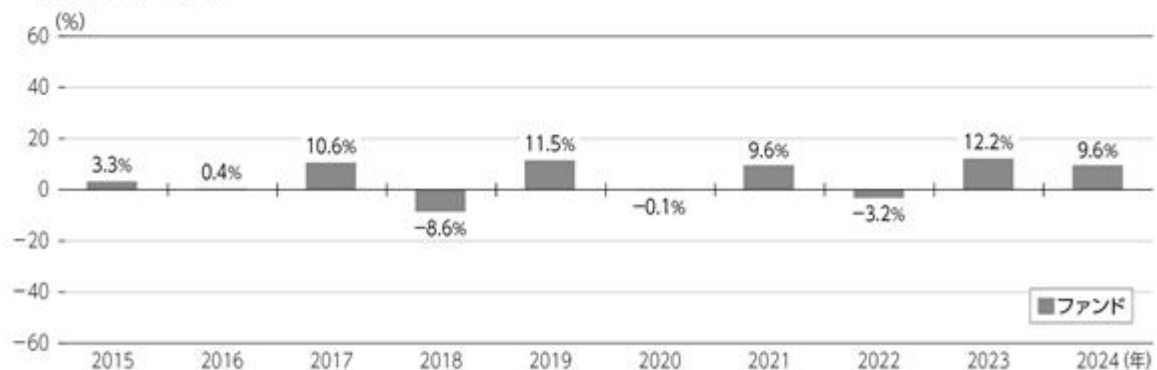
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
2023年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●資産構成比率



・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。

・2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

## 3.運用実績

2024年6月末現在

## DCニッセイ／パトナム・グローバルバランス(株式重視型)

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	25,925円
純資産総額	154億円

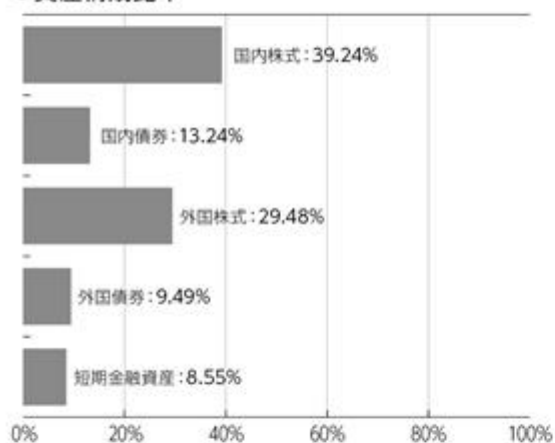
## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
2023年12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。

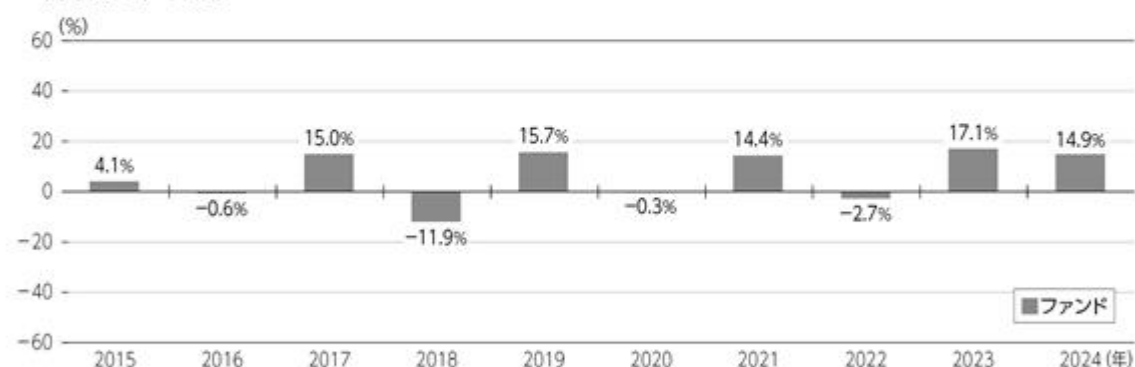
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



・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。

・2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

最新の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。

2024年6月末現在

## 3.運用実績

## ●マザーファンドの状況

## 1. ニッセイ国内株式マザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	ソニーグループ	4.2%
2	トヨタ自動車	4.1%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.7%
4	三井住友フィナンシャルグループ	3.2%
5	日立製作所	2.9%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 2. ニッセイ国内債券マザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第457回 利付国債(2年)	2026/02/01	0.100%	8.0%
2	第146回 利付国債(5年)	2025/12/20	0.100%	5.5%
3	第346回 利付国債(10年)	2027/03/20	0.100%	5.3%
4	第450回 利付国債(2年)	2025/07/01	0.005%	5.0%
5	第367回 利付国債(10年)	2032/06/20	0.200%	3.2%

・比率は対組入債券評価額比です。

## 3. ニッセイ／パトナム・海外株式マザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	業種	比率
1	マイクロソフト	アメリカ	情報技術	5.0%
2	アップル	アメリカ	情報技術	4.9%
3	エヌビディア	アメリカ	情報技術	4.7%
4	アマゾン・ドット・コム	アメリカ	一般消費財・サービス	4.2%
5	ウォルマート	アメリカ	生活必需品	3.3%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&amp;PおよびMSCI Inc.に帰属します。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 4. ニッセイ／パトナム・海外債券マザーファンド

## 組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	アメリカ	2028/11/15	3.125%	6.7%
2	アメリカ国債	アメリカ	2042/08/15	2.750%	6.4%
3	アメリカ国債	アメリカ	2026/01/31	2.625%	5.4%
4	アメリカ国債	アメリカ	2027/05/31	2.625%	5.0%
5	アメリカ国債	アメリカ	2026/08/31	1.375%	4.6%

・比率は対純資産総額比です。

## 組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	20.7%
2	輸送用機器	9.5%
3	銀行業	8.2%
4	化学	7.5%
5	サービス業	7.4%

・比率は対組入株式評価額比です。

## 組入債券種別

	種別	比率
	日本国債	100.0%
	その他	-

・比率は対組入債券評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	83.7%
2	イギリス	3.9%
3	フランス	3.2%
4	デンマーク	2.9%
5	カナダ	2.3%

・国・地域はパトナム社の分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

## 組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	52.5%
2	フランス	7.1%
3	イタリア	7.0%
4	イギリス	6.3%
5	スペイン	4.7%

・比率は対純資産総額比です。

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

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。

証券取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、申込みの受付けを中止することおよび既に受付けた申込みの受付けを取消すことがあります。

2024年11月5日以降は、原則として「午後3時30分」までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とする予定です。ただし、当該時刻は販売会社によって異なる場合があります。

#### 取扱コース

分配金の受取方法により、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の2つのコースがあります（販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります）。

分配金再投資コースを選択した場合、販売会社と「自動けいぞく（累積）投資契約」（同様の権利義務を規定する名称の異なる契約または規定も含まれます）を締結します。

#### 申込単位

1円以上1円単位とします。

#### 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

#### 販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### 申込手数料

ありません。

#### その他

1. ファンドの取得申込者は、販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。
2. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

### 2【換金（解約）手続等】

#### 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。

証券取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することがあります。

2024年11月5日以降は、原則として「午後3時30分」までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とする予定です。ただし、当該時刻は販売会社によって異なる場合があります。

#### 換金単位

1口単位とします。

#### 換金価額

換金請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

換金手数料はありません。

#### 信託財産留保額

ありません。

**支払開始日**

換金請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

**その他**

1. 受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
2. 換金請求の受付が中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記の規定に準じて算出した価額とします。
3. 詳細については、販売会社にお問合せください。なお、販売会社については、委託会社にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

**3【資産管理等の概要】****(1)【資産の評価】**

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金額をいいます。

ファンドおよびマザーファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	証券取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。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、償却原価法で評価します。
外国株式	証券取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
外国債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。
国内債券先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます）の円換算については、原則として国内における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

**(2)【保管】**

該当事項はありません。



## (3) 【信託期間】

無期限です。

## (4) 【計算期間】

毎年12月21日から翌年12月20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。

## (5) 【その他】

繰上償還

1. 委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。

4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

6. 前記3.から5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記3.の一定の期間を1ヵ月以上設けることが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更 4. 」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社の間において存続します。

9. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「 約款の変更 」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。

10. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までにお支払いします。

約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することができます。この場合、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

2. 委託会社は、前記1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記1.から5.の規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

前記「繰上償還」に規定する信託契約の解約または前記「約款の変更」に規定する約款の変更を行う場合において、「繰上償還 3.」または「約款の変更 3.」の一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権の買取りを請求することができます。ただし、当該買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社および販売会社の協議により決定します。

#### 公告

電子公告により行い、委託会社のホームページ(<https://www.nam.co.jp/>)に掲載します。

電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

委託会社は、ファンドの計算期間の末日毎および償還時に期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

- ・交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知られたる受益者に交付します。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページ(<https://www.nam.co.jp/>)に掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、交付します。

#### 信託事務処理の再信託

受託会社は、ファンドにかかる信託事務の処理の一部について、日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

委託会社と投資顧問会社との間で締結された「運用の再委託に関する契約」は、委託会社、投資顧問会社いずれかにより別段の意思表示がない限り、ファンドの償還日まで存続するものとします。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

受益者には、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利があります。

分配金受取コースの場合、原則として決算日から起算して5営業日目までに販売会社において支払いを開始します。ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

分配金再投資コースの場合、自動的に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### (2) 償還金に対する請求権

受益者には、持分に応じて償還金を請求する権利があります。原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までに販売会社において支払いを開始します。ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

##### (3) 解約請求権

受益者には、持分に応じて解約請求する権利があります。権利行使の方法等については、前記「2 換金（解約）手続等」の項をご参照ください。

##### (4) 帳簿閲覧権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する法令で定められた帳簿書類の閲覧を請求することができます。

##### (5) 反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 反対者の買取請求権」の項をご参照ください。

### 第3【ファンドの経理状況】

#### DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間（2022年12月21日から2023年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）

1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間（2022年12月21日から2023年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間（2022年12月21日から2023年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1 【財務諸表】

## 【DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 2022年12月20日現在	第23期 2023年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	3,591,771	7,868,202
コール・ローン	346,367,386	337,752,862
親投資信託受益証券	5,749,902,582	6,152,156,774
未収入金	1,893,886	6,134,699
流動資産合計	6,101,755,625	6,503,912,537
資産合計	6,101,755,625	6,503,912,537
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,172,153	5,603,874
未払受託者報酬	3,397,545	3,523,464
未払委託者報酬	33,975,853	35,234,992
その他未払費用	242,022	248,078
流動負債合計	38,787,573	44,610,408
負債合計	38,787,573	44,610,408
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,029,226,857	4,002,827,964
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,033,741,195	2,456,474,165
（分配準備積立金）	839,791,059	1,032,524,295
元本等合計	6,062,968,052	6,459,302,129
純資産合計	6,062,968,052	6,459,302,129
負債純資産合計	6,101,755,625	6,503,912,537

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期 自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	第23期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	6,146	8,853
有価証券売買等損益	81,548,320	514,533,214
営業収益合計	81,542,174	514,542,067
<b>営業費用</b>		
支払利息	177,295	157,404
受託者報酬	6,777,259	6,905,878
委託者報酬	67,773,359	69,059,572
その他費用	490,722	494,692
営業費用合計	75,218,635	76,617,546
営業利益又は営業損失（ ）	156,760,809	437,924,521
経常利益又は経常損失（ ）	156,760,809	437,924,521
当期純利益又は当期純損失（ ）	156,760,809	437,924,521
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	6,440,013	26,000,125
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,213,675,469	2,033,741,195
剰余金増加額又は欠損金減少額	224,687,508	225,044,837
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	224,687,508	225,044,837
剰余金減少額又は欠損金増加額	254,300,986	214,236,263
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	254,300,986	214,236,263
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,033,741,195	2,456,474,165

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	第23期	
	自 2022年12月21日	至 2023年12月20日
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22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1. 期首元本額	4,072,206,916円	4,029,226,857円
期中追加設定元本額	425,432,365円	396,230,578円
期中一部解約元本額	468,412,424円	422,629,471円
2. 受益権の総数	4,029,226,857口	4,002,827,964口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第22期	第23期
	自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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(1,675,993,467円)及び分配準備積立金(839,791,059円)より分配対象収益は2,515,784,526円(1万口当たり6,243.84円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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(276,638,711円)、収益調整金(1,743,408,576円)及び分配準備積立金(755,885,584円)より分配対象収益は2,775,932,871円(1万口当たり6,934.93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。
2. 委託費用	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 5,533,787円	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 5,664,805円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	第22期	第23期
	自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	90,876,554	437,313,574
合計	90,876,554	437,313,574

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1口当たり純資産額	1,5047円	1,6137円
(1万口当たり純資産額)	(15,047円)	(16,137円)

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

## ( 1 ) 株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2023年12月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ/パトナム・海外債券 マザーファンド	190,253,324	647,089,605	
	ニッセイ/パトナム・海外株式 マザーファンド	150,722,568	650,910,482	
	ニッセイ国内債券マザーファン ド	2,552,474,576	3,594,394,697	
	ニッセイ国内株式マザーファン ド	694,619,536	1,259,761,990	
親投資信託受益証券 合計		3,588,070,004	6,152,156,774	
合計			6,152,156,774	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2022年12月20日現在	第23期 2023年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	10,338,234	22,731,688
コール・ローン	996,953,141	975,787,456
親投資信託受益証券	16,256,007,917	18,207,105,047
未収入金	15,151,806	9,643,851
流動資産合計	17,278,451,098	19,215,268,042
資産合計	17,278,451,098	19,215,268,042
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	13,196,853	7,181,060
未払受託者報酬	9,603,371	10,378,451
未払委託者報酬	115,240,893	124,542,005
その他未払費用	512,453	542,751
流動負債合計	138,553,570	142,644,267
負債合計	138,553,570	142,644,267
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,907,437,495	9,853,637,005
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,232,460,033	9,218,986,770
（分配準備積立金）	3,911,457,059	5,291,482,500
元本等合計	17,139,897,528	19,072,623,775
純資産合計	17,139,897,528	19,072,623,775
負債純資産合計	17,278,451,098	19,215,268,042

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第22期 自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	第23期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	17,340	25,231
有価証券売買等損益	19,295,580	2,298,958,944
営業収益合計	19,312,920	2,298,984,175
<b>営業費用</b>		
支払利息	503,745	450,253
受託者報酬	18,953,352	20,054,613
委託者報酬	227,441,182	240,656,354
その他費用	1,036,501	1,073,765
営業費用合計	247,934,780	262,234,985
営業利益又は営業損失( )	228,621,860	2,036,749,190
経常利益又は経常損失( )	228,621,860	2,036,749,190
当期純利益又は当期純損失( )	228,621,860	2,036,749,190
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( )	3,780,331	106,938,722
期首剰余金又は期首欠損金( )	7,379,502,609	7,232,460,033
剰余金増加額又は欠損金減少額	681,053,931	726,882,552
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	681,053,931	726,882,552
剰余金減少額又は欠損金増加額	603,254,978	670,166,283
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	603,254,978	670,166,283
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,232,460,033	9,218,986,770

## （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第23期	
	自 2022年12月21日	至 2023年12月20日
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22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1. 期首元本額	9,802,869,531円	9,907,437,495円
期中追加設定元本額	906,262,073円	859,809,249円
期中一部解約元本額	801,694,109円	913,609,739円
2. 受益権の総数	9,907,437,495口	9,853,637,005口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第22期	第23期
	自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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（5,371,861,345円）及び分配準備積立金（3,911,457,059円）より分配対象収益は9,283,318,404円（1万口当たり9,370.05円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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（1,724,846,348円）、収益調整金（5,666,253,008円）及び分配準備積立金（3,566,636,152円）より分配対象収益は10,957,735,508円（1万口当たり11,120.50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。
2. 委託費用	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 24,046,842円	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 25,584,428円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	第22期	第23期
	自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	26,511,097	2,000,316,201
合計	26,511,097	2,000,316,201

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1口当たり純資産額	1.7300円	1.9356円
(1万口当たり純資産額)	(17,300円)	(19,356円)

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

## ( 1 ) 株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2023年12月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ/パトナム・海外債券 マザーファンド	563,593,161	1,916,893,059	
	ニッセイ/パトナム・海外株式 マザーファンド	892,994,757	3,856,487,157	
	ニッセイ国内債券マザーファン ド	4,854,246,773	6,835,750,305	
	ニッセイ国内株式マザーファン ド	3,086,664,384	5,597,974,526	
親投資信託受益証券 合計		9,397,499,075	18,207,105,047	
合計			18,207,105,047	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 【DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2022年12月20日現在	第23期 2023年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	6,955,480	15,688,638
コール・ローン	670,741,956	673,455,333
親投資信託受益証券	10,756,598,024	12,843,824,516
未収入金	5,195,038	5,012,444
流動資産合計	11,439,490,498	13,537,980,931
資産合計	11,439,490,498	13,537,980,931
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,358,979	2,865,345
未払受託者報酬	6,312,600	7,211,579
未払委託者報酬	88,377,094	100,962,962
その他未払費用	380,307	415,804
流動負債合計	98,428,980	111,455,690
負債合計	98,428,980	111,455,690
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,870,352,095	5,955,772,403
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,470,709,423	7,470,752,838
（分配準備積立金）	2,593,178,501	4,065,073,315
元本等合計	11,341,061,518	13,426,525,241
純資産合計	11,341,061,518	13,426,525,241
負債純資産合計	11,439,490,498	13,537,980,931

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期 自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	第23期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	11,391	16,947
有価証券売買等損益	162,544,612	2,119,142,062
営業収益合計	162,556,003	2,119,159,009
<b>営業費用</b>		
支払利息	332,802	302,800
受託者報酬	12,325,728	13,713,178
委託者報酬	172,561,362	191,986,016
その他費用	762,677	813,982
営業費用合計	185,982,569	206,815,976
営業利益又は営業損失（ ）	23,426,566	1,912,343,033
経常利益又は経常損失（ ）	23,426,566	1,912,343,033
当期純利益又は当期純損失（ ）	23,426,566	1,912,343,033
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（ ）	4,564,919	127,970,202
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,309,884,686	5,470,709,423
剰余金増加額又は欠損金減少額	728,139,908	869,003,415
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	728,139,908	869,003,415
剰余金減少額又は欠損金増加額	539,323,686	653,332,831
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	539,323,686	653,332,831
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,470,709,423	7,470,752,838

## （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第23期	
	自 2022年12月21日	至 2023年12月20日
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22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1. 期首元本額	5,678,783,857円	5,870,352,095円
期中追加設定元本額	768,434,684円	780,917,555円
期中一部解約元本額	576,866,446円	695,497,247円
2. 受益権の総数	5,870,352,095口	5,955,772,403口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第22期	第23期
	自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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（4,581,720,718円）及び分配準備積立金（2,593,178,501円）より分配対象収益は7,174,899,219円（1万口当たり12,222.26円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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（1,759,527,936円）、収益調整金（4,973,736,181円）及び分配準備積立金（2,305,545,379円）より分配対象収益は9,038,809,496円（1万口当たり15,176.55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。
2. 委託費用	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 21,205,502円	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 23,730,354円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第22期	第23期
	自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	122,912,040	1,867,845,193
合計	122,912,040	1,867,845,193

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	第22期	第23期
	2022年12月20日現在	2023年12月20日現在
1口当たり純資産額	1.9319円	2.2544円
(1万口当たり純資産額)	(19,319円)	(22,544円)

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## （１）株式

該当事項はありません。

## （２）株式以外の有価証券

2023年12月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ/パトナム・海外債券 マザーファンド	398,118,677	1,354,081,244	
	ニッセイ/パトナム・海外株式 マザーファンド	946,237,169	4,086,419,838	
	ニッセイ国内債券マザーファン ド	1,450,839,579	2,043,072,295	
	ニッセイ国内株式マザーファン ド	2,955,586,204	5,360,251,139	
親投資信託受益証券 合計		5,750,781,629	12,843,824,516	
合計			12,843,824,516	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）」、「DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）」、「DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）」は、「ニッセイ国内株式マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券マザーファンド」受益証券、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」受益証券を主要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。

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。）における同親投資信託の状況は以下の通りであります。それらは監査意見の対象外であります。

## ニッセイ国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2023年12月20日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	20,792,593
コール・ローン	892,549,291
株式	16,934,468,090
未収入金	51,072,063
未収配当金	902,700
前払金	17,199,000
差入委託証拠金	40,580,512
流動資産合計	17,957,564,249
<b>資産合計</b>	
17,957,564,249	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,718,800
未払金	49,756,168
未払解約金	11,700,885
その他未払費用	677
流動負債合計	74,176,530
<b>負債合計</b>	
74,176,530	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	9,860,487,938
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,022,899,781
元本等合計	17,883,387,719
純資産合計	17,883,387,719
負債純資産合計	17,957,564,249

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。



## （貸借対照表に関する注記）

項目	2023年12月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,082,899,379円
同期中追加設定元本額	1,458,586,785円
同期中一部解約元本額	2,680,998,226円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	122,512,010円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	215,621,522円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	121,080,249円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	20,403,172円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	307,671,122円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	1,279,026,992円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	752,262,055円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	694,619,536円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	3,086,664,384円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	2,955,586,204円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	86,400,786円
DCニッセイバランスアクティブ	218,639,906円
計	9,860,487,938円
2. 受益権の総数	9,860,487,938口
3. 差入代用有価証券	
株式	237,500,000円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）」にて記載しております。 (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）

## 売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式		1,490,712,408
合計		1,490,712,408

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2023年12月20日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	857,079,000	-	844,380,000	12,699,000
合計	857,079,000	-	844,380,000	12,699,000

## （注）株価指数先物取引

## 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2023年12月20日現在
1口当たり純資産額	1.8136円
（1万口当たり純資産額）	（18,136円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2023年12月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
サカタのタネ	20,800	3,900.00	81,120,000	
日揮ホールディングス	119,200	1,605.00	191,316,000	
総合警備保障	328,500	800.30	262,898,550	
エムスリー	51,100	2,291.00	117,070,100	
サントリー食品インターナショナル	54,400	4,707.00	256,060,800	
サンエー	15,400	4,535.00	69,839,000	
アスクル	33,900	2,266.00	76,817,400	
日清紡ホールディングス	88,700	1,113.00	98,723,100	
セブン&アイ・ホールディングス	49,300	5,490.00	270,657,000	
帝人	119,600	1,306.00	156,197,600	
東レ	375,300	737.60	276,821,280	
三菱ケミカルグループ	272,000	938.50	255,272,000	
KHネオケム	103,300	2,257.00	233,148,100	
積水化学工業	120,000	2,024.50	242,940,000	
花王	71,300	5,852.00	417,247,600	
武田薬品工業	51,200	3,996.00	204,595,200	
日本新薬	51,700	4,951.00	255,966,700	
参天製薬	179,300	1,380.00	247,434,000	
H・U・グループホールディングス	82,200	2,622.00	215,528,400	
栄研化学	37,000	1,713.00	63,381,000	
エン・ジャパン	57,300	2,588.00	148,292,400	
富士フイルムホールディングス	29,700	8,705.00	258,538,500	
TOYO TIRE	15,200	2,383.50	36,229,200	
太平洋セメント	104,600	2,699.00	282,315,400	
丸一鋼管	37,500	3,709.00	139,087,500	
UACJ	38,100	3,780.00	144,018,000	
リンナイ	49,100	3,194.00	156,825,400	
ユニプレス	153,700	947.00	145,553,900	
日立製作所	42,000	9,933.00	417,186,000	
三菱電機	197,000	2,036.50	401,190,500	
マキタ	65,400	3,939.00	257,610,600	
マブチモーター	76,500	4,689.00	358,708,500	
ニデック	58,100	5,627.00	326,928,700	
エレコム	90,700	1,735.00	157,364,500	
パナソニックホールディングス	184,200	1,390.50	256,130,100	
ソニーグループ	48,900	13,155.00	643,279,500	
デンソー	123,500	2,136.00	263,796,000	
京セラ	41,100	8,196.00	336,855,600	
IHI	98,900	2,617.00	258,821,300	
全国保証	40,900	5,212.00	213,170,800	
トヨタ自動車	267,000	2,644.00	705,948,000	
日野自動車	427,500	455.30	194,640,750	
スズキ	46,300	5,773.00	267,289,900	
SUBARU	41,700	2,655.00	110,713,500	

良品計画	58,000	2,341.00	135,778,000	
シークス	89,000	1,430.00	127,270,000	
トプコン	134,200	1,500.00	201,300,000	
朝日インテック	80,000	2,850.00	228,000,000	
三菱商事	53,900	6,713.00	361,830,700	
丸井グループ	111,100	2,373.00	263,640,300	
PALTAC	30,000	4,485.00	134,550,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	412,500	1,187.50	489,843,750	代用有価証券 200,000株
三井住友フィナンシャルグループ	57,800	6,703.00	387,433,400	
千葉銀行	169,200	1,006.00	170,215,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	17,200	3,209.00	55,194,800	
野村ホールディングス	185,000	645.40	119,399,000	
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	23,000	5,440.00	125,120,000	
T&Dホールディングス	65,700	2,180.00	143,226,000	
リログループ	112,400	1,571.50	176,636,600	
西日本旅客鉄道	44,400	5,746.00	255,122,400	
名古屋鉄道	158,500	2,194.50	347,828,250	
山九	28,500	5,061.00	144,238,500	
福山通運	20,500	3,870.00	79,335,000	
日本航空	120,200	2,765.00	332,353,000	
日本電信電話	3,275,700	169.30	554,576,010	
KDDI	28,700	4,434.00	127,255,800	
大阪瓦斯	67,200	2,921.00	196,291,200	
エイチ・アイ・エス	171,100	1,896.00	324,405,600	
東京都競馬	68,900	4,435.00	305,571,500	
スクウェア・エニックス・ホールディ ングス	36,400	4,760.00	173,264,000	
ミスミグループ本社	136,500	2,164.00	295,386,000	
ソフトバンクグループ	33,900	6,073.00	205,874,700	
合計	10,348,600		16,934,468,090	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## ニッセイ国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2023年12月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	36,818,499
コール・ローン	1,580,482,284
国債証券	18,703,977,422
未収入金	180,940,738
未収利息	13,064,859
前払費用	4,789,475
流動資産合計	20,520,073,277
資産合計	20,520,073,277
負債の部	
流動負債	
未払金	181,317,565
未払解約金	23,596,429
その他未払費用	1,061
流動負債合計	204,915,055
負債合計	204,915,055
純資産の部	
元本等	
元本	14,425,821,259
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,889,336,963
元本等合計	20,315,158,222
純資産合計	20,315,158,222
負債純資産合計	20,520,073,277

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
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、原則として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>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2023年12月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	13,532,003,859円
同期中追加設定元本額	3,107,602,101円
同期中一部解約元本額	2,213,784,701円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(債券重視型)	450,212,604円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(標準型)	339,528,067円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(株式重視型)	59,365,641円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン(標準型)VA(適格機関投資家専用)	32,076,348円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	1,130,407,003円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	2,011,747,891円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)SA(適格機関投資家限定)	369,186,689円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(債券重視型)	2,552,474,576円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)	4,854,246,773円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(株式重視型)	1,450,839,579円
DCニッセイ国内債券アクティブ	921,567,730円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	61,172,191円
DCニッセイバランスアクティブ	192,996,167円
計	14,425,821,259円
2. 受益権の総数	14,425,821,259口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）は短時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）

## 売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		82,552,637
合計		82,552,637

## （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。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	2023年12月20日現在
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	1,4082円 ( 14,082円 )

附属明細表

第 1 有価証券明細表

( 1 ) 株式

該当事項はありません。

( 2 ) 株式以外の有価証券

2023年12月20日現在

種類	銘柄	券面総額 ( 円 )	評価額 ( 円 )	備考
国債証券	第 4 3 3 回 利付国債 ( 2 年 )	165,000,000	165,013,708	
	第 4 3 7 回 利付国債 ( 2 年 )	61,000,000	61,038,536	
	第 4 3 8 回 利付国債 ( 2 年 )	297,100,000	297,312,304	
	第 4 3 9 回 利付国債 ( 2 年 )	51,400,000	51,431,660	
	第 4 4 0 回 利付国債 ( 2 年 )	175,100,000	175,209,199	
	第 4 4 3 回 利付国債 ( 2 年 )	3,200,000	3,201,953	
	第 4 4 7 回 利付国債 ( 2 年 )	488,300,000	488,485,554	
	第 4 5 0 回 利付国債 ( 2 年 )	241,000,000	241,036,150	
	第 4 5 1 回 利付国債 ( 2 年 )	23,400,000	23,405,616	
	第 4 5 2 回 利付国債 ( 2 年 )	481,700,000	481,700,000	
	第 4 5 3 回 利付国債 ( 2 年 )	28,500,000	28,492,305	
	第 4 5 4 回 利付国債 ( 2 年 )	59,100,000	59,204,016	
	第 1 4 3 回 利付国債 ( 5 年 )	8,000,000	8,012,880	
	第 1 4 6 回 利付国債 ( 5 年 )	1,030,700,000	1,032,441,883	
	第 1 5 1 回 利付国債 ( 5 年 )	394,400,000	393,567,816	
	第 1 5 6 回 利付国債 ( 5 年 )	298,500,000	299,389,530	
	第 1 回 利付国債 ( 4 0 年 )	7,900,000	9,475,655	
	第 7 回 利付国債 ( 4 0 年 )	2,100,000	2,189,649	
	第 8 回 利付国債 ( 4 0 年 )	3,400,000	3,292,628	
	第 1 2 回 利付国債 ( 4 0 年 )	23,900,000	17,126,023	
	第 1 3 回 利付国債 ( 4 0 年 )	10,600,000	7,519,640	
	第 1 4 回 利付国債 ( 4 0 年 )	34,300,000	25,945,206	
	第 1 5 回 利付国債 ( 4 0 年 )	9,200,000	7,654,216	
	第 1 6 回 利付国債 ( 4 0 年 )	252,200,000	229,262,410	
	第 3 3 7 回 利付国債 ( 1 0 年 )	800,000	802,800	
	第 3 3 9 回 利付国債 ( 1 0 年 )	45,700,000	45,976,485	
	第 3 4 6 回 利付国債 ( 1 0 年 )	1,000,000,000	1,000,970,000	
	第 3 4 8 回 利付国債 ( 1 0 年 )	600,000	599,886	
	第 3 5 1 回 利付国債 ( 1 0 年 )	506,900,000	505,541,508	

第352回 利付国債(10年)	800,000	796,424	
第353回 利付国債(10年)	110,200,000	109,626,960	
第356回 利付国債(10年)	772,000,000	766,086,480	
第358回 利付国債(10年)	66,900,000	66,221,634	
第359回 利付国債(10年)	52,700,000	52,078,140	
第360回 利付国債(10年)	340,700,000	336,080,108	
第361回 利付国債(10年)	936,400,000	921,979,440	
第362回 利付国債(10年)	62,200,000	61,079,778	
第363回 利付国債(10年)	847,500,000	830,202,525	
第364回 利付国債(10年)	141,700,000	138,452,236	
第365回 利付国債(10年)	137,100,000	133,601,208	
第370回 利付国債(10年)	126,500,000	126,220,435	
第371回 利付国債(10年)	62,500,000	61,681,250	
第372回 利付国債(10年)	469,900,000	480,543,235	
第29回 利付国債(30年)	103,600,000	124,155,276	
第30回 利付国債(30年)	9,600,000	11,363,520	
第34回 利付国債(30年)	158,100,000	183,973,065	
第37回 利付国債(30年)	94,200,000	104,934,090	
第38回 利付国債(30年)	38,800,000	42,472,420	
第40回 利付国債(30年)	77,100,000	84,149,253	
第42回 利付国債(30年)	92,700,000	99,358,641	
第43回 利付国債(30年)	159,800,000	171,113,840	
第44回 利付国債(30年)	168,500,000	180,397,785	
第46回 利付国債(30年)	111,700,000	115,226,369	
第49回 利付国債(30年)	48,900,000	49,314,672	
第50回 利付国債(30年)	42,300,000	37,738,791	
第54回 利付国債(30年)	800,000	705,912	
第55回 利付国債(30年)	21,700,000	19,094,047	
第56回 利付国債(30年)	157,600,000	138,281,392	
第57回 利付国債(30年)	13,600,000	11,899,048	
第58回 利付国債(30年)	66,700,000	58,191,748	
第63回 利付国債(30年)	150,000,000	116,142,000	
第64回 利付国債(30年)	77,100,000	59,468,772	
第66回 利付国債(30年)	128,700,000	98,515,989	
第67回 利付国債(30年)	221,100,000	178,463,076	
第69回 利付国債(30年)	16,900,000	13,940,303	
第70回 利付国債(30年)	272,000,000	223,853,280	

第73回 利付国債(30年)	23,100,000	18,861,150	
第74回 利付国債(30年)	8,600,000	7,603,604	
第75回 利付国債(30年)	86,600,000	82,483,036	
第76回 利付国債(30年)	166,700,000	162,534,167	
第77回 利付国債(30年)	5,000,000	5,106,150	
第78回 利付国債(30年)	334,200,000	325,420,566	
第79回 利付国債(30年)	114,100,000	105,588,140	
第80回 利付国債(30年)	335,800,000	358,362,402	
第92回 利付国債(20年)	17,300,000	18,358,587	
第99回 利付国債(20年)	28,600,000	30,852,536	
第102回 利付国債(20年)	49,600,000	54,571,408	
第107回 利付国債(20年)	15,300,000	16,742,331	
第109回 利付国債(20年)	70,900,000	77,114,385	
第110回 利付国債(20年)	79,400,000	87,182,788	
第112回 利付国債(20年)	37,800,000	41,669,964	
第113回 利付国債(20年)	24,200,000	26,774,638	
第114回 利付国債(20年)	6,500,000	7,214,740	
第117回 利付国債(20年)	1,500,000	1,670,595	
第118回 利付国債(20年)	200,000,000	222,088,000	
第123回 利付国債(20年)	40,300,000	45,255,691	
第134回 利付国債(20年)	19,200,000	21,302,592	
第140回 利付国債(20年)	22,600,000	24,946,106	
第141回 利付国債(20年)	32,900,000	36,361,738	
第142回 利付国債(20年)	121,900,000	135,777,096	
第144回 利付国債(20年)	37,500,000	40,795,125	
第146回 利付国債(20年)	51,900,000	57,501,567	
第147回 利付国債(20年)	409,100,000	449,588,627	
第148回 利付国債(20年)	151,800,000	165,383,064	
第149回 利付国債(20年)	127,100,000	138,462,740	
第150回 利付国債(20年)	148,300,000	159,954,897	

第151回 利付国債(20年)	174,100,000	184,021,959	
第152回 利付国債(20年)	89,600,000	94,614,016	
第153回 利付国債(20年)	3,600,000	3,837,960	
第154回 利付国債(20年)	41,200,000	43,412,440	
第155回 利付国債(20年)	370,900,000	381,733,989	
第157回 利付国債(20年)	132,900,000	123,630,225	
第158回 利付国債(20年)	117,300,000	112,966,938	
第159回 利付国債(20年)	139,500,000	135,655,380	
第160回 利付国債(20年)	5,500,000	5,401,770	
第161回 利付国債(20年)	700,000	676,760	
第162回 利付国債(20年)	200,000,000	192,776,000	
第163回 利付国債(20年)	18,900,000	18,161,199	
第164回 利付国債(20年)	155,900,000	147,189,867	
第165回 利付国債(20年)	70,700,000	66,518,802	
第166回 利付国債(20年)	77,600,000	74,896,416	
第167回 利付国債(20年)	19,800,000	18,484,686	
第168回 利付国債(20年)	48,900,000	44,781,642	
第169回 利付国債(20年)	110,500,000	99,190,325	
第170回 利付国債(20年)	167,100,000	149,255,391	
第171回 利付国債(20年)	57,700,000	51,280,875	
第172回 利付国債(20年)	186,700,000	167,878,773	
第173回 利付国債(20年)	130,900,000	117,124,084	
第174回 利付国債(20年)	700,000	623,210	
第175回 利付国債(20年)	67,100,000	60,511,451	
第176回 利付国債(20年)	256,200,000	230,246,940	

第177回 利付国債(20年)	1,900,000	1,670,537	
第181回 利付国債(20年)	34,800,000	33,019,632	
第184回 利付国債(20年)	82,900,000	80,844,909	
第185回 利付国債(20年)	212,500,000	206,530,875	
第186回 利付国債(20年)	460,000,000	477,834,200	
第24回 物価連動国債(10年)	516,000,000	580,975,383	
国債証券 合計	18,782,500,000	18,703,977,422	
合計		18,703,977,422	

## 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。

ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年12月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,242,989,433
金銭信託	10,663,630
コール・ローン	457,750,277
株式	52,361,262,064
投資証券	1,344,703,688
派生商品評価勘定	267,892,248
未収配当金	32,831,215
流動資産合計	55,718,092,555
資産合計	55,718,092,555
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	150,997,043
未払解約金	75,046,437
その他未払費用	409
流動負債合計	226,043,889
負債合計	226,043,889
純資産の部	
元本等	
元本	12,849,609,784
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	42,642,438,882
元本等合計	55,492,048,666
純資産合計	55,492,048,666
負債純資産合計	55,718,092,555

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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	2023年12月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	13,159,901,705円
同期中追加設定元本額	2,409,518,426円
同期中一部解約元本額	2,719,810,347円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	26,584,061円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	62,393,099円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	38,718,047円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	5,904,398円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	66,757,100円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	370,023,629円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	240,782,087円
DCニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式	9,939,193,086円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	150,722,568円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	892,994,757円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	946,237,169円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	27,926,967円
ニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式SA（適格機関投資家限定）	348,198円
DCニッセイバランスアクティブ	81,024,618円
計	12,849,609,784円
2. 受益権の総数	12,849,609,784口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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)」にて記載しております。 (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）

## 売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式		10,148,083,749
投資証券		62,693,280
合計		10,210,777,029

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2023年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	6,608,355,118	-	6,349,054,643	259,300,475
アメリカ・ドル	5,326,701,027	-	5,108,290,118	218,410,909
カナダ・ドル	350,724,429	-	344,130,194	6,594,235
デンマーク・クローネ	655,516,238	-	636,475,340	19,040,898
香港・ドル	275,413,424	-	260,158,991	15,254,433
買建	6,608,355,118	-	6,465,949,848	142,405,270
アメリカ・ドル	1,281,654,091	-	1,228,698,359	52,955,732
イギリス・ポンド	966,806,066	-	934,380,727	32,425,339
イスラエル・シェケル	95,309,480	-	95,276,100	33,380
オーストラリア・ドル	1,151,082,360	-	1,159,451,574	8,369,214
カナダ・ドル	475,924,029	-	466,626,141	9,297,888
シンガポール・ドル	189,101,276	-	183,091,492	6,009,784
スイス・フラン	1,404,288,145	-	1,370,109,589	34,178,556
スウェーデン・クローナ	471,468,593	-	465,106,799	6,361,794
ノルウェー・クローネ	79,263,029	-	79,485,588	222,559
ユーロ	493,458,049	-	483,723,479	9,734,570
合計	13,216,710,236	-	12,815,004,491	116,895,205

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## （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。

(1口当たり情報に関する注記)

		2023年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		4.3186円 (43,186円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年12月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	ADOBE INC	15,200	604.640	9,190,528.00	
	AMAZON.COM INC	85,000	153.790	13,072,150.00	
	APPLE INC	85,600	196.940	16,858,064.00	
	APPLIED MATERIALS INC	37,500	162.330	6,087,375.00	
	ASML HOLDING NV	8,100	744.720	6,032,232.00	
	ASSURED GUARANTY LTD	45,908	72.960	3,349,447.68	
	BALL CORP	84,900	57.390	4,872,411.00	
	BANK OF AMERICA CORP	196,000	33.510	6,567,960.00	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	166,500	55.820	9,294,030.00	
	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	16,300	274.330	4,471,579.00	
	CASELLA WASTE SYSTEMS INC-A	58,800	86.730	5,099,724.00	
	CHARLES SCHWAB CORP	53,500	69.740	3,731,090.00	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,000	2,327.030	4,654,060.00	
	CITIGROUP INC	133,300	50.930	6,788,969.00	
	CONSTELLATION ENERGY	71,400	120.810	8,625,834.00	
	DANAHER CORP	17,500	229.140	4,009,950.00	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	40,000	88.820	3,552,800.00	
	ELI LILLY & CO	14,500	579.810	8,407,245.00	
	FORTIVE CORP	72,900	72.790	5,306,391.00	
	GENERAL MOTORS CO	148,800	35.870	5,337,456.00	
	GINKGO BIOWORKS HOLDINGS INC	285,700	1.790	511,403.00	
	HOME DEPOT INC	15,600	352.070	5,492,292.00	
	INGERSOLL-RAND INC	135,000	76.330	10,304,550.00	
	JPMORGAN CHASE & CO	33,300	168.450	5,609,385.00	
	KKR & CO INC -A	50,400	84.690	4,268,376.00	
	KROGER CO	105,400	45.070	4,750,378.00	
	LEVI STRAUSS & CO- CLASS A	198,000	15.650	3,098,700.00	
	LINDE PLC	17,700	412.090	7,293,993.00	
	MERCK & CO INC	53,000	106.490	5,643,970.00	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,700	1,201.770	3,244,779.00	
MICROSOFT CORP	45,600	373.260	17,020,656.00		
MSCI INC	6,900	542.530	3,743,457.00		
NRG ENERGY INC	80,931	50.040	4,049,787.24		

	NVIDIA CORP	26,000	496.040	12,897,040.00	
	ON HOLDING AG-CLASS A	42,100	31.350	1,319,835.00	
	OTIS WORLDWIDE CORP	84,000	89.820	7,544,880.00	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	6,855	848.390	5,815,713.45	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	10,100	541.560	5,469,756.00	
	SALESFORCE INC	28,700	264.340	7,586,558.00	
	SYNOPSYS INC	4,900	558.650	2,737,385.00	
	T-MOBILE US INC	24,800	155.870	3,865,576.00	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,800	528.140	5,703,912.00	
	TPG INC	109,600	42.310	4,637,176.00	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	16,000	524.040	8,384,640.00	
	VISA INC-CLASS A SHARES	38,900	259.990	10,113,611.00	
	WALMART INC	64,400	155.530	10,016,132.00	
	WALT DISNEY CO	49,100	93.930	4,611,963.00	
アメリカ・ドル	小計	2,900,194		301,045,199.37 (43,359,540,064)	
イギリス・ポンド	ASHTED GROUP PLC	68,471	54.280	3,716,605.88	
	UNILEVER PLC	98,625	37.625	3,710,765.62	
イギリス・ポンド	小計	167,096		7,427,371.50 (1,361,288,649)	
カナダ・ドル	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	55,200	103.660	5,722,032.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,500	3,153.390	11,036,865.00	
カナダ・ドル	小計	58,700		16,758,897.00 (1,808,955,342)	
デンマーク・クローネ	NOVO-NORDISK A/S	53,972	682.300	36,825,095.60	
	NOVOZYMES A/S	61,452	363.000	22,307,076.00	
デンマーク・クローネ	小計	115,424		59,132,171.60 (1,253,602,038)	
ユーロ	AIXTRON AG	54,986	38.280	2,104,864.08	
	AXA SA	180,263	29.330	5,287,113.79	
	KERRY GROUP PLC-A	61,772	74.780	4,619,310.16	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6,236	745.500	4,648,938.00	
	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	8,742	379.800	3,320,211.60	
	SANOFI	57,959	88.930	5,154,293.87	
ユーロ	小計	369,958		25,134,731.50 (3,973,047,008)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	492,800	66.450	32,746,560.00	
香港・ドル	小計	492,800		32,746,560.00 (604,828,963)	
合計		4,104,172		52,361,262,064 (52,361,262,064)	

## (2) 株式以外の有価証券

2023年12月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN TOWER REIT INC	23,900.00	5,042,900.00	
		PROLOGIS INC	32,100.00	4,293,375.00	
	アメリカ・ドル	小計	56,000.00	9,336,275.00 (1,344,703,688)	
投資証券	合計		56,000	1,344,703,688 (1,344,703,688)	
合計				1,344,703,688 (1,344,703,688)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

- 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。
- 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 47銘柄	78.14	-	83.24
	投資証券 2銘柄	-	2.42	
イギリス・ポンド	株式 2銘柄	2.45	-	2.53
カナダ・ドル	株式 2銘柄	3.26	-	3.37
デンマーク・クローネ	株式 2銘柄	2.26	-	2.33
ユーロ	株式 6銘柄	7.16	-	7.40
香港・ドル	株式 1銘柄	1.09	-	1.13

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2023年12月20日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	751,252,131
金銭信託	2,163,573
コール・ローン	92,874,207
国債証券	7,834,012,687
地方債証券	174,649,985
特殊債券	966,370,178
社債券	496,800,763
派生商品評価勘定	65,262,138
未収入金	552,373,240
未収利息	67,910,203
前払費用	593,357
流動資産合計	11,004,262,462
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	51,807,708
未払金	777,407,551
未払解約金	6,593,167
その他未払費用	74
流動負債合計	835,808,500
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	2,989,635,476
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	7,178,818,486
元本等合計	10,168,453,962
純資産合計	10,168,453,962
負債純資産合計	11,004,262,462

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、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、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、原則として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礎となる事項	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	2023年12月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,073,604,702円
同期中追加設定元本額	375,164,358円
同期中一部解約元本額	459,133,584円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	33,557,197円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	39,377,486円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	16,289,872円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	3,726,614円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	84,267,505円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	233,535,351円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	101,305,349円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	190,253,324円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	563,593,161円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	398,118,677円
DCニッセイ/パトナム・グローバル債券	1,125,223,016円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	12,589,149円
ニッセイ/パトナム・グローバル債券SA（適格機関投資家限定）	150,641,117円
DCニッセイバランスアクティブ	37,157,658円
計	2,989,635,476円
2. 受益権の総数	2,989,635,476口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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)」にて記載しております。 (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）

## 売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		29,213,886
地方債証券		2,001,218
特殊債券		12,656,123
社債券		15,495,200
合計		24,373,591

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2023年12月20日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	1,774,979,506	-	1,715,597,777	59,381,729
イギリス・ポンド	1,132,353,196	-	1,082,561,826	49,791,370
オーストラリア・ドル	105,215,460	-	101,707,696	3,507,764
カナダ・ドル	45,828,834	-	45,922,615	93,781
シンガポール・ドル	60,743,914	-	59,270,151	1,473,763
スイス・フラン	5,824,368	-	5,679,590	144,778
スウェーデン・クローナ	10,857,288	-	11,042,152	184,864
デンマーク・クローネ	2,016,319	-	2,003,700	12,619
ニュージーランド・ドル	12,796,878	-	12,425,164	371,714
ノルウェー・クローネ	7,432,956	-	7,438,271	5,315
ポーランド・ズロチ	2,445,450	-	2,469,012	23,562
メキシコ・ペソ	13,779,214	-	13,376,971	402,243
ユーロ	16,499,712	-	16,023,696	476,016
買建	359,185,917	-	355,676,933	3,508,984
アメリカ・ドル	1,774,979,506	-	1,729,052,207	45,927,299
イギリス・ポンド	642,626,310	-	626,040,338	16,585,972
イスラエル・シケル	19,931,767	-	19,788,544	143,223
オーストラリア・ドル	32,366,960	-	32,355,624	11,336
オフショア・人民元	18,541,431	-	18,731,465	190,034
カナダ・ドル	776,047,215	-	749,536,821	26,510,394
シンガポール・ドル	31,798,162	-	32,085,854	287,692
スイス・フラン	47,916,914	-	46,394,078	1,522,836
ユーロ	25,383,533	-	24,765,732	617,801
ユーロ	180,367,214	-	179,353,751	1,013,463
合計	3,549,959,012	-	3,444,649,984	13,454,430

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2023年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4012円 (34,012円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

該当事項はありません。

## （2）株式以外の有価証券

2023年12月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,841,000.00	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,443,390.00	
		US TREASURY N/B	2,650,000.00	1,901,772.50	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,667,874.00	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	1,993,584.00	
		US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,157,478.00	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,431,088.00	
		US TREASURY N/B	5,600,000.00	4,527,656.00	
	アメリカ・ドル	小計	27,950,000.00 (4,025,638,500)	24,963,842.50 (3,595,542,235)	
	イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	1,410,000.00	1,239,897.60	
		UNITED KINGDOM GILT	70,000.00	63,128.10	
		UNITED KINGDOM GILT	1,370,000.00	1,320,885.50	
		UNITED KINGDOM GILT	10,000.00	7,017.40	
		UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	394,756.70	
UNITED KINGDOM GILT		170,000.00	168,641.70		
イギリス・ポンド	小計	3,400,000.00 (623,152,000)	3,194,327.00 (585,456,253)		
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	190,000.00	188,177.90		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	430,000.00	409,149.30		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	860,000.00	807,127.20		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	90,000.00	71,093.70		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	95,612.40		

オーストラリア・ドル 小計		1,690,000.00 (164,369,400)	1,571,160.50 (152,811,070)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	226,428.30	
カナダ・ドル 小計		210,000.00 (22,667,400)	226,428.30 (24,440,671)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,290,000.00	1,243,160.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	320,000.00	375,491.20	
スウェーデン・クローナ 小計		1,610,000.00 (22,813,700)	1,618,651.30 (22,936,289)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,190,000.00	1,172,352.30	
	KINGDOM OF DENMARK	800,000.00	1,026,040.00	
デンマーク・クローネ 小計		1,990,000.00 (42,188,000)	2,198,392.30 (46,605,917)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	330,000.00	308,269.50	
ニュージーランド・ドル 小計		330,000.00 (29,782,500)	308,269.50 (27,821,322)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,660,000.00	1,580,784.80	
ノルウェー・クローネ 小計		1,660,000.00 (23,256,600)	1,580,784.80 (22,146,795)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,870,000.00	1,768,122.40	
ポーランド・ズロチ 小計		1,870,000.00 (68,318,767)	1,768,122.40 (64,596,761)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA GOVERNMENT	1,750,000.00	1,718,535.00	
マレーシア・リングギット 小計		1,750,000.00 (54,079,375)	1,718,535.00 (53,107,028)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,280,000.00	12,510,955.20	
メキシコ・ペソ 小計		13,280,000.00 (112,063,280)	12,510,955.20 (105,573,695)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	630,000.00	608,227.20	
	BELGIUM KINGDOM	20,000.00	18,578.80	
	BELGIUM KINGDOM	590,000.00	694,978.70	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	178,415.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	451,137.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	110,000.00	122,059.30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	1,060,561.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	240,000.00	235,432.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	227,870.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	318,423.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,000.00	17,158.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	482,077.40	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	188,857.60	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,780,000.00	1,538,204.80	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	790,795.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	710,000.00	776,250.10		

		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	204,132.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	870,000.00	863,205.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,360,000.00	1,193,699.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	140,000.00	88,256.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,640,000.00	1,855,151.60	
		FINNISH GOVERNMENT	270,000.00	234,338.40	
		FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	985,287.20	
		FRANCE (GOVT OF)	110,000.00	115,867.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,040,000.00	1,006,397.60	
		FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	908,165.00	
		FRANCE (GOVT OF)	610,000.00	555,185.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,540,000.00	1,313,404.40	
		FRANCE (GOVT OF)	460,000.00	551,172.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	87,322.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	320,000.00	301,910.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	420,000.00	400,759.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	179,934.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	380,000.00	449,619.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	224,828.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	630,000.00	592,508.70	
		ユーロ 小計	19,980,000.00 (3,158,238,600)	19,820,172.40 (3,132,974,651)	
国債証券 合計			8,346,568,122 (8,346,568,122)	7,834,012,687 (7,834,012,687)	
地方債証券	カナダ・ドル	ONTARIO (PROVINCE OF)	460,000.00	448,720.80	
		ONTARIO (PROVINCE OF)	310,000.00	261,131.60	
		ONTARIO (PROVINCE OF)	800,000.00	908,176.00	
		カナダ・ドル 小計	1,570,000.00 (169,465,800)	1,618,028.40 (174,649,985)	
地方債証券 合計			169,465,800 (169,465,800)	174,649,985 (174,649,985)	
特殊債券	アメリカ・ドル	FNMA 545477	2,531.55	2,612.38	
		FNMA 555571	1,325.38	1,378.10	
		FNMA 602285	1,109.73	1,151.45	
		FNMA 609480	326.35	336.67	
		FNMA FM9958	996,023.83	907,138.66	
		FNW 2003-W1 2A	134,190.79	128,682.25	
		FNW 2003-W3 1A1	1,902.58	1,947.88	
		FR ZI1716	11,700.23	12,214.33	
		FR ZS4136	2,773.89	2,896.77	
		GNMA 781542	2,519.39	2,522.46	
		GNMA 786812	496,512.51	504,635.45	
		GNMA BX9597	818,460.16	683,340.57	
		GNMA CT0366	26,871.28	27,099.14	
		GNMA CU6592	36,817.74	37,135.84	
		GNMA CU6639	110,195.77	110,840.41	
		GNMA CU9006	32,835.90	33,287.06	
		GNMA CU9007	85,502.02	86,419.45	
		GNMA CX6938	59,000.00	60,567.04	

		GNMA TBA	2,000,000.00	1,899,660.00	
		GNMA TBA	1,000,000.00	896,460.00	
	アメリカ・ドル	小計	5,820,599.10 (838,340,888)	5,400,325.91 (777,808,941)	
	ユーロ	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	530,000.00	521,530.60	
		EFSF	440,000.00	446,085.20	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	225,000.00	225,281.25	
	ユーロ	小計	1,195,000.00 (188,893,650)	1,192,897.05 (188,561,237)	
特殊債券 合計			1,027,234,538.37 (1,027,234,538)	966,370,178 (966,370,178)	
社債券	アメリカ・ドル	APPLE INC	345,000.00	290,234.70	
		BACM 2015-UBS7 AS	144,000.00	135,753.12	
		BANK 2019-BN20 XA	1,365,693.10	49,875.11	
		BBCMS 2021-C9 XA	1,414,324.22	115,564.43	
		BERKSHIRE HATHAWAY FIN	95,000.00	89,555.55	
		BMARK 2019-B12 A5	28,000.00	24,908.52	
		CGCMT 2014-GC19 XA	522,492.25	167.19	
		CGCMT 2014-GC21 B	114,000.00	105,502.44	
		CGCMT 2018-C6 XA	2,506,644.85	75,575.34	
		COMM 2015-LC21 XA	2,841,053.47	19,745.29	
		COMMONWEALTH BANK AUST	500,000.00	474,010.00	
		CSAIL 2015-C1 AS	105,000.00	99,240.75	
		CSAIL 2018-CX12 XA	4,891,345.81	104,723.71	
		JPMBB 2013-C17 XA	91,526.52	11.89	
		JPMBB 2014-C19 C	84,000.00	78,843.24	
		JPMBB 2014-C23 B	102,000.00	98,087.28	
		JPMBB 2015-C33 XA	1,478,515.50	19,723.39	
		JPMCC 2013-C16 XA	342,095.43	3.40	
		JPMCC 2019-COR5 XA	3,074,744.97	165,206.04	
		MET LIFE GLOB FUNDING I	510,000.00	476,115.60	
		MSBAM 2013-C10 AS	9,457.58	9,027.26	
		MSBAM 2014-C14 B	82,000.00	81,230.84	
		MSBAM 2014-C14 C	280,000.00	273,000.00	
		MSBAM 2014-C16 B	102,000.00	95,693.34	
		MSBAM 2014-C17 XA	644,000.63	824.31	
		ROCHE HOLDINGS INC	250,000.00	224,692.50	
		UBSCM 2017-C1 A4	73,000.00	68,182.00	
		UBSCM 2017-C7 XA	1,031,640.94	32,527.63	
		UBSCM 2018-C13 AS	84,000.00	76,579.44	
		WFCM 2016-LC25 XA	1,205,852.96	23,502.07	
WFCM 2020-C56 XA	1,536,883.97	88,386.19			
WFRBS 2013-C11 B	59,783.41	52,794.13			
	アメリカ・ドル	小計	25,914,055.61 (3,732,401,430)	3,449,286.70 (496,800,763)	
社債券 合計			3,732,401,429.50 (3,732,401,430)	496,800,763 (496,800,763)	
合計				9,471,833,613 (9,471,833,613)	



（注）

- 1．各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
- 2．合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
- 3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 8銘柄	35.36	51.42
	特殊債券 20銘柄	7.65	
	社債券 32銘柄	4.89	
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	5.76	6.18
オーストラリア・ドル	国債証券 5銘柄	1.50	1.61
カナダ・ドル	国債証券 1銘柄	0.24	2.10
	地方債証券 3銘柄	1.72	
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.23	0.24
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	0.46	0.49
ニュージーランド・ドル	国債証券 1銘柄	0.27	0.29
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	0.22	0.23
ポーランド・ズロチ	国債証券 1銘柄	0.64	0.68
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	0.52	0.56
メキシコ・ペソ	国債証券 1銘柄	1.04	1.11
ユーロ	国債証券 36銘柄	30.81	35.07
	特殊債券 3銘柄	1.85	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## 中間財務諸表

## D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）

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、当中間計算期間（2023年12月21日から2024年6月20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。

## D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）

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、当中間計算期間（2023年12月21日から2024年6月20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。

## D Cニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）

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、当中間計算期間（2023年12月21日から2024年6月20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。



## 【DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	7,868,202	10,647,357
コール・ローン	337,752,862	357,349,270
親投資信託受益証券	6,152,156,774	6,259,190,314
未収入金	6,134,699	6,422,477
流動資産合計	6,503,912,537	6,633,609,418
資産合計	6,503,912,537	6,633,609,418
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,603,874	6,322,929
未払受託者報酬	3,523,464	3,612,011
未払委託者報酬	35,234,992	36,120,526
その他未払費用	248,078	252,011
流動負債合計	44,610,408	46,307,477
負債合計	44,610,408	46,307,477
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,002,827,964	3,939,462,552
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,456,474,165	2,647,839,389
（分配準備積立金）	1,032,524,295	961,359,889
元本等合計	6,459,302,129	6,587,301,941
純資産合計	6,459,302,129	6,587,301,941
負債純資産合計	6,503,912,537	6,633,609,418

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第23期中間計算期間 自 2022年12月21日 至 2023年6月20日	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	3,692	54,269
有価証券売買等損益	432,454,826	272,468,611
営業収益合計	432,458,518	272,522,880
<b>営業費用</b>		
支払利息	72,574	13,831
受託者報酬	3,382,414	3,612,011
委託者報酬	33,824,580	36,120,526
その他費用	243,349	253,744
営業費用合計	37,522,917	40,000,112
営業利益又は営業損失（ ）	394,935,601	232,522,768
経常利益又は経常損失（ ）	394,935,601	232,522,768
中間純利益又は中間純損失（ ）	394,935,601	232,522,768
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（ ）	6,786,806	10,871,884
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,033,741,195	2,456,474,165
剰余金増加額又は欠損金減少額	100,159,589	144,085,772
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	100,159,589	144,085,772
剰余金減少額又は欠損金増加額	103,228,522	174,371,432
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	103,228,522	174,371,432
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,418,821,057	2,647,839,389

## ( 3 ) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1. 期首元本額	4,029,226,857円	4,002,827,964円
期中追加設定元本額	396,230,578円	220,375,762円
期中一部解約元本額	422,629,471円	283,741,174円
2. 受益権の総数	4,002,827,964口	3,939,462,552口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第23期中間計算期間 自 2022年12月21日 至 2023年6月20日	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
1. 委託費用	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 2,764,707円	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 2,979,857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	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	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	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6137円 (16,137円)	1.6721円 (16,721円)

## 【DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス(標準型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	22,731,688	33,300,287
コール・ローン	975,787,456	1,117,632,602
親投資信託受益証券	18,207,105,047	19,481,304,459
未収入金	9,643,851	15,080,006
流動資産合計	19,215,268,042	20,647,317,354
資産合計	19,215,268,042	20,647,317,354
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,181,060	14,271,912
未払受託者報酬	10,378,451	10,987,700
未払委託者報酬	124,542,005	131,852,735
その他未払費用	542,751	565,916
流動負債合計	142,644,267	157,678,263
負債合計	142,644,267	157,678,263
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,853,637,005	9,771,065,980
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	9,218,986,770	10,718,573,111
(分配準備積立金)	5,291,482,500	5,027,396,101
元本等合計	19,072,623,775	20,489,639,091
純資産合計	19,072,623,775	20,489,639,091
負債純資産合計	19,215,268,042	20,647,317,354

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第23期中間計算期間 自 2022年12月21日 至 2023年6月20日	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	10,487	167,994
有価証券売買等損益	1,765,432,952	1,728,304,601
営業収益合計	1,765,443,439	1,728,472,595
<b>営業費用</b>		
支払利息	207,877	39,485
受託者報酬	9,676,162	10,987,700
委託者報酬	116,114,349	131,852,735
その他費用	521,739	570,901
営業費用合計	126,520,127	143,450,821
営業利益又は営業損失（ ）	1,638,923,312	1,585,021,774
経常利益又は経常損失（ ）	1,638,923,312	1,585,021,774
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,638,923,312	1,585,021,774
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（ ）	26,870,783	50,560,975
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,232,460,033	9,218,986,770
剰余金増加額又は欠損金減少額	321,375,540	435,968,922
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	321,375,540	435,968,922
剰余金減少額又は欠損金増加額	318,391,426	470,843,380
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	318,391,426	470,843,380
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,847,496,676	10,718,573,111

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
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。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1. 期首元本額	9,907,437,495円	9,853,637,005円
期中追加設定元本額	859,809,249円	419,839,417円
期中一部解約元本額	913,609,739円	502,410,442円
2. 受益権の総数	9,853,637,005口	9,771,065,980口

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第23期中間計算期間 自 2022年12月21日 至 2023年6月20日	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
1. 委託費用	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 12,296,762円	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 14,088,032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	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	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	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,9356円 (19,356円)	2,0970円 (20,970円)



## 【DCニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	15,688,638	24,838,815
コール・ローン	673,455,333	833,646,556
親投資信託受益証券	12,843,824,516	14,456,997,216
未収入金	5,012,444	16,724,539
流動資産合計	13,537,980,931	15,332,207,126
資産合計	13,537,980,931	15,332,207,126
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,865,345	16,236,518
未払受託者報酬	7,211,579	7,976,319
未払委託者報酬	100,962,962	111,668,911
その他未払費用	415,804	445,464
流動負債合計	111,455,690	136,327,212
負債合計	111,455,690	136,327,212
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,955,772,403	5,949,243,498
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,470,752,838	9,246,636,416
（分配準備積立金）	4,065,073,315	3,791,875,357
元本等合計	13,426,525,241	15,195,879,914
純資産合計	13,426,525,241	15,195,879,914
負債純資産合計	13,537,980,931	15,332,207,126

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第23期中間計算期間 自 2022年12月21日 至 2023年6月20日	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	7,008	124,223
有価証券売買等損益	1,542,536,781	1,904,456,642
営業収益合計	1,542,543,789	1,904,580,865
<b>営業費用</b>		
支払利息	139,781	26,871
受託者報酬	6,501,599	7,976,319
委託者報酬	91,023,054	111,668,911
その他費用	391,926	448,923
営業費用合計	98,056,360	120,121,024
営業利益又は営業損失（ ）	1,444,487,429	1,784,459,841
経常利益又は経常損失（ ）	1,444,487,429	1,784,459,841
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,444,487,429	1,784,459,841
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（ ）	31,593,792	72,719,521
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,470,709,423	7,470,752,838
剰余金増加額又は欠損金減少額	362,263,684	585,239,674
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	362,263,684	585,239,674
剰余金減少額又は欠損金増加額	314,575,169	521,096,416
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	314,575,169	521,096,416
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,931,291,575	9,246,636,416

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
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。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1. 期首元本額	5,870,352,095円	5,955,772,403円
期中追加設定元本額	780,917,555円	407,492,196円
期中一部解約元本額	695,497,247円	414,021,101円
2. 受益権の総数	5,955,772,403口	5,949,243,498口

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第23期中間計算期間 自 2022年12月21日 至 2023年6月20日	第24期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
1. 委託費用	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 11,207,349円	投資信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用 13,843,639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	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	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	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第23期 2023年12月20日現在	第24期中間計算期間 2024年6月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2544円 (22,544円)	2,5543円 (25,543円)

## （参考）

「DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）」、「DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）」、「DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）」は、「ニッセイ国内株式マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券マザーファンド」受益証券、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」受益証券を主要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。

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。）における同親投資信託の状況は以下の通りであります。それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年6月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	16,761,712
コール・ローン	562,560,794
株式	18,234,415,860
未収入金	14,803,661
未収配当金	133,961,454
前払金	7,155,000
差入委託証拠金	32,104,234
流動資産合計	19,001,762,715
資産合計	
19,001,762,715	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,043,750
未払金	15,896,545
未払解約金	15,370,409
流動負債合計	39,310,704
負債合計	
39,310,704	
純資産の部	
元本等	
元本	9,358,002,978
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,604,449,033
元本等合計	18,962,452,011
純資産合計	
18,962,452,011	
負債純資産合計	
19,001,762,715	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2024年6月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,860,487,938円
同期中追加設定元本額	678,548,002円
同期中一部解約元本額	1,181,032,962円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	109,122,789円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	193,352,980円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	108,685,844円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	16,787,238円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	275,152,437円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	1,189,862,646円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	726,376,692円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	628,330,647円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	2,929,985,696円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	2,902,707,308円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	72,240,882円
DCニッセイバランスアクティブ	205,397,819円
計	9,358,002,978円
2. 受益権の総数	9,358,002,978口
3. 差入代用有価証券	
株式	309,400,000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	2024年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）」にて記載しております。 (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。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2024年6月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	689,280,000	-	681,250,000	8,030,000
合計	689,280,000	-	681,250,000	8,030,000

## （注）株価指数先物取引

## 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

## （1口当たり情報に関する注記）

	2024年6月20日現在
1口当たり純資産額	2.0263円
（1万口当たり純資産額）	（20,263円）

## ニッセイ国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2024年6月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	60,566,681
コール・ローン	2,032,754,214
国債証券	18,906,035,855
未収入金	458,704,640
未収利息	16,283,731
前払費用	5,210,806
流動資産合計	21,479,555,927
資産合計	21,479,555,927
負債の部	
流動負債	
未払金	458,850,071
未払解約金	14,619,532
流動負債合計	473,469,603
負債合計	473,469,603
純資産の部	
元本等	
元本	15,402,865,640
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,603,220,684
元本等合計	21,006,086,324
純資産合計	21,006,086,324
負債純資産合計	21,479,555,927

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年12月21日
	至 2024年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。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。 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。



## （貸借対照表に関する注記）

項目	2024年6月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,425,821,259円
同期中追加設定元本額	2,044,413,389円
同期中一部解約元本額	1,067,369,008円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	462,255,078円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	347,930,527円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	62,628,616円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	30,208,296円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,165,601,556円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	2,141,077,540円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	418,620,660円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	2,661,674,725円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	5,272,455,747円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	1,672,702,268円
DCニッセイ国内債券アクティブ	874,967,119円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	60,014,677円
DCニッセイバランスアクティブ	232,728,831円
計	15,402,865,640円
2. 受益権の総数	15,402,865,640口

## （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	2024年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）は短時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。

## （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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年6月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3638円 (13,638円)

ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年6月20日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	2,451,693,539
金銭信託	19,844,230
コール・ローン	666,017,047
株式	67,382,567,629
投資証券	1,660,114,736
派生商品評価勘定	157,525,896
未収入金	106,494,627
未収配当金	42,449,501
流動資産合計	72,486,707,205
資産合計	72,486,707,205
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	119,717,711
未払解約金	92,941,500
流動負債合計	212,659,211
負債合計	212,659,211
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	12,698,846,388
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	59,575,201,606
元本等合計	72,274,047,994
純資産合計	72,274,047,994
負債純資産合計	72,486,707,205

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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	2024年6月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,849,609,784円
同期中追加設定元本額	1,437,484,232円
同期中一部解約元本額	1,588,247,628円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	20,997,173円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	49,596,661円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	31,284,781円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	4,305,789円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	52,943,819円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	305,213,876円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	209,114,410円
DCニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式	10,218,288,125円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	120,899,061円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	751,581,704円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	835,529,352円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	20,983,744円
ニッセイ/パトナム・グローバル・コア株式SA（適格機関投資家限定）	340,381円
DCニッセイバランスアクティブ	77,767,512円
計	12,698,846,388円
2. 受益権の総数	12,698,846,388口

## （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	2024年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）」にて記載しております。 (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。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2024年6月20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				
アメリカ・ドル	7,740,653,512	-	7,780,570,651	39,917,139
イギリス・ポンド	6,580,013,778	-	6,632,862,876	52,849,098
カナダ・ドル	30,676,992	-	30,493,916	183,076
デンマーク・クローネ	24,668,146	-	24,801,159	133,013
ユーロ	1,069,197,837	-	1,056,498,484	12,699,353
ユーロ	36,096,759	-	35,914,216	182,543
買建	7,740,653,512	-	7,818,378,836	77,725,324
アメリカ・ドル	1,160,639,734	-	1,157,969,185	2,670,549
イギリス・ポンド	122,662,641	-	121,638,166	1,024,475
イスラエル・シケル	100,835,571	-	102,876,101	2,040,530
オーストラリア・ドル	1,265,839,920	-	1,345,301,638	79,461,718
カナダ・ドル	655,117,905	-	672,320,609	17,202,704
シンガポール・ドル	197,842,284	-	197,984,357	142,073
スイス・フラン	1,473,319,785	-	1,488,033,216	14,713,431
スウェーデン・クローナ	586,606,707	-	584,550,383	2,056,324
ノルウェー・クローネ	86,300,387	-	85,013,146	1,287,241
ユーロ	1,765,919,728	-	1,736,241,075	29,678,653
香港・ドル	325,568,850	-	326,450,960	882,110
合計	15,481,307,024	-	15,598,949,487	37,808,185

## (注) 為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## (1口当たり情報に関する注記)

	2024年6月20日現在
1口当たり純資産額	5,6914円
(1万口当たり純資産額)	(56,914円)

## ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2024年6月20日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	406,270,362
金銭信託	2,146,665
コール・ローン	72,046,894
国債証券	8,461,470,717
地方債証券	168,309,965
特殊債券	921,171,919
社債券	818,395,248
派生商品評価勘定	7,607,700
未収入金	859,970,288
未収利息	75,287,010
前払費用	3,426,613
流動資産合計	11,796,103,381
資産合計	11,796,103,381
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,267,328
未払金	857,820,302
未払解約金	9,195,092
流動負債合計	889,282,722
負債合計	889,282,722
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	2,952,815,716
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	7,954,004,943
元本等合計	10,906,820,659
純資産合計	10,906,820,659
負債純資産合計	11,796,103,381

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年12月21日 至 2024年6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、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、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、原則として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礎となる事項	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	2024年6月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,989,635,476円
同期中追加設定元本額	212,318,832円
同期中一部解約元本額	249,138,592円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（債券重視型）	31,404,977円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）	37,091,178円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（株式重視型）	15,597,081円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランスオープン（標準型）VA（適格機関投資家専用）	3,220,241円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	79,188,634円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	228,255,682円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）SA（適格機関投資家限定）	104,252,084円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）	180,828,714円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）	562,077,913円
DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）	416,568,290円
DCニッセイ/パトナム・グローバル債券	1,104,014,356円
ニッセイ/パトナム・グローバルバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	11,209,414円
ニッセイ/パトナム・グローバル債券SA（適格機関投資家限定）	138,198,310円
DCニッセイバランスアクティブ	40,908,842円
計	2,952,815,716円
2. 受益権の総数	2,952,815,716口

## （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	2024年6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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）」にて記載しております。 (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。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2024年6月20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				
アメリカ・ドル	1,585,944,734	-	1,591,058,606	5,113,872
イギリス・ポンド	1,303,088,928	-	1,308,120,761	5,031,833
オーストラリア・ドル	151,272,068	-	149,829,157	1,442,911
オフショア・人民元	42,274,464	-	44,494,862	2,220,398
オフショア・人民元	15,269,325	-	15,451,293	181,968
カナダ・ドル	12,252,800	-	12,572,970	320,170
スウェーデン・クローナ	1,019,590	-	1,022,536	2,946
ニュージーランド・ドル	7,513,272	-	7,998,322	485,050
ノルウェー・クローネ	2,673,930	-	2,640,711	33,219
メキシコ・ペソ	17,513,283	-	16,297,075	1,216,208
ユーロ	33,067,074	-	32,630,919	436,155
買建	1,585,944,734	-	1,576,398,978	9,545,756
アメリカ・ドル	282,855,806	-	284,315,869	1,460,063
イスラエル・シェケル	34,243,612	-	34,936,573	692,961
オーストラリア・ドル	26,184,045	-	26,318,237	134,192
オフショア・人民元	1,084,583,224	-	1,075,124,737	9,458,487
シンガポール・ドル	43,994,655	-	44,026,249	31,594
スイス・フラン	14,545,204	-	14,690,461	145,257
デンマーク・クローネ	7,904,868	-	7,770,248	134,620
ポーランド・ズロチ	830,553	-	808,585	21,968
メキシコ・ペソ	26,189,265	-	24,880,434	1,308,831
ユーロ	64,613,502	-	63,527,585	1,085,917
合計	3,171,889,468	-	3,167,457,584	14,659,628



## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## （1口当たり情報に関する注記）

	2024年6月20日現在
1口当たり純資産額	3.6937円
（1万口当たり純資産額）	（36,937円）

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）

2024年6月28日現在

資産総額	6,627,759,418円
負債総額	19,546,698円
純資産総額（ - ）	6,608,212,720円
発行済数量	3,933,818,749口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6798円

## DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（標準型）

2024年6月28日現在

資産総額	20,690,063,358円
負債総額	19,952,142円
純資産総額（ - ）	20,670,111,216円
発行済数量	9,761,644,444口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1175円

## DCニッセイ/パトナム・グローバルバランス（株式重視型）

2024年6月28日現在

資産総額	15,452,634,161円
負債総額	22,085,756円
純資産総額（ - ）	15,430,548,405円
発行済数量	5,951,962,390口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5925円

（参考）

## ニッセイ国内株式マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	19,572,426,802円
負債総額	31,962,995円
純資産総額（ - ）	19,540,463,807円
発行済数量	9,345,236,847口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0910円

## ニッセイ国内債券マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	21,070,430,698円
負債総額	231,618,715円
純資産総額（ - ）	20,838,811,983円
発行済数量	15,377,490,995口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3552円

## ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	73,397,604,732円
負債総額	182,659,631円
純資産総額( - )	73,214,945,101円
発行済数量	12,756,930,060口
1口当たり純資産額( / )	5.7392円

## ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	11,140,535,289円
負債総額	108,081,814円
純資産総額( - )	11,032,453,475円
発行済数量	2,948,837,366口
1口当たり純資産額( / )	3.7413円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### (2) 受益者に対する特典

ありません。

### (3) 譲渡制限

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

### (4) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

前記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (5) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

### (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

## 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】

##### (1) 資本金の額

2024年6月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後1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、取締役のなか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】

「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。

2024年6月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	415	81,118
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	113	19,799
単位型公社債投資信託	0	0
合計	528	100,917

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】

#### 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。

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### 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29期事業年度（自2023年4月1日 至 2024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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金		31,522,565		23,594,998
有価証券		5,099,877		4,958,109
前払費用		595,955		645,436
未収委託者報酬		5,813,921		7,068,985
未収運用受託報酬		3,456,007		7,149,867
未収投資助言報酬		259,830		308,690
その他		18,700		58,384
流動資産合計		46,766,858		43,784,472
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物附属設備	1	150,182	1	143,306
車両	1	482	1	0
器具備品	1	92,889	1	67,645
有形固定資産合計		243,554		210,951
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		1,803,047		1,890,946
ソフトウェア仮勘定		1,198,151		1,968,913
その他		8,013		8,032
無形固定資産合計		3,009,212		3,867,892
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		37,635,584		47,543,934
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		11,881		27,817
差入保証金		367,613		360,305
繰延税金資産		1,600,306		1,809,123
その他		10,037		12,801
投資その他の資産合計		39,691,645		49,820,204
固定資産合計		42,944,413		53,899,049
資産合計		89,711,272		97,683,522

## 負債の部

## 流動負債

預り金		53,649		89,613
未払収益分配金		7,080		6,178
未払手数料	2	2,148,508	2	2,551,424
未払運用委託報酬	2	1,868,264	2	4,921,643
未払投資助言報酬	2	801,755	2	895,917
その他未払金	2	2,880,396	2	1,753,139
未払費用	2	122,649	2	181,100
未払法人税等		1,689,458		3,839,095
未払消費税等		321,144		937,421
賞与引当金		1,047,233		1,342,646
その他		46,054		34,063
流動負債合計		10,986,194		16,552,244

## 固定負債

退職給付引当金		2,402,314		2,474,312
役員退職慰労引当金		16,150		21,250
固定負債合計		2,418,464		2,495,562

## 負債合計

負債合計		13,404,658		19,047,806
------	--	------------	--	------------

## 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		57,905,876		60,488,508

利益剰余金合計		58,585,683		61,168,315
---------	--	------------	--	------------

株主資本合計		76,867,523		79,450,155
--------	--	------------	--	------------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		254,732		484,519
繰延ヘッジ損益		306,177		329,920
評価・換算差額等合計		560,910		814,439

純資産合計		76,306,613		78,635,715
-------	--	------------	--	------------

負債・純資産合計		89,711,272		97,683,522
----------	--	------------	--	------------



## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	27,807,455	29,505,710
運用受託報酬	18,365,703	24,242,291
投資助言報酬	1,146,302	1,181,976
その他営業収益	4,497	11,333
営業収益計	47,323,959	54,941,312
営業費用		
支払手数料	10,826,133	11,188,210
広告宣伝費	34,423	46,512
公告費	125	375
調査費	9,426,129	14,344,571
支払運用委託報酬	3,994,350	8,375,976
支払投資助言報酬	3,279,321	3,524,180
委託調査費	143,143	140,696
調査費	2,009,314	2,303,717
委託計算費	278,897	281,167
営業雑経費	876,260	980,132
通信費	60,541	72,591
印刷費	166,600	174,220
協会費	37,646	37,566
その他営業雑経費	611,472	695,754
営業費用計	21,441,969	26,840,969
一般管理費		
役員報酬	114,167	242,750
給料・手当	5,179,604	5,515,210
賞与引当金繰入額	1,033,669	1,325,993
賞与	357,187	329,794
福利厚生費	988,302	1,094,736
退職給付費用	411,161	446,711
役員退職慰労引当金繰入額	5,850	8,700
役員退職慰労金	2,550	821
その他人件費	214,336	192,956
不動産賃借料	803,805	805,677
その他不動産経費	35,247	37,672
交際費	27,169	28,219
旅費交通費	133,750	177,813
固定資産減価償却費	663,401	687,280
租税公課	367,046	393,138
業務委託費	438,018	414,081
器具備品費	769,903	1,022,398
保険料	49,248	49,463
寄付金	10,762	4,382
諸経費	279,825	352,612
一般管理費計	11,885,008	13,130,414
営業利益	13,996,981	14,969,928
営業外収益		

受取利息		950		825
有価証券利息		15,666		61,304
受取配当金	1	191,353	1	61,395
為替差益		22,628		182,640
その他営業外収益		20,449		8,780
営業外収益計		251,049		314,945
営業外費用				
金融派生商品費用		-		185,184
控除対象外消費税		5,712		11,281
その他営業外費用		314		14,042
営業外費用計		6,026		210,509
経常利益		14,242,004		15,074,365
特別利益				
投資有価証券売却益		97,919		220,932
投資有価証券償還益		45,181		65,698
特別利益計		143,100		286,630
特別損失				
投資有価証券売却損		73,703		5,154
投資有価証券償還損		71,887		55,591
固定資産除却損	2	1,757	2	8,209
事故損失賠償金	3	2,015	3	71
特別損失計		149,364		69,028
税引前当期純利益		14,235,739		15,291,967
法人税、住民税及び事業税		4,112,329		4,785,139
法人税等調整額		74,919		114,620
法人税等合計		4,187,249		4,670,518
当期純利益		10,048,489		10,621,448

## （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2022年4月1日 至2023年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	56,866,270	57,546,077	75,827,917
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,008,883	9,008,883	9,008,883
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,048,489	10,048,489	10,048,489
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,039,606	1,039,606	1,039,606
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	57,905,876	58,585,683	76,867,523

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	348,871	192,067	156,803	75,984,720
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,008,883
当期純利益	-	-	-	10,048,489
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	603,603	114,109	717,713	717,713
当期変動額合計	603,603	114,109	717,713	321,892
当期末残高	254,732	306,177	560,910	76,306,613

当事業年度(自2023年4月1日 至2024年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	57,905,876	58,585,683	76,867,523
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	8,038,816	8,038,816	8,038,816
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,621,448	10,621,448	10,621,448
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,582,632	2,582,632	2,582,632
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	60,488,508	61,168,315	79,450,155

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	254,732	306,177	560,910	76,306,613
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	8,038,816
当期純利益	-	-	-	10,621,448
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	229,786	23,743	253,529	253,529
当期変動額合計	229,786	23,743	253,529	2,329,102
当期末残高	484,519	329,920	814,439	78,635,715

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024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 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>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．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．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、2016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3～18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>
4．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。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、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。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>

5. 収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p><b>投資信託委託業務</b>  投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。  委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p> <p><b>投資運用業務</b>  投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。  運用受託報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。また、成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。</p> <p><b>投資助言業務</b>  投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。  投資助言報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p>
6. 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、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>
7. ヘッジ会計の方法	<p><b>ヘッジ会計の方法</b>  繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p><b>ヘッジ手段とヘッジ対象</b>  ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約  ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p><b>ヘッジ方針</b>  ヘッジ指定は、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間について、原則として個々取引毎に行います。</p> <p><b>ヘッジ有効性評価の方法</b>  ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
8. グループ通算制度の適用	<p>当社は、日本生命保険相互会社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。</p>

## （未適用の会計基準等）

- ・「法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準」（企業会計基準第27号 2022年10月28日）
- ・「包括利益の表示に関する会計基準」（企業会計基準第25号 2022年10月28日）
- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2022年10月28日）

## 1．概要

その他の包括利益に対して課税される場合の法人税等の計上区分及びグループ法人税制が適用される場合の子会社株式等の売却に係る税効果の取扱いを定めるものです。

## 2．適用予定日

2025年3月期の期首より適用予定であります。

## 3．当該会計基準等の適用による影響

「法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

## （貸借対照表関係）

## 1．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物附属設備	340,233千円	350,825千円
車両	6,246	6,729
器具備品	516,937	463,698
計	863,417	821,253

## （損益計算書関係）

## 1．各科目に含まれている関係会社に対するものは、以下のとおりであります。

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
受取配当金	174,180千円	42,264千円

## 2．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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
器具備品	1,749	6,353
ソフトウェア	8	1,856
計	1,757	8,209

## 3．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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自2022年4月1日 至2023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

2022年6月30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	9,008,883千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	83,071円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

当事業年度（自2023年4月1日 至2024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

2023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	8,038,816千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	74,126円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023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

2024年6月26日開催の定時株主総会において、以下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	8,497,226千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	78,353円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月26日



## （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地方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。

上記の自社設定投資信託の一部につきましてはデリバティブを用いてヘッジを行っております。デリバティブを用いたヘッジ取引につきましては、外貨建て資産の為替変動リスクを回避する目的で為替予約を使ってヘッジ会計を適用しております。ヘッジ会計の適用にあたっては、資金運用規則のほか資金運用リスク管理規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類及び選択したヘッジ手段を明確にし、また事前の有効性の確認、事後の有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運用しております。ヘッジの有効性判定については資金運用リスク管理規程に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

## 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、以下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金融商品または市場価格のない株式等（注1）は次表に含まれておりません。また、短期間で決済されるため時価が簿価に近似する金融商品は、注記を省略しております。

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,445,768	23,460,731	14,962
その他有価証券	19,289,693	19,289,693	-
資産計	42,735,461	42,750,424	14,962
デリバティブ取引（ ）			
ヘッジ会計が適用されて いるもの	24,321	24,321	-
デリバティブ取引計	24,321	24,321	-

（ ）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 示しております。

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	28,036,676	27,975,611	61,065
その他有価証券	24,465,367	24,465,367	-
資産計	52,502,043	52,440,978	61,065
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用されて いるもの	10,936	10,936	-
デリバティブ取引計	10,936	10,936	-

( ) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については で示しております。

(注1) 市場価格のない株式等

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)
関係会社株式	66,222

(単位:千円)

区分	当事業年度 (2024年3月31日)
関係会社株式	66,222

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

## (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 其他有価証券	-	19,289,693	-	19,289,693
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	24,321	-	24,321
合計	-	19,265,372	-	19,265,372

( )デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 示しております。

当事業年度（2024年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 其他有価証券	3,473,100	20,992,267	-	24,465,367
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	10,936	-	10,936
合計	-	24,454,430	-	24,454,430

( )デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 示しております。

## (2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
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	-	23,460,731	-	23,460,731
合計	-	23,460,731	-	23,460,731

当事業年度（2024年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
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	-	27,975,611	-	27,975,611
合計	-	27,975,611	-	27,975,611

(注) 時価の算定に用いた評価技法および時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

国債・地方債は相場価格を用いて評価しております。国債は、市場での取引頻度が高く、活発な市場における相場価格と認められるため、その時価をレベル1の時価に分類しております。一方、地方債は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格と認められないため、その時価をレベル2の時価に分類しております。

市場における取引価格が存在しない投資信託について、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額を時価とし、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

4. 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(2023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	31,522,565	-	-	-
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	5,100,000	18,340,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	3,029,947	15,086,454	997,574	175,716
合計	39,652,513	33,426,454	997,574	175,716

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2024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	23,594,998	-	-	-
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	4,950,000	23,050,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
国債・地方債等	-	-	-	3,000,000
其他(注)	8,363,707	9,339,165	2,160,208	928,678
合計	36,908,706	32,389,165	2,160,208	3,928,678

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

## 1. 満期保有目的の債券

前事業年度（2023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	13,455,768	13,484,645	28,876
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	13,455,768	13,484,645	28,876
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	9,990,000	9,976,086	13,914
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	9,990,000	9,976,086	13,914
合計		23,445,768	23,460,731	14,962

当事業年度（2024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	1,094,587	1,098,374	3,786
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,094,587	1,098,374	3,786
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	26,942,089	26,877,237	64,852
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,942,089	26,877,237	64,852
合計		28,036,676	27,975,611	61,065

## 2. その他有価証券

前事業年度（2023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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,778,610	6,336,999	441,610
	小計	6,778,610	6,336,999	441,610
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）	12,511,082	13,413,000	901,917
	小計	12,511,082	13,413,000	901,917
	合計	19,289,693	19,749,999	460,306

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）関係会社株式66,222千円は、市場価格がないことから、上表には記載しておりません。

当事業年度（2024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	-	-	-
	国債・地方債等	3,473,100	3,459,180	13,920
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,089,659	5,473,000	616,659
	小計	9,562,759	8,932,180	630,579
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）	14,902,608	16,307,000	1,404,391
	小計	14,902,608	16,307,000	1,404,391
	合計	24,465,367	25,239,180	773,812

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）関係会社株式66,222千円は、市場価格がないことから、上表には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2022年4月1日 至2023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	325,215	97,919	73,703
合計	325,215	97,919	73,703

当事業年度（自2023年4月1日 至2024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	2,529,777	220,932	5,154
合計	2,529,777	220,932	5,154

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2023年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2024年3月31日）

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等のうち1年超 (千円)	時価 (千円)
原則的 処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	1,129,663	-	24,321
合計			1,129,663	-	24,321

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(注2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 〇 で示しております。

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等のうち1年超 (千円)	時価 (千円)
原則的 処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	916,030	-	10,936
合計			916,030	-	10,936

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(注2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 〇 で示しております。

## (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、年俸制適用者及び年俸制非適用者を制度の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。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表（簡便法を適用した制度を除く）

	前事業年度	当事業年度
	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,324,488 千円	2,226,246 千円
勤務費用	261,043	295,775
利息費用	7,886	14,661
数理計算上の差異の発生額	51,020	16,051
退職給付の支払額	318,533	240,354
その他	2,382	4,124
退職給付債務の期末残高	2,226,246	2,284,401

## (2) 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

	前事業年度	当事業年度
	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	147,543千円	162,914千円
退職給付費用	18,835	16,453
退職給付の支払額	1,081	15,208
その他	2,382	4,124
退職給付引当金の期末残高	162,914	160,035

## (3) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,389,160千円	2,444,436千円
未認識数理計算上の差異	13,153	29,875
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,402,314	2,474,312
退職給付引当金	2,402,314	2,474,312
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,402,314	2,474,312

## (4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	18,835千円	16,453千円
勤務費用	261,043	295,775
利息費用	7,886	14,661
数理計算上の差異の当期費用処理額	10,874	670
確定給付制度に係る退職給付費用	298,639	327,560

## (5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表しております。)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
割引率	0.66 %	0.88 %

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において75,867千円、当事業年度において81,815千円であり、退職給付費用に計上しております。

## ( 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 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
繰延税金資産		
賞与引当金	320,663 千円	411,118 千円
未払事業税	113,779	154,657
退職給付引当金	735,588	757,634
税務上の繰延資産償却超過額	2,055	1,901
役員退職慰労引当金	4,945	6,506
投資有価証券評価差額	314,276	459,720
減価償却超過額	48,992	1,035
その他	180,561	203,947
小計	1,720,862	1,996,521
評価性引当額	12,818	7,242
繰延税金資産合計	1,708,043	1,989,278
繰延税金負債		
特別分配金否認	10,817	15,934
投資有価証券評価差額	96,919	164,220
繰延税金負債合計	107,737	180,154
繰延税金資産( は負債)の純額	1,600,306	1,809,123

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要な項目別の内訳  
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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、日本生命保険相互会社を通算親会社として、グループ通算制度を適用しております。

これにより、法人税および地方法人税の会計処理またはこれらに関する税効果会計の会計処理は、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（企業会計基準委員会実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従っております。

## (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2022年4月1日 至2023年3月31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

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	5,921,322

当事業年度（自2023年4月1日 至2024年3月31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

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	6,138,470

## [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。

## （収益認識関係）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

（単位：千円）

区分	前事業年度 （自 2022年4月1日 至2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至2024年3月31日）
営業収益		
投資信託委託業務	27,807,455	29,505,710
投資運用業務（注）	18,365,703	24,242,291
投資助言業務	1,146,302	1,181,976
その他営業収益	4,497	11,333
計	47,323,959	54,941,312

（注）成功報酬は、損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

## 2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の「5．収益及び費用の計上基準」に記載の通りでございます。

## （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2022年4月1日 至2023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	100,000	生命保険業	(被所有) 直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	5,922,395	未収運用受託報酬	1,446,614
								投資助言報酬の受取	118,702	未収投資助言報酬	10,996
								グループ通算に伴う支払	2,065,951	その他未払金	2,065,951

当事業年度（自2023年4月1日 至2024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	100,000	生命保険業	(被所有) 直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	6,088,919	未収運用受託報酬	1,590,885
								投資助言報酬の受取	117,195	未収投資助言報酬	11,015
								グループ通算に伴う支払	624,787	その他未払金	624,787

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1 株当たり純資産額	703,623円97銭	725,100円65銭
1 株当たり当期純利益金額	92,657円21銭	97,940円47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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
当期純利益	10,048,489千円	10,621,448千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	10,048,489千円	10,621,448千円
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。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (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

2024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

2024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

(資本金の額：2024年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
株式会社SBI証券	54,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	
株式会社東邦銀行	23,519	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
株式会社千葉銀行	145,069	
株式会社第四北越銀行	32,776	
株式会社北洋銀行	121,101	
労働金庫連合会	120,000	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
日本生命保険相互会社	1,450,000	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) 投資顧問会社

a. 名称

ザ・パトナム・アドバイザー・カンパニー・エルエルシー

b. 資本金の額

2023年3月末現在、25,436,499米ドル(約3,396百万円。1米ドル=133.53円)

(注) 資本の額はCapital-Issued and Outstanding(発行済流通株式資本)を記載しております。

c. 事業の内容

内外の有価証券等に関する投資顧問業務およびその他付帯関連する一切の業務を営んでいます。

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) 投資顧問会社

委託会社との契約に基づいて、「ニッセイ/パトナム・海外株式マザーファンド」および「ニッセイ/パトナム・海外債券マザーファンド」の運用指図(国内の短期金融資産を除きます)を行います。

3【資本関係】

日本生命保険相互会社(販売会社)は、委託会社の株式を108,448株(持株比率100%)保有しています。

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。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
  - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
  - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
- なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
- コールセンター 0120-762-506  
(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)  
ホームページ <https://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- 投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

# 独立監査人の監査報告書

2024年5月31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  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大竹 新

## 監査意見

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2023年4月1日から2024年3月31日までの第29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。

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2024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、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

## 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の監査報告書

2024年3月15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  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）の2022年12月21日から2023年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（債券重視型）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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。



財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2024年3月15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  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

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/パトナム・グローバルバランス（標準型）の2022年12月21日から2023年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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/パトナム・グローバルバランス（標準型）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2024年3月15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  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）の2022年12月21日から2023年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年9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  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 中間監査意見

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/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）の2023年12月21日から2024年6月20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。

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/パトナム・グローバルバランス（債券重視型）の2024年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月21日から2024年6月20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。

## 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年9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  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 中間監査意見

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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）の2023年12月21日から2024年6月20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。

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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（標準型）の2024年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月21日から2024年6月20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。

## 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。



監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年9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  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 中間監査意見

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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）の2023年12月21日から2024年6月20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。

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ニッセイノパトナム・グローバルバランス（株式重視型）の2024年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月21日から2024年6月20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。

## 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ニッセイアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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。