

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成23年11月21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 皆川 卓士
【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 澤田 昌彦
【電話番号】	03 - 5533 - 4605
【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ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型） DCニッセイワールドセレクトファンド（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ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） 5,000億円 DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型） 5,000億円 DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型） 5,000億円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成23年5月20日をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、半期報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社の概況（平成23年3月末現在）

1. 委託会社の名称：ニッセイアセットマネジメント株式会社

（略）

<訂正後>

（略）

委託会社の概況（平成23年9月末現在）

1. 委託会社の名称：ニッセイアセットマネジメント株式会社

（略）

2【投資方針】

（2）【投資対象】

<訂正前>

- a 主な投資対象

（略）

各指定投資信託証券の概要

（略）

ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド

（略）

3 主な関係法人

関係	名称
委託会社	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
受託会社	中央三井アセット信託銀行株式会社

（略）

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

(略)

3 主な関係法人

関係	名称
委託会社	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
受託会社	中央三井アセット信託銀行株式会社

(略)

<訂正後>

a 主な投資対象

(略)

各指定投資信託証券の概要

(略)

ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド

(略)

3 主な関係法人

関係	名称
委託会社	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
受託会社	中央三井アセット信託銀行株式会社

ただし、関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および住友信託銀行株式会社と合併し、新商号を三井住友信託銀行株式会社とする予定です。

(略)

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

(略)

3 主な関係法人

関係	名称
委託会社	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
受託会社	中央三井アセット信託銀行株式会社

ただし、関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および住友信託銀行株式会社と合併し、新商号を三井住友信託銀行株式会社とする予定です。

(略)

(3) 【運用体制】

<訂正前>

(略)

< 受託会社に対する管理体制等 >

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、SAS70（受託業務にかかわる内部統制について評価する監査人の業務に関する基準）に基づく受託業務の内部統制の有効性についての監査報告書を、定期的に受託会社より受取っています。

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

< 受託会社に対する管理体制等 >

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、SAS70、SSAE16またはISAE3402（受託業務にかかわる内部統制について評価する監査人の業務に関する基準）に基づく受託業務の内部統制の有効性についての監査報告書を、定期的に受託会社より受取っています。

（ 略 ）

（ 4 ）【分配方針】

< 訂正前 >

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

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。

3【投資リスク】

< 訂正前 >

ファンド（指定投資信託証券を含みます）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、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。

（ 略 ）

< 訂正後 >

ファンド（指定投資信託証券を含みます）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。

（ 略 ）

5【運用状況】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。

(1)【投資状況】

「債券重視型」

(平成23年9月30日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	2,276,677,728	96.26
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		88,381,105	3.74
純資産総額		2,365,058,833	100.00

「標準型」

(平成23年9月30日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	6,927,115,761	96.55
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		247,174,046	3.45
純資産総額		7,174,289,807	100.00

「株式重視型」

(平成23年9月30日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	3,570,708,032	96.48
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		130,170,932	3.52
純資産総額		3,700,878,964	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

「債券重視型」

(平成23年9月30日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	ニッセイ国内債券インデックスS A (適格機関投資家限定)	投資信託受益証券	935,366,087	11,243	1,051,610,459	11,542	1,079,599,537	45.65
2	日本	ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)	投資信託受益証券	602,144,273	9,729	585,852,677	8,145	490,446,510	20.74

3	日本	ステート・スト リート外国債券イ ンデックス・ファン ド	投資信託 受益証券	410,089,978	12,134	497,589,563	11,449	469,512,015	19.85
4	日本	ステート・スト リート外国株式イ ンデックス・ファン ド	投資信託 受益証券	323,889,723	9,167	296,912,480	7,321	237,119,666	10.02
								投資比率：合計	96.26

「標準型」

(平成23年9月30日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	ニッセイ国内株式 インデックスS A (適格機関投資家 限定)	投資信託 受益証券	2,751,475,114	9,817	2,701,031,433	8,145	2,241,076,480	31.24
2	日本	ニッセイ国内債券 インデックスS A (適格機関投資家 限定)	投資信託 受益証券	1,899,856,127	11,244	2,136,147,074	11,542	2,192,813,941	30.56
3	日本	ステート・スト リート外国株式イ ンデックス・ファン ド	投資信託 受益証券	1,953,993,463	9,236	1,804,789,988	7,321	1,430,518,614	19.94
4	日本	ステート・スト リート外国債券イ ンデックス・ファン ド	投資信託 受益証券	928,209,212	12,135	1,126,356,248	11,449	1,062,706,726	14.81
								投資比率：合計	96.55

「株式重視型」

(平成23年9月30日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	ニッセイ国内株式 インデックスS A (適格機関投資家 限定)	投資信託 受益証券	1,891,893,037	9,898	1,872,608,465	8,145	1,540,946,878	41.64
2	日本	ステート・スト リート外国株式イ ンデックス・ファン ド	投資信託 受益証券	1,503,977,217	9,295	1,397,950,820	7,321	1,101,061,720	29.75
3	日本	ニッセイ国内債券 インデックスS A (適格機関投資家 限定)	投資信託 受益証券	489,267,552	11,246	550,233,645	11,542	564,712,608	15.26
4	日本	ステート・スト リート外国債券イ ンデックス・ファン ド	投資信託 受益証券	317,920,191	12,135	385,796,133	11,449	363,986,826	9.83
								投資比率：合計	96.48

（注1）投資有価証券は4銘柄のみで、簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額であります。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

「債券重視型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	96.26
合計		96.26

「標準型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	96.55
合計		96.55

「株式重視型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	96.48
合計		96.48

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額の比率であります。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

平成23年9月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

「債券重視型」

		純資産総額（円）		1万口当たり純資産総額（円）	
第1期末	（平成16年2月23日）	分配付：	47,417,429	分配付：	10,855
		分配落：	47,417,429	分配落：	10,855
第2期末	（平成17年2月21日）	分配付：	538,308,102	分配付：	11,316
		分配落：	538,308,102	分配落：	11,316
第3期末	（平成18年2月21日）	分配付：	1,314,616,710	分配付：	12,528
		分配落：	1,314,616,710	分配落：	12,528
第4期末	（平成19年2月21日）	分配付：	1,801,858,564	分配付：	13,421
		分配落：	1,801,858,564	分配落：	13,421
第5期末	（平成20年2月21日）	分配付：	2,005,643,716	分配付：	12,719
		分配落：	2,005,643,716	分配落：	12,719

第6期末	(平成21年2月23日)	分配付：1,837,832,308 分配落：1,837,832,308	分配付：10,431 分配落：10,431
第7期末	(平成22年2月22日)	分配付：2,226,476,366 分配落：2,226,476,366	分配付：11,509 分配落：11,509
第8期末	(平成23年2月21日)	分配付：2,468,732,723 分配落：2,468,732,723	分配付：11,802 分配落：11,802
	平成22年9月末日	2,336,372,350	11,512
	10月末日	2,315,422,826	11,345
	11月末日	2,337,092,757	11,464
	12月末日	2,372,889,238	11,509
	平成23年1月末日	2,434,693,647	11,642
	2月末日	2,448,901,313	11,681
	3月末日	2,475,933,519	11,590
	4月末日	2,456,145,231	11,598
	5月末日	2,368,068,942	11,548
	6月末日	2,419,160,959	11,576
	7月末日	2,425,090,944	11,503
	8月末日	2,382,924,444	11,229
	平成23年9月30日	2,365,058,833	11,088

「標準型」

		純資産総額（円）	1万口当たり純資産総額（円）
第1期末	(平成16年2月23日)	分配付：104,312,125 分配落：104,312,125	分配付：11,253 分配落：11,253
第2期末	(平成17年2月21日)	分配付：1,685,435,357 分配落：1,685,435,357	分配付：11,884 分配落：11,884
第3期末	(平成18年2月21日)	分配付：4,211,489,449 分配落：4,211,489,449	分配付：13,838 分配落：13,838
第4期末	(平成19年2月21日)	分配付：6,194,491,862 分配落：6,194,491,862	分配付：15,275 分配落：15,275
第5期末	(平成20年2月21日)	分配付：6,484,983,703 分配落：6,484,983,703	分配付：13,809 分配落：13,809
第6期末	(平成21年2月23日)	分配付：5,244,908,506 分配落：5,244,908,506	分配付：10,030 分配落：10,030
第7期末	(平成22年2月22日)	分配付：6,824,522,532 分配落：6,824,522,532	分配付：11,685 分配落：11,685
第8期末	(平成23年2月21日)	分配付：7,926,206,447 分配落：7,926,206,447	分配付：12,272 分配落：12,272
	平成22年9月末日	7,174,664,468	11,582
	10月末日	7,103,982,051	11,393
	11月末日	7,274,932,894	11,645
	12月末日	7,457,912,256	11,792
	平成23年1月末日	7,708,244,435	11,982
	2月末日	7,806,453,410	12,054

	3月末日	7,857,292,661	11,880
	4月末日	7,810,532,653	11,870
	5月末日	7,488,566,334	11,756
	6月末日	7,613,040,337	11,773
	7月末日	7,619,729,002	11,686
	8月末日	7,279,367,818	11,160
	平成23年9月30日	7,174,289,807	10,960

「株式重視型」

		純資産総額(円)	1万口当たり純資産総額(円)
第1期末	(平成16年2月23日)	分配付: 58,719,649	分配付: 11,659
		分配落: 58,719,649	分配落: 11,659
第2期末	(平成17年2月21日)	分配付: 875,027,196	分配付: 12,475
		分配落: 875,027,196	分配落: 12,475
第3期末	(平成18年2月21日)	分配付: 2,375,768,675	分配付: 15,253
		分配落: 2,375,768,675	分配落: 15,253
第4期末	(平成19年2月21日)	分配付: 3,578,213,433	分配付: 17,319
		分配落: 3,578,213,433	分配落: 17,319

		純資産総額(円)	1万口当たり純資産総額(円)
第5期末	(平成20年2月21日)	分配付: 3,543,921,213	分配付: 14,897
		分配落: 3,543,921,213	分配落: 14,897
第6期末	(平成21年2月23日)	分配付: 2,565,505,965	分配付: 9,552
		分配落: 2,565,505,965	分配落: 9,552
第7期末	(平成22年2月22日)	分配付: 3,635,729,715	分配付: 11,734
		分配落: 3,635,729,715	分配落: 11,734
第8期末	(平成23年2月21日)	分配付: 4,343,954,086	分配付: 12,613
		分配落: 4,343,954,086	分配落: 12,613
	平成22年9月末日	3,816,775,808	11,522
	10月末日	3,778,883,192	11,312
	11月末日	3,904,089,636	11,696
	12月末日	4,055,849,256	11,943
	平成23年1月末日	4,197,608,313	12,191
	2月末日	4,235,055,060	12,295
	3月末日	4,178,136,349	12,028
	4月末日	4,145,859,338	11,998
	5月末日	3,940,092,718	11,819
	6月末日	4,021,824,927	11,824
	7月末日	4,022,773,630	11,724
	8月末日	3,770,677,329	10,946
	平成23年9月30日	3,700,878,964	10,690

(参考情報) 指定投資信託証券の投資状況及び投資資産(平成23年9月30日現在)

各ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)」、「ニッセイ国内債券インデックスS A (適格機関投資家限定)」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」及び「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」の受益証券を主要な投資対象としております。各指定投資信託証券の平成23年9月30日現在の投資状況及び投資資産は次に示すとおりであります。

また、各指定投資信託証券は、それぞれ「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンド」及び「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の受益証券を主要な投資対象としております。各マザーファンドの平成23年9月30日現在の投資状況及び投資資産は次に示すとおりであります。

(1) 投資状況

1. ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	16,733,689,601	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		138,615	0.00
純資産総額		16,733,550,986	100.00

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式		26,789,736,985	97.73
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		622,517,645	2.27
純資産総額		27,412,254,630	100.00

(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合計の比率であります。

(注2) その他資産として、下記のとおり株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

資産の名称	取引所	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
東証株価指数先物(買建) (2011年12月限)	東京証券取引所	597,047,600	606,000,000	2.21

2. ニッセイ国内債券インデックスS A (適格機関投資家限定)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,106,237,112	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		29,675	0.00
純資産総額		5,106,207,437	100.00

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

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券		18,273,011,050	98.82
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		217,675,696	1.18
純資産総額		18,490,686,746	100.00

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

3. ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,796,989,118	99.99
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		260,197	0.01
純資産総額		2,797,249,315	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンド

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	16,084,098,355	53.40
	イギリス	3,085,647,663	10.25
	カナダ	1,669,012,580	5.54
	フランス	1,253,148,516	4.16
	スイス	1,216,417,122	4.04
	ドイツ	1,111,552,149	3.69
	オーストラリア	1,099,885,882	3.65
	スペイン	489,479,214	1.63
	スウェーデン	411,020,370	1.36
	香港	369,666,587	1.23
	オランダ	341,960,137	1.14
	イタリア	330,365,236	1.10
	シンガポール	231,268,015	0.77
	デンマーク	142,327,522	0.47
	ベルギー	135,554,146	0.45
	フィンランド	126,464,509	0.42
	ノルウェー	124,697,145	0.41
	イスラエル	88,962,973	0.30
	オーストリア	36,592,817	0.12
	ポルトガル	35,363,310	0.12
アイルランド	34,029,497	0.11	
ギリシャ	19,582,478	0.06	
ニュージーランド	17,687,383	0.06	
小計	28,454,783,606	94.48	
投資証券	アメリカ	338,326,291	1.12
	オーストラリア	76,280,133	0.25
	フランス	37,421,737	0.12
	イギリス	35,079,472	0.12
	香港	11,011,203	0.04
	シンガポール	7,432,101	0.03
	オランダ	4,358,543	0.02
	カナダ	4,215,986	0.01
	小計	514,125,466	1.71
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,148,257,533	3.81
純資産総額		30,117,166,605	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

4. ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,907,059,616	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		26,764	0.00
純資産総額		1,907,032,852	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	92,170,549,561	39.79
	フランス	22,931,621,586	9.90
	ドイツ	22,135,762,373	9.56
	イタリア	20,804,290,558	8.98
	イギリス	18,660,115,424	8.06
	スペイン	9,645,929,330	4.16
	カナダ	6,621,019,110	2.86
	ベルギー	6,252,366,280	2.70
	オランダ	5,947,757,307	2.57
	オーストリア	4,069,285,662	1.76
	オーストラリア	2,879,248,757	1.24
	デンマーク	2,054,438,473	0.89
	メキシコ	1,895,861,984	0.82
	ポーランド	1,698,701,534	0.73
	アイルランド	1,673,435,819	0.72
	スウェーデン	1,550,885,990	0.67
	フィンランド	1,537,884,289	0.66
	ポルトガル	1,485,324,874	0.64
	マレーシア	1,126,282,292	0.49
	スイス	1,061,041,358	0.46
シンガポール	895,215,782	0.39	
ノルウェー	677,837,562	0.29	
	小計	227,774,855,905	98.34
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		3,854,372,460	1.66
純資産総額		231,629,228,365	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

1. ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	ニッセイ国内株式 インデックスマ ザーファンド	親投資信 託受益証 券	24,276,352,244	8,168	19,830,066,543	6,893	16,733,689,601	100.00

投資比率：合計 100.00

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

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	100.00
合計		100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額の比率であります。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額(円) 下段：評価額(円)		投資比率(%)
						単価	金額	
1	日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	335,400	3,867 2,688	1,297,128,177 901,555,200	3.29
2	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	1,950,300	466 354	908,425,654 690,406,200	2.52
3	日本	キヤノン	株式	電気機器	162,200	4,080 3,550	661,746,458 575,810,000	2.10
4	日本	ホンダ	株式	輸送用機器	220,200	3,642 2,299	801,873,840 506,239,800	1.85
5	日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	196,400	3,156 2,206	619,834,762 433,258,400	1.58
6	日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	3,458,000	170 114	586,786,009 394,212,000	1.44
7	日本	武田薬品工業	株式	医薬品	102,400	4,089 3,680	418,753,275 376,832,000	1.37
8	日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	96,800	4,077 3,730	394,687,349 361,064,000	1.32
9	日本	三菱商事	株式	卸売業	201,000	2,342 1,592	470,765,014 319,992,000	1.17
10	日本	NTTドコモ	株式	情報・通信業	2,123	157,254 141,700	333,850,440 300,829,100	1.10
11	日本	ファナック	株式	電気機器	27,200	12,776 10,830	347,500,170 294,576,000	1.07
12	日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	116,700	3,384 2,292	394,887,931 267,476,400	0.98
13	日本	三井物産	株式	卸売業	222,400	1,545 1,134	343,519,118 252,201,600	0.92
14	日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	107,800	2,288 2,189	246,675,415 235,974,200	0.86
15	日本	パナソニック	株式	電気機器	304,000	1,097 754	333,556,350 229,216,000	0.84
16	日本	日産自動車	株式	輸送用機器	329,800	870 693	286,923,064 228,551,400	0.83
17	日本	三菱地所	株式	不動産業	180,000	1,681 1,268	302,582,340 228,240,000	0.83
18	日本	日立製作所	株式	電気機器	586,000	494 389	289,577,220 227,954,000	0.83

19	日本	J T	株式	食料品	608	347,398 363,500	211,217,938 221,008,000	0.81
20	日本	ソニー	株式	電気機器	146,600	3,030 1,507	444,132,918 220,926,200	0.81
21	日本	コマツ	株式	機械	129,500	2,541 1,699	329,117,896 220,020,500	0.80
22	日本	K D D I	株式	情報・通信業	400	547,025 536,000	218,810,025 214,400,000	0.78
23	日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	45,400	5,571 4,710	252,925,576 213,834,000	0.78
24	日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	97,800	2,761 1,984	269,984,840 194,035,200	0.71
25	日本	三菱電機	株式	電気機器	261,000	965 695	251,919,690 181,395,000	0.66

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額(円) 下段：評価額(円)		投資 比率 (%)
						単価	金額	
26	日本	アステラス製薬	株式	医薬品	60,700	3,280 2,941	199,069,144 178,518,700	0.65
27	日本	信越化学工業	株式	化学	45,500	4,737 3,830	215,536,058 174,265,000	0.64
28	日本	任天堂	株式	その他製品	14,900	25,241 11,360	376,093,873 169,264,000	0.62
29	日本	東芝	株式	電気機器	515,000	525 320	270,625,820 164,800,000	0.60
30	日本	新日本製鐵	株式	鉄鋼	717,000	302 224	216,316,060 160,608,000	0.59
投資比率：合計								33.35

(注1) 投資有価証券の評価金額の上位30銘柄について記載しております。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	電気機器	13.00
	銀行業	9.45
	輸送用機器	9.32
	情報・通信業	6.14
	化学	5.97
	医薬品	5.13
	卸売業	5.13
	機械	4.73
	小売業	4.20
	陸運業	4.04
	食料品	3.55
	電気・ガス業	3.31
	建設業	2.40
	保険業	2.29
	不動産業	2.29
	鉄鋼	2.01
	サービス業	1.95
	その他製品	1.63
	精密機器	1.55
	ガラス・土石製品	1.22
	非鉄金属	1.17
	証券、商品先物取引業	1.06
	繊維製品	0.95
	石油・石炭製品	0.84
	金属製品	0.77
	ゴム製品	0.77
	その他金融業	0.77
	鉱業	0.60
パルプ・紙	0.44	
海運業	0.39	
空運業	0.31	
倉庫・運輸関連業	0.24	

種類	業種	投資比率(%)
株式	水産・農林業	0.11
	合計	97.73

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

2. ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	4,278,372,109	11,642	4,980,777,360	11,935	5,106,237,112	100.00
投資比率：合計									100.00

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

（注2）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	-	100.00
合計		100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額の比率であります。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

順位	国名	銘柄名	利率（％）	償還日	種類	額面	上段：帳簿価額（円） 下段：評価額（円）		投資比率（％）
							単価	金額	
1	日本	第108回利付国債（20年）	1.900	2028/12/20	国債証券	1,369,000,000	98.76 103.98	1,352,065,300 1,423,445,130	7.70
2	日本	第113回利付国債（20年）	2.100	2029/9/20	国債証券	1,303,000,000	101.30 106.53	1,319,906,620 1,388,072,870	7.51
3	日本	第312回利付国債（10年）	1.200	2020/12/20	国債証券	1,347,000,000	101.04 102.33	1,361,013,780 1,378,425,510	7.45
4	日本	第69回利付国債（5年）	0.900	2012/12/20	国債証券	1,364,000,000	101.02 100.95	1,377,972,760 1,376,917,080	7.44
5	日本	第288回利付国債（10年）	1.700	2017/9/20	国債証券	1,280,000,000	105.60 107.16	1,351,737,000 1,371,648,000	7.42
6	日本	第305回利付国債（10年）	1.300	2019/12/20	国債証券	1,251,000,000	101.54 104.13	1,270,249,120 1,302,678,810	7.05
7	日本	第121回利付国債（20年）	1.900	2030/9/20	国債証券	1,248,000,000	99.62 103.02	1,243,313,700 1,285,627,200	6.95
8	日本	第289回利付国債（10年）	1.500	2017/12/20	国債証券	1,108,000,000	105.69 106.05	1,171,083,990 1,175,067,240	6.35
9	日本	第71回利付国債（5年）	1.300	2013/3/20	国債証券	980,000,000	101.81 101.71	997,718,400 996,787,400	5.39
10	日本	第273回利付国債（10年）	1.500	2015/9/20	国債証券	927,000,000	104.89 104.74	972,283,950 970,893,450	5.25
11	日本	第280回利付国債（10年）	1.900	2016/6/20	国債証券	886,000,000	107.21 107.20	949,850,330 949,809,720	5.14
12	日本	第269回利付国債（10年）	1.300	2015/3/20	国債証券	805,000,000	103.30 103.63	831,584,820 834,229,550	4.51
13	日本	第84回利付国債（5年）	0.700	2014/6/20	国債証券	780,000,000	101.40 101.40	790,933,800 790,920,000	4.28
14	日本	第87回利付国債（5年）	0.500	2014/12/20	国債証券	771,000,000	100.33 100.91	773,506,320 778,000,680	4.21
15	日本	第264回利付国債（10年）	1.500	2014/9/20	国債証券	541,000,000	103.71 103.84	561,055,540 561,768,990	3.04
16	日本	第81回利付国債（5年）	0.800	2014/3/20	国債証券	501,000,000	101.39 101.56	507,959,370 508,835,640	2.75
17	日本	第303回利付国債（10年）	1.400	2019/9/20	国債証券	426,000,000	102.03 105.12	434,655,790 447,802,680	2.42
18	日本	第85回利付国債（5年）	0.700	2014/9/20	国債証券	314,000,000	101.55 101.49	318,870,140 318,662,900	1.72
19	日本	第311回利付国債（10年）	0.800	2020/9/20	国債証券	177,000,000	98.96 99.17	175,153,890 175,530,900	0.95

20	日本	第92回利付国債（20年）	2.100	2026/12/20	国債証券	101,000,000	103.42 108.10	104,454,610 109,179,990	0.59
21	日本	第37回利付国債（20年）	3.100	2017/9/20	国債証券	70,000,000	114.50 115.48	80,147,320 80,835,300	0.44
22	日本	第43回利付国債（20年）	2.900	2019/9/20	国債証券	41,000,000	114.08 116.76	46,771,980 47,872,010	0.26
投資比率：合計									98.82

（注1）投資有価証券の全銘柄を記載しております。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
国債証券	-	98.82
合計		99.82

（注）投資比率は、純資産総額に対する各種類の評価金額の比率であります。

3. ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (％)
1	日本	親投資 信託受 益証券	ステート・ストリート 外国株式インデックス ・マザー・ファンド		3,471,071,132	1.0060	3,492,069,432	0.8058	2,796,989,118	99.99
投資比率：合計									99.99	

（注1）投資有価証券は1銘柄です。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券		99.99
合計		99.99

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンド

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (％)
1	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	96,072	6,326	607,704,299	5,663	544,046,320	1.81
2	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	18,078	27,469	496,590,988	29,937	541,204,529	1.80
3	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・サー ビス	23,622	12,783	301,969,386	13,733	324,409,914	1.08
4	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	67,626	4,425	299,225,703	4,286	289,850,175	0.96
5	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サー ビス	148,162	2,029	300,676,161	1,951	289,025,910	0.96
6	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	39,256	7,662	300,769,140	7,235	284,016,904	0.94
7	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソ ナル用品	54,478	4,871	265,344,166	4,883	265,994,555	0.88
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテ クノロジー・ライフ サイエンス	53,543	4,773	255,558,181	4,898	262,250,133	0.87

9	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	115,538	2,230	257,706,400	2,211	255,406,685	0.85
10	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	206,976	1,536	317,922,340	1,216	251,614,306	0.84
11	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	347,794	796	276,954,668	614	213,608,313	0.71
12	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	40,169	5,026	201,895,126	5,293	212,601,763	0.71
13	アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	154,224	1,481	228,425,797	1,378	212,546,427	0.71
14	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,000,921	209	209,627,726	200	200,379,934	0.67
15	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	4,940	45,018	222,387,773	40,433	199,738,402	0.66
16	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	45,558	4,466	203,451,054	4,337	197,598,895	0.66
17	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	98,088	2,324	227,976,761	1,915	187,885,945	0.62
18	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	77,531	3,382	262,210,400	2,406	186,542,958	0.62
19	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	79,057	2,521	199,328,732	2,273	179,670,669	0.60
20	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	103,493	1,694	175,324,754	1,702	176,186,120	0.59
21	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	368,442	561	206,654,952	469	172,894,672	0.57
22	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	13,717	11,726	160,839,469	12,500	171,457,452	0.57
23	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	34,695	4,862	168,686,061	4,906	170,226,385	0.57
24	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	70,186	2,615	183,551,078	2,407	168,922,131	0.56
25	オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	62,694	3,339	209,354,464	2,634	165,133,287	0.55
26	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	100,735	1,488	149,920,374	1,603	161,430,114	0.54
27	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	55,193	2,817	155,475,096	2,848	157,164,689	0.52
28	アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,304	2,543	153,339,793	2,503	150,964,370	0.50
29	アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	37,314	4,154	154,984,302	3,980	148,525,932	0.49
30	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	30,873	4,912	151,655,119	4,797	148,090,278	0.49
									投資比率：合計	22.90

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 平成23年9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	11.43
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.79
	銀行	7.18
	素材	7.03
	資本財	6.93
	食品・飲料・タバコ	6.88
	ソフトウェア・サービス	5.77

電気通信サービス	4.38
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.34
各種金融	4.31
公益事業	4.04
保険	3.83
小売	2.72
ヘルスケア機器・サービス	2.66
食品・生活必需品小売り	2.35
メディア	2.34
家庭用品・パーソナル用品	1.82
運輸	1.66
消費者サービス	1.64
半導体・半導体製造装置	1.60
自動車・自動車部品	1.22
耐久消費財・アパレル	1.18
商業・専門サービス	0.77
不動産	0.61
小計	94.48
投資証券	1.71
合計	96.19

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

(注2) 平成23年9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

4. ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

順位	国/地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	日本	親投資信託受益証券	ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド		1,347,554,845	1.4458	1,948,371,355	1.4152	1,907,059,616	100.00
									投資比率：合計	100.00

(注1) 投資有価証券は1銘柄です。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券		100.00
合計		100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

順位	国/地域名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/11/15	30,000,000	8,314	2,494,058,395	8,305	2,491,365,681	1.08

2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2013/06/30	26,800,000	7,660	2,052,936,112	7,681	2,058,554,404	0.89
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2012/12/15	25,500,000	7,721	1,968,776,941	7,750	1,976,182,826	0.85
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	24,500,000	7,722	1,892,009,437	7,868	1,927,659,965	0.83
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	21,800,000	8,479	1,848,510,562	8,840	1,927,228,288	0.83
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	21,000,000	8,398	1,763,572,781	8,713	1,829,719,738	0.79
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2012/11/15	22,000,000	8,105	1,782,999,187	7,992	1,758,165,047	0.76
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	19,750,000	8,508	1,680,391,811	8,884	1,754,513,441	0.76
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	21,000,000	8,272	1,737,134,280	8,233	1,728,863,898	0.75
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2015/06/30	21,200,000	7,627	1,616,855,100	8,019	1,700,008,371	0.73
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/08/15	20,000,000	7,107	1,421,306,923	8,190	1,637,915,454	0.71
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2014/07/15	20,700,000	7,736	1,601,281,976	7,712	1,596,444,661	0.69
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2012/08/31	20,000,000	8,080	1,615,938,366	7,943	1,588,571,250	0.69
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11.250	2015/02/15	15,095,000	10,464	1,579,579,745	10,418	1,572,569,287	0.68
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2039/11/15	15,000,000	7,270	1,090,430,181	9,714	1,457,128,764	0.63
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2039/05/15	15,200,000	7,127	1,083,342,647	9,512	1,445,792,045	0.62
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	16,500,000	8,359	1,379,182,612	8,635	1,424,791,125	0.62
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/11/15	17,000,000	7,256	1,233,602,236	8,175	1,389,783,614	0.60
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2013/05/15	17,000,000	8,132	1,382,455,260	8,079	1,373,495,489	0.59
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	15,500,000	7,682	1,190,688,765	8,758	1,357,470,733	0.59
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	15,000,000	8,325	1,248,772,448	9,035	1,355,267,812	0.59
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	15,500,000	8,004	1,240,685,043	8,701	1,348,650,464	0.58
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2038/05/15	13,300,000	7,461	992,366,501	9,851	1,310,145,858	0.57
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.750	2017/05/15	12,000,000	10,339	1,240,651,994	10,874	1,304,822,759	0.56
25	イギリス	国債証券	UK GILT BOND	4.750	2038/12/07	9,000,000	12,497	1,124,712,162	14,442	1,299,750,747	0.56
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	14,000,000	8,553	1,197,472,290	9,224	1,291,409,317	0.56
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2014/04/30	16,000,000	7,779	1,244,700,185	7,957	1,273,156,500	0.55
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2018/04/30	15,300,000	7,771	1,188,979,230	8,283	1,267,297,565	0.55
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/10/31	15,000,000	7,859	1,178,852,472	8,115	1,217,297,812	0.53
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/08/31	15,000,000	7,888	1,183,170,598	8,096	1,214,423,437	0.52
										投資比率：合計	20.26

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 平成23年9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		98.34
合計		98.34

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

(注2) 平成23年9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

その他投資資産の主要なもの

1. ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)

該当事項はありません。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

種類	取引所	資産の名称	買建 売建	数量(枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	東京証券 取引所	東証株価指数先物 (2011年12月限)	買建	80	597,047,600	606,000,000	2.21

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する各取引の時価の比率であります。

(注2) 時価の算定方法

1. 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。
2. 先物取引の評価においては、取引所の発表する清算値段によっております。

2. ニッセイ国内債券インデックスS A (適格機関投資家限定)

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

3. ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンド

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	MINI S&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	155	8,921,332.16	8,961,325.00	686,885,561	2.28
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	76	1,533,430.00	1,672,760.00	174,151,043	0.58
	FTSE100INDEX	ロンドン国際金融先物 オプション取引所	買建	イギリス・ポ ンド	25	1,272,264.28	1,290,875.00	154,608,098	0.51
	S&P 60	モンリオール取引所	買建	カナダ・ドル	8	1,102,180.00	1,071,520.00	79,260,334	0.26
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリ ア・ドル	8	807,875.00	801,200.00	60,226,204	0.20
	FSMI INDEX	ユーレックス・チュー リッヒ取引所	買建	スイス・フラン	12	641,240.71	670,920.00	57,283,149	0.19

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額(平成23年9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています)の比率です。

（注２）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

（注３）先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

４．ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

該当事項はありません。

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

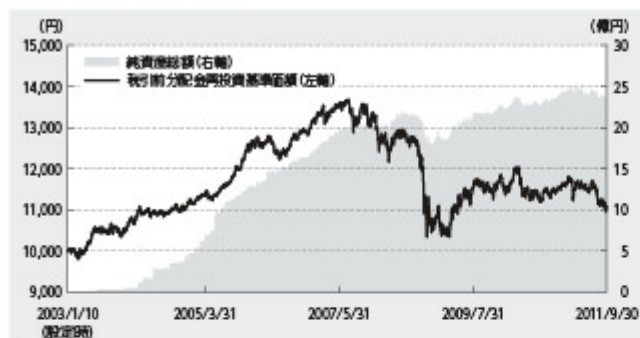
該当事項はありません。

〈参考情報〉

2011年9月末現在

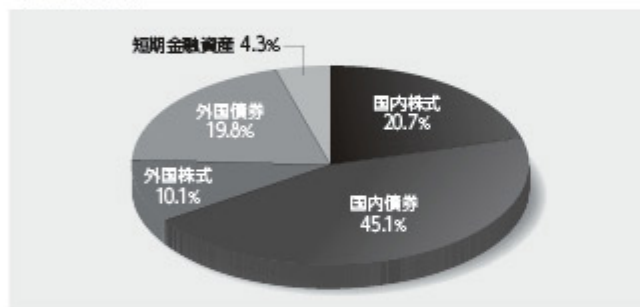
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

● 基準価額・純資産の推移



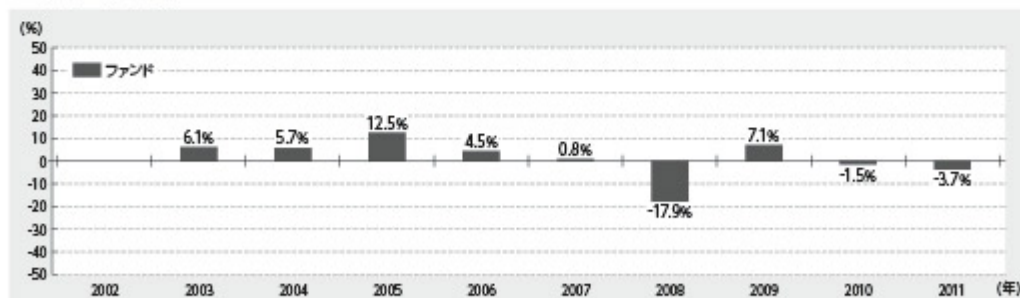
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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。
- ・2003年はファンド設定時から年末まで、2011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。

● 基準価額および純資産総額

基準価額	11,088円
純資産総額	23億円

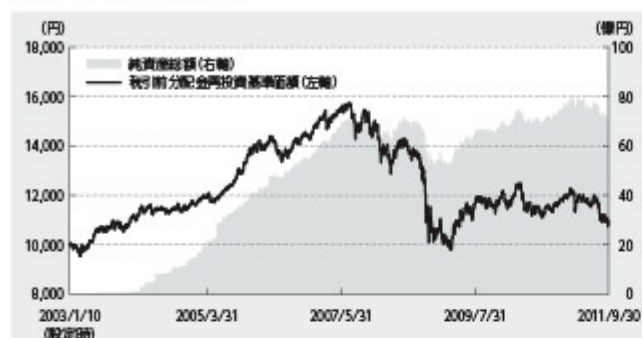
● 分配の推移 1万円当り(税引前)

期	日	金額
第4期	2007年2月21日	0円
第5期	2008年2月21日	0円
第6期	2009年2月23日	0円
第7期	2010年2月22日	0円
第8期	2011年2月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2011年9月末現在

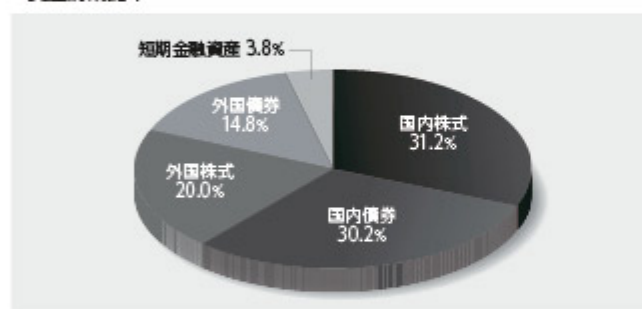
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

● 基準価額・純資産の推移



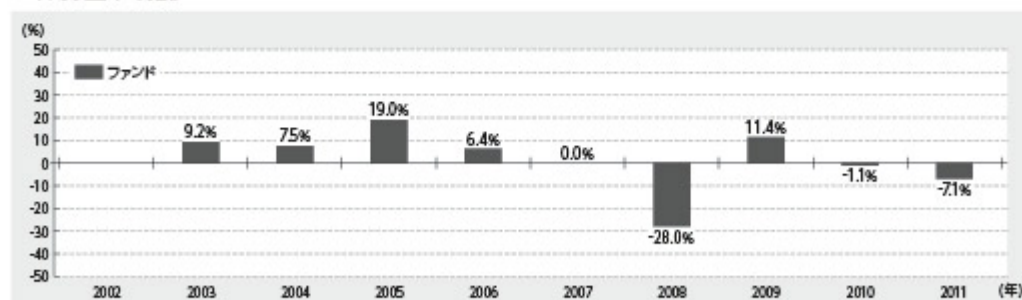
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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。
- ・2003年はファンド設定時から年末まで、2011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。

● 基準価額および純資産総額

基準価額	10,960円
純資産総額	71億円

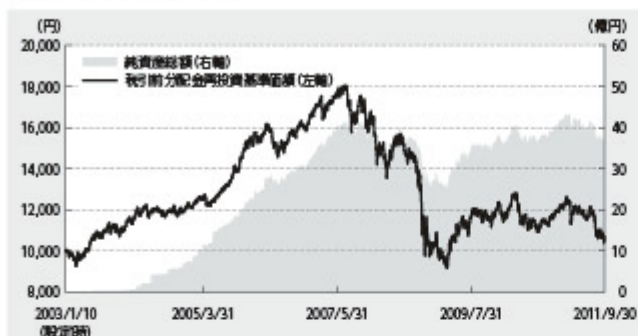
● 分配の推移 1万円当り(税引前)

第4期	2007年2月21日	0円
第5期	2008年2月21日	0円
第6期	2009年2月23日	0円
第7期	2010年2月22日	0円
第8期	2011年2月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2011年9月末現在

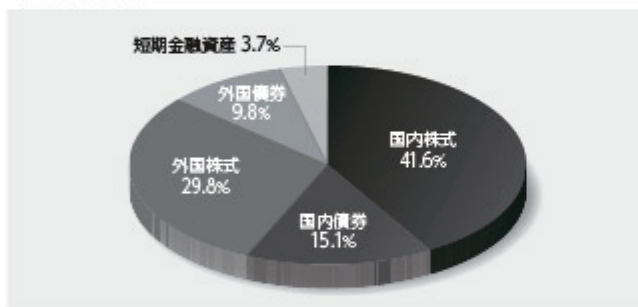
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

● 基準価額・純資産の推移



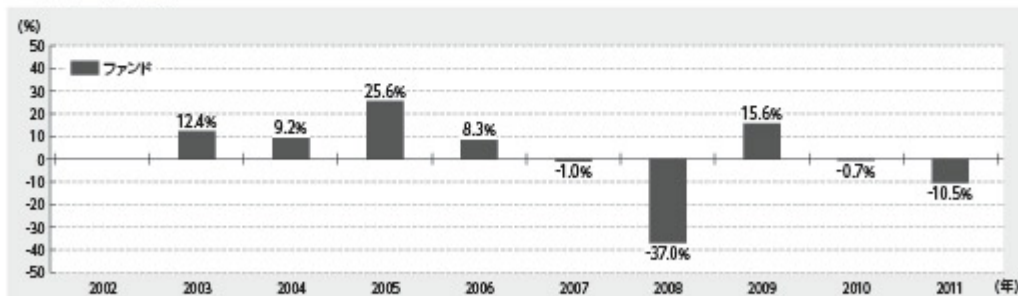
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

● 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)を再投資したもとして計算しております。
- ・2003年はファンド設定時から年末まで、2011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。

● 基準価額および純資産総額

基準価額	10,690円
純資産総額	37億円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

第4期	2007年2月21日	0円
第5期	2008年2月21日	0円
第6期	2009年2月23日	0円
第7期	2010年2月22日	0円
第8期	2011年2月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」に以下の内容が追加されます。

- 1) 各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) 各ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間計算期間（平成22年2月23日から平成22年8月22日まで）及び第9期中間計算期間（平成23年2月22日から平成23年8月21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ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】中間財務諸表

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 （平成22年8月22日現在）	第9期中間計算期間 （平成23年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	111,756,916	116,355,501
投資信託受益証券	2,188,716,189	2,259,485,958
流動資産合計	2,300,473,105	2,375,841,459
資産合計	2,300,473,105	2,375,841,459
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,254,449	227,585
未払受託者報酬	353,958	376,091
未払委託者報酬	1,002,984	1,065,701
その他未払費用	426,870	434,244
流動負債合計	4,038,261	2,103,621
負債合計	4,038,261	2,103,621
純資産の部		
元本等		
元本	2,012,974,793	2,114,559,067
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	283,460,051	259,178,771
純資産合計	2,296,434,844	2,373,737,838
負債純資産合計	2,300,473,105	2,375,841,459

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 （自平成22年2月23日 至平成22年8月22日）	第9期中間計算期間 （自平成23年2月22日 至平成23年8月21日）
営業収益		
受取配当金	13,289,785	16,101,663
受取利息	38,015	28,802
有価証券売買等損益	32,303,019	136,684,115
営業収益合計	18,975,219	120,553,650
営業費用		
受託者報酬	353,958	376,091
委託者報酬	1,002,984	1,065,701
その他費用	426,870	434,244
営業費用合計	1,783,812	1,876,036
営業利益又は営業損失（ ）	20,759,031	122,429,686
経常利益又は経常損失（ ）	20,759,031	122,429,686
中間純利益又は中間純損失（ ）	20,759,031	122,429,686
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（ ）	739,224	5,264,214
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	291,840,003	376,950,511
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,184,656	34,056,838
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	26,184,656	34,056,838
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,066,353	34,663,106
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,066,353	34,663,106
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	283,460,051	259,178,771

(3) 【中間注記表】

(中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項に関する注記)

項目	第8期中間計算期間 (自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)	第9期中間計算期間 (自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、中間計算期間末日に知りうる直近の日の前営業日の基準価額で評価しております。	投資信託受益証券 同左
2. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとしておりますが、前計算期間末日が休業日のため、当中間計算期間は平成22年2月23日から平成22年8月22日までとなっております。	-

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	2,012,974,793口	2,114,559,067口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1408円 (11,408円)	1.1226円 (11,226円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期中間計算期間(自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)

該当事項はありません。

第9期中間計算期間(自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
----	-----------------------------	-----------------------------

1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>1. 投資信託受益証券 （中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>1. 投資信託受益証券 同左</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(重要な後発事象に関する注記)

第8期中間計算期間 (自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)	第9期中間計算期間 (自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
期首元本額	1,934,636,363円	2,091,782,212円
期中追加設定元本額	164,548,152円	216,079,577円
期中一部解約元本額	86,209,722円	193,302,722円

2 有価証券関係

第8期中間計算期間（平成22年8月22日現在）

該当事項はありません。

第9期中間計算期間（平成23年8月21日現在）

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

第8期中間計算期間（平成22年8月22日現在）

該当事項はありません。

第9期中間計算期間（平成23年8月21日現在）

該当事項はありません。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】中間財務諸表
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 （平成22年8月22日現在）	第9期中間計算期間 （平成23年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	308,369,770	364,125,085
投資信託受益証券	6,723,036,849	6,910,406,520
流動資産合計	7,031,406,619	7,274,531,605
資産合計	7,031,406,619	7,274,531,605
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,471,292	2,629,484
未払受託者報酬	1,096,720	1,187,110
未払委託者報酬	3,107,479	3,363,581
その他未払費用	631,213	649,285
流動負債合計	8,306,704	7,829,460
負債合計	8,306,704	7,829,460
純資産の部		
元本等		
元本	6,148,793,033	6,511,879,290
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	874,306,882	754,822,855
純資産合計	7,023,099,915	7,266,702,145
負債純資産合計	7,031,406,619	7,274,531,605

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 （自平成22年2月23日 至平成22年8月22日）	第9期中間計算期間 （自平成23年2月22日 至平成23年8月21日）
営業収益		
受取配当金	30,607,312	38,716,182
受取利息	116,842	89,648
有価証券売買等損益	191,937,345	761,772,727
営業収益合計	161,213,191	722,966,897
営業費用		
受託者報酬	1,096,720	1,187,110
委託者報酬	3,107,479	3,363,581
その他費用	631,213	649,285
営業費用合計	4,835,412	5,199,976
営業利益又は営業損失（ ）	166,048,603	728,166,873
経常利益又は経常損失（ ）	166,048,603	728,166,873
中間純利益又は中間純損失（ ）	166,048,603	728,166,873
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（ ）	1,335,348	27,219,136
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	983,966,881	1,467,180,757
剰余金増加額又は欠損金減少額	92,204,908	109,095,193
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	92,204,908	109,095,193
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,480,956	120,505,358
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,480,956	120,505,358
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	874,306,882	754,822,855

(3) 【中間注記表】

(中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項に関する注記)

項目	第8期中間計算期間 (自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)	第9期中間計算期間 (自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、中間計算期間末日に知りうる直近の日の前営業日の基準価額で評価しております。	投資信託受益証券 同左
2. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとしておりますが、前計算期間末日が休業日のため、当中間計算期間は平成22年2月23日から平成22年8月22日までとなっております。	-

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	6,148,793,033口	6,511,879,290口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1422円 (11,422円)	1.1159円 (11,159円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期中間計算期間 (自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)

該当事項はありません。

第9期中間計算期間 (自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
----	-------------------------------	-------------------------------

1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>1. 投資信託受益証券 （中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>1. 投資信託受益証券 同左</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(重要な後発事象に関する注記)

第8期中間計算期間 (自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)	第9期中間計算期間 (自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
期首元本額	5,840,555,651円	6,459,025,690円
期中追加設定元本額	511,478,142円	587,107,346円
期中一部解約元本額	203,240,760円	534,253,746円

2 有価証券関係

第8期中間計算期間（平成22年8月22日現在）

該当事項はありません。

第9期中間計算期間（平成23年8月21日現在）

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

第8期中間計算期間（平成22年8月22日現在）

該当事項はありません。

第9期中間計算期間（平成23年8月21日現在）

該当事項はありません。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】中間財務諸表

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 （平成22年8月22日現在）	第9期中間計算期間 （平成23年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	182,651,142	202,498,373
投資信託受益証券	3,549,416,262	3,579,782,361
流動資産合計	3,732,067,404	3,782,280,734
資産合計	3,732,067,404	3,782,280,734
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,033,171	2,562,110
未払受託者報酬	585,914	629,138
未払委託者報酬	1,660,170	1,782,622
その他未払費用	504,191	518,589
流動負債合計	7,783,446	5,492,459
負債合計	7,783,446	5,492,459
純資産の部		
元本等		
元本	3,293,287,822	3,450,440,243
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	430,996,136	326,348,032
純資産合計	3,724,283,958	3,776,788,275
負債純資産合計	3,732,067,404	3,782,280,734

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 （自平成22年2月23日 至平成22年8月22日）	第9期中間計算期間 （自平成23年2月22日 至平成23年8月21日）
営業収益		
受取配当金	10,906,297	14,137,901
受取利息	63,847	47,497
有価証券売買等損益	152,535,975	589,276,841
営業収益合計	141,565,831	575,091,443
営業費用		
受託者報酬	585,914	629,138
委託者報酬	1,660,170	1,782,622
その他費用	504,191	518,589
営業費用合計	2,750,275	2,930,349
営業利益又は営業損失（ ）	144,316,106	578,021,792
経常利益又は経常損失（ ）	144,316,106	578,021,792
中間純利益又は中間純損失（ ）	144,316,106	578,021,792
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（ ）	3,141,478	25,609,805
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	537,253,487	899,871,874
剰余金増加額又は欠損金減少額	67,555,872	66,955,661
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	67,555,872	66,955,661
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,355,639	88,067,516
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	26,355,639	88,067,516
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	430,996,136	326,348,032

(3) 【中間注記表】

(中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項に関する注記)

項目	第8期中間計算期間 (自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)	第9期中間計算期間 (自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、中間計算期間末日に知りうる直近の日の前営業日の基準価額で評価しております。	投資信託受益証券 同左
2. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとしておりますが、前計算期間末日が休業日のため、当中間計算期間は平成22年2月23日から平成22年8月22日までとなっております。	-

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	3,293,287,822口	3,450,440,243口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1309円 (11,309円)	1.0946円 (10,946円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期中間計算期間 (自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)

該当事項はありません。

第9期中間計算期間 (自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
----	-------------------------------	-------------------------------

1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>1. 投資信託受益証券 （中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>1. 投資信託受益証券 同左</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(重要な後発事象に関する注記)

第8期中間計算期間 (自平成22年2月23日 至平成22年8月22日)	第9期中間計算期間 (自平成23年2月22日 至平成23年8月21日)
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第8期中間計算期間 (平成22年8月22日現在)	第9期中間計算期間 (平成23年8月21日現在)
期首元本額	3,098,476,228円	3,444,082,212円
期中追加設定元本額	345,025,317円	346,134,365円
期中一部解約元本額	150,213,723円	339,776,334円

2 有価証券関係

第8期中間計算期間（平成22年8月22日現在）

該当事項はありません。

第9期中間計算期間（平成23年8月21日現在）

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

第8期中間計算期間（平成22年8月22日現在）

該当事項はありません。

第9期中間計算期間（平成23年8月21日現在）

該当事項はありません。

[次へ](#)

< 参考 >

開示対象各ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）／（標準型）／（株式重視型））は、「ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）」、「ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」及び「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」の受益証券を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている投資信託受益証券は、すべて各投資信託の受益証券であります。

「ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）」及び「ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）」は、ニッセイアセットマネジメント株式会社の設定・運用する追加型証券投資信託であり、それらの計算期間は原則として、毎年3月11日から翌年の3月10日までであります。

開示対象各ファンドの中間計算期間末日（中間計算期間末日が休業日の場合、中間計算期間末日の知りうる直近の日）の前営業日（以下、「計算日」という。）における上記の各投資信託の状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

1. 「ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

	（平成22年8月19日現在）	（平成23年8月18日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,582,573	26,484,030
親投資信託受益証券	18,430,158,147	16,625,218,354
未収入金	12,218,142	5,068,325
流動資産合計	18,470,958,862	16,656,770,709
資産合計	18,470,958,862	16,656,770,709
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,885,667	4,759,417
未払受託者報酬	6,374,774	5,901,631
未払委託者報酬	22,311,813	20,655,790
その他未払費用	391,765	376,382
流動負債合計	40,964,019	31,693,220
負債合計	40,964,019	31,693,220
純資産の部		
元本等		
元本	21,018,187,000	20,475,117,275
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,588,192,157	3,850,039,786
純資産合計	18,429,994,843	16,625,077,489
負債純資産合計	18,470,958,862	16,656,770,709

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	(自平成22年3月11日 至平成22年8月19日)	(自平成23年3月11日 至平成23年8月18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、計算日の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、証券取引所の発表する計算日の清算値段によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18日現在)
1. 計算日における受益権総数	21,018,187,000口	20,475,117,275口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	2,588,192,157円	3,850,039,786円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8769円 (8,769円)	0.8120円 (8,120円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18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

<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>1. 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>1. 親投資信託受益証券 同左</p> <p>2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
<p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>同左</p>

(重要な後発事象に関する注記)

<p>(自平成22年3月11日 至平成22年8月19日)</p>	<p>(自平成23年3月11日 至平成23年8月18日)</p>
<p>該当事項はありません。</p>	<p>同左</p>

(その他の注記)

1 ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)の期首から計算日までの期間における元本額の変動

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18日現在)
期首	平成22年3月11日	平成23年3月11日
期首元本額	20,741,382,079円	20,488,170,086円
期首から計算日までの追加設定元本額	925,118,335円	1,417,071,273円
期首から計算日までの一部解約元本額	648,313,414円	1,430,124,084円

2 有価証券関係

(平成22年8月19日現在)

該当事項はありません。

(平成23年8月18日現在)

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

(平成22年8月19日現在)

該当事項はありません。

（平成23年8月18日現在）

該当事項はありません。

「ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）」は、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。同マザーファンドの計算日の状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（平成22年8月19日現在）	（平成23年8月18日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	406,792,767	665,924,954
株式	29,280,437,432	26,747,875,030
派生商品評価勘定	385,275	89,210
未収入金	-	31,704,674
未収配当金	24,032,825	26,962,075
前払金	9,455,000	1,765,000
差入委託証拠金	15,435,000	36,570,000
流動資産合計	29,736,538,299	27,510,890,943
資産合計	29,736,538,299	27,510,890,943
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,231,580	5,345,240
未払金	-	330,507,885
未払解約金	18,548,634	9,606,956
流動負債合計	23,780,214	345,460,081
負債合計	23,780,214	345,460,081
純資産の部		
元本等		
元本	40,130,294,736	39,487,524,913
剰余金		
剰余金又は欠損金（　）	10,417,536,651	12,322,094,051
純資産合計	29,712,758,085	27,165,430,862
負債純資産合計	29,736,538,299	27,510,890,943

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	（自平成22年3月11日 至平成22年8月19日）	（自平成23年3月11日 至平成23年8月18日）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、証券取引所における計算日の最終相場によっております。</p>	<p>株式 同左</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、証券取引所の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>本マザーファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>	<p>株価指数先物取引 同左</p> <p>同左</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式の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> <p>(2) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>	<p>(1) 受取配当金 同左</p> <p>(2) 派生商品取引等損益の計上基準 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18日現在)
1. 計算日における受益権総数	40,130,294,736口	39,487,524,913口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	10,417,536,651円	12,322,094,051円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7404円 (7,404円)	0.6879円 (6,879円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18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	<p>1. 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>2. デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「（その他の注記）」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>3. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>1. 株式 同左</p> <p>2. デリバティブ取引 同左</p> <p>3. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

（重要な後発事象に関する注記）

（自平成22年3月11日 至平成22年8月19日）	（自平成23年3月11日 至平成23年8月18日）
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）の期首から計算日までの期間における本マザーファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	（平成22年8月19日現在）	（平成23年8月18日現在）
----	----------------	----------------

期首	平成22年3月11日	平成23年3月11日
同期間の期首元本額	39,785,483,991円	38,879,765,123円
同期間中の追加設定元本額	2,652,062,574円	3,219,740,053円
同期間中の一部解約元本額	2,307,251,829円	2,611,980,263円
同期間末日の元本額	40,130,294,736円	39,487,524,913円
上記元本額の内訳		
ニッセイTOPIXオープン	10,330,358,728円	10,469,695,585円
ニッセイ国内株式インデックスSA（適格機関投資家限定）	24,892,163,894円	24,168,074,363円
ニッセイ日本バランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	214,039,688円	207,788,773円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	365,884,432円	317,070,881円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	309,801,265円	347,225,660円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	2,369,755,040円	2,376,042,069円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	1,648,291,689円	1,601,627,582円
合計	40,130,294,736円	39,487,524,913円

2 有価証券関係

（平成22年8月19日現在）

該当事項はありません。

（平成23年8月18日現在）

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

（平成22年8月19日現在）

株式関連

区分	種類	契約額等（円）	契約額等のうち 1年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場 取引	株価指数先物取引 買建	418,651,305	-	413,805,000	4,846,305
合計		418,651,305	-	413,805,000	4,846,305

（注1）時価の算定方法

1. 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。
2. 先物取引の評価においては、証券取引所の発表する計算日の清算値段によっております。

（注2）評価損益の算定方法

評価損益は、本マザーファンドの期首（平成22年2月23日）から計算日までの期間に対応するもので

あります。

（平成23年8月18日現在）

株式関連

区分	種類	契約額等（円）	契約額等のうち 1年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場 取引	株価指数先物取引 買建	419,706,030	-	414,450,000	5,256,030
合計		419,706,030	-	414,450,000	5,256,030

（注1）時価の算定方法

1. 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。
2. 先物取引の評価においては、証券取引所の発表する計算日の清算値段によっております。

（注2）評価損益の算定方法

評価損益は、本マザーファンドの期首（平成23年2月22日）から計算日までの期間に対応するものであります。

2. 「ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

	（平成22年8月19日現在）	（平成23年8月18日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,861,887	5,205,392
親投資信託受益証券	4,936,151,824	4,981,251,386
未収入金	62,421	62,692
流動資産合計	4,941,076,132	4,986,519,470
資産合計	4,941,076,132	4,986,519,470
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	675,106	723,311
未払委託者報酬	4,050,868	4,340,090
その他未払費用	228,949	233,890
流動負債合計	4,954,923	5,297,291
負債合計	4,954,923	5,297,291
純資産の部		
元本等		
元本	4,304,060,018	4,330,347,084
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	632,061,191	650,875,095
純資産合計	4,936,121,209	4,981,222,179
負債純資産合計	4,941,076,132	4,986,519,470

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	（自平成22年3月11日 至平成22年8月19日）	（自平成23年3月11日 至平成23年8月18日）
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、計算日の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成22年8月19日現在）	（平成23年8月18日現在）
1．計算日における受益権総数	4,304,060,018口	4,330,347,084口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1469円 （11,469円）	1.1503円 （11,503円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成22年8月19日現在）	（平成23年8月18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．親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 2．コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。	1．親投資信託受益証券 同左 2．コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

項目	（平成22年8月19日現在）	（平成23年8月18日現在）
----	----------------	----------------

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(重要な後発事象に関する注記)

(自平成22年3月11日 至平成22年8月19日)	(自平成23年3月11日 至平成23年8月18日)
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）の期首から計算日までの期間における元本額の変動

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18日現在)
期首	平成22年3月11日	平成23年3月11日
期首元本額	4,214,316,611円	4,725,602,670円
期首から計算日までの追加設定元本額	441,968,831円	360,731,180円
期首から計算日までの一部解約元本額	352,225,424円	755,986,766円

2 有価証券関係

(平成22年8月19日現在)

該当事項はありません。

(平成23年8月18日現在)

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

(平成22年8月19日現在)

該当事項はありません。

(平成23年8月18日現在)

該当事項はありません。

「ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）」は、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」の受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。同マザーファンドの計算日の状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	283,727,167	121,176,097
国債証券	29,322,457,479	18,208,616,360
未収利息	112,625,609	69,314,580
前払費用	7,094,222	6,570,860
流動資産合計	29,725,904,477	18,405,677,897
資産合計	29,725,904,477	18,405,677,897
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,491,144	7,606,554
流動負債合計	4,491,144	7,606,554
負債合計	4,491,144	7,606,554
純資産の部		
元本等		
元本	25,104,851,875	15,457,633,507
剰余金		
剰余金又は欠損金()	4,616,561,458	2,940,437,836
純資産合計	29,721,413,333	18,398,071,343
負債純資産合計	29,725,904,477	18,405,677,897

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自平成22年3月11日 至平成22年8月19日)	(自平成23年3月11日 至平成23年8月18日)
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日まで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>	<p>国債証券 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18日現在)

1. 計算日における受益権総数	25,104,851,875口	15,457,633,507口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1839円 (11,839円)	1.1902円 (11,902円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18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. 国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。	1. 国債証券 同左 2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(重要な後発事象に関する注記)

(自平成22年3月11日 至平成22年8月19日)	(自平成23年3月11日 至平成23年8月18日)
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

- 1 ニッセイ国内債券インデックスS A (適格機関投資家限定)の期首から計算日までの期間における本マザーファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(平成22年8月19日現在)	(平成23年8月18日現在)

期首	平成22年3月11日	平成23年3月11日
同期間の期首元本額	24,963,282,450円	25,950,746,670円
同期間中の追加設定元本額	1,014,533,927円	937,547,728円
同期間中の一部解約元本額	872,964,502円	11,430,660,891円
同期間末日の元本額	25,104,851,875円	15,457,633,507円
上記元本額の内訳		
ニッセイバランスポートフォリオ	14,438,531,778円	4,442,852,863円
ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）	4,169,399,294円	4,185,222,136円
DCニッセイ国内債券インデックス	3,395,983,969円	3,899,282,999円
ニッセイ日本バランス（標準型）S A（適格機関投資家限定）	135,710,780円	122,937,011円
ニッセイ日本バランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	124,910,610円	100,989,316円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（債券重視型）S A（適格機関投資家限定）	536,936,189円	562,472,746円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（標準型）S A（適格機関投資家限定）	1,742,082,305円	1,633,542,231円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	561,296,950円	510,334,205円
合計	25,104,851,875円	15,457,633,507円

2 有価証券関係

（平成22年8月19日現在）

該当事項はありません。

（平成23年8月18日現在）

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

（平成22年8月19日現在）

該当事項はありません。

（平成23年8月18日現在）

該当事項はありません。

「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」及び「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の設定・運用する追加型証券投資信託であり、それらの計算期間は原則として、2月21日から翌年の2月20日までであります。

開示対象である各ファンドの主要な投資対象としての上記各投資信託の中間計算期間末日の状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

3. 「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」の状況

(1) 中間貸借対照表（単位：円）

区 分	注記 番号	前中間計算期間末 (平成22年 8月22日現在)	当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,123,960	4,715,413
親投資信託受益証券		2,655,995,179	2,786,266,272
未収入金		400,000	
未収利息		7	9
流動資産合計		2,660,519,146	2,790,981,694
資産合計		2,660,519,146	2,790,981,694
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬		867,895	926,414
未払委託者報酬		3,471,549	3,705,629
流動負債合計		4,339,444	4,632,043
負債合計		4,339,444	4,632,043
純資産の部			
元本等			
元本	1	3,385,304,958	3,700,088,067
剰余金			
中間剰余金又は中間欠損金()	3	729,125,256	913,738,416
(分配準備積立金)		(345,266,064)	(333,127,096)
元本等合計		2,656,179,702	2,786,349,651
純資産合計		2,656,179,702	2,786,349,651
負債純資産合計		2,660,519,146	2,790,981,694

(2) 中間損益及び剰余金計算書 (単位:円)

区 分	注記 番号	前中間計算期間 自平成22年 2月23日 至平成22年 8月22日	当中間計算期間 自平成23年 2月22日 至平成23年 8月21日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		661	776
有価証券売買等損益		251,419,133	681,766,901
営業収益合計		251,418,472	681,766,125
営業費用			
受託者報酬		867,895	926,414
委託者報酬		3,471,549	3,705,629
営業費用合計		4,339,444	4,632,043
営業損失()		255,757,916	686,398,168
経常損失()		255,757,916	686,398,168
中間純損失()		255,757,916	686,398,168
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()		2,099,636	18,537,964
期首剰余金又は期首欠損金()		441,390,302	147,326,993
剰余金増加額又は欠損金減少額		54,418,076	16,850,104

中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	54,418,076	16,850,104
剰余金減少額又は欠損金増加額	84,295,478	115,401,323
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	84,295,478	115,401,323
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	729,125,256	913,738,416

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前中間計算期間 自 平成22年 2月23日 至 平成22年 8月22日	当中間計算期間 自 平成23年 2月22日 至 平成23年 8月21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、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。	親投資信託受益証券 同左
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 平成22年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成22年2月23日から平成22年8月22日までとなっております。	計算期間 平成23年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成23年2月22日から平成23年8月21日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前中間計算期間末 (平成22年 8月22日現在)	当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在)
1 期首元本額	3,210,327,913円	3,292,074,800円
期中追加設定元本額	565,295,483円	763,401,332円
期中一部解約元本額	390,318,438円	355,388,065円
2 中間計算期間末日における受益権の総数	3,385,304,958口	3,700,088,067口
3 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は729,125,256円です。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は913,738,416円です。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間（自 平成22年2月23日 至 平成22年8月22日）

該当する事項はありません。

当中間計算期間（自 平成23年2月22日 至 平成23年8月21日）

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	中間貸借対照表計上額は期末時価を計上しているため、その差額は ありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期 間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該 金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記 載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。
3 金融商品の時価等に関する事 項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がな い場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額 の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券関係に関する注記）

前中間計算期間末（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

当中間計算期間末（平成23年8月21日現在）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

前中間計算期間末（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

当中間計算期間末（平成23年8月21日現在）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前中間計算期間末 (平成22年 8月22日現在)	当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在)
1口当たり純資産額	0.7846 円	0.7530 円
(1万口当たり純資産額)	(7,846 円)	(7,530 円)

< 参考 >

当ファンドは「ステート・ストリート外国株式インデックス・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。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（1）貸借対照表（単位：円）

区 分	注記 番号	（平成22年 8月22日現在）	（平成23年 8月21日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		595,951,453	928,981,784
コール・ローン		6,186,866	5,006,062
株式		40,461,712,755	24,793,667,091
投資証券		710,381,548	460,333,671
派生商品評価勘定		5,949,715	5,240,851
未収入金		620,722	200,880
未収配当金		90,685,807	51,380,395
未収利息		11	9
差入委託証拠金		142,714,534	266,422,126
流動資産合計		42,014,203,411	26,511,232,869
資産合計		42,014,203,411	26,511,232,869
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,249,046	116,902,681
未払解約金		400,000	
流動負債合計		7,649,046	116,902,681
負債合計		7,649,046	116,902,681
純資産の部			
元本等			
元本	1	49,315,926,390	32,184,163,944
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	3	7,309,372,025	5,789,833,756
元本等合計		42,006,554,365	26,394,330,188
純資産合計		42,006,554,365	26,394,330,188
負債純資産合計		42,014,203,411	26,511,232,869

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成22年 2月23日 至 平成22年 8月22日	自 平成23年 2月22日 至 平成23年 8月21日
1 有価証券の評価基準及び評価 方法	株式、投資証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、金融商品取引所 又は店頭市場における計算期間末 日の最終相場（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。	株式、投資証券 同左

2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として計算期間末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つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <p>為替予約取引 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、原則として計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>	<p>先物取引 同左</p> <p>為替予約取引 同左</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式及び投資証券の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、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>	<p>受取配当金 同左</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

区分	（平成22年 8月22日現在）	（平成23年 8月21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	36,509,278,699円	21,138,250,567円
同期中における追加設定元本額	23,739,770,518円	12,322,606,380円
同期中における一部解約元本額	10,933,122,827円	1,276,693,003円
同中間期末における元本の内訳 ファンド名		
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	3,118,097,182円	3,397,471,373円
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド（年金1） 適格機関投資家限定	1,525,422,858円	1,467,080,381円
ステート・ストリート世界株式インデックス・ファンド（為替ヘッジ付き）＜適格機関投資家限定＞	3,800,136,575円	5,029,768,160円
ステート・ストリート世界株式インデックス・ファンドL＜適格機関投資家限定＞	38,028,639,312円	15,304,745,353円
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド／為替ヘッジ付き（年金）＜適格機関投資家限定＞	2,227,892,898円	2,173,834,724円
ステート・ストリート世界株式インデックス・ファンド＜適格機関投資家限定＞	615,737,565円	601,763,783円
ステート・ストリート全世界株式インデックス・ファンド（年金）＜適格機関投資家限定＞	円	4,209,500,170円
計	49,315,926,390円	32,184,163,944円
2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	49,315,926,390口	32,184,163,944口
3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,309,372,025円です。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,789,833,756円です。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	（平成23年 8月21日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は期末時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>
---------------------------	---

（有価証券関係に関する注記）

（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

（平成23年8月21日現在）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（単位：円）

区分	種類	（平成22年 8月22日現在）			
		契約額等		時価	評価損益
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	446,097,253		443,721,747	2,375,506
	S&P 60	55,990,485		55,799,122	191,363
	SPI 200	42,132,593		42,374,242	241,649
	FTSE100INDEX	109,658,885		110,936,377	1,277,492
	FSMI INDEX	47,187,269		46,768,503	418,766
	EURO STOXX 50	122,745,685		122,912,848	167,163
	合計	823,812,170		822,512,839	1,299,331

（単位：円）

区分	種類	（平成23年 8月21日現在）			
		契約額等		時価	評価損益
		うち1年超			

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	667,861,615		615,225,870	52,635,745
	S&P 60	90,476,484		86,394,363	4,082,121
	SPI 200	61,987,613		58,807,586	3,180,027
	FTSE100INDEX	155,845,797		141,636,211	14,209,586
	FSMI INDEX	67,524,079		60,131,093	7,392,986
	EURO STOXX 50	192,714,346		162,552,981	30,161,365
合計	1,236,409,934		1,124,748,104	111,661,830	

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末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。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成22年 8月22日現在)	(平成23年 8月21日現在)
本報告書における開示対象ファンドの 中間計算期間末日における当該親投資 信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8518 円 (8,518 円)	0.8201 円 (8,201 円)

4. 「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」の状況

(1) 中間貸借対照表 (単位:円)

区分	注記 番号	前中間計算期間末 (平成22年 8月22日現在)	当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,557,786	2,733,399
親投資信託受益証券		1,887,430,357	1,945,760,655
未収利息		4	5
流動資産合計		1,889,988,147	1,948,494,059
資産合計		1,889,988,147	1,948,494,059
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬		392,156	422,568
未払委託者報酬		2,058,792	2,218,430
流動負債合計		2,450,948	2,640,998
負債合計		2,450,948	2,640,998

純資産の部			
元本等			
元本	1	1,508,470,587	1,633,812,035
剰余金			
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		379,066,612	312,041,026
（分配準備積立金）		(159,345,780)	(130,831,181)
元本等合計		1,887,537,199	1,945,853,061
純資産合計		1,887,537,199	1,945,853,061
負債純資産合計		1,889,988,147	1,948,494,059

(2) 中間損益及び剰余金計算書（単位：円）

区 分	注記 番号	前中間計算期間	当中間計算期間
		自 平成22年 2月23日 至 平成22年 8月22日	自 平成23年 2月22日 至 平成23年 8月21日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		443	401
有価証券売買等損益		85,669,427	21,850,616
営業収益合計		85,668,984	21,851,017
営業費用			
受託者報酬		392,156	422,568
委託者報酬		2,058,792	2,218,430
営業費用合計		2,450,948	2,640,998
営業利益又は営業損失（ ）		88,119,932	19,210,019
経常利益又は経常損失（ ）		88,119,932	19,210,019
中間純利益又は中間純損失（ ）		88,119,932	19,210,019
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		1,950,509	989,933
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		424,768,877	305,793,633
剰余金増加額又は欠損金減少額		56,488,907	50,396,783
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		56,488,907	50,396,783
剰余金減少額又は欠損金増加額		16,021,749	64,349,342
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		16,021,749	64,349,342
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		379,066,612	312,041,026

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成22年 2月23日 至 平成22年 8月22日	自 平成23年 2月22日 至 平成23年 8月21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、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。	親投資信託受益証券 同左
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 平成22年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成22年2月23日から平成22年8月22日までとなっております。	計算期間 平成23年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成23年2月22日から平成23年8月21日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	前中間計算期間末 (平成22年 8月22日現在)	当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在)
1 期首元本額	1,370,084,849円	1,723,893,652円
期中追加設定元本額	190,314,495円	273,558,970円
期中一部解約元本額	51,928,757円	363,640,587円
2 中間計算期間末日における受益権の総数	1,508,470,587口	1,633,812,035口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間（自 平成22年2月23日 至 平成22年8月22日）

該当する事項はありません。

当中間計算期間（自 平成23年2月22日 至 平成23年8月21日）

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	中間貸借対照表計上額は期末時価を計上しているため、その差額は ありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期 間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該 金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載し ております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
---------------------------	---

（有価証券関係に関する注記）

前中間計算期間末（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

当中間計算期間末（平成23年8月21日現在）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

前中間計算期間末（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

当中間計算期間末（平成23年8月21日現在）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前中間計算期間末 （平成22年 8月22日現在）	当中間計算期間末 （平成23年 8月21日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2513 円 （12,513 円）	1.1910 円 （11,910 円）

<参考>

当ファンドは「ステート・ストリート外国債券インデックス・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。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（1）貸借対照表（単位：円）

区 分	注記 番号	（平成22年 8月22日現在）	（平成23年 8月21日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		1,853,751,646	535,208,495
コール・ローン		398,766,741	334,756,843
国債証券		300,321,783,566	241,888,440,637
派生商品評価勘定			280,000
未収入金			1,155,508,558
未収利息		3,291,710,853	2,624,848,180
前払費用		182,852,528	197,749,358
流動資産合計		306,048,865,334	246,736,792,071
資産合計		306,048,865,334	246,736,792,071
負債の部			

流動負債			
派生商品評価勘定			280,280
未払金			1,155,058,568
未払解約金		259,857,324	486,268,656
流動負債合計		259,857,324	1,641,607,504
負債合計		259,857,324	1,641,607,504
純資産の部			
元本等			
元本	1	206,123,607,931	167,480,256,837
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		99,665,400,079	77,614,927,730
元本等合計		305,789,008,010	245,095,184,567
純資産合計		305,789,008,010	245,095,184,567
負債純資産合計		306,048,865,334	246,736,792,071

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成22年 2月23日 至 平成22年 8月22日	自 平成23年 2月22日 至 平成23年 8月21日
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左
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、原則として計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	為替予約取引 同左

3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>
---------------------------	---	------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成22年 8月22日現在)	(平成23年 8月21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	418,555,598,568円	176,531,085,978円
同期中における追加設定元本額	17,761,876,840円	11,256,171,483円
同期中における一部解約元本額	230,193,867,477円	20,307,000,624円
同中間期末における元本の内訳 ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	3,790,380,283円	4,337,749,818円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	円	2,534,818円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	1,272,282,007円	1,329,616,411円
ステート・ストリート海外国債インデックス・ファンド 適格機関投資家限定	1,739,247,853円	1,708,081,943円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き(年金1) <適格機関投資家限定>	2,960,110,191円	3,427,501,877円
ステート・ストリート外国債券パッシブ・ファンド <適格機関投資家限定>	34,913,467,088円	33,484,691,677円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30A <適格機関投資家限定>	141,746,402円	140,895,940円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30B <適格機関投資家限定>	12,161,166,450円	12,114,842,987円
ステート・ストリート・バランスファンドVA40A <適格機関投資家限定>	9,947,667円	9,969,117円
ステート・ストリート・バランスファンドVA40B <適格機関投資家限定>	101,887,681円	104,042,774円

ステート・ストリート・バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	16,694,322円	18,187,311円
ステート・ストリート・バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	20,563,070,434円	19,881,990,191円
ステート・ストリート・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	54,228,890,481円	円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	3,374,958,003円	3,119,352,547円
ステート・ストリート・バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	93,898,711円	93,932,635円
ステート・ストリート・バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	12,709,265,715円	12,335,480,979円
ステート・ストリート・バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	3,498,243,202円	3,343,899,678円
ステート・ストリート・バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	109,892,707円	110,266,878円
ステート・ストリート4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	3,683,006,550円	3,538,405,286円
ステート・ストリート4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	9,717,034,849円	9,597,911,298円
ステート・ストリート4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	3,485,359,658円	3,466,567,376円
ステート・ストリート・バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	10,671,687,081円	9,923,001,457円
ステート・ストリート・バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	1,650,355,181円	1,652,612,802円
ステート・ストリート世界4資産バランスVA45<適格機関投資家限定>	2,493,468,936円	2,433,413,069円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	2,750,142,508円	5,961,012,826円
ステート・ストリート世界4資産バランスVA20<適格機関投資家限定>	223,877,594円	212,962,973円
ステート・ストリート・グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	241,853,971円	241,986,991円
ステート・ストリート・グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	171,420,345円	164,302,634円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	72,394,728円	120,605,623円
ステート・ストリート4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	188,564,087円	185,143,510円
ステート・ストリート・バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	1,858,117,521円	1,758,499,904円
ステート・ストリート・バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	17,547,651円	17,502,816円
ステート・ストリート・バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	12,864,787円	12,965,261円

ステート・ストリート・バランスファン ドVA50D<適格機関投資家限定>	1,011,132円	105,337円
ステート・ストリート外国債券インデッ クス・ファンドVA3<適格機関投資家 限定>	9,592,930,678円	23,890,048,933円
ステート・ストリート外国債券インデッ クス・ファンドA<適格機関投資家限定 >	1,317,178,235円	813,104,201円
ステート・ストリート4資産インデック スバランスVA20<適格機関投資家限 定>	1,658,584,778円	2,463,042,800円
ステート・ストリート世界分散ファンド VA25A<適格機関投資家限定>	2,748,049,514円	4,427,940,915円
ステート・ストリート外国債券インデッ クス・ファンドA/為替ヘッジ付き<適 格機関投資家限定>	1,882,662,862円	1,035,721,140円
ステート・ストリート4資産インデック スバランスVA30<適格機関投資家限 定>	186,453円	194,498円
ステート・ストリート4資産インデック スバランスVA40<適格機関投資家限 定>	159,635円	167,606円
計	206,123,607,931円	167,480,256,837円
2 本報告書における開示対象ファンドの中 間計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	206,123,607,931円	167,480,256,837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

区分	(平成23年 8月21日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこ れらの差額	貸借対照表計上額は期末時価を計上しているため、その差額はあり ません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期 間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該 金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載 しております。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載して おります。

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	---

（有価証券関係に関する注記）

（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

（平成23年8月21日現在）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

（単位：円）

区分	種類	（平成23年 8月21日現在）			
		契約額等		時価	評価損益
		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	138,168,000		138,330,000	162,000
	カナダ・ドル	14,732,220		14,734,500	2,280
	イギリス・ポンド	25,332,000		25,340,000	8,000
	ユーロ	143,315,000		143,143,000	172,000
合計		321,547,220		321,547,500	280

（注）1．時価の算定方法

(1) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末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。

計算期間末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、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、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ております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

- 2．換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 4．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成22年 8月22日現在）	（平成23年 8月21日現在）
本報告書における開示対象ファンドの 中間計算期間末日における当該親投資 信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4835 円 （14,835 円）	1.4634 円 （14,634 円）

2【ファンドの現況】

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

【純資産額計算書】

「債券重視型」

（平成23年9月30日現在）

資産総額	2,368,970,258 円
負債総額	3,911,425 円
純資産総額（ - ）	2,365,058,833 円
発行済数量	2,132,920,041 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	11,088 円

「標準型」

（平成23年9月30日現在）

資産総額	7,179,118,097 円
負債総額	4,828,290 円
純資産総額（ - ）	7,174,289,807 円
発行済数量	6,546,009,063 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	10,960 円

「株式重視型」

（平成23年9月30日現在）

資産総額	3,704,454,456 円
負債総額	3,575,492 円
純資産総額（ - ）	3,700,878,964 円
発行済数量	3,461,896,101 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	10,690 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

(1) 資本金の額

平成23年9月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間ににおける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

平成23年9月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです

(ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます)。

種類	ファンド数(本)	純資産総額合計額 (単位:億円)
追加型株式投資信託	151	18,032
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	1	15
単位型公社債投資信託	0	0
合計	152	18,047

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

3【委託会社等の経理状況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」について以下の通り記載内容を訂正いたします。

1.財務諸表の作成方法について

委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条および「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）に基づいて作成しております。

なお、第15期事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）は改正前の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき、第16期事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）は改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第15期事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）及び第16期事業年度（自平成22年4月1日 至平成23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)

	第15期 (平成22年3月31日現在)		第16期 (平成23年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		7,338,891		6,270,894
有価証券		7,509,155		11,023,094
前払費用	1	167,143	1	195,613
未収委託者報酬		1,639,083		1,751,247
未収運用受託報酬	1	621,865	1	656,202
未収投資助言報酬	1	176,080	1	171,421
未収収益		26,952		-
未収金		9,402		-
貯蔵品		13,545		-
繰延税金資産		253,992		295,260
その他		68		64,039
流動資産合計		17,756,180		20,427,773
固定資産				
有形固定資産				
建物	2	158,855	2	133,329
車両		-	2	5,095
器具備品	2	163,773	2	179,790
有形固定資産合計		322,629		318,215

無形固定資産			
電信加入権		292	-
電話加入権		7,942	-
ソフトウェア		1,516,892	1,372,451
ソフトウェア仮勘定		49,810	51,575
その他		-	8,203
無形固定資産合計		1,574,938	1,432,230
投資その他の資産			
投資有価証券		18,457,108	16,986,491
差入保証金		-	1 284,824
長期差入保証金	1	282,326	-
預託金		458	-
繰延税金資産		665,854	500,589
その他		-	17
投資その他の資産合計		19,405,748	17,771,923
固定資産合計		21,303,315	19,522,370
資産合計		39,059,496	39,950,144
負債の部			
流動負債			
預り金		29,359	28,412
未払収益分配金		5,024	4,324
未払償還金		159,114	151,440
未払手数料	1	565,051	1 683,709
未払運用委託報酬		438,086	391,985
未払投資助言報酬		100,080	106,084
その他未払金	1	170,412	1 187,916
未払費用	1	53,471	1 119,099
未払法人税等		71,382	145,709
未払消費税等		22,816	-
賞与引当金		502,405	552,829
その他		12,777	42,559
流動負債合計		2,129,982	2,414,070
固定負債			
退職給付引当金		537,616	644,223
役員退職慰労引当金		12,962	11,275
その他		-	1 66,068
固定負債合計		550,578	721,566
負債合計		2,680,560	3,135,637
純資産の部			
株主資本			
資本金		10,000,000	10,000,000
資本剰余金			
資本準備金		8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840	8,281,840
利益剰余金			
利益準備金		139,807	139,807

その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000
繰越利益剰余金	17,323,750	17,625,364
利益剰余金合計	18,003,557	18,305,171
株主資本合計	36,285,397	36,587,011
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	93,537	227,494
評価・換算差額等合計	93,537	227,494
純資産合計	36,378,935	36,814,506
負債・純資産合計	39,059,496	39,950,144

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,527,251	11,004,207
運用受託報酬	3,551,530	3,873,347
投資助言報酬	780,375	751,384
業務受託料	-	47,100
その他営業収益	47,100	-
営業収益計	15,906,257	15,676,039
営業費用		
支払手数料	4,836,212	4,548,772
広告宣伝費	20,846	110,792
公告費	-	466
受益証券発行費	6,873	-
調査費	2,876,269	2,708,450
支払運用委託報酬	1,628,406	1,442,927
支払投資助言報酬	409,100	448,879
委託調査費	-	20,521
調査費	838,762	796,121
委託計算費	106,973	104,902
営業雑経費	454,818	543,623
通信費	58,544	57,003
印刷費	177,070	175,972
協会費	17,981	17,084
販売事務費	24,802	-
その他営業雑経費	176,419	293,563
営業費用計	8,301,993	8,017,006
一般管理費		
役員報酬	1 60,906	1 62,167
給料・手当	3,003,448	2,985,814
賞与引当金繰入額	489,537	547,443
賞与	240,551	256,821

福利厚生費		501,440		550,141
海外派遣関係費		89,982		-
退職給付費用		109,004		163,211
退職給付負担金		64,509		-
役員退職慰労引当金繰入額		4,600		5,550
役員退職慰労金		-		637
その他人件費		6,257		135,147
不動産賃借料		662,795		635,759
その他不動産経費		-		38,835
交際費		17,004		14,220
旅費交通費		69,949		87,941
固定資産減価償却費		604,130		627,055
租税公課		79,700		77,387
業務委託費		156,825		183,393
器具備品賃借料		4,057		-
器具備品費		152,994		178,045
保守料		-		92,961
保険料		-		63,246
寄付金		-		820
諸経費		252,151		39,883
一般管理費計		6,569,846		6,746,486
営業利益		1,034,417		912,546
営業外収益				
受取利息		7,927		3,284
有価証券利息		127,716		107,994
受取配当金		88,280		102,558
雑収入		14,354		-
その他営業外収益		-		22,945
営業外収益計		238,280		236,783
営業外費用				
為替差損		1,142		9,852
雑損失		6,007		-
その他営業外費用		-		15,292
営業外費用計		7,150		25,144
経常利益		1,265,547		1,124,185
特別利益				
投資有価証券売却益		123,026		35,991
投資有価証券償還益		32,782		351
事故受取保険金		-	3	5,462
前期支払投資助言報酬戻入益		25,605		-
前期支払運用委託報酬戻入益		31,404		-
役員退職慰労引当金戻入益		583		-
特別利益計		213,401		41,804
特別損失				
投資有価証券売却損		424,493		17,676
投資有価証券償還損		54,263		355,993
投資有価証券評価損		118,045		5,706
固定資産除却損	4	3,290	4	16,762
事故損失賠償金	2	478	2	22,343
その他特別損失		230		-

特別損失計	600,801	418,482
税引前当期純利益	878,147	747,507
法人税、住民税及び事業税	337,932	272,647
過年度法人税等	27,704	-
法人税等還付額	35,406	-
法人税等調整額	43,138	37,686
法人税等合計	373,369	310,333
当期純利益	504,778	437,174

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第16期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	10,000,000	10,000,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,281,840	8,281,840
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計		
前期末残高	8,281,840	8,281,840
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	139,807	139,807
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	120,000	120,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	120,000	120,000
研究開発積立金		
前期末残高	70,000	70,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	70,000	70,000
別途積立金		

前期末残高	350,000	350,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	350,000	350,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	16,954,532	17,323,750
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	504,778	437,174
当期変動額合計	369,218	301,614
当期末残高	17,323,750	17,625,364
利益剰余金合計		
前期末残高	17,634,339	18,003,557
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	504,778	437,174
当期変動額合計	369,218	301,614
当期末残高	18,003,557	18,305,171
株主資本合計		
前期末残高	35,916,179	36,285,397
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	504,778	437,174
当期変動額合計	369,218	301,614
当期末残高	36,285,397	36,587,011
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	1,394,911	93,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,488,449	133,956
当期変動額合計	1,488,449	133,956
当期末残高	93,537	227,494
評価・換算差額等合計		
前期末残高	1,394,911	93,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,488,449	133,956
当期変動額合計	1,488,449	133,956
当期末残高	93,537	227,494
純資産合計		
前期末残高	34,521,267	36,378,935
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	504,778	437,174
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,488,449	133,956
当期変動額合計	1,857,668	435,570
当期末残高	36,378,935	36,814,506

（重要な会計方針）

第15期 （自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日）	第16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>なお、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の財務諸表を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>有形固定資産 定率法によっております。なお主な耐用年数は、建物3～15年、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> <p>3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p> <p>外貨建金銭債権債務は期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>4. 引当金の計上基準</p> <p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当事業年度末在籍者に対する支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>満期保有目的の債券 同左</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 同左</p> <p>時価のないもの 同左</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>有形固定資産 定率法によっております。主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年あります。</p> <p>無形固定資産 同左</p> <p>3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p> <p>同左</p> <p>4. 引当金の計上基準</p> <p>賞与引当金 同左</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に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額(簡便法により自己都合退職による期末要支給額の100%)を計上しております。なお受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</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> <p>5. リース取引の処理方法 平成19年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>6. 消費税及び地方消費税の会計処理 税抜方式によっております。</p>	<p>退職給付引当金 同左</p> <p>役員退職慰労引当金 同左</p> <p>5. リース取引の処理方法 同左</p> <p>6. 消費税及び地方消費税の会計処理 同左</p>
---	--

(表示方法の変更)

<p>第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)</p>	<p>第16期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)</p>
<p>(貸借対照表)</p>	<p>(貸借対照表) 重要性の観点等から、表示方法を次のように変更することに致しました。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・前期まで区分掲記していた「未収収益」「未収金」「貯蔵品」は、流動資産の「その他」に含めて表示しております。 ・前期まで区分掲記していた「電信加入権」「電話加入権」は、無形固定資産の「その他」に含めて表示しております。 ・前期まで「長期差入保証金」として表示していたものは、「差入保証金」として表示しております。 ・前期まで区分掲記していた「預託金」は、投資その他の資産の「その他」に含めて表示しております。 ・前期まで区分掲記していた「未払消費税等」は、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

<p>(損益計算書)</p> <p>前期において「退職給付引当金繰入額」として表示していたものは、「退職給付費用」として表示しております。</p>	<p>(損益計算書)</p> <p>重要性の観点等から、表示方法を次のように変更することに致しました。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・前期まで「その他営業収益」として表示していたものは、「業務受託料」として表示しております。 ・前期まで区分掲記していた「受益証券発行費」「販売事務費」は、「その他営業雑経費」に含めて表示しております。 ・前期まで「調査費」に含めて表示していた「委託調査費」は、区分掲記しております。 ・前期まで区分掲記していた「海外派遣関係費」は、「その他人件費」に含めて表示しております。 ・前期まで区分掲記していた「退職給付負担金」は、「退職給付費用」に含めて表示しております。 ・前期まで「諸経費」に含めて表示していた「役員退職慰労金」「保守料」「保険料」は、区分掲記しております。尚、前期における「役員退職慰労金」「保守料」「保険料」のそれぞれの金額は、1,491千円、93,768千円、63,571千円であります。 ・前期まで「不動産賃借料」に含めて表示していた「その他不動産経費」は、区分掲記しております。 ・前期まで区分掲記していた「器具備品賃借料」は、「諸経費」に含めて表示しております。 ・前期まで「雑収入」「雑損失」として表示していたものは、それぞれ「その他営業外収益」「その他営業外費用」として表示しております。
---	--

(注記事項)

(貸借対照表関係)

第15期 (平成22年3月31日現在)	第16期 (平成23年3月31日現在)																														
<p>1. 関係会社に対する資産及び負債は以下のとおりであり、すべて親会社に対するものであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">229,597千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未収投資助言報酬</td> <td style="text-align: right;">171,926千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">前払費用</td> <td style="text-align: right;">52,971千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">長期差入保証金</td> <td style="text-align: right;">265,746千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払手数料</td> <td style="text-align: right;">78,620千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">5,080千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他未払金</td> <td style="text-align: right;">15,052千円</td> </tr> </table>	未収運用受託報酬	229,597千円	未収投資助言報酬	171,926千円	前払費用	52,971千円	長期差入保証金	265,746千円	未払手数料	78,620千円	未払費用	5,080千円	その他未払金	15,052千円	<p>1. 関係会社に対する資産及び負債は以下のとおりであり、すべて親会社に対するものであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">前払費用</td> <td style="text-align: right;">60,402千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未収運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">296,706千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未収投資助言報酬</td> <td style="text-align: right;">152,956千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">差入保証金</td> <td style="text-align: right;">280,262千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払手数料</td> <td style="text-align: right;">88,132千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他未払金</td> <td style="text-align: right;">14,956千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">60,986千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他固定負債</td> <td style="text-align: right;">66,068千円</td> </tr> </table>	前払費用	60,402千円	未収運用受託報酬	296,706千円	未収投資助言報酬	152,956千円	差入保証金	280,262千円	未払手数料	88,132千円	その他未払金	14,956千円	未払費用	60,986千円	その他固定負債	66,068千円
未収運用受託報酬	229,597千円																														
未収投資助言報酬	171,926千円																														
前払費用	52,971千円																														
長期差入保証金	265,746千円																														
未払手数料	78,620千円																														
未払費用	5,080千円																														
その他未払金	15,052千円																														
前払費用	60,402千円																														
未収運用受託報酬	296,706千円																														
未収投資助言報酬	152,956千円																														
差入保証金	280,262千円																														
未払手数料	88,132千円																														
その他未払金	14,956千円																														
未払費用	60,986千円																														
その他固定負債	66,068千円																														
<p>2. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。</p>	<p>2. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。</p>																														

建物	169,123千円	建物	187,418千円
器具備品	585,673千円	車両	1,919千円
合計	754,796千円	器具備品	592,884千円
		合計	782,221千円

(損益計算書関係)

第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。 取締役 180,000千円 監査役 30,000千円	1. 同左
2. 事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。	2. 同左
3.	3. 事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。
4. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。 器具備品 2,957千円 ソフトウェア 333千円 合計 3,290千円	4. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。 建物 8,300千円 器具備品 8,461千円 合計 16,762千円

(株主資本等変動計算書関係)

第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1. 発行済株式の種類及び総数は以下のとおりであります。 前事業年度未発行済株式総数 普通株式 108,448株 当事業年度未発行済株式総数 普通株式 108,448株 当事業年度に増加または減少した発行済株式数 なし	1. 発行済株式の種類及び総数は以下のとおりであります。 前事業年度未発行済株式総数 普通株式 108,448株 当事業年度未発行済株式総数 普通株式 108,448株 当事業年度に増加または減少した発行済株式数 なし

2. 配当に関する事項	2. 配当に関する事項
<p>配当金支払額 平成21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</p> <p>株式の種類 普通株式 配当金の総額 135,560千円 1株当たり配当額 1,250円 基準日 平成21年3月31日 効力発生日 平成21年6月26日</p> <p>基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの 平成22年6月25日開催の定時株主総会決議において、次のとおり決議することを予定しております。</p> <p>株式の種類 普通株式 配当金の総額 135,560千円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 1,250円 基準日 平成22年3月31日 効力発生日 平成22年6月25日</p>	<p>配当金支払額 平成22年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項</p> <p>株式の種類 普通株式 配当金の総額 135,560千円 1株当たり配当額 1,250円 基準日 平成22年3月31日 効力発生日 平成22年6月25日</p> <p>基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの 平成23年6月27日開催の定時株主総会決議において、次のとおり決議することを予定しております。</p> <p>株式の種類 普通株式 配当金の総額 135,560千円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 1,250円 基準日 平成23年3月31日 効力発生日 平成23年6月27日</p>

(リース取引関係)

第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第16期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)																																				
<p>1. リース取引に関する会計基準適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。その内容は以下のとおりであります。</p> <p>リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>取得価額相当額</th> <th>減価償却累計額相当額</th> <th>期末残高相当額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>10,400</td> <td>8,365</td> <td>2,035</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <tbody> <tr> <td>1年内</td> <td>1,329千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td>804千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>2,134千円</td> </tr> </tbody> </table>		取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額		千円	千円	千円	器具備品	10,400	8,365	2,035	1年内	1,329千円	1年超	804千円	合計	2,134千円	<p>1. リース取引に関する会計基準適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。その内容は以下のとおりであります。</p> <p>リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>取得価額相当額</th> <th>減価償却累計額相当額</th> <th>期末残高相当額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3,237</td> <td>2,461</td> <td>776</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <table> <tbody> <tr> <td>1年内</td> <td>342千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td>462千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>804千円</td> </tr> </tbody> </table>		取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額		千円	千円	千円	器具備品	3,237	2,461	776	1年内	342千円	1年超	462千円	合計	804千円
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額																																		
	千円	千円	千円																																		
器具備品	10,400	8,365	2,035																																		
1年内	1,329千円																																				
1年超	804千円																																				
合計	2,134千円																																				
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額																																		
	千円	千円	千円																																		
器具備品	3,237	2,461	776																																		
1年内	342千円																																				
1年超	462千円																																				
合計	804千円																																				

<p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <p>支払リース料 2,169千円 減価償却費相当額 1,979千円 支払利息相当額 103千円</p> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</p> <p>2. オペレーティング・リース取引 未経過リース料期末残高相当額</p> <table border="1"> <tbody> <tr> <td>1年内</td> <td>510千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>510千円</td> </tr> </tbody> </table>	1年内	510千円	1年超	-	合計	510千円	<p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <p>支払リース料 1,383千円 減価償却費相当額 1,258千円 支払利息相当額 53千円</p> <p>減価償却費相当額の算定方法 同左</p> <p>利息相当額の算定方法 同左</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>—</p>
1年内	510千円						
1年超	-						
合計	510千円						

（金融商品関係）

前事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金及び預金	7,338,891	7,338,891	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,009,955	4,026,820	16,864
その他有価証券	3,499,200	3,499,200	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	10,550,685	10,662,050	111,364
その他有価証券	7,773,922	7,773,922	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金及び預金

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

ります。

有価証券

これらの時価について、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから当該帳簿価額によっており、譲渡性預金以外のものは決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）は、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっており、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資以外のものは、決算日の市場価格等によっております。

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額132,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券その他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	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)
現金及び預金	7,338,891	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	10,400,000	-	-
（1）国債・地方債等	4,000,000	10,400,000	-	-
（2）社債	-	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	5,800,000	3,590,445	1,123,345	1,000
その他（注）	5,800,000	3,590,445	1,123,345	1,000
合計	17,138,891	13,990,445	1,123,345	1,000

（注）譲渡性預金と投資信託受益証券であります。

（追加情報）

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	6,270,894	6,270,894	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,028,251	4,044,880	16,628
その他有価証券	6,994,842	6,994,842	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	10,512,627	10,567,760	55,132
その他有価証券	6,341,364	6,341,364	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

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

有価証券

これらの時価について、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから当該帳簿価額によっており、譲渡性預金以外のものは決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）は、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっており、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資以外のものは、決算日の市場価格等によっております。

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額132,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	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	6,270,894	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	10,400,000	-	-
（1）国債・地方債等	4,000,000	10,400,000	-	-
（2）社債	-	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	8,732,095	2,405,100	1,236,025	-
その他（注）	8,732,095	2,405,100	1,236,025	-
合計	19,002,989	12,805,100	1,236,025	-

（注）譲渡性預金、投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

（有価証券関係）

前事業年度（平成22年3月31日現在）

1．満期保有目的の債券

	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	12,539,527	12,670,410	130,882
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,539,527	12,670,410	130,882
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	2,021,114	2,018,460	2,654
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,021,114	2,018,460	2,654
合計		14,560,641	14,688,870	128,228

2. その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	999,729	999,800	71
	国債・地方債等	999,729	999,800	71
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	3,410,636	4,408,424	997,787
	小計	4,410,365	5,408,224	997,858
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,999,408	1,999,400	8
	国債・地方債等	1,999,408	1,999,400	8
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	4,083,982	3,274,650	809,331
	小計	6,083,391	5,274,050	809,340
合計		10,493,756	10,682,275	188,518

(注1) 投資信託受益証券であります。

(注2) 非上場株式(貸借対照表計上額132,500千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
2,269,047	123,026	424,493

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)において、有価証券について118,045千円(その他有価証券の投資信託受益証券118,045千円)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

当事業年度(平成23年3月31日現在)

1. 満期保有目的の債券

	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	12,507,839	12,583,440	75,600
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,507,839	12,583,440	75,600
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	2,033,039	2,029,200	3,839
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,033,039	2,029,200	3,839
合計		14,540,878	14,612,640	71,761

2. その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,493,181	5,495,142	1,961
	国債・地方債等	5,493,181	5,495,142	1,961
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	2,608,636	3,659,502	1,050,865
	小計	8,101,818	9,154,645	1,052,826
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	999,761	999,700	61
	国債・地方債等	999,761	999,700	61
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	3,835,995	3,181,862	654,133
	小計	4,835,756	4,181,562	654,194
合計		12,937,574	13,336,207	398,632

(注1) 譲渡性預金、投資信託受益証券、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資等でありま
す。

(注2) 非上場株式(貸借対照表計上額132,500千円)については、市場価格がなく、時価を把握するこ
とが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
561,210	35,991	17,676

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について5,706千円(その他有価証券の投資信託受益証券5,706千円)減
損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処
理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処
理を行っております。

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務及びその内訳（平成22年3月31日現在）

- (1)退職給付債務 537,616千円
(2)退職給付引当金 537,616千円

（注）当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

3．退職給付費用の内訳

勤務費用 110,011千円

（注）勤務費用には退職金（「諸経費」）1,007千円を含めております。この他、確定拠出型年金制度への拠出金（「福利厚生費」）41,273千円及び受入出向者にかかる退職給付負担金64,509千円を計上しております。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

(1)退職給付債務	644,223千円
(2)退職給付引当金	644,223千円

（注）当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

3．退職給付費用に関する事項

(1)勤務費用	130,059千円
(2)退職給付負担金	33,151千円
(3)合計	163,211千円

（注）この他、福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金43,211千円を計上しております。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

（税効果会計関係）

第15期 （平成22年3月31日現在）	第16期 （平成23年3月31日現在）
------------------------	------------------------

<p>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</p> <p>(流動資産)</p> <p>繰延税金資産</p> <table border="0"> <tr><td>賞与引当金</td><td>200,962千円</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td>21,062千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td>32,093千円</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td><u>254,117千円</u></td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table border="0"> <tr><td>有価証券評価差額</td><td>28千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td>97千円</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td><u>125千円</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td>253,992千円</td></tr> </table> <p>(固定資産)</p> <p>繰延税金資産</p> <table border="0"> <tr><td>退職給付引当金</td><td>215,046千円</td></tr> <tr><td>役員退職慰労引当金</td><td>5,185千円</td></tr> <tr><td>税務上の繰延資産償却超過額</td><td>6,611千円</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td>695,776千円</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価差額</td><td>327,794千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td>5,018千円</td></tr> <tr><td>小計</td><td><u>1,255,430千円</u></td></tr> <tr><td></td><td>円</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td><u>126,659千円</u></td></tr> <tr><td></td><td>円</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td><u>1,128,770千円</u></td></tr> <tr><td></td><td>円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table border="0"> <tr><td>特別分配金否認</td><td>63,801千円</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価差額</td><td>399,115千円</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td><u>462,916千円</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td>665,854千円</td></tr> </table>	賞与引当金	200,962千円	未払事業税	21,062千円	その他	32,093千円	繰延税金資産合計	<u>254,117千円</u>	有価証券評価差額	28千円	その他	97千円	繰延税金負債合計	<u>125千円</u>	繰延税金資産の純額	253,992千円	退職給付引当金	215,046千円	役員退職慰労引当金	5,185千円	税務上の繰延資産償却超過額	6,611千円	投資有価証券評価損	695,776千円	投資有価証券評価差額	327,794千円	その他	5,018千円	小計	<u>1,255,430千円</u>		円	評価性引当額	<u>126,659千円</u>		円	繰延税金資産合計	<u>1,128,770千円</u>		円	特別分配金否認	63,801千円	投資有価証券評価差額	399,115千円	繰延税金負債合計	<u>462,916千円</u>	繰延税金資産の純額	665,854千円	<p>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</p> <p>(流動資産)</p> <p>繰延税金資産</p> <table border="0"> <tr><td>賞与引当金</td><td>221,131千円</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td>18,935千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td>55,977千円</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td><u>296,044千円</u></td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table border="0"> <tr><td>有価証券評価差額</td><td>784千円</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td><u>784千円</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td>295,260千円</td></tr> </table> <p>(固定資産)</p> <p>繰延税金資産</p> <table border="0"> <tr><td>退職給付引当金</td><td>257,689千円</td></tr> <tr><td>役員退職慰労引当金</td><td>4,510千円</td></tr> <tr><td>税務上の繰延資産償却超過額</td><td>5,310千円</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td>539,831千円</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価差額</td><td>261,653千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td>30,323千円</td></tr> <tr><td>小計</td><td><u>1,099,317千円</u></td></tr> <tr><td></td><td>円</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td><u>120,282千円</u></td></tr> <tr><td></td><td>円</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td><u>979,034千円</u></td></tr> <tr><td></td><td>円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table border="0"> <tr><td>特別分配金否認</td><td>58,098千円</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価差額</td><td>420,346千円</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td><u>478,445千円</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td>500,589千円</td></tr> </table>	賞与引当金	221,131千円	未払事業税	18,935千円	その他	55,977千円	繰延税金資産合計	<u>296,044千円</u>	有価証券評価差額	784千円	繰延税金負債合計	<u>784千円</u>	繰延税金資産の純額	295,260千円	退職給付引当金	257,689千円	役員退職慰労引当金	4,510千円	税務上の繰延資産償却超過額	5,310千円	投資有価証券評価損	539,831千円	投資有価証券評価差額	261,653千円	その他	30,323千円	小計	<u>1,099,317千円</u>		円	評価性引当額	<u>120,282千円</u>		円	繰延税金資産合計	<u>979,034千円</u>		円	特別分配金否認	58,098千円	投資有価証券評価差額	420,346千円	繰延税金負債合計	<u>478,445千円</u>	繰延税金資産の純額	500,589千円
賞与引当金	200,962千円																																																																																														
未払事業税	21,062千円																																																																																														
その他	32,093千円																																																																																														
繰延税金資産合計	<u>254,117千円</u>																																																																																														
有価証券評価差額	28千円																																																																																														
その他	97千円																																																																																														
繰延税金負債合計	<u>125千円</u>																																																																																														
繰延税金資産の純額	253,992千円																																																																																														
退職給付引当金	215,046千円																																																																																														
役員退職慰労引当金	5,185千円																																																																																														
税務上の繰延資産償却超過額	6,611千円																																																																																														
投資有価証券評価損	695,776千円																																																																																														
投資有価証券評価差額	327,794千円																																																																																														
その他	5,018千円																																																																																														
小計	<u>1,255,430千円</u>																																																																																														
	円																																																																																														
評価性引当額	<u>126,659千円</u>																																																																																														
	円																																																																																														
繰延税金資産合計	<u>1,128,770千円</u>																																																																																														
	円																																																																																														
特別分配金否認	63,801千円																																																																																														
投資有価証券評価差額	399,115千円																																																																																														
繰延税金負債合計	<u>462,916千円</u>																																																																																														
繰延税金資産の純額	665,854千円																																																																																														
賞与引当金	221,131千円																																																																																														
未払事業税	18,935千円																																																																																														
その他	55,977千円																																																																																														
繰延税金資産合計	<u>296,044千円</u>																																																																																														
有価証券評価差額	784千円																																																																																														
繰延税金負債合計	<u>784千円</u>																																																																																														
繰延税金資産の純額	295,260千円																																																																																														
退職給付引当金	257,689千円																																																																																														
役員退職慰労引当金	4,510千円																																																																																														
税務上の繰延資産償却超過額	5,310千円																																																																																														
投資有価証券評価損	539,831千円																																																																																														
投資有価証券評価差額	261,653千円																																																																																														
その他	30,323千円																																																																																														
小計	<u>1,099,317千円</u>																																																																																														
	円																																																																																														
評価性引当額	<u>120,282千円</u>																																																																																														
	円																																																																																														
繰延税金資産合計	<u>979,034千円</u>																																																																																														
	円																																																																																														
特別分配金否認	58,098千円																																																																																														
投資有価証券評価差額	420,346千円																																																																																														
繰延税金負債合計	<u>478,445千円</u>																																																																																														
繰延税金資産の純額	500,589千円																																																																																														
<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p>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。</p>	<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p style="text-align: center;">同左</p>																																																																																														

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

前事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,096,879

[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]

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

該当事項はありません。

(追加情報)

当事業年度から「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

(関連当事者との取引)

前事業年度（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1)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

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	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有)直接所有 90.00%	兼任5 出向3 転籍4	営業取引	運用受託報酬の受取	962,342	未収運用受託報酬	229,597
								投資助言報酬の受取	734,939	未収投資助言報酬	171,926

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

3. 上記の他に、当社は、日本生命保険相互会社が保有する私募投資信託より委託者報酬を受取っております。

4. 運用受託報酬の受取962,342千円には、日本生命保険相互会社が保有する外国籍投資信託に係る運用受託報酬738,747千円を含んでおります。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

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	議決権等の所有(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)
同一の親会社を持つ会社	ニッセイ情報テクノロジーシステム株式会社	東京都大田区	4,000	システムサービス	なし	ソフトウェアの開発費用	ソフトウェア及びソフトウェア仮勘定等の取得	307,154	その他未払金	31,915

(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 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社(非上場であります。)

当事業年度(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と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

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	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有)直接所有 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	1,352,450	未収運用受託報酬	296,706
								投資助言報酬の受取	697,329	未収投資助言報酬	152,956

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社(非上場であります。)

(1株当たり情報)

第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1株当たり純資産額 335,450円49銭 1株当たり当期純利益金額 4,654円56銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 339,466円90銭 1株当たり当期純利益金額 4,031円18銭 同左

(注) 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。

	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
当期純利益	504,778千円	437,174千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株主に係る当期純利益	504,778千円	437,174千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

前事業年度(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 吉益裕二 印
--------------------	--------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 松崎雅則 印
--------------------	--------------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成23年2月22日から平成23年8月21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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要なに応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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ニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成23年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年2月22日から平成23年8月21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。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 吉益裕二 印
--------------------	--------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 松崎雅則 印
--------------------	--------------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)の平成23年2月22日から平成23年8月21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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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ニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)の平成23年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(平成23年2月22日から平成23年8月21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。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月7日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 吉益裕二 印
--------------------	--------------

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第16期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 吉益裕二 印
--------------------	--------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 松崎雅則 印
--------------------	--------------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成23年2月22日から平成23年8月21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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成23年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年2月22日から平成23年8月21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。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 吉益裕二 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成22年2月23日から平成22年8月22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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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ニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成22年8月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年2月23日から平成22年8月22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。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 吉益裕二 印
--------------------	--------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 松崎雅則 印
--------------------	--------------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の平成22年2月23日から平成22年8月22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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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ニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の平成22年8月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年2月23日から平成22年8月22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。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 吉益裕二 印
--------------------	--------------

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第15期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 吉益裕二 印
--------------------	--------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 松崎雅則 印
--------------------	--------------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成22年2月23日から平成22年8月22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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成22年8月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年2月23日から平成22年8月22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。

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

以上

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

[次へ](#)