

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成24年5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 宇治原 潔
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4603
【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。

第一部【証券情報】

（１）【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）

以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」または「DCニッセイワールドセレクトファンド」といいます。また、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）を「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）を「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）を「株式重視型」ということがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「（8）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成24年5月22日（火）～平成25年5月21日（火）

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

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度向けのファンドであり、主として有価証券に投資する投資信託証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標に運用を行います。

ファンドの特色

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

- ・ファンド・オブ・ファンズとは、投資対象を投資信託証券とするファンドです。

詳細については、後記「（3）ファンドの仕組み ファンド・オブ・ファンズ等の仕組み」をご参照ください。

主に有価証券に投資する下記の投資信託証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることをめざします。

- ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)
- ニッセイ国内債券インデックスSA(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
- ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

- ・なお、上記投資信託証券を「指定投資信託証券」ということがあります。

〈指定投資信託証券の概要〉

ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定) (以下「国内株式インデックス」ということがあります)

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」を通じて、実質的に国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数) ^{※1} の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ国内債券インデックスSA(適格機関投資家限定) (以下「国内債券インデックス」ということがあります)

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」を通じて、実質的に国内の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合 ^{※2} の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド (以下「外国株式インデックス」ということがあります)

運用会社	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
運用の基本方針	「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」を通じて、実質的に日本を除く世界の証券取引所に上場されている株式等に投資することにより、中長期的な観点から、日本を除く世界の主要国の株式市場の動き(MSCI コクサイ指数、日本円ベース ^{※3})に連動する投資成果を目標に運用を行います。

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド (以下「外国債券インデックス」ということがあります)

運用会社	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
運用の基本方針	「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」を通じて、実質的に日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等に投資することにより、シティグループ世界国債指数(除く日本) ^{※4} に連動する投資成果を目標に運用を行います。

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行うことができます。

※2 NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

※3 [MSCI コクサイ指数、日本円ベース]とは、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く世界の主要先進国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

※4 シティグループ世界国債指数(除く日本)とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した債券指数で、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均し、指数化したものです。シティグループ世界国債指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。シティグループ・グローバル・マーケット・インクは当ファンドとは何ら関係なく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

- ・運用にあたっては、以下の各指定投資信託証券への投資比率（基準ポートフォリオ）を基本とします。



- ・基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、ファンドの購入または換金等ともなう資金フローの影響により、一時的に基準ポートフォリオの配分から乖離する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

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

ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
追加型	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

属性区分表

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

商品分類表

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

資産複合 目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

属性区分表

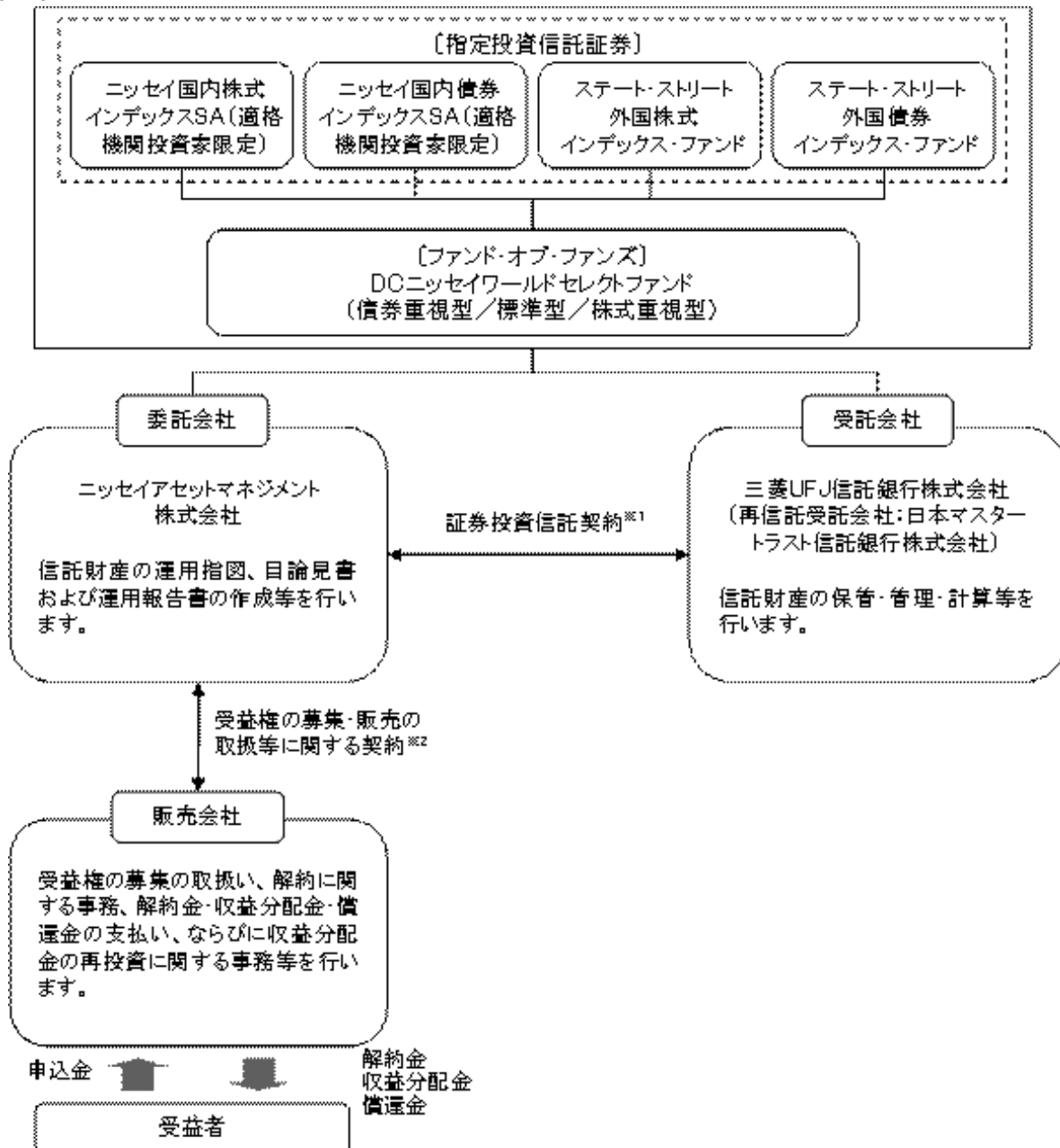
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式・債券)資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券とし、ファンドの実質的な運用を投資信託証券にて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファンド・オブ・ファンズ	社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条において、投資信託及び外国投資信託の受益証券並びに投資法人及び外国投資法人の投資証券への投資を目的とする投資信託をいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成15年1月10日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

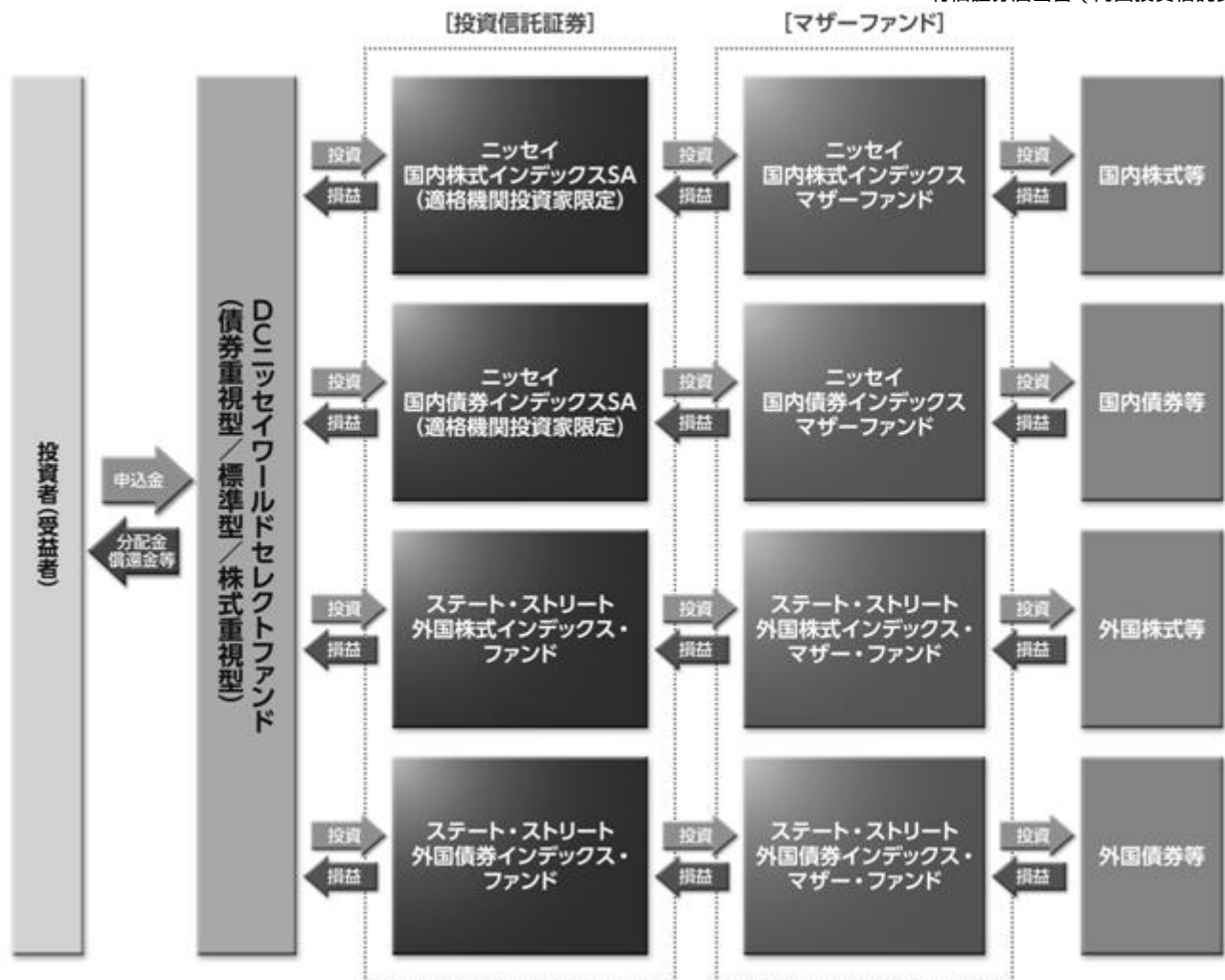


- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

ファンド・オブ・ファンズ等の仕組み

ファンドは指定投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。なお、ファンドが主要投資対象とする各指定投資信託証券は、ファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。

<イメージ図>



委託会社の概況（平成24年4月2日現在）

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

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

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

平成10年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。

平成12年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

8. 大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

主として有価証券に投資する投資信託証券（指定投資信託証券）を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

各指定投資信託証券への投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

	債券重視型	標準型	株式重視型
国内株式インデックス	20%	30%	40%
国内債券インデックス	45%	30%	15%
外国株式インデックス	10%	20%	30%
外国債券インデックス	20%	15%	10%
短期金融資産	5%	5%	5%

基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等にもなう資金フローの影響により、一時的に上記の配分から乖離する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

a 主な投資対象

有価証券に投資する下記の指定投資信託証券を主要投資対象とします。

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）

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

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

各指定投資信託証券の概要

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）

1 運用の基本方針

（１）基本方針

TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

（２）運用方法

投資対象

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドを主要投資対象とします。なお直接、株式等に投資を行う場合があります。

投資態度

1．主にニッセイ国内株式インデックスマザーファンド（以下「国内株式マザーファンド」といいます）に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

2．主に国内株式マザーファンドに投資を行いますが、追加設定・一部解約に伴う資金フローに対応するため株価指数先物等にも投資します。

3. 株式の実質投資総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
4. 株式以外の資産(国内株式マザーファンドを通じて投資する場合は、国内株式マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
5. 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

投資制限

1. 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
2. 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
3. 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。
4. 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
5. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
6. 投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
7. 外貨建資産への投資は行いません。

(3) 収益分配方針

毎期、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等の全額とします。

分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

留保益の運用方針については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

2. ファンドにかかる費用

信託報酬

1. 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.33075%(税込)をかけた額とします。
2. 前記1.の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払うものとします。

その他の手数料等

1. 証券取引に伴う手数料等
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および税金等は、信託財産中から支払います。この他に、先物取引・オプション取引等に要する費用についても信託財産中から支払います。
2. 信託財産の財務諸表の監査に要する費用
監査費用および当該監査費用に関する消費税等に相当する金額は、信託報酬を支払う際に信託財産より支払います。
3. 信託事務の諸費用
信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支払います。

4．借入金の利息

信託財産において一部解約に伴う支払資金の手当てを目的として資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は、借入れのつど、信託財産中から支払います。

5．信託財産留保額

ありません。

3 主な関係法人

関係	名称
委託会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

4 沿革

平成13年11月30日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

5 信託期間

無期限

6 計算期間

原則として、毎年3月11日から翌年3月10日まで

(参考)ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

(1) 基本方針

国内の株式市場の動きをとらえることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

(2) 運用方法

投資対象

国内の証券取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資態度

- 1．国内の証券取引所上場株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
- 2．株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。
- 3．株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。
- 4．資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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）

1 運用の基本方針

(1) 基本方針

NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

(2) 運用方法

投資対象

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドを主要投資対象とします。また、直接、公社債等に投資を行う場合があります。

投資態度

1. 主にニッセイ国内債券インデックスマザーファンド（以下「国内債券マザーファンド」といいます）に投資を行い、NOMURA-BPI総合の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
2. 主に国内債券マザーファンドに投資を行いますが、追加設定・一部解約に伴う資金フローに対応するため、有価証券先物取引等を活用する場合があります。
3. 公社債の実質投資総額と有価証券先物取引等の買建玉の実質投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
4. 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

投資制限

1. 株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。なお、ここでいう新株予約権とは、転換社債型新株予約権付社債の新株予約権をいいます。
2. 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
3. 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
4. 投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
5. 投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限り、ります。

(3) 収益分配方針

毎期、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

留保益の運用方針については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

2. ファンドにかかる費用

信託報酬

1. 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.2205%（税込）をかけた額とします。
2. 前記1.の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払うものとします。

その他の手数料等

1. 証券取引に伴う手数料等
組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および税金等は、信託財産中から支払います。この他に、先物取引・オプション取引等に要する費用についても信託財産中から支払います。
2. 信託財産の財務諸表の監査に要する費用

監査費用および当該監査費用に関する消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときに信託財産より支払います。

3. 信託事務の諸費用

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

4. 借入金の利息

信託財産において一部解約に伴う支払資金の手当てを目的として資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は、借入れのつど、信託財産中から支払います。

5. 信託財産留保額

ありません。

3 主な関係法人

関係	名称
委託会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

4 沿革

平成13年11月30日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

5 信託期間

無期限

6 計算期間

原則として、毎年3月11日から翌年3月10日まで

(参考)ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドの概要

(1) 基本方針

主として国内の公社債への投資を行うことにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

(2) 運用方法

投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

- 国内の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。
- 組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。
- 公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りません。

1 運用の基本方針

(1) 基本方針

中長期的な観点から、日本を除く世界の主要国の株式市場の動き（MSCI コクサイ指数、日本円ベース）に連動した投資成果を目指して運用を行います。

(2) 運用方法

ベンチマーク

MSCI Inc.が発表するMSCI コクサイ指数（日本円ベース）

投資態度

1. 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（以下「外国株式マザーファンド」といいます）を主たる投資対象とします。
2. MSCI コクサイ指数に連動した投資成果を目指して運用を行います。
3. 外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。
4. 投資状況に応じ、外国株式マザーファンドと同様の運用を直接行うことがあります。
5. 有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、有価証券の貸付けおよび資金借入れを行うことができます。

投資制限

1. 外国株式マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。
2. 株式の実質投資割合には制限を設けません。
3. 投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
4. 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
5. 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

(3) 収益分配方針

毎期、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます）等の範囲内とします。

分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

2 ファンドにかかる費用

信託報酬

1. 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に下記の信託報酬率をかけた額とします。

純資産総額50億円以下の部分 年0.3150%（税込）

純資産総額50億円超100億円以下の部分 年0.2625%（税込）

純資産総額100億円超の部分 年0.2100%（税込）

2. 前記1.の信託報酬については、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払うものとします。

その他の手数料等

1. 証券取引に伴う手数料等

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

います。

2. 信託事務の諸費用

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

3. 借入金の利息

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

4. 信託財産留保額

受益権の取得申込時および一部解約請求時において、取得申込日および一部解約請求日の翌営業日の基準価額に0.20%の率をかけた額とします。

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	三井住友信託銀行株式会社

4 沿革

平成12年6月29日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

5 信託期間

無期限

6 計算期間

原則として、毎年2月21日から翌年2月20日まで

(参考) ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンドの概要

(1) 基本方針

中長期的な観点から、日本を除く世界の主要国の株式市場の動き（MSCI コクサイ指数、日本円ベース）に連動した投資成果を目指して運用を行います。

(2) 運用方法

ベンチマーク

MSCI Inc. が発表するMSCI コクサイ指数（日本円ベース）

投資態度

1. 日本を除く世界の証券取引所に上場されている株式（それらに類するものを含みます）を主要投資対象とし、MSCI コクサイ指数（日本円ベース）に連動した投資成果を目指して運用を行います。
2. 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。
3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
4. 有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引および有価証券の貸付を行うことができます。

(3) 投資制限

株式の投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

1 運用の基本方針

(1) 基本方針

シティグループ世界国債指数（除く日本）に連動した投資成果をめざして運用を行います。

(2) 運用方法

投資対象

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンドを主要投資対象とします。

投資態度

1. 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（以下「外国債券マザーファンド」といいます）を主たる投資対象とします。
2. 外国債券マザーファンドへの組入比率は、原則として高位を維持します。
3. 外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。
4. 投資状況に応じ、外国債券マザーファンドと同様の運用を直接行うことがあります。
5. 有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、有価証券の貸付けおよび資金借入れを行うことができます。
6. 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては上記の運用ができないことがあります。

投資制限

1. 外国債券マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。
2. 公社債の実質投資割合には制限を設けません。
3. 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り）の行使により取得可能なものに限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
4. 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません（なお、外国債券マザーファンド組入れに伴う実質的な外貨エクスポージャーについては為替ヘッジを行いません）。

(3) 収益分配方針

毎年1回決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、繰越分を含めた利子等収益と売買益（評価益を含みます）等の全額とします。分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

2 ファンドにかかる費用

信託報酬

1. 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.2625%（税込）をかけた額とします。
2. 前記1.の信託報酬については、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期末および信託終了のときに信託財産中から支払うものとします。

その他の手数料等

1. 証券取引に伴う手数料等

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

2. 信託事務の諸費用

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

3．借入金の利息

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

4．信託財産留保額

受益権の取得申込時および一部解約請求時において、取得申込日および一部解約請求日の翌営業日の基準価額に0.10%の率をかけた額とします。

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	三井住友信託銀行株式会社

4 沿革

平成13年3月14日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

5 信託期間

無期限

6 計算期間

原則として、毎年2月21日から翌年2月20日まで

（参考）ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンドの概要

（1）基本方針

主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債等を主要投資対象としシティグループ世界国債指数（除く日本）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

（2）運用方法

投資対象

日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とします。

投資態度

- 1．公社債への投資は原則として高位を維持します。
- 2．外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。
- 3．有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引および有価証券の貸付を行うことができます。
- 4．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては上記の運用ができないことがあります。

（3）投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち転換社債型新株予約権付社債の転換による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ）
 - イ．有価証券
 - ロ．金銭債権（イ．およびハ．に掲げるものに該当するものを除きます）
 - ハ．約束手形（イ．に掲げるものを除きます）

2．次に掲げる特定資産以外の資産

- イ．為替手形

有価証券

主として前記「a 主な投資対象」において投資対象とする指定投資信託証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。以下同じ）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除き、国内の通貨表示のものに限ります）に投資します。

- 1．コマーシャルペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1．の証券の性質を有するもの
- 3．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます）
- 4．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）

なお、3．の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用は買現先取引（売戻し条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

金融商品

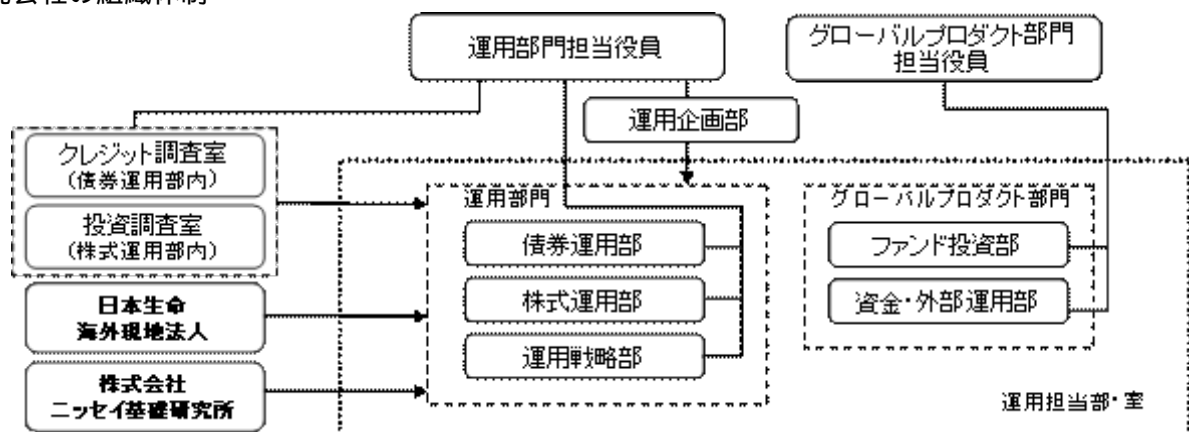
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

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

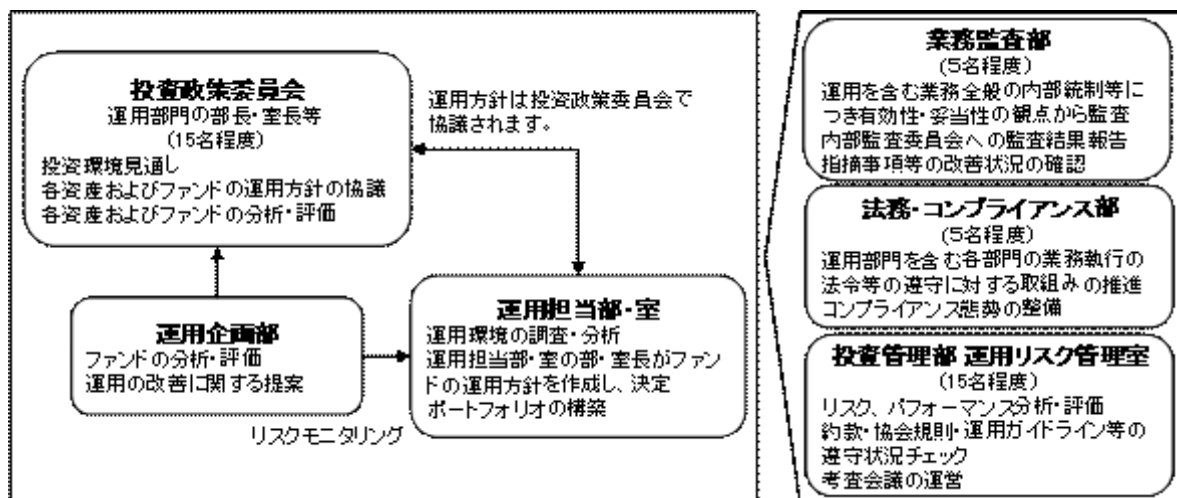
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、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。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

分配時期

毎決算日とし、決算日は2月21日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。

< 分配金再投資コースの場合 >

自動的に再投資されます。

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への直接投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

b 約款に定めるその他の投資制限

公社債の借入れ

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

資金の借入れ

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

3 【投資リスク】

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。

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・短期金融資産の運用に関するリスク

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

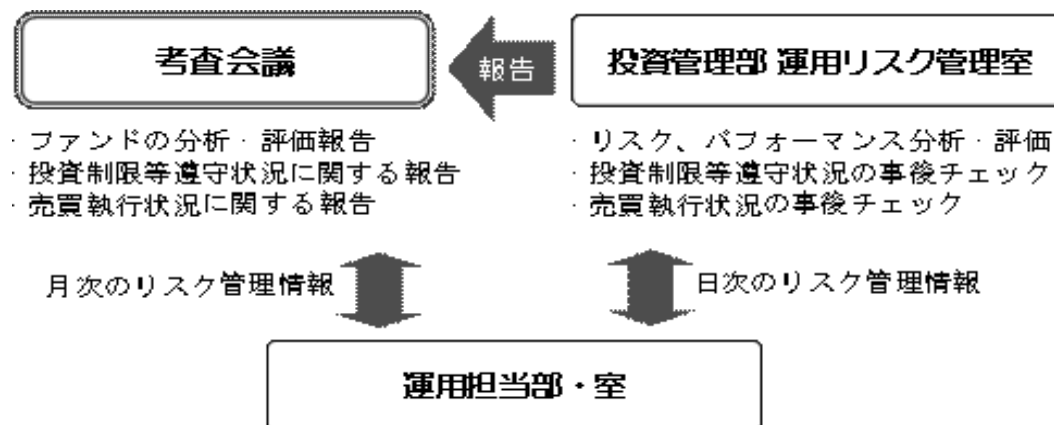
・為替変動リスク

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

・流動性リスク

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

（２）投資リスク管理体制



1. 投資管理部 運用リスク管理室が、以下の通り管理を行います。

- ・ 運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
- ・ 売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。

2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

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

4 【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

各ファンドにつき、信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.12075%（税込）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分（税込）	
委託会社	年0.01050%
販売会社	年0.07875%
受託会社	年0.03150%

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

(参考1) 投資対象とする指定投資信託証券の信託報酬率

指定投資信託証券の名称	信託報酬率（税込）
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）	年0.33075%
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）	年0.22050%
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	年0.31500%（上限）
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	年0.26250%

各指定投資信託証券の信託報酬の詳細については、前記「2 投資方針（2）投資対象 a 主な投資対象」をご覧ください。

(参考2) 指定投資信託証券を含めた実質的な信託報酬率

ファンドの名称	指定投資信託証券を含めた実質的な信託報酬率（税込）
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	年0.3701%程度
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	年0.3885%程度
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	年0.4069%程度

「指定投資信託証券を含めた実質的な信託報酬率」とは、投資対象とする指定投資信託証券の信託報酬を含めたものです。なお、上記は目安であり、指定投資信託証券であるステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドの信託報酬率は当該ファンドの純資産総額に応じて変動することおよび各指定投資信託証券への投資比率が変動することにより、投資者が負担する実質的な信託報酬率（年率）は変動します。

(4) 【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および税金等は、信託財産中から支払いません。

監査費用

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

純資産総額	監査報酬率（税込）
-------	-----------

100億円超	の部分	年 0.0021%
50億円超	100億円以下 の部分	年 0.0063%
10億円超	50億円以下 の部分	年 0.0105%
	10億円以下 の部分	年 0.0735%

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

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

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

「債券重視型」

(平成24年3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	2,501,134,543	95.32
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		122,766,647	4.68
純資産総額		2,623,901,190	100.00

「標準型」

(平成24年3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	7,895,444,722	95.30
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		389,792,253	4.70
純資産総額		8,285,236,975	100.00

「株式重視型」

(平成24年3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	4,229,040,963	95.08
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		218,913,553	4.92
純資産総額		4,447,954,516	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24年3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SA(適格機関投資家限定)	投資信託受益証券	1,025,939,837	11,608	1,190,871,901	11,598	1,189,885,022	45.35
2	日本	ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	投資信託受益証券	572,688,448	8,752	501,216,930	9,262	530,424,040	20.21
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	428,117,700	11,665	499,399,298	12,171	521,062,052	19.86
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	273,925,371	8,941	244,916,674	9,483	259,763,429	9.90
投資比率：合計									95.32

「標準型」

（平成24年3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SA（適格機関投資家限定）	投資信託受益証券	2,711,252,980	8,752	2,372,888,609	9,262	2,511,162,510	30.31
2	日本	ニッセイ国内債券インデックスSA（適格機関投資家限定）	投資信託受益証券	2,161,009,387	11,607	2,508,378,547	11,598	2,506,338,687	30.25
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	1,731,134,284	8,941	1,547,807,164	9,483	1,641,634,641	19.82
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	1,015,782,503	11,665	1,184,910,290	12,171	1,236,308,884	14.92
投資比率：合計									95.30

「株式重視型」

（平成24年3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SA（適格機関投資家限定）	投資信託受益証券	1,935,692,282	8,756	1,694,833,713	9,262	1,792,838,191	40.31
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	1,394,965,081	8,941	1,247,238,279	9,483	1,322,845,386	29.74
3	日本	ニッセイ国内債券インデックスSA（適格機関投資家限定）	投資信託受益証券	578,071,777	11,607	670,985,967	11,598	670,447,646	15.07
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	363,905,793	11,669	424,623,662	12,171	442,909,740	9.96
投資比率：合計									95.08

（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	-	95.32
合計		95.32

「標準型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	95.30
合計		95.30

「株式重視型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	95.08
合計		95.08

（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24年3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	分配付：	10,431
		分配落：	1,837,832,308	分配落：	10,431
第7期末	（平成22年2月22日）	分配付：	2,226,476,366	分配付：	11,509
		分配落：	2,226,476,366	分配落：	11,509
第8期末	（平成23年2月21日）	分配付：	2,468,732,723	分配付：	11,802
		分配落：	2,468,732,723	分配落：	11,802
第9期末	（平成24年2月21日）	分配付：	2,562,790,233	分配付：	11,636
		分配落：	2,562,790,233	分配落：	11,636
	平成23年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
	9月末日		2,365,058,833		11,088
	10月末日		2,433,380,879		11,263
	11月末日		2,384,397,507		11,029
	12月末日		2,436,618,673		11,086

	平成24年1月末日	2,480,884,305	11,275
	2月末日	2,583,684,697	11,755
	平成24年3月30日	2,623,901,190	11,937

「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	分配付: 11,253
		分配落: 104,312,125	分配落: 11,253
第2期末	(平成17年2月21日)	分配付: 1,685,435,357	分配付: 11,884
		分配落: 1,685,435,357	分配落: 11,884
第3期末	(平成18年2月21日)	分配付: 4,211,489,449	分配付: 13,838
		分配落: 4,211,489,449	分配落: 13,838
第4期末	(平成19年2月21日)	分配付: 6,194,491,862	分配付: 15,275
		分配落: 6,194,491,862	分配落: 15,275
第5期末	(平成20年2月21日)	分配付: 6,484,983,703	分配付: 13,809
		分配落: 6,484,983,703	分配落: 13,809
第6期末	(平成21年2月23日)	分配付: 5,244,908,506	分配付: 10,030
		分配落: 5,244,908,506	分配落: 10,030
第7期末	(平成22年2月22日)	分配付: 6,824,522,532	分配付: 11,685
		分配落: 6,824,522,532	分配落: 11,685
第8期末	(平成23年2月21日)	分配付: 7,926,206,447	分配付: 12,272
		分配落: 7,926,206,447	分配落: 12,272
第9期末	(平成24年2月21日)	分配付: 7,963,099,330	分配付: 11,781
		分配落: 7,963,099,330	分配落: 11,781
	平成23年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
	9月末日	7,174,289,807	10,960
	10月末日	7,487,581,907	11,275
	11月末日	7,245,828,159	10,909
	12月末日	7,368,918,271	10,977
	平成24年1月末日	7,591,463,234	11,270
	2月末日	8,063,469,928	11,937
	平成24年3月30日	8,285,236,975	12,201

「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	分配付: 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
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 分配落：2,565,505,965	分配付：9,552 分配落：9,552
第7期末	(平成22年2月22日)	分配付：3,635,729,715 分配落：3,635,729,715	分配付：11,734 分配落：11,734
第8期末	(平成23年2月21日)	分配付：4,343,954,086 分配落：4,343,954,086	分配付：12,613 分配落：12,613
第9期末	(平成24年2月21日)	分配付：4,217,589,091 分配落：4,217,589,091	分配付：11,770 分配落：11,770
	平成23年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
	9月末日	3,700,878,964	10,690
	10月末日	3,902,464,926	11,138
	11月末日	3,745,638,042	10,650
	12月末日	3,826,023,457	10,728
	平成24年1月末日	3,982,291,894	11,116
	2月末日	4,277,735,312	11,962
	平成24年3月30日	4,447,954,516	12,305

【分配の推移】

「債券重視型」

		1万口当たり分配金
第1期	(平成16年2月23日)	0円
第2期	(平成17年2月21日)	0円
第3期	(平成18年2月21日)	0円
第4期	(平成19年2月21日)	0円
第5期	(平成20年2月21日)	0円
第6期	(平成21年2月23日)	0円
第7期	(平成22年2月22日)	0円
第8期	(平成23年2月21日)	0円
第9期	(平成24年2月21日)	0円

「標準型」

		1万口当たり分配金
第1期	(平成16年2月23日)	0円
第2期	(平成17年2月21日)	0円
第3期	(平成18年2月21日)	0円
第4期	(平成19年2月21日)	0円
第5期	(平成20年2月21日)	0円
第6期	(平成21年2月23日)	0円
第7期	(平成22年2月22日)	0円
第8期	(平成23年2月21日)	0円
第9期	(平成24年2月21日)	0円

「株式重視型」

		1万口当たり分配金

第1期	（平成16年2月23日）	0円
第2期	（平成17年2月21日）	0円
第3期	（平成18年2月21日）	0円
第4期	（平成19年2月21日）	0円
第5期	（平成20年2月21日）	0円
第6期	（平成21年2月23日）	0円
第7期	（平成22年2月22日）	0円
第8期	（平成23年2月21日）	0円
第9期	（平成24年2月21日）	0円

【収益率の推移】

「債券重視型」

		収益率
第1期	自平成15年1月10日 至平成16年2月23日	8.55%
第2期	自平成16年2月24日 至平成17年2月21日	4.25%
第3期	自平成17年2月22日 至平成18年2月21日	10.71%
第4期	自平成18年2月22日 至平成19年2月21日	7.13%
第5期	自平成19年2月22日 至平成20年2月21日	5.23%
第6期	自平成20年2月22日 至平成21年2月23日	17.99%
第7期	自平成21年2月24日 至平成22年2月22日	10.33%
第8期	自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	2.55%
第9期	自平成23年2月22日 至平成24年2月21日	1.41%

「標準型」

		収益率
第1期	自平成15年1月10日 至平成16年2月23日	12.53%
第2期	自平成16年2月24日 至平成17年2月21日	5.61%
第3期	自平成17年2月22日 至平成18年2月21日	16.44%
第4期	自平成18年2月22日 至平成19年2月21日	10.38%
第5期	自平成19年2月22日 至平成20年2月21日	9.60%
第6期	自平成20年2月22日 至平成21年2月23日	27.37%
第7期	自平成21年2月24日 至平成22年2月22日	16.50%
第8期	自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	5.02%
第9期	自平成23年2月22日 至平成24年2月21日	4.00%

「株式重視型」

		収益率
第1期	自平成15年1月10日 至平成16年2月23日	16.59%
第2期	自平成16年2月24日 至平成17年2月21日	7.00%
第3期	自平成17年2月22日 至平成18年2月21日	22.27%
第4期	自平成18年2月22日 至平成19年2月21日	13.54%
第5期	自平成19年2月22日 至平成20年2月21日	13.98%
第6期	自平成20年2月22日 至平成21年2月23日	35.88%
第7期	自平成21年2月24日 至平成22年2月22日	22.84%
第8期	自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	7.49%
第9期	自平成23年2月22日 至平成24年2月21日	6.68%

（注）収益率は、以下の計算式により算出しております。ただし、第1期については、前期末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額（10,000円）を用いております。

$$\text{収益率} = (\text{当期末分配付基準価額} - \text{前期末分配落基準価額}) \div \text{前期末分配落基準価額} \times 100$$

（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24年3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24年3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24年3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	18,262,404,569	100.00
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		150,016	0.00
純資産総額		18,262,254,553	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	日本	29,384,105,180	97.63
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		714,800,943	2.37
純資産総額		30,098,906,123	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) (2012年6月限)	東京証券取引所	693,962,490	702,740,000	2.33

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	5,700,958,012	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		32,027	0.00
純資産総額		5,700,925,985	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	日本	14,310,713,310	99.34
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		94,822,833	0.66
純資産総額		14,405,536,143	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	3,189,995,275	99.99
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		166,275	0.01
純資産総額		3,190,161,550	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	19,543,535,382	55.17
	イギリス	3,513,546,947	9.92
	カナダ	1,879,487,925	5.31
	フランス	1,408,777,687	3.98
	ドイツ	1,351,187,167	3.81
	スイス	1,345,593,205	3.80
	オーストラリア	1,257,100,628	3.55
	スウェーデン	502,026,207	1.42
	香港	453,739,133	1.28
	スペイン	452,552,447	1.28
	オランダ	387,860,388	1.09
	イタリア	371,271,638	1.05
	シンガポール	274,740,225	0.77
	デンマーク	176,525,494	0.50
	ベルギー	165,584,024	0.47
	ノルウェー	150,888,424	0.43
	フィンランド	141,608,971	0.40
	イスラエル	100,061,900	0.28
	アイルランド	45,035,985	0.13

	オーストリア	41,578,894	0.12
	ポルトガル	33,816,285	0.09
	ニュージーランド	19,424,896	0.05
	ギリシャ	14,310,097	0.04
	小計	33,630,253,949	94.94
投資証券	アメリカ	469,995,068	1.33
	オーストラリア	89,481,218	0.25
	フランス	43,097,034	0.12
	イギリス	38,976,755	0.11
	香港	12,660,887	0.04
	カナダ	8,361,132	0.02
	シンガポール	7,674,263	0.02
	オランダ	5,251,445	0.02
	小計	675,497,802	1.91
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,114,833,255	3.15
純資産総額		35,420,585,006	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。

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	113	7,793,060.00	7,899,830.00	649,287,027	1.83
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	56	1,380,035.14	1,335,600.00	146,648,880	0.41
	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	17	1,000,044.89	967,810.00	127,112,165	0.36
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	6	844,660.00	846,240.00	69,831,724	0.20
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア ・ドル	6	640,350.00	651,000.00	55,627,950	0.16
	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	8	492,020.00	485,760.00	44,233,305	0.12

（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24年3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

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	2,189,864,417	100.00
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		44,685	0.00
純資産総額		2,189,819,732	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	97,786,077,270	40.60
	フランス	22,999,777,063	9.55
	ドイツ	22,311,658,054	9.26
	イタリア	22,015,558,195	9.14
	イギリス	19,916,753,867	8.27
	スペイン	10,459,765,060	4.34

カナダ	7,205,289,777	2.99
ベルギー	6,191,670,694	2.57
オランダ	6,137,829,850	2.55
オーストリア	4,210,569,409	1.75
オーストラリア	3,510,681,283	1.46
メキシコ	2,151,120,173	0.89
デンマーク	2,122,217,143	0.88
ポーランド	1,813,252,053	0.75
アイルランド	1,769,821,290	0.74
フィンランド	1,557,949,330	0.65
スウェーデン	1,484,555,366	0.62
マレーシア	1,276,422,446	0.53
シンガポール	961,270,763	0.40
スイス	939,916,941	0.39
ノルウェー	772,674,156	0.32

種類	国 / 地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
	小計	237,594,830,183	98.65
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		3,251,557,106	1.35
純資産総額		240,846,387,289	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ＳＡ（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	23,317,676,927	7,669	17,881,233,315	7,832	18,262,404,569	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	326,700	3,350 3,570	1,094,445,000 1,166,319,000	3.87
2	日本	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	1,882,600	411 412	773,748,600 775,631,200	2.58
3	日本	ホンダ	株式	輸送用機器	212,600	2,975 3,145	632,485,000 668,627,000	2.22

4	日本	キャノン	株式	電気機器	156,500	3,590 3,910	561,835,000 611,915,000	2.03
5	日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	188,100	2,707 2,723	509,186,700 512,196,300	1.70
6	日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	3,195,400	128 135	409,011,200 431,379,000	1.43
7	日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	114,500	3,770 3,755	431,665,000 429,947,500	1.43
8	日本	ファナック	株式	電気機器	26,200	14,410 14,680	377,542,000 384,616,000	1.28
9	日本	武田薬品工業	株式	医薬品	98,800	3,505 3,645	346,294,000 360,126,000	1.20
10	日本	三菱商事	株式	卸売業	181,100	1,970 1,920	356,767,000 347,712,000	1.16
11	日本	日立製作所	株式	電気機器	566,000	462 531	261,492,000 300,546,000	1.00
12	日本	J T	株式	食料品	626	440,000 466,000	275,440,000 291,716,000	0.97

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	
13	日本	三井物産	株式	卸売業	214,700	1,373 1,357	294,783,100 291,347,900	0.97
14	日本	コマツ	株式	機械	123,100	2,423 2,359	298,271,300 290,392,900	0.96
15	日本	日産自動車	株式	輸送用機器	320,700	808 881	259,106,400 282,536,700	0.94
16	日本	N T T ドコモ	株式	情報・通信業	2,049	136,900 137,400	280,508,100 281,532,600	0.94
17	日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	112,700	2,442 2,447	275,213,400 275,776,900	0.92
18	日本	ソニー	株式	電気機器	157,200	1,681 1,704	264,253,200 267,868,800	0.89
19	日本	三菱地所	株式	不動産業	174,000	1,434 1,476	249,516,000 256,824,000	0.85
20	日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	104,000	2,238 2,458	232,752,000 255,632,000	0.85
21	日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	43,800	5,220 5,210	228,636,000 228,198,000	0.76
22	日本	信越化学工業	株式	化学	47,300	4,360 4,780	206,228,000 226,094,000	0.75
23	日本	パナソニック	株式	電気機器	287,900	724 761	208,439,600 219,091,900	0.73
24	日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	94,400	2,239 2,271	211,361,600 214,382,400	0.71
25	日本	K D D I	株式	情報・通信業	386	519,000 536,000	200,334,000 206,896,000	0.69
26	日本	アステラス製薬	株式	医薬品	58,600	3,250 3,400	190,450,000 199,240,000	0.66
27	日本	野村ホールディングス	株式	証券、商品先物取引業	538,300	353 366	190,019,900 197,017,800	0.65
28	日本	東芝	株式	電気機器	530,000	347 364	183,910,000 192,920,000	0.64
29	日本	国際石油開発帝石	株式	鉱業	343	572,000 559,000	196,196,000 191,737,000	0.64
30	日本	三菱電機	株式	電気機器	252,000	728 732	183,456,000 184,464,000	0.61

(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	13.48
	輸送用機器	10.53
	銀行業	9.36
	情報・通信業	5.91
	化学	5.69
	卸売業	5.42
	機械	4.99
	医薬品	4.63
	小売業	4.13
	陸運業	3.74
	食料品	3.53
	電気・ガス業	2.92
	不動産業	2.45
	保険業	2.36
	建設業	2.33
	鉄鋼	1.86
	サービス業	1.83
	その他製品	1.57
	精密機器	1.40
	非鉄金属	1.18
	証券、商品先物取引業	1.17
	ガラス・土石製品	1.09
	繊維製品	0.89
	石油・石炭製品	0.81
	その他金融業	0.80
	ゴム製品	0.77
	鋳業	0.72
	金属製品	0.69
	海運業	0.41
	パルプ・紙	0.36
空運業	0.28	
倉庫・運輸関連業	0.23	
水産・農林業	0.10	
	合計	97.63

(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	4,741,315,712	12,025	5,701,339,256	12,024	5,700,958,012	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121回利付国債（20年）	1.900	2030/9/20	国債証券	2,046,000,000	103.17 103.17	2,110,842,930 2,110,899,120	14.65
2	日本	第296回利付国債（10年）	1.500	2018/9/20	国債証券	1,985,000,000	106.47 106.23	2,113,337,270 2,108,605,950	14.64
3	日本	第73回利付国債（5年）	1.300	2013/6/20	国債証券	1,902,000,000	101.54 101.45	1,931,374,450 1,929,483,900	13.40
4	日本	第270回利付国債（10年）	1.300	2015/6/20	国債証券	1,339,000,000	103.71 103.61	1,388,653,570 1,387,311,120	9.63
5	日本	第113回利付国債（20年）	2.100	2029/9/20	国債証券	1,238,000,000	106.92 106.82	1,323,612,770 1,322,481,120	9.18
6	日本	第312回利付国債（10年）	1.200	2020/12/20	国債証券	1,209,000,000	103.24 103.05	1,248,161,290 1,245,850,320	8.65
7	日本	第88回利付国債（5年）	0.500	2015/3/20	国債証券	1,075,000,000	101.05 101.00	1,086,312,960 1,085,760,750	7.54
8	日本	第313回利付国債（10年）	1.300	2021/3/20	国債証券	925,000,000	103.91 103.70	961,183,250 959,252,750	6.66
9	日本	第93回利付国債（5年）	0.500	2015/12/20	国債証券	664,000,000	101.10 101.07	671,292,800 671,091,520	4.66
10	日本	第269回利付国債（10年）	1.300	2015/3/20	国債証券	531,000,000	103.49 103.36	549,523,080 548,825,670	3.81
11	日本	第273回利付国債（10年）	1.500	2015/9/20	国債証券	386,000,000	104.61 104.51	403,791,050 403,393,160	2.80
12	日本	第305回利付国債（10年）	1.300	2019/12/20	国債証券	385,000,000	104.86 104.54	403,711,460 402,490,550	2.79
13	日本	第281回利付国債（10年）	2.000	2016/6/20	国債証券	112,000,000	107.42 107.27	120,308,550 120,142,400	0.83
14	日本	第43回利付国債（20年）	2.900	2019/9/20	国債証券	13,000,000	116.90 116.35	15,196,700 15,124,980	0.10
								投資比率：合計	99.34

（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	-	99.34
合計		99.34

（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		3,115,838,323	0.9753	3,038,877,117	1.0238	3,189,995,275	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	APPLE INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	17,178	41,269	708,923,052	50,124	861,036,829	2.43
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	88,672	7,037	623,994,422	7,075	627,346,880	1.77
3	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・サー ビス	21,822	15,897	346,908,475	17,118	373,542,695	1.05
4	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サー ビス	139,962	2,568	359,483,649	2,640	369,491,674	1.04
5	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	36,856	8,766	323,093,900	8,782	323,669,447	0.91
6	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	195,176	1,585	309,280,417	1,640	320,028,233	0.90
7	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	60,995	5,086	310,202,332	5,108	311,590,883	0.88
8	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	109,538	2,467	270,177,875	2,565	280,981,389	0.79
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソ ナル用品	50,878	5,335	271,431,733	5,508	280,213,225	0.79
10	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	50,443	5,342	269,442,701	5,387	271,722,952	0.77
11	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	70,231	3,162	222,059,838	3,754	263,620,296	0.74
12	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	142,024	1,742	247,349,864	1,843	261,707,596	0.74
13	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	92,588	2,555	236,588,922	2,790	258,276,874	0.73
14	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サー ビス	4,740	49,695	235,556,013	53,293	252,607,956	0.71
15	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	330,084	758	250,148,151	719	237,185,534	0.67
16	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	37,769	5,675	214,347,365	6,066	229,123,519	0.65
17	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	32,095	6,718	215,620,969	7,122	228,572,999	0.65
18	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製 造装置	93,993	2,250	211,441,041	2,314	217,544,016	0.61
19	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	928,429	229	212,175,364	229	212,724,094	0.60
20	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	350,225	641	224,472,931	603	211,087,352	0.60
21	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	43,089	4,735	204,031,585	4,533	195,321,006	0.55
22	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	67,228	3,012	202,465,606	2,861	192,355,570	0.54
23	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	12,969	14,734	191,078,865	14,296	185,410,270	0.52

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 (%)
24	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	74,457	2,366	176,183,883	2,409	179,366,086	0.51
25	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	56,204	3,169	178,124,324	3,124	175,583,650	0.50
26	アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	35,014	5,135	179,804,985	4,999	175,027,836	0.49
27	オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	59,275	3,008	178,289,716	2,927	173,477,919	0.49
28	アメリカ	株式	QUALCOMM	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	31,064	5,139	159,622,948	5,583	173,435,490	0.49
29	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	99,172	1,668	165,382,708	1,728	171,414,408	0.48
30	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	93,166	1,857	173,023,013	1,839	171,309,914	0.48
投資比率：合計									23.08	

(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24年3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	11.52	
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.42	
	資本財	7.25	
	銀行	7.20	
	素材	6.89	
	食品・飲料・タバコ	6.70	
	ソフトウェア・サービス	5.91	
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.07	
	各種金融	4.73	
	保険	3.94	
	電気通信サービス	3.79	
	公益事業	3.55	
	小売	2.78	
	ヘルスケア機器・サービス	2.68	
	メディア	2.49	
	食品・生活必需品小売り	2.18	
	運輸	1.73	
	家庭用品・パーソナル用品	1.73	
	消費者サービス	1.69	
	半導体・半導体製造装置	1.67	
	自動車・自動車部品	1.32	
	耐久消費財・アパレル	1.25	
	商業・専門サービス	0.80	
	不動産	0.65	
		小計	94.94

種類	業種	投資比率(%)
投資証券		1.91
合計		96.85

(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24年3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		1,420,421,883	1.4843	2,108,332,201	1.5417	2,189,864,417	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	8,780	2,634,057,996	8,745	2,623,356,858	1.09
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2013/06/30	26,800,000	8,234	2,206,656,845	8,231	2,205,797,795	0.92
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	24,500,000	8,402	2,058,559,506	8,389	2,055,196,702	0.85
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	21,800,000	9,408	2,050,989,149	9,344	2,036,995,644	0.85
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2013/09/30	23,000,000	8,200	1,885,946,534	8,198	1,885,568,460	0.78
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	19,750,000	9,465	1,869,402,509	9,402	1,856,968,394	0.77
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	21,000,000	8,704	1,827,857,929	8,667	1,820,108,234	0.76
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2014/07/15	20,700,000	8,272	1,712,238,544	8,260	1,709,839,665	0.71
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	18,000,000	9,273	1,669,081,644	9,216	1,658,799,675	0.69
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2015/06/30	18,300,000	8,597	1,573,174,297	8,560	1,566,466,113	0.65
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2021/05/15	17,000,000	9,101	1,547,208,668	8,984	1,527,354,029	0.63
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	16,500,000	9,182	1,514,951,969	9,126	1,505,730,251	0.63
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2039/11/15	15,000,000	10,202	1,530,275,062	9,998	1,499,651,068	0.62
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2013/05/15	17,000,000	8,561	1,455,410,657	8,531	1,450,338,712	0.60
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2039/05/15	14,700,000	10,005	1,470,781,666	9,804	1,441,144,692	0.60
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	15,500,000	9,339	1,447,520,006	9,259	1,435,175,479	0.60

17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2014/01/31	17,000,000	8,211	1,395,920,096	8,208	1,395,315,794	0.58
----	------	------	-----------------	-------	------------	------------	-------	---------------	-------	---------------	------

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 (%)
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11.250	2015/02/15	12,900,000	10,854	1,400,199,276	10,733	1,384,539,370	0.57
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	14,000,000	9,866	1,381,240,757	9,778	1,368,928,695	0.57
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2021/08/15	16,500,000	8,360	1,379,324,908	8,252	1,361,640,908	0.57
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2014/04/30	16,000,000	8,496	1,359,317,396	8,474	1,355,832,540	0.56
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2018/04/30	15,300,000	8,923	1,365,275,349	8,855	1,354,863,191	0.56
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/10/31	15,000,000	8,651	1,297,673,253	8,622	1,293,333,621	0.54
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/08/31	15,000,000	8,632	1,294,776,055	8,604	1,290,547,380	0.54
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	13,800,000	9,464	1,306,033,948	9,344	1,289,474,307	0.54
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2038/05/15	12,500,000	10,384	1,297,985,575	10,177	1,272,177,915	0.53
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2016/03/31	14,600,000	8,751	1,277,600,318	8,704	1,270,748,466	0.53
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	13,500,000	9,467	1,278,085,732	9,357	1,263,261,943	0.52
29	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	3.000	2015/10/25	10,600,000	11,569	1,226,278,604	11,650	1,234,911,596	0.51
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	12,800,000	9,668	1,237,452,640	9,587	1,227,174,287	0.51
投資比率：合計											19.38

(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24年3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		98.65
合計		98.65

(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24年3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 (2012年6月限)	買建	82	693,962,490	702,740,000	2.33

(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	113	7,793,060.00	7,899,830.00	649,287,027	1.83
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	56	1,380,035.14	1,335,600.00	146,648,880	0.41
	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	17	1,000,044.89	967,810.00	127,112,165	0.36
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	6	844,660.00	846,240.00	69,831,724	0.20
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア ・ドル	6	640,350.00	651,000.00	55,627,950	0.16
	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	8	492,020.00	485,760.00	44,233,305	0.12

(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24年3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。

(4) 【設定及び解約の実績】

「債券重視型」

		設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第1期	自平成15年1月10日 至平成16年2月23日	49,699,625	6,017,055	43,682,570
第2期	自平成16年2月24日 至平成17年2月21日	489,629,732	57,586,807	475,725,495
第3期	自平成17年2月22日 至平成18年2月21日	734,634,479	161,022,679	1,049,337,295
第4期	自平成18年2月22日 至平成19年2月21日	455,517,896	162,320,721	1,342,534,470
第5期	自平成19年2月22日 至平成20年2月21日	504,409,601	270,097,830	1,576,846,241
第6期	自平成20年2月22日 至平成21年2月23日	512,581,327	327,540,966	1,761,886,602
第7期	自平成21年2月24日 至平成22年2月22日	367,240,452	194,490,691	1,934,636,363

第8期	自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	333,709,523	176,563,674	2,091,782,212
第9期	自平成23年2月22日 至平成24年2月21日	387,759,923	277,103,043	2,202,439,092

「標準型」

		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	自平成15年1月10日 至平成16年2月23日	92,750,504	55,495	92,695,009
第2期	自平成16年2月24日 至平成17年2月21日	1,400,565,557	75,026,595	1,418,233,971
第3期	自平成17年2月22日 至平成18年2月21日	1,960,859,580	335,731,584	3,043,361,967
第4期	自平成18年2月22日 至平成19年2月21日	1,394,017,782	382,068,206	4,055,311,543
第5期	自平成19年2月22日 至平成20年2月21日	1,292,543,957	651,710,119	4,696,145,381
第6期	自平成20年2月22日 至平成21年2月23日	1,260,534,424	727,669,423	5,229,010,382
第7期	自平成21年2月24日 至平成22年2月22日	1,066,340,314	454,795,045	5,840,555,651
第8期	自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	987,847,202	369,377,163	6,459,025,690
第9期	自平成23年2月22日 至平成24年2月21日	1,099,851,674	799,681,966	6,759,195,398

「株式重視型」

		設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	自平成15年1月10日 至平成16年2月23日	50,989,564	623,697	50,365,867
第2期	自平成16年2月24日 至平成17年2月21日	716,961,838	65,907,199	701,420,506
第3期	自平成17年2月22日 至平成18年2月21日	1,116,762,077	260,594,832	1,557,587,751
第4期	自平成18年2月22日 至平成19年2月21日	880,091,639	371,661,429	2,066,017,961
第5期	自平成19年2月22日 至平成20年2月21日	873,103,865	560,232,208	2,378,889,618
第6期	自平成20年2月22日 至平成21年2月23日	700,741,378	393,780,964	2,685,850,032
第7期	自平成21年2月24日 至平成22年2月22日	732,174,234	319,548,038	3,098,476,228
第8期	自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	629,814,287	284,208,303	3,444,082,212
第9期	自平成23年2月22日 至平成24年2月21日	647,867,405	508,663,783	3,583,285,834

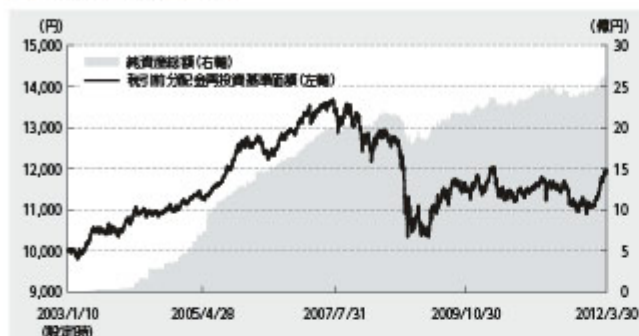
(注) 本邦外における販売又は解約の実績はありません。

〈参考情報〉

2012年3月末現在

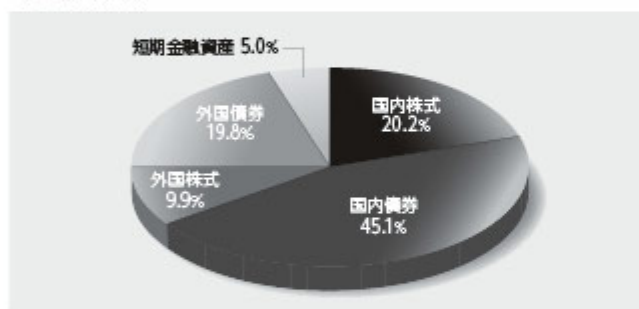
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

● 基準価額・純資産の推移



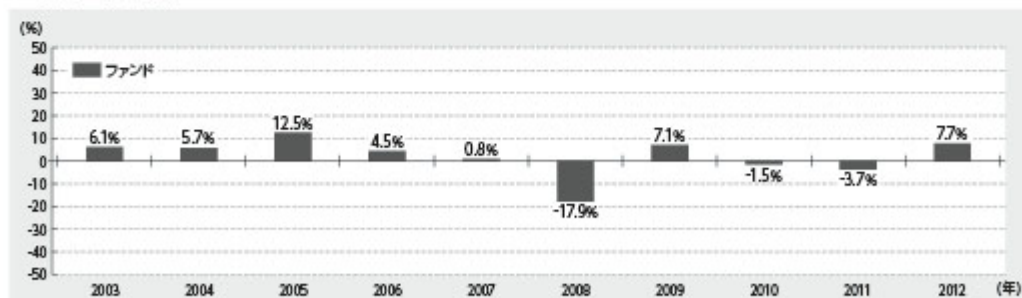
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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、2012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	11,937円
純資産総額	26億円

● 分配の推移 1万円当り(税引前)

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
第9期	2012年2月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2012年3月末現在

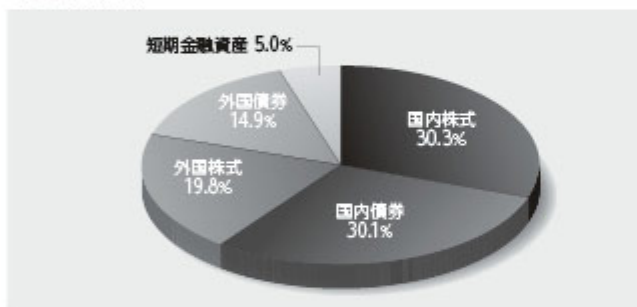
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

● 基準価額・純資産の推移



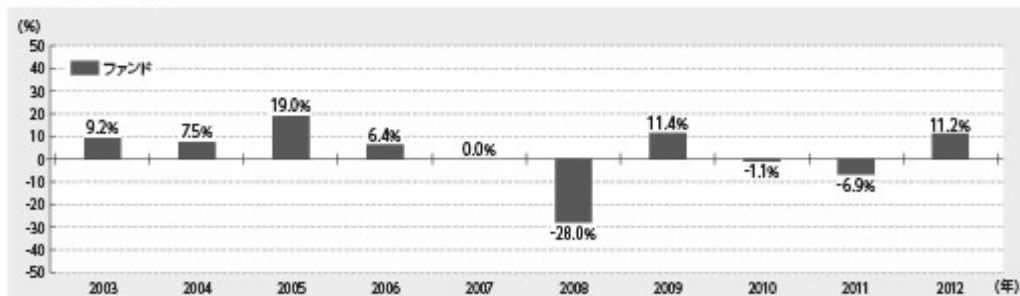
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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、2012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	12,201円
純資産総額	82億円

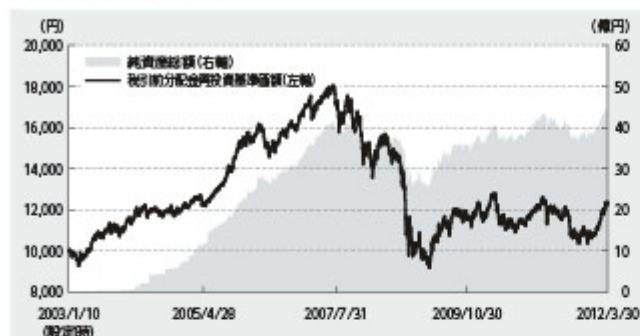
● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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
第9期	2012年2月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2012年3月末現在

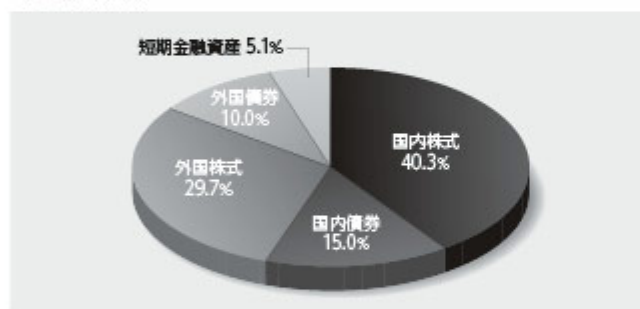
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

● 基準価額・純資産の推移



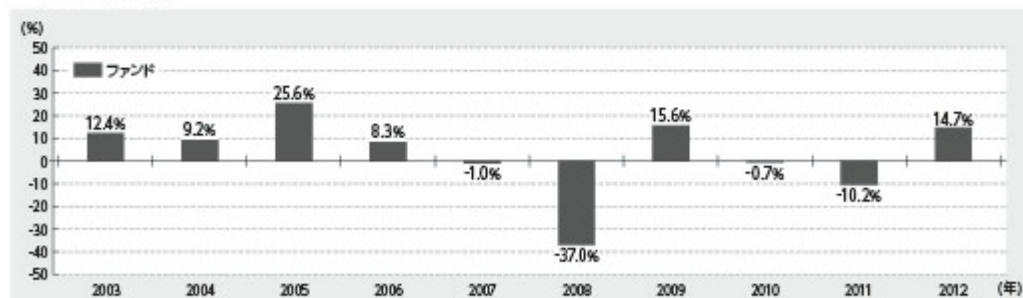
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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、2012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	12,305円
純資産総額	44億円

● 分配の推移 1万円当り(税引前)

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
第9期	2012年2月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受け付けを行います。

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

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

1円以上1円単位とします。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

2【換金（解約）手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受け付けを行います。

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

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

換金単位

1口単位とします。

換金価額

換金請求受付日の翌々営業日の基準価額とします。

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

換金請求受付日から起算して、原則として6営業日目からお支払いします。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

ファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

主な投資資産	評価方法の概要
投資信託受益証券	計算日の前営業日の基準価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限です。

（4）【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

（5）【その他】

繰上償還

- 1．委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
 - ・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき
 - ・やむを得ない事情が発生したとき
- 2．委託会社は、前記1．により解約するときには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 3．前記2．の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
- 4．前記3．の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1．の信託契約の解約をしません。
- 5．委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 6．前記3．から5．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記3．の一定の期間を1ヵ月以上設けることが困難な場合には適用しません。
- 7．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
- 8．委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「約款の変更 4．」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社の間において存続します。
- 9．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任

した場合、委託会社は後記「 約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。

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

約款の変更

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

反対者の買取請求権

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

公告

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

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

運用報告書の作成

委託会社は、ファンドの計算期間の末日毎および償還時に期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、これを販売会社を通じてファンドの知られたる受益者に交付します。

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 反対者の買取請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 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期計算期間（平成22年2月23日から平成23年2月21日まで）及び第9期計算期間（平成23年2月22日から平成24年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （平成23年2月21日現在）	第9期 （平成24年2月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	99,412,168	91,311,554
投資信託受益証券	2,342,068,410	2,440,617,617
未収入金	33,000,000	36,000,000
流動資産合計	2,474,480,578	2,567,929,171
資産合計		
	2,474,480,578	2,567,929,171
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,891,106	3,229,053
未払受託者報酬	370,230	382,559
未払委託者報酬	1,049,045	1,084,018
その他未払費用	437,474	443,308
流動負債合計	5,747,855	5,138,938
負債合計		
	5,747,855	5,138,938
純資産の部		
元本等		
元本	2,091,782,212	2,202,439,092
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	376,950,511	360,351,141
純資産合計	2,468,732,723	2,562,790,233
負債純資産合計	2,474,480,578	2,567,929,171

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）
営業収益		
受取配当金	13,289,785	33,468,208
受取利息	75,021	62,942
有価証券売買等損益	52,049,202	60,919,001
営業収益合計	65,414,008	27,387,851
営業費用		
受託者報酬	730,134	764,794
委託者報酬	2,068,874	2,167,131
その他費用	871,502	884,776
営業費用合計	3,670,510	3,816,701
営業利益又は営業損失（ ）	61,743,498	31,204,552
経常利益又は経常損失（ ）	61,743,498	31,204,552
当期純利益又は当期純損失（ ）	61,743,498	31,204,552
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	457,449	10,104,831
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	50,534,118	53,829,623
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	50,534,118	53,829,623
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,709,659	49,329,272
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	26,709,659	49,329,272
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	376,950,511	360,351,141

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2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、計算期間末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、平成22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。	-

(貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 (平成23年2月21日現在)	第9期 (平成24年2月21日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	2,091,782,212口	2,202,439,092口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1802円 (11,802円)	1.1636円 (11,636円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)
分配金の計算過程 計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,669,500円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(412,669,496円)、及び分配準備積立金(130,356,898円)より、分配対象収益は554,695,894円(1口当たり0.265179円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	分配金の計算過程 計算期間末における費用控除後の配当等収益(27,941,495円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(461,923,920円)、及び分配準備積立金(124,637,577円)より、分配対象収益は614,502,992円(1口当たり0.279010円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)

<p>1．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2．金融商品の内容及びそのリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1．金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2．金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>
---	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 (平成23年2月21日現在)	第9期 (平成24年2月21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．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．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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2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計算期間における元本額の変動

項目	第8期 （平成23年2月21日現在）	第9期 （平成24年2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	333,709,523円	387,759,923円
期中一部解約元本額	176,563,674円	277,103,043円

2 有価証券関係

第8期（平成23年2月21日現在）

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	44,345,069
合計	44,345,069

第9期（平成24年2月21日現在）

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	39,455,515
合計	39,455,515

3 デリバティブ取引関係

第8期（平成23年2月21日現在）

該当事項はありません。

第9期（平成24年2月21日現在）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
投資信託受益証券	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）	586,976,416	513,721,759	
	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）	988,862,768	1,147,871,901	
	ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	292,168,190	261,227,578	
	ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	443,888,881	517,796,379	
合計		2,311,896,255	2,440,617,617	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （平成23年2月21日現在）	第9期 （平成24年2月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	297,004,022	284,271,757
投資信託受益証券	7,519,463,066	7,584,157,806
未収入金	118,000,000	104,000,000
流動資産合計	7,934,467,088	7,972,429,563
資産合計	7,934,467,088	7,972,429,563
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,193,366	4,207,984
未払受託者報酬	1,152,513	1,165,555
未払委託者報酬	3,265,506	3,302,516
その他未払費用	649,256	654,178
流動負債合計	8,260,641	9,330,233
負債合計	8,260,641	9,330,233
純資産の部		
元本等		
元本	6,459,025,690	6,759,195,398
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,467,180,757	1,203,903,932
純資産合計	7,926,206,447	7,963,099,330
負債純資産合計	7,934,467,088	7,972,429,563

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）
営業収益		
受取配当金	30,607,312	78,614,360
受取利息	233,211	192,687
有価証券売買等損益	356,488,872	373,919,619
営業収益合計	387,329,395	295,112,572
営業費用		
受託者報酬	2,267,416	2,371,478
委託者報酬	6,424,501	6,719,401
その他費用	1,291,008	1,314,128
営業費用合計	9,982,925	10,405,007
営業利益又は営業損失（ ）	377,346,470	305,517,579
経常利益又は経常損失（ ）	377,346,470	305,517,579
当期純利益又は当期純損失（ ）	377,346,470	305,517,579
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	519,669	56,835,046
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	168,889,459	163,923,077
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	168,889,459	163,923,077
剰余金減少額又は欠損金増加額	62,502,384	178,517,369
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	62,502,384	178,517,369
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,467,180,757	1,203,903,932

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2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、計算期間末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、平成22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。	-

(貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 (平成23年2月21日現在)	第9期 (平成24年2月21日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	6,459,025,690口	6,759,195,398口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2272円 (12,272円)	1.1781円 (11,781円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)
<p>分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(28,526,808円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,810,265,379円)、及び分配準備積立金(677,757,286円)より、分配対象収益は2,516,549,473円(1口当たり0.389618円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。</p>	<p>分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(64,463,121円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,013,797,834円)、及び分配準備積立金(625,192,000円)より、分配対象収益は2,703,452,955円(1口当たり0.399967円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)

<p>1．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2．金融商品の内容及びそのリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1．金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2．金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>
---	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 (平成23年2月21日現在)	第9期 (平成24年2月21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．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．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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2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計算期間における元本額の変動

項目	第8期 （平成23年2月21日現在）	第9期 （平成24年2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	987,847,202円	1,099,851,674円
期中一部解約元本額	369,377,163円	799,681,966円

2 有価証券関係

第8期（平成23年2月21日現在）

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	334,755,398
合計	334,755,398

第9期（平成24年2月21日現在）

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	274,439,260
合計	274,439,260

3 デリバティブ取引関係

第8期（平成23年2月21日現在）

該当事項はありません。

第9期（平成24年2月21日現在）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
投資信託受益証券	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）	2,732,379,205	2,391,378,280	
	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）	2,045,467,391	2,374,378,547	
	ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	1,807,416,089	1,616,010,725	
	ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	1,030,767,471	1,202,390,254	
合計		7,616,030,156	7,584,157,806	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （平成23年2月21日現在）	第9期 （平成24年2月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	156,891,770	161,553,186
投資信託受益証券	4,122,921,301	4,014,381,342
未収入金	68,000,000	50,000,000
流動資産合計	4,347,813,071	4,225,934,528
資産合計	4,347,813,071	4,225,934,528
負債の部		
流動負債		
未払解約金	963,595	5,509,277
未払受託者報酬	619,502	604,866
未払委託者報酬	1,755,333	1,713,883
その他未払費用	520,555	517,411
流動負債合計	3,858,985	8,345,437
負債合計	3,858,985	8,345,437
純資産の部		
元本等		
元本	3,444,082,212	3,583,285,834
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	899,871,874	634,303,257
純資産合計	4,343,954,086	4,217,589,091
負債純資産合計	4,347,813,071	4,225,934,528

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）
営業収益		
受取配当金	10,906,297	28,083,004
受取利息	127,427	101,674
有価証券売買等損益	295,969,064	303,622,962
営業収益合計	307,002,788	275,438,284
営業費用		
受託者報酬	1,215,058	1,243,781
委託者報酬	3,442,821	3,524,210
その他費用	1,033,137	1,044,436
営業費用合計	5,691,016	5,812,427
営業利益又は営業損失（ ）	301,311,772	281,250,711
経常利益又は経常損失（ ）	301,311,772	281,250,711
当期純利益又は当期純損失（ ）	301,311,772	281,250,711
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,351,046	52,932,663
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	114,378,444	92,573,879
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	114,378,444	92,573,879
剰余金減少額又は欠損金増加額	49,720,783	129,824,448
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	49,720,783	129,824,448
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	899,871,874	634,303,257

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2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、計算期間末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、平成22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。	-

(貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 (平成23年2月21日現在)	第9期 (平成24年2月21日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	3,444,082,212口	3,583,285,834口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2613円 (12,613円)	1.1770円 (11,770円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)
<p>分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,143,652円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,406,473,526円)、及び分配準備積立金(366,247,149円)より、分配対象収益は1,782,864,327円(1口当たり0.517660円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。</p>	<p>分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,750,807円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,532,099,564円)、及び分配準備積立金(324,850,692円)より、分配対象収益は1,877,701,063円(1口当たり0.524017円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第8期 (自平成22年2月23日 至平成23年2月21日)	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)

<p>1．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2．金融商品の内容及びそのリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1．金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2．金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>3．金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>
---	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 (平成23年2月21日現在)	第9期 (平成24年2月21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．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．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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

第8期 （自平成22年2月23日 至平成23年2月21日）	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2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計算期間における元本額の変動

項目	第8期 （平成23年2月21日現在）	第9期 （平成24年2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	629,814,287円	647,867,405円
期中一部解約元本額	284,208,303円	508,663,783円

2 有価証券関係

第8期（平成23年2月21日現在）

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	289,459,596
合計	289,459,596

第9期（平成24年2月21日現在）

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	232,645,597
合計	232,645,597

3 デリバティブ取引関係

第8期（平成23年2月21日現在）

該当事項はありません。

第9期（平成24年2月21日現在）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
投資信託受益証券	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）	1,925,003,530	1,684,763,089	
	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）	540,132,639	626,985,967	
	ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	1,431,638,660	1,280,028,125	
	ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	362,283,893	422,604,161	
合計		4,259,058,722	4,014,381,342	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

<参考>

開示対象各ファンド（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、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、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計算期間末日の前営業日（以下、「計算日」という。）における上記の各投資信託の状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,677,652	23,198,007
親投資信託受益証券	20,922,078,867	17,567,591,828
未収入金	17,331,214	29,756,390
流動資産合計	20,967,087,733	17,620,546,225
資産合計	20,967,087,733	17,620,546,225
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,950,193	29,440,490
未払受託者報酬	6,190,248	5,248,245
未払委託者報酬	21,665,967	18,368,947
その他未払費用	385,205	357,716
流動負債合計	45,191,613	53,415,398
負債合計	45,191,613	53,415,398
純資産の部		
元本等		
元本	20,526,206,277	20,073,176,698
剰余金		
剰余金又は欠損金()	395,689,843	2,506,045,871
純資産合計	20,921,896,120	17,567,130,827
負債純資産合計	20,967,087,733	17,620,546,225

(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23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)

1. 計算日における受益権総数	20,526,206,277口	20,073,176,698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	- 円	2,506,045,871円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0193円 (10,193円)	0.8752円 (8,752円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

(自平成22年3月11日 至平成23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは親投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
----	----------------	----------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<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>

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成22年3月11日 至平成23年2月18日）	（自平成23年3月11日 至平成24年2月20日）
該当事項はありません。	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23年2月18日）	（自平成23年3月11日 至平成24年2月20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元本額の変動

項目	（平成23年2月18日現在）	（平成24年2月20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	1,494,886,982円	2,135,649,603円
期首から計算日までの一部解約元本額	1,710,062,784円	2,550,642,991円

2 有価証券関係

（平成23年2月18日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,519,059,443
合計	1,519,059,443

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、当ファンドの期首（平成22年3月11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24年2月20日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,670,732,024
合計	1,670,732,024

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、当ファンドの期首（平成23年3月11日）から計算日までの期間に対応するものであります。

3 デリバティブ取引関係

（平成23年2月18日現在）

該当事項はありません。

（平成24年2月20日現在）

該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	23,653,684,972	17,567,591,828	
合計		23,653,684,972	17,567,591,828	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ国内株式インデックスSA（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貸借対照

表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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	379,103,292	228,695,144
株式	33,229,743,150	28,502,185,220
派生商品評価勘定	9,009,880	10,246,530
未収入金	8,637,870	335,046,440
未収配当金	30,301,891	30,808,593
差入委託証拠金	6,435,000	12,285,000
流動資産合計	33,663,231,083	29,119,266,927
資産合計	33,663,231,083	29,119,266,927
負債の部		
流動負債		
前受金	17,700,000	22,205,000
未払金	-	14,612,910
未払解約金	33,530,455	47,283,538
流動負債合計	51,230,455	84,101,448
負債合計	51,230,455	84,101,448
純資産の部		
元本等		
元本	38,987,000,936	39,093,719,161
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,375,000,308	10,058,553,682
純資産合計	33,612,000,628	29,035,165,479
負債純資産合計	33,663,231,083	29,119,266,927

(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23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、証券取引所における計算日の最終相場によっております。	株式 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。	株価指数先物取引 同左

<p>3. 収益及び費用の計上基準</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>(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>同左</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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	38,987,000,936口	39,093,719,161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	5,375,000,308円	10,058,553,682円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8621円 (8,621円)	0.7427円 (7,427円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

(自平成22年3月11日 至平成23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)
<p>1. 金融商品に対する取組方針 本マザーファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 本マザーファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは株価変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p>

<p>3．金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>3．金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>
--	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<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>

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成22年3月11日 至平成23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)
該当事項はありません。	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23年2月18日）	（自平成23年3月11日 至平成24年2月20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23年2月18日現在）	（平成24年2月20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	4,146,329,832円	5,286,578,890円
同期間中の一部解約元本額	4,944,812,887円	5,072,624,852円
同期間末日の元本額	38,987,000,936円	39,093,719,161円
上記元本額の内訳		
ニッセイTOPIXオープン	10,097,374,163円	10,699,762,197円
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）	24,268,737,812円	23,653,684,972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）	192,483,951円	188,809,005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）	333,410,786円	309,578,192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）	324,235,465円	364,167,872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）	2,221,102,091円	2,332,842,758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）	1,549,656,668円	1,544,874,165円
合計	38,987,000,936円	39,093,719,161円

2 有価証券関係

（平成23年2月18日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	2,342,324,009
合計	2,342,324,009

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、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24年2月20日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	4,977,075,182
合計	4,977,075,182

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、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。

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23年2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	146,910,120	-	155,920,000	9,009,880
合計		146,910,120	-	155,920,000	9,009,880

（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。

（注3）上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（平成24年2月20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	366,033,470	-	376,280,000	10,246,530
合計		366,033,470	-	376,280,000	10,246,530

（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。

（注3）上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

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23年2月18日現在）	（平成24年2月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,021,458	5,102,347
親投資信託受益証券	5,235,591,377	5,341,349,965
未収入金	2,233,822	315,985
流動資産合計	5,242,846,657	5,346,768,297

資産合計	5,242,846,657	5,346,768,297
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,167,668	248,748
未払受託者報酬	698,217	719,131
未払委託者報酬	4,189,497	4,314,928
その他未払費用	231,448	233,483
流動負債合計	7,286,830	5,516,290
負債合計	7,286,830	5,516,290
純資産の部		
元本等		
元本	4,662,200,618	4,601,225,445
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	573,359,209	740,026,562
純資産合計	5,235,559,827	5,341,252,007
負債純資産合計	5,242,846,657	5,346,768,297

(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23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	4,662,200,618口	4,601,225,445口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1230円 (11,230円)	1.1608円 (11,608円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

(自平成22年3月11日 至平成23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左

<p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは親投資信託受益証券の価格変動リスクなどの市場リスク及び流動性リスクに晒されております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>
---	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成23年2月18日現在）	（平成24年2月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<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>

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成22年3月11日 至平成23年2月18日）	（自平成23年3月11日 至平成24年2月20日）
該当事項はありません。	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23年2月18日）	（自平成23年3月11日 至平成24年2月20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元本額の変動

項目	（平成23年2月18日現在）	（平成24年2月20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	1,059,347,189円	813,837,618円
期首から計算日までの一部解約元本額	611,463,182円	938,214,843円

2 有価証券関係

（平成23年2月18日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	36,851,225
合計	36,851,225

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、当ファンドの期首（平成22年3月11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24年2月20日現在）

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	159,703,409
合計	159,703,409

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、当ファンドの期首（平成23年3月11日）から計算日までの期間に対応するものであります。

3 デリバティブ取引関係

（平成23年2月18日現在）

該当事項はありません。

（平成24年2月20日現在）

該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	4,441,871,073	5,341,349,965	

合計	4,441,871,073	5,341,349,965	
----	---------------	---------------	--

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ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貸借対照表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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	128,293,669	88,089,239
国債証券	29,766,060,759	13,816,162,110
未収利息	112,901,259	47,605,141
前払費用	7,866,380	12,599,965
流動資産合計	30,015,122,067	13,964,456,455
資産合計	30,015,122,067	13,964,456,455
負債の部		
流動負債		
未払金	-	142,134,860
未払解約金	12,476,431	5,566,050
流動負債合計	12,476,431	147,700,910
負債合計	12,476,431	147,700,910
純資産の部		
元本等		

元本	25,851,806,717	11,490,153,246
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,150,838,919	2,326,602,299
純資産合計	30,002,645,636	13,816,755,545
負債純資産合計	30,015,122,067	13,964,456,455

(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23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	25,851,806,717口	11,490,153,246口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1606円 (11,606円)	1.2025円 (12,025円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

(自平成22年3月11日 至平成23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)
<p>1. 金融商品に対する取組方針 本マザーファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 本マザーファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p>

(自平成22年3月11日 至平成23年2月18日)	(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)
--------------------------------	--------------------------------

<p>3．金融商品に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>3．金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>
---	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成23年2月18日現在）	（平成24年2月20日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<p>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。</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．国債証券 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>

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成22年3月11日 至平成23年2月18日）	（自平成23年3月11日 至平成24年2月20日）
該当事項はありません。	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23年2月18日）	（自平成23年3月11日 至平成24年2月20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23年2月18日現在)	(平成24年2月20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	2,434,495,517円	2,108,336,839円
同期間中の一部解約元本額	1,545,971,250円	16,568,930,263円
同期間末日の元本額	25,851,806,717円	11,490,153,246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	- 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）	4,511,107,511円	4,441,871,073円
DCニッセイ国内債券インデックス	3,629,631,317円	4,229,699,124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）	135,638,130円	109,658,367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）	126,316,586円	96,843,352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）	621,048,007円	574,256,918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）	1,805,760,683円	1,559,383,894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）	583,772,705円	478,440,518円
合計	25,851,806,717円	11,490,153,246円

2 有価証券関係

(平成23年2月18日現在)

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	171,236,700
合計	171,236,700

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、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24年2月20日現在)

売買目的有価証券

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	190,868,890
合計	190,868,890

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、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。

3 デリバティブ取引関係

(平成23年2月18日現在)

該当事項はありません。

（平成24年2月20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。

本報告書の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) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	第11期 (平成23年 2月21日現在)	第12期 (平成24年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,786,449	4,661,941
親投資信託受益証券		3,144,713,173	3,202,357,307
未収入金		60,840,000	
未収利息		9	8
流動資産合計		3,210,339,631	3,207,019,256
資産合計		3,210,339,631	3,207,019,256
負債の部			
流動負債			
未払解約金		60,999,999	
未払受託者報酬		918,380	913,420
未払委託者報酬		3,673,445	3,653,588
流動負債合計		65,591,824	4,567,008
負債合計		65,591,824	4,567,008
純資産の部			
元本等			
元本	1	3,292,074,800	3,581,648,757
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()	3	147,326,993	379,196,509
(分配準備積立金)		(371,043,220)	(359,791,619)
元本等合計		3,144,747,807	3,202,452,248
純資産合計		3,144,747,807	3,202,452,248
負債純資産合計		3,210,339,631	3,207,019,256

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

区 分	注記 番号	第11期 自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日	第12期 自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		1,356	1,477
有価証券売買等損益		337,808,861	153,025,866
営業収益合計		337,810,217	153,024,389
営業費用			
受託者報酬		1,800,029	1,854,262

委託者報酬		7,200,009	7,416,928
営業費用合計		9,000,038	9,271,190
営業利益又は営業損失()		328,810,179	162,295,579
経常利益又は経常損失()		328,810,179	162,295,579
当期純利益又は当期純損失()		328,810,179	162,295,579
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		5,940,555	82,006,348
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		112,955,051	57,772,058
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		112,955,051	57,772,058
剰余金減少額又は欠損金増加額		141,761,366	209,352,343
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		141,761,366	209,352,343
分配金	1		
期末剰余金又は期末欠損金()		147,326,993	379,196,509

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第11期 自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	第12期 自平成23年2月22日 至平成24年2月20日
1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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日及び平成23年2月20日が休日のため、当計算期間は平成22年2月23日から平成23年2月21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、当計算期間は平成23年2月22日から平成24年2月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第11期 (平成23年2月21日現在)	第12期 (平成24年2月20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	877,761,375円	1,166,352,356円
期中一部解約元本額	796,014,488円	876,778,399円
2 計算期間末日における受益権の総数	3,292,074,800口	3,581,648,757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147,326,993円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は379,196,509円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第11期 自平成22年2月23日 至平成23年2月21日	第12期 自平成23年2月22日 至平成24年2月20日

1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（64,155,328円）、収益調整金（2,970,285,075円）及び分配準備積立金（306,887,892円）より分配対象収益は3,341,328,295円（1万口当たり10,149円）ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（70,069,099円）、収益調整金（3,351,238,968円）及び分配準備積立金（289,722,520円）より分配対象収益は3,711,030,587円（1万口当たり10,361円）ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行っておりません。
------------	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第11期 自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日	第12期 自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、親投資信託受益証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	第11期 (平成23年 2月21日現在)	第12期 (平成24年 2月20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。	同左

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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 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	(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）」に記載していません。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。 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。	(2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左 同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	第11期 (平成23年 2月21日現在)	第12期 (平成24年 2月20日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託 受益証券	333,332,935	69,609,326
合計	333,332,935	69,609,326

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

第11期（平成23年2月21日現在）

該当する事項はありません。

第12期（平成24年2月20日現在）

該当する事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第11期 自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日	第12期 自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 (平成23年 2月21日現在)	第12期 (平成24年 2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9552 円 (9,552 円)	0.8941 円 (8,941 円)

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
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	3,283,458,738	3,202,357,307	
合計		3,283,458,738	3,202,357,307	

（注）親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

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、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23年 2月21日現在）	（平成24年 2月20日現在）
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		329,860,630	574,542,058
コール・ローン		9,901,700,869	5,436,767
株式		20,938,930,731	36,683,950,027
投資証券		327,240,290	724,477,878
派生商品評価勘定		37,332,207	63,017,328
未収入金		19,995,236	261,883
未収配当金		67,637,173	52,519,090
未収利息		18,989	10
差入委託証拠金		293,947,919	238,679,232
流動資産合計		31,916,664,044	38,342,884,273
資産合計		31,916,664,044	38,342,884,273
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		65,944	50,969
未払解約金		9,959,740,000	
流動負債合計		9,959,805,944	50,969
負債合計		9,959,805,944	50,969
純資産の部			
元本等			
元本	1	21,138,250,567	39,314,181,997
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	3	818,607,533	971,348,693

元本等合計		21,956,858,100	38,342,833,304
純資産合計		21,956,858,100	38,342,833,304
負債純資産合計		31,916,664,044	38,342,884,273

(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23年 2月21日	自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20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	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。	先物取引 同左
	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 収益及び費用の計上 基準	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。	受取配当金 同左

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23年 2月21日現在)	(平成24年 2月20日現在)
1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	36,509,278,699円	21,138,250,567円
同期中における追加設定元本額	25,381,919,024円	20,630,302,882円
同期中における一部解約元本額	40,752,947,156円	2,454,371,452円
同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	3,027,547,101円	3,283,458,738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	1,578,061,066円	1,649,887,423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＞	4,432,475,838円	5,264,438,574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＞	9,272,195,280円	15,293,930,089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＞	2,218,331,585円	3,544,395,681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＞	609,639,697円	601,109,006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	9,676,962,486円
計	21,138,250,567円	39,314,181,997円
2 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	21,138,250,567口	39,314,181,997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971,348,693円であります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日	自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、株価指数先物取引、為替予約取引があり、株価指数先物取引はファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、効率的な運用に資する目的として、また為替予約取引は保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用しております。これらは、それぞれの取引種類により、株価変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	(平成23年 2月21日現在)	(平成24年 2月20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。	同左

2	<p>金融商品の時価の算定方法</p> <p>(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。</p> <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）」に記載してあります。</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）」に記載してあります。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3	<p>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>	<p>同左</p>

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	（平成23年 2月21日現在）	（平成24年 2月20日現在）
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,748,523,773	40,630,921
投資証券	47,991,845	23,120,647
合計	2,796,515,618	17,510,274

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

（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23年 2月21日現在）		
		契約額等	時価	評価損益

市場取引	株価指数先物取引 買建			
	MINI S&P 500	339,625,182		362,505,052
	S&P 60	51,398,888		54,694,348
	SPI 200	40,352,850		41,443,240
	FTSE100INDEX	79,468,368		81,691,288
	FSMI INDEX	28,491,076		29,236,725
	EURO STOXX 50	97,708,855		104,642,973
	合 計	637,045,219		674,213,626

(単位：円)

区分	種 類	(平成24年 2月20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	478,118,129		519,579,441	41,461,312
	S&P 60	54,817,507		56,670,620	1,853,113
	SPI 200	44,369,088		44,742,840	373,752
	FTSE100INDEX	97,343,553		104,062,555	6,719,002
	FSMI INDEX	30,418,750		32,205,881	1,787,131
	EURO STOXX 50	113,856,375		124,610,724	10,754,349
	合 計	818,923,402		881,872,061	62,948,659

(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。

通貨関連

(単位：円)

区分	種 類	(平成23年 2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	52,504,200		52,340,400	163,800
	イギリス・ポンド	12,132,000		12,145,500	13,500
	ニュージーランド・ドル	10,920,000		10,960,844	40,844
	ユーロ	4,537,200		4,548,800	11,600
	合 計	80,093,400		79,995,544	97,856

(単位：円)

区分	種 類	(平成24年 2月20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	27,874,000	27,860,000	14,000
	カナダ・ドル	803,100	802,600	500
	オーストラリア・ドル	859,500	859,000	500
	イギリス・ポンド	13,904,000	13,900,700	3,300
	スイス・フラン	5,220,000	5,220,600	600
	合 計	48,660,600	48,642,900	17,700

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日	自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成23年 2月21日現在)	(平成24年 2月20日現在)
本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日にお 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)	1.0387 円 (10,387 円)	0.9753 円 (9,753 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) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	第10期 (平成23年 2月21日現在)	第11期 (平成24年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,634,541	2,644,835
親投資信託受益証券		2,098,566,036	2,147,788,063
未収利息		5	5

流動資産合計		2,101,200,582	2,150,432,903
資産合計		2,101,200,582	2,150,432,903
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		68,955,746	71,209,825
未払受託者報酬		409,215	413,300
未払委託者報酬		2,148,336	2,169,750
流動負債合計		71,513,297	73,792,875
負債合計		71,513,297	73,792,875
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,723,893,652	1,780,245,645
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		305,793,633	296,394,383
(分配準備積立金)		(161,340,881)	(125,521,103)
元本等合計		2,029,687,285	2,076,640,028
純資産合計		2,029,687,285	2,076,640,028
負債純資産合計		2,101,200,582	2,150,432,903

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位:円)

区 分	注記 番号	第10期	第11期
		自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日	自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		869	815
有価証券売買等損益		133,965,763	55,472,013
営業収益合計		133,964,894	55,472,828
営業費用			
受託者報酬		807,887	842,585
委託者報酬		4,241,336	4,423,445
営業費用合計		5,049,223	5,266,030
営業利益又は営業損失()		139,014,117	50,206,798
経常利益又は経常損失()		139,014,117	50,206,798
当期純利益又は当期純損失()		139,014,117	50,206,798
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		3,744,899	2,550,639
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		111,306,964	87,328,789
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		111,306,964	87,328,789
剰余金減少額又は欠損金増加額		26,057,244	78,275,651
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		26,057,244	78,275,651
分配金	1	68,955,746	71,209,825
期末剰余金又は期末欠損金()		305,793,633	296,394,383

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第10期	第11期
	自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日	自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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日及び平成23年2月20日が休日のため、当計算期間は平成22年2月23日から平成23年2月21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、当計算期間は平成23年2月22日から平成24年2月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第10期 (平成23年 2月21日現在)	第11期 (平成24年 2月20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	438,496,453円	498,626,974円
期中一部解約元本額	84,687,650円	442,274,981円
2 計算期間末日における受益権の総数	1,723,893,652口	1,780,245,645口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第10期 自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日	第11期 自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(74,337,693円)、収益調整金(849,733,971円)及び分配準備積立金(155,958,934円)より分配対象収益は1,080,030,598円(1万口当たり6,265円)であり、うち68,955,746円(1万口当たり400円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(71,773,197円)、収益調整金(921,735,709円)及び分配準備積立金(124,957,731円)より分配対象収益は1,118,466,637円(1万口当たり6,282円)であり、うち71,209,825円(1万口当たり400円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第10期 自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日	第11期 自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、親投資信託受益証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。	同左

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。	同左
------------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 (平成23年 2月21日現在)	第11期 (平成24年 2月20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。	同左
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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 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。	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	第10期 (平成23年 2月21日現在)	第11期 (平成24年 2月20日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	129,525,899	58,793,069
合計	129,525,899	58,793,069

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

第10期（平成23年2月21日現在）

該当する事項はありません。

第11期（平成24年2月20日現在）

該当する事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日	第11期 自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

	第10期 （平成23年 2月21日現在）	第11期 （平成24年 2月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1774 円 （11,774 円）	1.1665 円 （11,665 円）

（4）附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
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	1,447,004,018	2,147,788,063	
合計		1,447,004,018	2,147,788,063	

（注）親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

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、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23年 2月21日現在）	（平成24年 2月20日現在）
		金 額	金 額
資産の部 流動資産 預金		1,440,531,507	1,009,803,843

コール・ローン		117,263,624	37,141,432
国債証券		251,006,053,557	234,868,184,150
派生商品評価勘定		1,954,028	2,408
未収入金		1,070,519,291	
未収利息		2,826,685,269	2,446,752,806
前払費用		365,907,916	160,457,627
流動資産合計		256,828,915,192	238,522,342,266
資産合計		256,828,915,192	238,522,342,266
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,774,529	75,518
未払金		274,722,804	
未払解約金		1,453,191,356	16,818,650
流動負債合計		1,729,688,689	16,894,168
負債合計		1,729,688,689	16,894,168
純資産の部			
元本等			
元本	1	176,531,085,978	160,685,006,426
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		78,568,140,525	77,820,441,672
元本等合計		255,099,226,503	238,505,448,098
純資産合計		255,099,226,503	238,505,448,098
負債純資産合計		256,828,915,192	238,522,342,266

(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23年 2月21日	自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20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	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。	外貨建取引等の処理基準 同左
---------------------------	--	-------------------

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成23年 2月21日現在)	(平成24年 2月20日現在)
1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	418,555,598,568円	176,531,085,978円
同期中における追加設定元本額	49,429,331,568円	22,672,756,691円
同期中における一部解約元本額	291,453,844,158円	38,518,836,243円
同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	4,044,386,569円	4,550,747,616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	5,332,917円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	1,452,194,337円	1,447,004,018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	1,711,621,785円	1,704,498,028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>	3,493,639,328円	2,570,984,105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>	36,174,805,819円	32,434,302,825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>	149,301,428円	137,929,331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>	12,685,260,196円	11,765,953,779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>	10,442,617円	9,809,398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>	107,891,902円	98,104,583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>	18,416,704円	17,372,327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>	21,481,180,230円	18,585,620,597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>	3,243,234,347円	3,030,451,634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>	98,623,434円	89,276,768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>	13,036,140,691円	11,988,462,014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>	3,592,196,094円	3,155,701,840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>	120,806,975円	101,533,566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>	3,736,656,161円	3,401,251,018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>	10,134,764,690円	9,278,930,630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>	3,596,134,167円	3,357,009,671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>	10,836,995,185円	9,361,424,898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>	1,750,486,097円	1,589,243,927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>	2,577,124,799円	2,337,992,314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>	3,933,684,041円	3,992,101,285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>	227,174,957円	205,761,170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>	245,837,913円	208,700,443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>	170,797,983円	159,594,930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>	105,230,925円	148,297,687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>	196,078,930円	182,627,285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>	1,820,063,626円	1,675,657,093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>	17,365,850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>	13,682,614円	12,717,034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>	106,288円	102,937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>	27,873,637,477円	24,239,721,842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>	474,611,521円	473,406,631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>	2,334,390,806円	2,598,871,771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>	3,951,799,266円	4,606,947,816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>	1,113,947,593円	1,088,356,066円

ステート・ストリート4資産インデックスバランスV A 3 0 < 適格機関投資家限定 >	200,116円	191,687円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスV A 4 0 < 適格機関投資家限定 >	172,517円	163,287円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスV A 5 0 < 適格機関投資家限定 >	円	140,853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V A 4 < 適格機関投資家限定 >	円	55,205,989円
計	176,531,085,978円	160,685,006,426円
2 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	176,531,085,978口	160,685,006,426口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日	自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク及び信用リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用している為替予約取引があり、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。	同左

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。	同左
------------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

区分	（平成23年 2月21日現在）	（平成24年 2月20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。	同左
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 「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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 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。	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

（平成23年 2月21日現在）	（平成24年 2月20日現在）
-----------------	-----------------

種類	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	4,305,418,011	11,462,935,460
合計	4,305,418,011	11,462,935,460

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております

(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

(単位：円)

区分	種類	(平成23年 2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 買建				
	アメリカ・ドル	4,709,527		4,679,998	29,529
	売建				
	アメリカ・ドル	583,380,000		581,560,000	1,820,000
	オーストラリア・ドル	84,290,000		84,180,000	110,000
	イギリス・ポンド	134,800,000		134,950,000	150,000
	マレーシア・リングgit	4,709,527		4,685,499	24,028
ユーロ	623,865,000		625,460,000	1,595,000	
合計		1,435,754,054		1,435,515,497	179,499

(単位：円)

区分	種類	(平成24年 2月20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 買建				
	アメリカ・ドル	4,455,514		4,457,922	2,408
	売建				
	マレーシア・リングgit	4,455,514		4,531,032	75,518
合計		8,911,028		8,988,954	73,110

(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。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日	自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成23年 2月21日現在）	（平成24年 2月20日現在）
本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日にお 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）	1.4451 円 （14,451 円）	1.4843 円 （14,843 円）

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

（平成24年3月30日現在）

資産総額	2,627,892,275 円
負債総額	3,991,085 円
純資産総額（ - ）	2,623,901,190 円
発行済数量	2,198,171,399 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	11,937 円

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

（平成24年3月30日現在）

資産総額	8,288,575,180 円
負債総額	3,338,205 円
純資産総額（ - ）	8,285,236,975 円
発行済数量	6,790,784,565 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	12,201 円

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

（平成24年3月30日現在）

資産総額	4,450,790,242 円
負債総額	2,835,726 円
純資産総額（ - ）	4,447,954,516 円
発行済数量	3,614,675,974 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	12,305 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限

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

(4) 受益権の譲渡

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

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

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

平成24年3月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間に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】

「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24年3月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	156	17,622
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	2	200
単位型公社債投資信託	0	0
合計	158	17,823

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】

1 . 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

2 . 監査証明について

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

また、第17期事業年度に係る中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

財務諸表

(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
事故損失賠償金	2	478	2
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>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>
2．固定資産の減価償却の方法	2．固定資産の減価償却の方法

<p>有形固定資産 定率法によっております。なお主な耐用年数は、建物3～15年、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 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 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>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 同左</p> <p>4. 引当金の計上基準 賞与引当金 同左</p>
--	---

<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>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いません。</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>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>

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。	6. 消費税及び地方消費税の会計処理 同左
-------------------------------------	--------------------------

(表示方法の変更)

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)
(貸借対照表)	(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。 <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。

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>(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="width: 70%;">未収運用受託報酬</td><td style="text-align: right;">229,597千円</td></tr> <tr><td>未収投資助言報酬</td><td style="text-align: right;">171,926千円</td></tr> <tr><td>前払費用</td><td style="text-align: right;">52,971千円</td></tr> <tr><td>長期差入保証金</td><td style="text-align: right;">265,746千円</td></tr> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">78,620千円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">5,080千円</td></tr> <tr><td>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="width: 70%;">前払費用</td><td style="text-align: right;">60,402千円</td></tr> <tr><td>未収運用受託報酬</td><td style="text-align: right;">296,706千円</td></tr> <tr><td>未収投資助言報酬</td><td style="text-align: right;">152,956千円</td></tr> <tr><td>差入保証金</td><td style="text-align: right;">280,262千円</td></tr> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">88,132千円</td></tr> <tr><td>その他未払金</td><td style="text-align: right;">14,956千円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">60,986千円</td></tr> <tr><td>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																														

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。	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。
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。	1.
取締役 180,000千円 監査役 30,000千円	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。	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	建物 8,300千円
ソフトウェア 333千円	器具備品 8,461千円
合計 3,290千円	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。	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。
前事業年度末発行済株式総数	前事業年度末発行済株式総数
普通株式 108,448株	普通株式 108,448株
当事業年度末発行済株式総数	当事業年度末発行済株式総数
普通株式 108,448株	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	当事業年度に増加または減少した発行済株式数
なし	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>		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	<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>		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
	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																						
	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	1,329千円	1年内	342千円
1年超	804千円	1年超	462千円
合計	2,134千円	合計	804千円
支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額		支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額	
支払リース料	2,169千円	支払リース料	1,383千円
減価償却費相当額	1,979千円	減価償却費相当額	1,258千円
支払利息相当額	103千円	支払利息相当額	53千円
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。		減価償却費相当額の算定方法 同左	
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。		利息相当額の算定方法 同左	
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		2. オペレーティング・リース取引	
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、適切にリスク管理を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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、適切なり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せ

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)
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	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
(流動資産)	(流動資産)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 200,962千円	賞与引当金 221,131千円
未払事業税 21,062千円	未払事業税 18,935千円
その他 32,093千円	その他 55,977千円
繰延税金資産合計 254,117千円	繰延税金資産合計 296,044千円
繰延税金負債	繰延税金負債
有価証券評価差額 28千円	有価証券評価差額 784千円
その他 97千円	繰延税金負債合計 784千円
繰延税金負債合計 125千円	繰延税金資産の純額 295,260千円
繰延税金資産の純額 253,992千円	
(固定資産)	(固定資産)
繰延税金資産	繰延税金資産
退職給付引当金 215,046千円	退職給付引当金 257,689千円
役員退職慰労引当金 5,185千円	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 6,611千円	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 695,776千円	投資有価証券評価損 539,831千円
投資有価証券評価差額 327,794千円	投資有価証券評価差額 261,653千円
その他 5,018千円	その他 30,323千円
小計 1,255,430千円	小計 1,099,317千円
円	円
評価性引当額 126,659千円	評価性引当額 120,282千円
円	円
繰延税金資産合計 1,128,770千円	繰延税金資産合計 979,034千円
円	
繰延税金負債	繰延税金負債
特別分配金否認 63,801千円	特別分配金否認 58,098千円
投資有価証券評価差額 399,115千円	投資有価証券評価差額 420,346千円
繰延税金負債合計 462,916千円	繰延税金負債合計 478,445千円
繰延税金資産の純額 665,854千円	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>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ズ株式会社	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勤定等の取得	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株当たり純資産額	339,466円90銭
1株当たり当期純利益金額	4,654円56銭	1株当たり当期純利益金額	4,031円18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。		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。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第17期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		1,915,645
有価証券		14,510,640
未収委託者報酬		1,693,267
未収運用受託報酬		901,745
未収投資助言報酬		165,835
繰延税金資産		189,016
その他		302,313
流動資産合計		19,678,463
固定資産		
有形固定資産	1	292,426
無形固定資産		1,357,827
投資その他の資産		
投資有価証券		17,148,577
繰延税金資産		707,428
その他		284,450
投資その他の資産合計		18,140,456
固定資産合計		19,790,709
資産合計		39,469,173
負債の部		
流動負債		
未払運用委託報酬		450,621
未払投資助言報酬		132,217
その他未払金		115,419
未払費用		112,560
未払法人税等		68,119
前受投資助言報酬		70,455
賞与引当金		332,982
その他		881,810
流動負債合計		2,164,186
固定負債		
退職給付引当金		704,019
役員退職慰労引当金		11,725
その他		35,575
固定負債合計		751,320
負債合計		2,915,506
純資産の部		
株主資本		

資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	17,743,435
利益剰余金合計	18,423,242
株主資本合計	36,705,082
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	151,415
評価・換算差額等合計	151,415
純資産合計	36,553,666
負債・純資産合計	39,469,173

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第17期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	5,305,764
運用受託報酬	1,962,058
投資助言報酬	364,956
業務受託料	23,550
営業収益計	7,656,329
営業費用	3,846,408
一般管理費	1 3,379,396
営業利益	430,524
営業外収益	2 74,967
営業外費用	3 6,666
経常利益	498,825
特別利益	4 25,290
特別損失	5 95,074
税引前中間純利益	429,041
法人税、住民税及び事業税	38,652
法人税等調整額	136,758
法人税等合計	175,410
中間純利益	253,630

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第17期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
---	--

株主資本	
資本金	
前期末残高	10,000,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840
資本剰余金合計	
前期末残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	139,807
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
前期末残高	120,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	120,000
研究開発積立金	
前期末残高	70,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	70,000
別途積立金	
前期末残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
繰越利益剰余金	
前期末残高	17,625,364
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	253,630
当中間期変動額合計	118,070
当中間期末残高	17,743,435
利益剰余金合計	

前期末残高	18,305,171
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	253,630
当中間期変動額合計	118,070
当中間期末残高	18,423,242
株主資本合計	
前期末残高	36,587,011
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	253,630
当中間期変動額合計	118,070
当中間期末残高	36,705,082
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	227,494
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	378,910
当中間期変動額合計	378,910
当中間期末残高	151,415
評価・換算差額等合計	
前期末残高	227,494
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	378,910
当中間期変動額合計	378,910
当中間期末残高	151,415
純資産合計	
前期末残高	36,814,506
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	253,630
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	378,910
当中間期変動額合計	260,839
当中間期末残高	36,553,666

（重要な会計方針）

項目	第17期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。

	<p>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ます。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき、当中間会計期間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中間会計期間末要支給額の100%）を計上しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．リース取引の処理方法	<p>平成20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>
6．消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p> <p>なお、仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。</p>

（追加情報）

当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（注記事項）

[中間貸借対照表関係]

<p>第17期中間会計期間末 （平成23年9月30日現在）</p>	
1．有形固定資産の減価償却累計額	780,433千円

[中間損益計算書関係]

第17期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	46,609千円
無形固定資産	266,699千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
有価証券利息	43,968千円
受取配当金	23,038千円
受取利息	1,567千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	5,821千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	25,290千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	1,778千円
投資有価証券償還損	87,378千円
事故損失賠償金	30千円
固定資産除却損 器具備品	5,887千円

[中間株主資本等変動計算書関係]

第17期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)					
1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項					
	前事業年度末 株式数(千 株)	当中間会計期間増加 株式数(千株)	当中間会計期間減少 株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)	
発行済株式					
普通株式	108	-	-	108	
合計	108	-	-	108	
2. 配当に関する事項					
配当金支払額					
(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月27日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成23年3月31日	平成23年6月27日

[リース取引関係]

第17期中間会計期間
（自 平成23年4月1日
至 平成23年9月30日）

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。

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中間会計期間末残高相当額

	取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	中間 会計期間末残高 相当額
有形固定資産 (器具備品)	千円 862	千円 330	千円 532

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1年内	171千円
1年超	375千円
合計	547千円

当中間会計期間の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料	268千円
減価償却費相当額	244千円
支払利息相当額	11千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

2. オペレーティング・リース取引

該当取引はありません。

[金融商品関係]

第17期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月30日（中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金 有価証券	1,915,645	1,915,645	-

満期保有目的の債券	4,014,240	4,028,080	13,839
その他有価証券	10,496,400	10,496,400	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	11,017,242	11,074,340	57,097
その他有価証券	6,063,834	6,063,834	-

(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

これらの時価は、中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

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、中間決算日の市場価格等によっております。

(注2) 非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）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。

[有価証券関係]

第17期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	13,520,429	13,592,830	72,400
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	13,520,429	13,592,830	72,400
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	1,511,053	1,509,590	1,463
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,511,053	1,509,590	1,463
合計		15,031,482	15,102,420	70,937

2. その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)

中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	6,992,009	6,997,350	5,341
	国債・地方債等	6,992,009	6,997,350	5,341
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	2,572,596	3,199,499	626,903
	小計	9,564,605	10,196,849	632,244
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	3,499,245	3,499,050	195
	国債・地方債等	3,499,245	3,499,050	195
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	3,714,015	2,864,335	849,679
	小計	7,213,260	6,363,385	849,875
	合計	16,777,865	16,560,234	217,630

（注1）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（中間貸借対照表計上額67,500千円）については、市場価格がなく、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。

[デリバティブ取引関係]

第17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間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	1,067,973

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

該当事項はありません。

[1株当たり情報]

	第17期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
1株当たり純資産額	337,061円69銭
1株当たり中間純利益	2,338円73銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益	253,630千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	<u>253,630千円</u>
期中平均株式数	108千株

[重要な後発事象]

第17期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成23年9月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

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

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成23年9月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

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

(2) 販売会社

(平成23年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
株式会社八十二銀行	52,243百万円	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,100,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

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

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

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
 - ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せや、資料のご請求などを委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
コールセンター 0120-762-506
（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）
ホームページ <http://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。

投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成24年4月13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 山田 信之 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24年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成24年2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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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、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. 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24年4月13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 山田 信之 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24年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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、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24年2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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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、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. 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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年11月28日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第17期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成23年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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。

独立監査人の監査報告書

平成24年4月13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	山田 信之 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24年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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、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24年2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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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、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. 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4月14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23年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。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、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21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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、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. 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4月14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23年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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、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21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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、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. 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。

独立監査人の監査報告書

平成23年4月14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23年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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、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21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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、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. 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](#)