

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成24年11月21日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成24年5月21日をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、半期報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

ファンドの分類 (略)

ファンドの分類 (略)

属性区分表

(略)

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。
---------	---

(略)

<訂正後>

ファンドの分類 (略)

ファンドの分類 (略)

属性区分表

(略)

為替ヘッジなし	目論見書または約款において、 <u>対円での</u> 為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは <u>対円での</u> 為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
---------	---

(略)

（3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

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
(略)

<訂正後>

委託会社の概況（平成24年9月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社

（ 略 ）

5【運用状況】

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

(1)【投資状況】

「債券重視型」

(平成24年9月28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	2,506,944,831	95.11
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		128,942,703	4.89
純資産総額		2,635,887,534	100.00

「標準型」

(平成24年9月28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	7,751,489,076	95.14
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		395,585,322	4.86
純資産総額		8,147,074,398	100.00

「株式重視型」

(平成24年9月28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	4,037,403,439	94.95
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		214,799,634	5.05
純資産総額		4,252,203,073	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9月28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	1,015,399,714	11,616	1,179,538,175	11,766	1,194,719,303	45.32
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	651,117,846	8,646	562,973,831	8,135	529,684,367	20.10
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	449,477,731	11,667	524,397,540	11,685	525,214,728	19.93

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	282,807,378	8,917	252,185,714	9,099	257,326,433	9.76
投資比率：合計									95.11

「標準型」

(平成24年9月28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	2,098,581,703	11,618	2,438,226,920	11,766	2,469,191,231	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	3,030,037,474	8,663	2,624,834,168	8,135	2,464,935,485	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	1,754,260,988	8,921	1,564,974,792	9,099	1,596,202,072	19.59
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	1,045,066,571	11,663	1,218,888,266	11,685	1,221,160,288	14.99
投資比率：合計									95.14

「株式重視型」

(平成24年9月28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	2,107,165,991	8,683	1,829,661,083	8,135	1,714,179,533	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	1,377,296,417	8,928	1,229,581,506	9,099	1,253,202,009	29.47
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	547,041,404	11,619	635,628,292	11,766	643,648,915	15.14
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	364,889,159	11,664	425,597,274	11,685	426,372,982	10.03
投資比率：合計									94.95

(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	-	95.11
合計		95.11

「標準型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	95.14
合計		95.14

「株式重視型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	94.95
合計		94.95

（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9月28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
	3月末日	2,623,901,190	11,937

	4月末日	2,597,756,533	11,755
	5月末日	2,560,596,007	11,337
	6月末日	2,576,168,710	11,462
	7月末日	2,582,098,639	11,414
	8月末日	2,633,734,380	11,515
	平成24年9月28日	2,635,887,534	11,574

「標準型」

		純資産総額（円）	1万口当たり純資産総額（円）
第1期末	（平成16年2月23日）	分配付：104,312,125 分配落：104,312,125	分配付：11,253 分配落：11,253
第2期末	（平成17年2月21日）	分配付：1,685,435,357 分配落：1,685,435,357	分配付：11,884 分配落：11,884
第3期末	（平成18年2月21日）	分配付：4,211,489,449 分配落：4,211,489,449	分配付：13,838 分配落：13,838
第4期末	（平成19年2月21日）	分配付：6,194,491,862 分配落：6,194,491,862	分配付：15,275 分配落：15,275
第5期末	（平成20年2月21日）	分配付：6,484,983,703 分配落：6,484,983,703	分配付：13,809 分配落：13,809
第6期末	（平成21年2月23日）	分配付：5,244,908,506 分配落：5,244,908,506	分配付：10,030 分配落：10,030
第7期末	（平成22年2月22日）	分配付：6,824,522,532 分配落：6,824,522,532	分配付：11,685 分配落：11,685
第8期末	（平成23年2月21日）	分配付：7,926,206,447 分配落：7,926,206,447	分配付：12,272 分配落：12,272
第9期末	（平成24年2月21日）	分配付：7,963,099,330 分配落：7,963,099,330	分配付：11,781 分配落：11,781
	平成23年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
	3月末日	8,285,236,975	12,201
	4月末日	8,073,015,598	11,910
	5月末日	7,818,166,946	11,274
	6月末日	7,928,011,274	11,454
	7月末日	7,947,110,856	11,397
	8月末日	8,123,346,271	11,549
	平成24年9月28日	8,147,074,398	11,631

「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 分配落：58,719,649	分配付：11,659 分配落：11,659
第2期末	（平成17年2月21日）	分配付：875,027,196 分配落：875,027,196	分配付：12,475 分配落：12,475
第3期末	（平成18年2月21日）	分配付：2,375,768,675 分配落：2,375,768,675	分配付：15,253 分配落：15,253
第4期末	（平成19年2月21日）	分配付：3,578,213,433 分配落：3,578,213,433	分配付：17,319 分配落：17,319

第5期末	(平成20年2月21日)	分配付： 分配落：	3,543,921,213 3,543,921,213	分配付： 分配落：	14,897 14,897
第6期末	(平成21年2月23日)	分配付： 分配落：	2,565,505,965 2,565,505,965	分配付： 分配落：	9,552 9,552
第7期末	(平成22年2月22日)	分配付： 分配落：	3,635,729,715 3,635,729,715	分配付： 分配落：	11,734 11,734
第8期末	(平成23年2月21日)	分配付： 分配落：	4,343,954,086 4,343,954,086	分配付： 分配落：	12,613 12,613
第9期末	(平成24年2月21日)	分配付： 分配落：	4,217,589,091 4,217,589,091	分配付： 分配落：	11,770 11,770
	平成23年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
	3月末日		4,447,954,516		12,305
	4月末日		4,285,722,481		11,906
	5月末日		4,069,214,706		11,058
	6月末日		4,135,329,724		11,292
	7月末日		4,125,161,462		11,228
	8月末日		4,242,588,259		11,426
	平成24年9月28日		4,252,203,073		11,529

(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9月28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9月28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9月28日現在の投資状況及び投資資産は次に示すとおりであります。

(1) 投資状況

1. ニッセイ国内株式インデックスS A(適格機関投資家限定)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	16,063,869,566	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		126,555	0.00
純資産総額		16,063,743,011	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	27,274,521,435	97.60
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		671,608,073	2.40
純資産総額		27,946,129,508	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12月限)	東京証券取引所	659,200,105	654,150,000	2.34

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	5,729,989,517	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		31,753	0.00
純資産総額		5,729,957,764	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	14,614,568,810	99.28
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		105,277,412	0.72
純資産総額		14,719,846,222	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	3,131,929,350	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		112,457	0.00
純資産総額		3,132,041,807	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	20,556,045,713	55.35
	イギリス	3,701,753,438	9.97
	カナダ	1,957,253,923	5.27
	フランス	1,456,473,785	3.92
	ドイツ	1,389,419,238	3.74
	スイス	1,389,086,210	3.74
	オーストラリア	1,322,119,132	3.56
	スウェーデン	521,166,479	1.40
	香港	476,305,224	1.28
	スペイン	468,547,288	1.26
	オランダ	397,789,130	1.07
	イタリア	362,154,341	0.98
	シンガポール	287,711,003	0.78
	デンマーク	191,997,974	0.52
	ベルギー	184,631,456	0.50
	ノルウェー	157,599,050	0.42
	フィンランド	121,436,387	0.33
	イスラエル	93,619,821	0.25
	アイルランド	43,683,656	0.12
	オーストリア	41,851,001	0.11
ポルトガル	26,439,796	0.07	

	ニュージーランド	19,019,024	0.05
	ギリシャ	6,989,235	0.02
	小計	35,173,092,304	94.71
投資証券	アメリカ	566,113,439	1.52
	オーストラリア	103,930,853	0.28
	イギリス	42,899,164	0.12
	フランス	42,781,550	0.11
	香港	16,903,427	0.05
	シンガポール	12,156,472	0.03
	カナダ	9,738,239	0.03
	オランダ	4,406,738	0.01
	小計	798,929,882	2.15
	コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,166,403,189
純資産総額		37,138,425,375	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

4. ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,175,722,692	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		5,766	0.00
純資産総額		2,175,716,926	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	96,725,720,023	41.44
	フランス	22,738,276,562	9.74
	ドイツ	20,999,501,745	9.00
	イタリア	20,505,234,836	8.79
	イギリス	19,484,173,839	8.35
	スペイン	9,341,164,478	4.00
	カナダ	6,715,356,191	2.88
	ベルギー	6,129,319,920	2.63
	オランダ	6,119,473,766	2.62
	オーストリア	4,132,546,974	1.77
	オーストラリア	3,590,374,648	1.54
	メキシコ	2,244,410,786	0.96
	デンマーク	2,012,584,627	0.86
	アイルランド	1,743,241,279	0.75
	ポーランド	1,722,300,618	0.74
	スウェーデン	1,424,086,627	0.61
	フィンランド	1,313,144,140	0.56
	マレーシア	1,233,212,647	0.53
	スイス	946,979,887	0.41
	シンガポール	912,272,731	0.39
ノルウェー	567,170,923	0.24	
小計	230,600,547,247	98.81	
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		2,787,866,105	1.19
純資産総額		233,388,413,352	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

1. ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	23,481,756,420	7,626	17,908,114,641	6,841	16,063,869,566	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	350,800	3,335 3,040	1,169,909,900 1,066,432,000	3.82
2	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	2,022,100	408 366	824,798,700 740,088,600	2.65
3	日本	ホンダ	株式	輸送用機器	228,300	2,952 2,397	673,974,600 547,235,100	1.96
4	日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	202,800	2,691 2,440	545,670,300 494,832,000	1.77
5	日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	123,000	3,758 3,720	462,231,100 457,560,000	1.64
6	日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	3,435,400	128 127	438,870,600 436,295,800	1.56
7	日本	キヤノン	株式	電気機器	168,100	3,561 2,495	598,588,600 419,409,500	1.50
8	日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	121,000	2,458 3,160	297,435,300 382,360,000	1.37
9	日本	武田薬品工業	株式	医薬品	106,100	3,504 3,595	371,789,000 381,429,500	1.36
10	日本	ファナック	株式	電気機器	28,200	14,337 12,580	404,299,200 354,756,000	1.27
11	日本	J T	株式	食料品	134,400	2,206 2,342	296,465,007 314,764,800	1.13
12	日本	三菱地所	株式	不動産業	187,000	1,428 1,494	267,129,000 279,378,000	1.00
13	日本	N T T ドコモ	株式	情報・通信業	2,200	136,449 126,600	300,187,929 278,520,000	1.00
14	日本	三菱商事	株式	卸売業	194,500	1,945 1,419	378,323,400 275,995,500	0.99
15	日本	日立製作所	株式	電気機器	623,000	464 434	288,978,000 270,382,000	0.97
16	日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	111,700	2,249 2,397	251,237,600 267,744,900	0.96

17	日本	三井物産	株式	卸売業	230,500	1,359 1,098	313,299,000 253,089,000	0.91
18	日本	KDDI	株式	情報・通信業	41,400	5,192 6,060	214,952,037 250,884,000	0.90
19	日本	アステラス製薬	株式	医薬品	62,900	3,262 3,965	205,176,600 249,398,500	0.89
20	日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	47,000	5,201 5,170	244,427,100 242,990,000	0.87
21	日本	日産自動車	株式	輸送用機器	344,200	804 665	276,812,300 228,893,000	0.82
22	日本	信越化学工業	株式	化学	50,800	4,355 4,390	221,258,800 223,012,000	0.80
23	日本	コマツ	株式	機械	132,200	2,387 1,537	315,618,100 203,191,400	0.73
24	日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	97,000	2,219 1,994	215,276,372 193,418,000	0.69
25	日本	三井不動産	株式	不動産業	118,000	1,497 1,563	176,601,000 184,434,000	0.66

順位	国名	銘柄名	種類	業種	株数	上段：帳簿価額（円） 下段：評価額（円）		投資比率（%）
						単価	金額	
26	日本	花王	株式	化学	75,200	2,056 2,300	154,596,900 172,960,000	0.62
27	日本	国際石油開発帝石	株式	鉱業	369	565,080 465,500	208,514,648 171,769,500	0.61
28	日本	伊藤忠商事	株式	卸売業	213,000	896 791	190,853,800 168,483,000	0.60
29	日本	住友商事	株式	卸売業	157,600	1,177 1,053	185,551,600 165,952,800	0.59
30	日本	デンソー	株式	輸送用機器	66,800	2,648 2,451	176,855,000 163,726,800	0.59
投資比率：合計								35.23

（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	11.58
	輸送用機器	9.81
	銀行業	9.74
	情報・通信業	7.03
	化学	5.57
	医薬品	5.46
	卸売業	5.30
	機械	4.59
	小売業	4.45
	陸運業	4.28
	食料品	4.26
	不動産業	2.84
	建設業	2.58
	電気・ガス業	2.45
	保険業	2.25
	サービス業	2.10
	その他製品	1.51
	精密機器	1.44
	鉄鋼	1.41
	非鉄金属	1.07
	証券、商品先物取引業	1.07
	ガラス・土石製品	0.96
	その他金融業	0.92
	繊維製品	0.84
	ゴム製品	0.79
	石油・石炭製品	0.76
	金属製品	0.70
	鉱業	0.69
	空運業	0.29
	パルプ・紙	0.27
海運業	0.26	
倉庫・運輸関連業	0.24	

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.09
	合計	97.60

（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	4,693,634,926	12,036	5,649,420,963	12,208	5,729,989,517	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97回 利付国債(5年)	0.400	2016/6/20	国債証券	1,334,000,000	101.02 101.02	1,347,579,470 1,347,553,440	9.15
2	日本	第256回 利付国債(10年)	1.400	2013/12/20	国債証券	1,319,000,000	101.69 101.59	1,341,225,730 1,339,906,150	9.10
3	日本	第125回 利付国債(20年)	2.200	2031/3/20	国債証券	1,041,000,000	109.91 109.72	1,144,214,100 1,142,226,840	7.76
4	日本	第54回 利付国債(20年)	2.200	2021/12/20	国債証券	910,000,000	112.97 113.58	1,028,042,660 1,033,541,600	7.02
5	日本	第123回 利付国債(20年)	2.100	2030/12/20	国債証券	841,000,000	108.28 108.27	910,661,600 910,584,340	6.19
6	日本	第312回 利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	国債証券	801,000,000	103.44 105.11	828,568,250 841,923,090	5.72
7	日本	第121回 利付国債(20年)	1.900	2030/9/20	国債証券	662,000,000	103.36 105.36	684,257,650 697,496,440	4.74
8	日本	第296回 利付国債(10年)	1.500	2018/9/20	国債証券	644,000,000	106.52 107.16	685,963,460 690,110,400	4.69
9	日本	第279回 利付国債(10年)	2.000	2016/3/20	国債証券	612,000,000	106.64 106.52	652,660,200 651,902,400	4.43
10	日本	第313回 利付国債(10年)	1.300	2021/3/20	国債証券	588,000,000	103.99 105.81	611,465,950 622,151,040	4.23
11	日本	第105回 利付国債(5年)	0.200	2017/6/20	国債証券	594,000,000	99.96 100.09	593,791,920 594,552,420	4.04
12	日本	第302回 利付国債(10年)	1.400	2019/6/20	国債証券	496,000,000	106.49 106.78	528,202,710 529,643,680	3.60
13	日本	第81回 利付国債(5年)	0.800	2014/3/20	国債証券	509,000,000	101.08 101.03	514,509,870 514,237,610	3.49
14	日本	第91回 利付国債(5年)	0.400	2015/9/20	国債証券	475,000,000	100.96 100.89	479,548,010 479,213,250	3.26
15	日本	第130回 利付国債(20年)	1.800	2031/9/20	国債証券	459,000,000	102.92 102.99	472,400,850 472,701,150	3.21
16	日本	第303回 利付国債(10年)	1.400	2019/9/20	国債証券	439,000,000	106.63 106.85	468,085,600 469,071,500	3.19
17	日本	第272回 利付国債(10年)	1.400	2015/9/20	国債証券	436,000,000	104.23 103.85	454,452,140 452,764,200	3.08
18	日本	第270回 利付国債(10年)	1.300	2015/6/20	国債証券	435,000,000	103.68 103.26	451,000,580 449,194,050	3.05
19	日本	第113回 利付国債(20年)	2.100	2029/9/20	国債証券	403,000,000	107.11 109.22	431,652,980 440,164,660	2.99
20	日本	第93回 利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	国債証券	394,000,000	101.10 101.27	398,336,070 398,988,040	2.71
21	日本	第88回 利付国債(5年)	0.500	2015/3/20	国債証券	349,000,000	101.05 101.00	352,664,800 352,472,550	2.39
22	日本	第61回 利付国債(20年)	1.000	2023/3/20	国債証券	164,000,000	101.21 101.78	165,987,820 166,924,120	1.13
23	日本	第43回 利付国債(20年)	2.900	2019/9/20	国債証券	13,000,000	116.90 117.14	15,196,700 15,228,720	0.10
24	日本	第80回 利付国債(5年)	0.800	2013/12/20	国債証券	2,000,000	101.08 100.86	2,021,560 2,017,120	0.01
								投資比率：合計	99.28

(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	-	99.28
合計		99.28

(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		3,124,119,053	0.9733	3,040,705,075	1.0025	3,131,929,350	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	18,678	40,392	754,447,272	52,877	987,644,376	2.66
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	93,572	6,617	619,177,312	7,124	666,576,984	1.79
3	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	212,076	1,513	320,786,269	1,764	374,069,828	1.01
4	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	39,456	8,234	324,874,492	9,095	358,841,272	0.97
5	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービ ス	151,262	2,404	363,688,289	2,344	354,485,522	0.95
6	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・サービ ス	21,922	15,051	329,943,918	15,979	350,283,219	0.94
7	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	117,338	2,418	283,701,051	2,948	345,915,240	0.93
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	66,051	4,634	306,104,269	4,942	326,424,207	0.88
9	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービ ス	5,240	46,798	245,220,469	58,704	307,611,056	0.83
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル 用品	54,878	5,000	274,376,706	5,378	295,116,323	0.79
11	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	54,995	5,045	277,433,141	5,355	294,507,904	0.79
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	149,924	1,667	249,893,849	1,937	290,387,195	0.78
13	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	101,088	2,439	246,570,529	2,697	272,672,345	0.73
14	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	363,620	720	261,710,568	730	265,462,271	0.71
15	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	81,338	2,740	222,879,446	2,973	241,806,161	0.65
16	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	76,231	2,935	223,713,244	3,157	240,643,581	0.65

17	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	34,195	6,417	219,422,861	7,035	240,569,211	0.65
18	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	988,408	219	216,704,444	223	220,275,242	0.59
19	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	46,073	4,312	198,646,177	4,768	219,676,870	0.59
20	アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	37,314	4,961	185,130,261	5,741	214,214,002	0.58
21	アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,904	3,025	184,225,305	3,510	213,763,782	0.58
22	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	375,361	597	223,963,797	555	208,350,833	0.56
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	14,073	13,398	188,551,156	14,772	207,888,537	0.56
24	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	56,893	3,072	174,803,222	3,551	202,025,677	0.54
25	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	74,076	2,839	210,309,194	2,726	201,946,524	0.54
26	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	79,757	2,230	177,849,669	2,422	193,194,104	0.52
27	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	100,508	1,792	180,122,370	1,810	181,889,598	0.49
28	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	100,793	2,102	211,900,265	1,790	180,442,853	0.49
29	オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	64,610	2,797	180,697,549	2,679	173,063,208	0.47
30	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	31,373	4,977	156,152,638	5,482	171,976,244	0.46
									投資比率：合計	23.68

(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9月28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	11.31
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.05
	銀行	7.40
	資本財	7.06
	食品・飲料・タバコ	6.79
	素材	6.69
	ソフトウェア・サービス	6.07
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.87
	各種金融	4.35
	保険	3.96
	電気通信サービス	3.93
	公益事業	3.48
	小売	2.89
	メディア	2.66
	ヘルスケア機器・サービス	2.59
	食品・生活必需品小売り	2.29
	家庭用品・パーソナル用品	1.81
	消費者サービス	1.62
	運輸	1.62
	半導体・半導体製造装置	1.41

	自動車・自動車部品	1.20
	耐久消費財・アパレル	1.19
	商業・専門サービス	0.79
	不動産	0.68
	小計	94.71
投資証券		2.15
	合計	96.86

(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9月28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		1,459,139,355	1.4837	2,164,925,062	1.4911	2,175,722,692	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	0.250	2014/05/31	31,600,000	7,765	2,453,659,115	7,760	2,452,258,086	1.05
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/11/15	30,000,000	8,290	2,486,955,840	8,113	2,433,947,280	1.04
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	24,500,000	7,933	1,943,596,760	7,884	1,931,657,224	0.83
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2013/09/30	23,000,000	7,742	1,780,623,568	7,754	1,783,479,248	0.76
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2014/07/15	20,700,000	7,810	1,616,616,511	7,811	1,616,857,459	0.69
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	17,800,000	8,882	1,581,013,088	8,757	1,558,691,603	0.67
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	18,000,000	8,755	1,575,869,760	8,628	1,553,073,984	0.67
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2039/11/15	15,000,000	9,632	1,444,815,000	10,272	1,540,845,000	0.66
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2015/06/30	18,300,000	8,116	1,485,318,475	8,090	1,480,547,006	0.63
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	16,500,000	8,669	1,430,347,644	8,532	1,407,735,780	0.60
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2014/05/15	17,000,000	7,868	1,337,545,125	7,855	1,335,333,816	0.57
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2014/01/31	17,000,000	7,753	1,317,963,250	7,762	1,319,556,184	0.57
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	14,000,000	9,315	1,304,103,696	9,302	1,302,322,000	0.56
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2014/04/30	16,000,000	8,021	1,283,404,672	7,960	1,273,608,448	0.55

15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11.250	2015/02/15	12,900,000	10,248	1,322,003,453	9,773	1,260,689,755	0.54
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2041/02/15	11,400,000	10,219	1,164,964,721	10,893	1,241,813,400	0.53
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	14,000,000	8,936	1,251,098,240	8,831	1,236,377,520	0.53
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	13,500,000	8,939	1,206,709,488	9,147	1,234,858,500	0.53
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2021/08/15	15,000,000	7,893	1,183,904,400	8,206	1,230,930,000	0.53
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/05/15	15,500,000	7,912	1,226,299,026	7,867	1,219,338,500	0.52
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/10/31	15,000,000	8,168	1,225,203,120	8,099	1,214,831,880	0.52
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/08/31	15,000,000	8,150	1,222,467,720	8,074	1,211,060,520	0.52
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	13,300,000	8,817	1,172,649,296	8,900	1,183,671,910	0.51
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	12,800,000	9,128	1,168,345,600	9,162	1,172,696,166	0.50
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2017/02/15	12,600,000	9,176	1,156,122,979	9,130	1,150,393,305	0.49
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2016/12/31	14,500,000	7,841	1,136,964,798	7,878	1,142,336,796	0.49
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/09/30	14,000,000	8,123	1,137,155,250	8,089	1,132,398,176	0.49
28	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	3.500	2015/04/25	10,400,000	10,720	1,114,914,027	10,848	1,128,159,981	0.48
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.250	2017/03/31	12,900,000	8,662	1,117,410,900	8,691	1,121,084,716	0.48
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/08/31	14,000,000	8,096	1,133,506,304	7,969	1,115,635,024	0.48
										投資比率：合計	17.99

(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9月28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		98.81
合計		98.81

(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9月28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12月限)	買建	89	659,200,105	654,150,000	2.34

(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	122	8,869,705.00	8,790,710.00	682,159,096	1.84
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	58	1,481,030.00	1,450,000.00	145,348,000	0.39
	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	19	1,107,700.00	1,093,355.00	137,740,862	0.37
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	6	851,760.00	843,120.00	66,724,516	0.18
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリ ア・ドル	7	768,975.00	767,550.00	62,263,656	0.17
	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	10	653,300.00	655,100.00	54,275,035	0.15

(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9月28日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています）の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

4．ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

該当事項はありません。

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

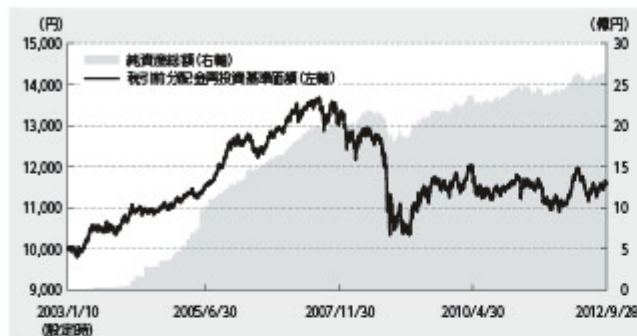
該当事項はありません。

〈参考情報〉

2012年9月末現在

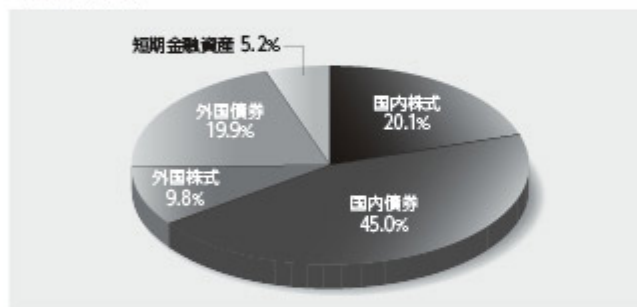
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

● 基準価額・純資産の推移



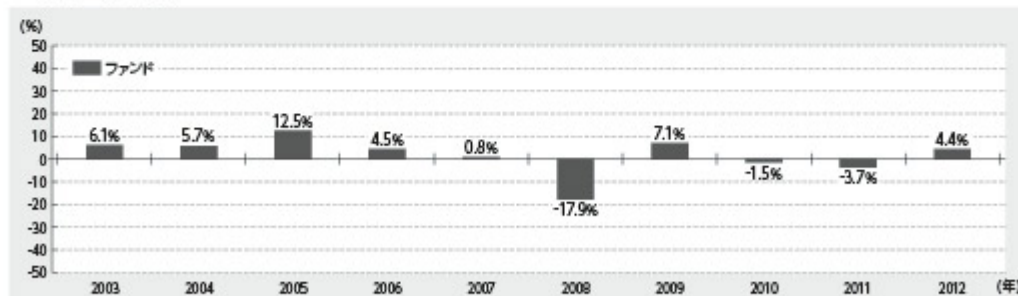
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2003年はファンド設定時から年末まで、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	11,574円
純資産総額	26億円

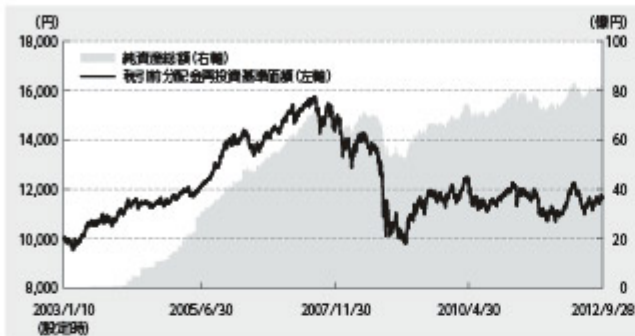
● 分配の推移 1万円当り(税引前)

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9月末現在

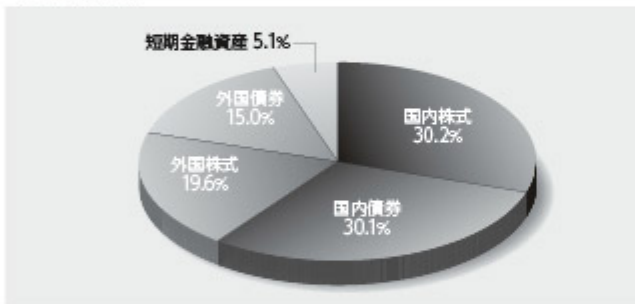
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

● 基準価額・純資産の推移



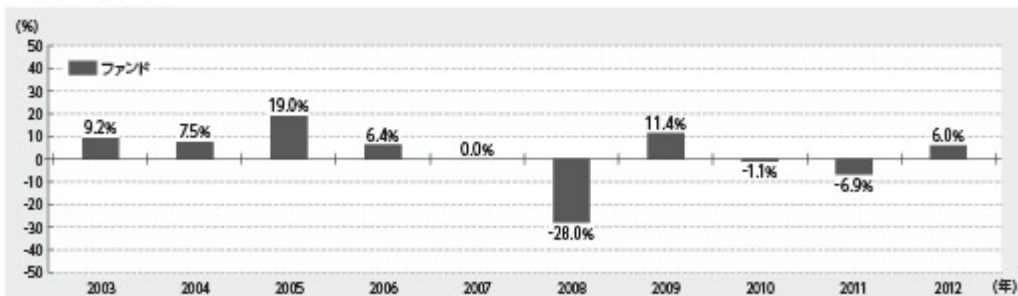
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2003年はファンド設定時から年末まで、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	11,631円
純資産総額	81億円

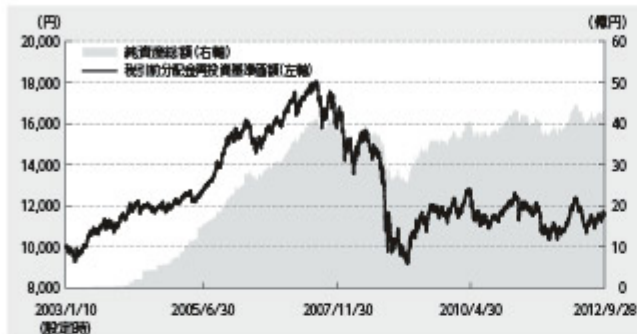
● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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9月末現在

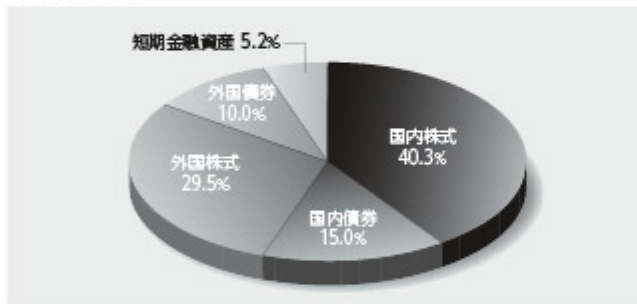
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

● 基準価額・純資産の推移



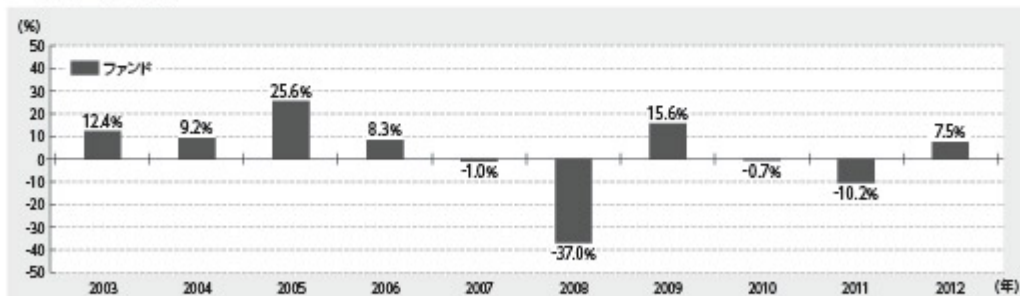
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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	11,529円
純資産総額	42億円

● 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3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

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

- 1) 各ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2) 各ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間（平成24年2月22日から平成24年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

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

（単位：円）

		第10期中間計算期間 （平成24年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		120,525,553
投資信託受益証券		2,512,513,093
流動資産合計		2,633,038,646
資産合計		2,633,038,646
負債の部		
流動負債		
未払解約金		435,190
未払受託者報酬		404,345
未払委託者報酬		1,145,692
その他未払費用		447,983
流動負債合計		2,433,210
負債合計		2,433,210
純資産の部		
元本等		
元本		2,270,232,178
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		360,373,258
純資産合計		2,630,605,436
負債純資産合計		2,633,038,646

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 （自平成24年2月22日 至平成24年8月21日）
営業収益	
受取利息	38,188
有価証券売買等損益	8,104,524
営業収益合計	8,066,336
営業費用	
受託者報酬	404,345
委託者報酬	1,145,692
その他費用	447,983
営業費用合計	1,998,020
営業利益又は営業損失（ ）	10,064,356
経常利益又は経常損失（ ）	10,064,356
中間純利益又は中間純損失（ ）	10,064,356
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	568,199
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	360,351,141
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,170,981
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	27,170,981
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,652,707
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,652,707
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	360,373,258

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、中間計算期間末日の前営業日の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(追加情報)

第10期中間計算期間 (自平成24年2月22日 至平成24年8月21日)
第10期中間計算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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	2,270,232,178口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1587円 (11,587円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期中間計算期間(自平成24年2月22日 至平成24年8月21日)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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。 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。

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

(その他の注記)

1 開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
期首元本額	2,202,439,092円
期中追加設定元本額	175,649,637円
期中一部解約元本額	107,856,551円

2 有価証券関係

第10期中間計算期間(平成24年8月21日現在)

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

第10期中間計算期間(平成24年8月21日現在)

該当事項はありません。

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

（単位：円）

		第10期中間計算期間 （平成24年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		354,586,282
投資信託受益証券		7,818,805,620
流動資産合計		8,173,391,902
資産合計		8,173,391,902
負債の部		
流動負債		
未払解約金		250,773
未払受託者報酬		1,252,591
未払委託者報酬		3,549,105
その他未払費用		668,140
流動負債合計		5,720,609
負債合計		5,720,609
純資産の部		
元本等		
元本		6,994,224,198
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,173,447,095
純資産合計		8,167,671,293
負債純資産合計		8,173,391,902

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第10期中間計算期間 （ 自平成24年2月22日 至平成24年8月21日 ）
営業収益	
受取利息	118,092
有価証券売買等損益	61,352,185
営業収益合計	61,234,093
営業費用	
受託者報酬	1,252,591
委託者報酬	3,549,105
その他費用	668,140
営業費用合計	5,469,836
営業利益又は営業損失（ ）	66,703,929
経常利益又は経常損失（ ）	66,703,929
中間純利益又は中間純損失（ ）	66,703,929
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,778,245
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,203,903,932
剰余金増加額又は欠損金減少額	77,335,417
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	77,335,417
剰余金減少額又は欠損金増加額	43,866,570
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	43,866,570
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,173,447,095

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、中間計算期間末日の前営業日の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(追加情報)

第10期中間計算期間 (自平成24年2月22日 至平成24年8月21日)
第10期中間計算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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	6,994,224,198口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1678円 (11,678円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期中間計算期間(自平成24年2月22日 至平成24年8月21日)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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。 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。

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

(その他の注記)

1 開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
期首元本額	6,759,195,398円
期中追加設定元本額	481,317,569円
期中一部解約元本額	246,288,769円

2 有価証券関係

第10期中間計算期間(平成24年8月21日現在)

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

第10期中間計算期間(平成24年8月21日現在)

該当事項はありません。

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

（単位：円）

		第10期中間計算期間 （平成24年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		194,976,404
投資信託受益証券		4,096,470,939
流動資産合計		4,291,447,343
資産合計		4,291,447,343
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,753,977
未払受託者報酬		658,287
未払委託者報酬		1,865,235
その他未払費用		532,630
流動負債合計		4,810,129
負債合計		4,810,129
純資産の部		
元本等		
元本		3,693,113,377
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		593,523,837
純資産合計		4,286,637,214
負債純資産合計		4,291,447,343

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 （自平成24年2月22日 至平成24年8月21日）
営業収益	
受取利息	62,663
有価証券売買等損益	54,910,403
営業収益合計	54,847,740
営業費用	
受託者報酬	658,287
委託者報酬	1,865,235
その他費用	532,630
営業費用合計	3,056,152
営業利益又は営業損失（ ）	57,903,892
経常利益又は経常損失（ ）	57,903,892
中間純利益又は中間純損失（ ）	57,903,892
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,903,391
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	634,303,257
剰余金増加額又は欠損金減少額	47,869,346
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	47,869,346
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,648,265
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,648,265
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	593,523,837

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、中間計算期間末日の前営業日の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(追加情報)

第10期中間計算期間 (自平成24年2月22日 至平成24年8月21日)
第10期中間計算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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	3,693,113,377口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1607円 (11,607円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期中間計算期間(自平成24年2月22日 至平成24年8月21日)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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。 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。

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

(その他の注記)

1 開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第10期中間計算期間 (平成24年8月21日現在)
期首元本額	3,583,285,834円
期中追加設定元本額	305,388,318円
期中一部解約元本額	195,560,775円

2 有価証券関係

第10期中間計算期間（平成24年8月21日現在）

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

第10期中間計算期間（平成24年8月21日現在）

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、中間貸借対照表の資産の部に計上されている投資信託受益証券は、すべて各投資信託の受益証券であります。

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

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

1. 「ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成24年8月20日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,919,312
親投資信託受益証券	16,622,298,129
未収入金	7,653,556

流動資産合計	16,653,870,997
資産合計	16,653,870,997
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,352,241
未払受託者報酬	5,399,055
未払委託者報酬	18,896,776
その他未払費用	362,592
流動負債合計	32,010,664
負債合計	32,010,664
純資産の部	
元本等	
元本	20,127,948,128
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,506,087,795
純資産合計	16,621,860,333
負債純資産合計	16,653,870,997

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年8月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	20,127,948,128口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6 第10号に規定する額 元本の欠損	3,506,087,795円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8258円 (8,258円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2．時価の算定方法	1．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。
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．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。 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。

（その他の注記）

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

項目	（平成24年8月20日現在）
期首	平成24年3月13日
期首元本額	19,832,219,388円
期首から計算日までの追加設定元本額	1,044,137,818円
期首から計算日までの一部解約元本額	748,409,078円

2 有価証券関係

（平成24年8月20日現在）

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

（平成24年8月20日現在）

該当事項はありません。

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

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年8月20日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	591,741,249
株式	27,931,719,720
派生商品評価勘定	20,758,300
未収入金	564,330
未収配当金	29,321,450

差入委託証拠金	16,590,000
流動資産合計	28,590,695,049
資産合計	28,590,695,049
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	689,175
前受金	19,970,000
未払金	51,890
未払解約金	35,529,680
流動負債合計	56,240,745
負債合計	56,240,745
純資産の部	
元本等	
元本	40,644,936,357
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,110,482,053
純資産合計	28,534,454,304
負債純資産合計	28,590,695,049

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、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。
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。 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。
3. 収益及び費用の計上基準	(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。 (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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年8月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	40,644,936,357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	12,110,482,053円

3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7020円 (7,020円)
------------------------------	---------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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24年8月20日現在)
期首	平成24年3月13日
同期間の期首元本額	38,559,318,270円
同期間中の追加設定元本額	3,962,139,590円
同期間中の一部解約元本額	1,876,521,503円
同期間末日の元本額	40,644,936,357円
上記元本額の内訳	
ニッセイTOPIXオープン	12,129,943,400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)	23,678,487,364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)	196,695,315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)	317,749,924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)	381,658,908円

ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス （標準型）SA（適格機関投資家限定）	2,371,653,872円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス （成長型）SA（適格機関投資家限定）	1,568,747,574円
合計	40,644,936,357円

2 有価証券関係

(平成24年8月20日現在)

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

(平成24年8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	555,180,875	-	575,250,000	20,069,125
	合計	555,180,875	-	575,250,000	20,069,125

(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24年2月21日）から計算日までの期間に対応するものであります。

2. 「ニッセイ国内債券インデックスSA（適格機関投資家限定）」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(平成24年8月20日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,470,574
親投資信託受益証券	5,571,239,063
未収入金	558,419
流動資産合計	5,577,268,056
資産合計	5,577,268,056
負債の部	
流動負債	
未払解約金	488,115
未払受託者報酬	771,875
未払委託者報酬	4,631,421
その他未払費用	239,213
流動負債合計	6,130,624
負債合計	6,130,624
純資産の部	

元本等 元本 剰余金 剰余金又は欠損金（ ）	4,749,483,280 821,654,152
純資産合計	5,571,137,432
負債純資産合計	5,577,268,056

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年8月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	4,749,483,280口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1730円 (11,730円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	1. 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 2. コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(その他の注記)

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

項目	(平成24年8月20日現在)
期首	平成24年3月13日
期首元本額	4,816,466,324円
期首から計算日までの追加設定元本額	402,376,812円

期首から計算日までの一部解約元本額	469,359,856円
-------------------	--------------

2 有価証券関係

(平成24年8月20日現在)

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

(平成24年8月20日現在)

該当事項はありません。

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

「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(平成24年8月20日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	134,894,470
国債証券	14,129,266,780
未収利息	52,981,578
前払費用	12,556,764
流動資産合計	14,329,699,592
資産合計	14,329,699,592
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,825,484
流動負債合計	10,825,484
負債合計	10,825,484
純資産の部	
元本等	
元本	11,770,848,009
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,548,026,099
純資産合計	14,318,874,108
負債純資産合計	14,329,699,592

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年8月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	11,770,848,009口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2165円 (12,165円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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24年8月20日現在)
期首	平成24年3月13日
同期間の期首元本額	11,868,611,143円
同期間中の追加設定元本額	980,195,276円
同期間中の一部解約元本額	1,077,958,410円
同期間末日の元本額	11,770,848,009円
上記元本額の内訳	
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)	4,579,727,960円

DCニッセイ国内債券インデックス	4,482,624,348円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	104,315,204円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	90,708,337円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	565,853,551円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	1,490,818,871円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	456,799,738円
合計	11,770,848,009円

2 有価証券関係

(平成24年8月20日現在)

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

(平成24年8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。

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

3. 「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」の状況

(1) 中間貸借対照表 (単位:円)

区分	注記 番号	当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
		金額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,115,693
親投資信託受益証券		3,312,586,412
未収利息		9
流動資産合計		3,317,702,114
資産合計		3,317,702,114
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		984,942
未払委託者報酬		3,939,718
流動負債合計		4,924,660
負債合計		4,924,660
純資産の部		
元本等		
元本	1	3,622,478,764
剰余金		

中間剰余金又は中間欠損金（ ） （分配準備積立金）	3	309,701,310 (335,630,976)
元本等合計		3,312,777,454
純資産合計		3,312,777,454
負債純資産合計		3,317,702,114

(2) 中間損益及び剰余金計算書（単位：円）

区 分	注記 番号	当中間計算期間 自 平成24年 2月21日 至 平成24年 8月20日
		金 額
営業収益		
受取利息		752
有価証券売買等損益		89,249,105
営業収益合計		89,249,857
営業費用		
受託者報酬		984,942
委託者報酬		3,939,718
営業費用合計		4,924,660
営業利益		84,325,197
経常利益		84,325,197
中間純利益		84,325,197
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		4,442,400
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		379,196,509
剰余金増加額又は欠損金減少額		26,705,059
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		26,705,059
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,092,657
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,092,657
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		309,701,310

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-------------------	--

(追加情報)

当中間計算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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 （平成24年 8月20日現在）
1 期首元本額	3,581,648,757円
期中追加設定元本額	289,092,663円
期中一部解約元本額	248,262,656円
2 受益権の総数	3,622,478,764口

3 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は309,701,310円であります。
---------	---

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	中間貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載してあります。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9145 円 (9,145 円)

<参考>

当ファンドは「ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表（単位：円）

区 分	注記 番号	(平成24年 8月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		747,493,525
コール・ローン		2,674,416
株式		34,477,081,756
投資証券		794,389,764
派生商品評価勘定		64,531,901
未収入金		2,380,362
未収配当金		65,746,952
未収利息		5
差入委託証拠金		139,924,562
流動資産合計		36,294,223,243
資産合計		36,294,223,243
純資産の部		
元本等		
元本	1	36,328,098,327
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3	33,875,084
元本等合計		36,294,223,243
純資産合計		36,294,223,243
負債純資産合計		36,294,223,243

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券、新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>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、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>

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</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
---------------------------	---

（追加情報）

当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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（平成24年 8月20日現在）
1 期首元本額	39,314,181,997円
期中追加設定元本額	8,011,553,698円
期中一部解約元本額	10,997,637,368円
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	3,315,570,426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	1,227,932,519円
ステート・ストリート世界株式インデックス・ファンド（為替ヘッジ付き）＜適格機関投資家限定＞	3,439,912,997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＞	15,087,498,640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＞	2,293,167,923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＞	600,411,370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＞	10,363,604,452円
計	36,328,098,327円
2 受益権の総数	36,328,098,327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33,875,084円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	（平成24年 8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時価を計上しているため、その差額はありません。
2	金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。
3	金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

（有価証券関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（単位：円）

区分	種類	（平成24年 8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	567,822,121		602,601,359	34,779,238
	S&P 60	52,522,230		55,526,592	3,004,362
	SPI 200	51,463,790		53,979,945	2,516,155
	FTSE100INDEX	116,638,928		124,056,526	7,417,598
	FSMI INDEX	40,106,756		42,665,694	2,558,938
	EURO STOXX 50	111,616,651		125,872,261	14,255,610
	合計	940,170,476		1,004,702,377	64,531,901

（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、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対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

5．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

（平成24年 8月20日現在）	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9991 円 （9,991 円）

4. 「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」の状況

（1）中間貸借対照表 （単位：円）

区 分	注記 番号	当中間計算期間末 （平成24年 8月20日現在）
		金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,914,510
親投資信託受益証券		2,150,931,999
未収利息		5
流動資産合計		2,153,846,514
資産合計		2,153,846,514
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		447,077
未払委託者報酬		2,347,085
流動負債合計		2,794,162
負債合計		2,794,162
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,853,388,164
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		297,664,188
（分配準備積立金）		(119,088,791)
元本等合計		2,151,052,352
純資産合計		2,151,052,352
負債純資産合計		2,153,846,514

（2）中間損益及び剰余金計算書 （単位：円）

区 分	注記 番号	当中間計算期間 自 平成24年 2月21日 至 平成24年 8月20日
		金 額
営業収益		
受取利息		543
有価証券売買等損益		7,003,897
営業収益合計		7,003,354
営業費用		
受託者報酬		447,077
委託者報酬		2,347,085
営業費用合計		2,794,162
営業損失（ ）		9,797,516
経常損失（ ）		9,797,516
中間純損失（ ）		9,797,516
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		1,159,375
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		296,394,383
剰余金増加額又は欠損金減少額		28,278,189

中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	28,278,189
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,051,493
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,051,493
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	297,664,188

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	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。時価評価にあつては、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。
-------------------	---

(追加情報)

当中間計算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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
1 期首元本額	1,780,245,645円
期中追加設定元本額	169,931,645円
期中一部解約元本額	96,789,126円
2 受益権の総数	1,853,388,164口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	中間貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。

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

（有価証券関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	当中間計算期間末 （平成24年 8月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1606 円 （11,606 円）

<参考>

当ファンドは「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（1）貸借対照表（単位：円）

区 分	注記 番号	（平成24年 8月20日現在）
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		576,720,858
コール・ローン		24,232,024
国債証券		226,078,119,616
派生商品評価勘定		8,407
未収入金		1,523,825,166
未収利息		2,192,668,975
前払費用		82,457,500
流動資産合計		230,478,032,546
資産合計		230,478,032,546
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		6,865
未払金		1,766,329,678
未払解約金		17,289,767
流動負債合計		1,783,626,310
負債合計		1,783,626,310
純資産の部		
元本等		
元本	1	154,665,607,710
剰余金		

剰余金又は欠損金（ ）		74,028,798,526
元本等合計		228,694,406,236
純資産合計		228,694,406,236
負債純資産合計		230,478,032,546

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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>

(追加情報)

当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。

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成24年 8月20日現在)
1 期首元本額	160,685,006,426円
期中追加設定元本額	6,484,367,985円
期中一部解約元本額	12,503,766,701円
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	4,786,199,812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	8,581,433円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	1,454,708,508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	1,132,825,006円

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き(年金1) < 適格機関投資家限定 >	2,126,209,677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 >	30,961,563,324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 >	132,621,679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 >	11,555,876,264円
ステート・ストリート・バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	9,612,854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 >	90,793,280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 >	17,280,149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 >	17,848,544,664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 >	2,891,583,464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 >	86,905,757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 >	11,590,825,688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 >	3,040,991,319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 >	98,765,133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 >	3,217,167,246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 >	8,863,616,741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 >	3,269,370,724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 >	8,778,100,179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 >	1,559,285,298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 >	2,262,048,404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 >	3,039,201,715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 >	197,251,597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 >	201,580,749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 >	153,413,907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 >	176,725,542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 >	177,140,913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 >	1,597,346,119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 >	16,919,290円

ステート・ストリート・バランスファン ドVA35B<適格機関投資家限定>	12,392,321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>	101,352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>	24,811,775,127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 >	415,824,818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>	2,505,413,172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>	4,326,260,952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>	1,100,430,518円
ステート・ストリート4資産インデック スバランスVA50<適格機関投資家限 定>	143,916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VA4 <適格機関投資家限定>	150,209,099円
計	154,665,607,710円
2 受益権の総数	154,665,607,710口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	(平成24年 8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時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算 定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載してあります。 (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)」に記載してあります。
3 金融商品の時価等 に関する事項につい ての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

（単位：円）

区分	種類	（平成24年 8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	4,355,969		4,364,376	8,407
	売建 マレーシア・リングgit	4,355,969		4,362,834	6,865
	合 計	8,711,938		8,727,210	1,542

（注）1．時価の算定方法

- (1) 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。
- 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。
- 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。
- ・ 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。
 - ・ 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) 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、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- 2．換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 4．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成24年 8月20日現在）
1口当たり純資産額	1.4786 円
（1万口当たり純資産額）	（14,786 円）

2【ファンドの現況】

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

【純資産額計算書】

「債券重視型」

（平成24年9月28日現在）

資産総額	2,636,487,703 円
負債総額	600,169 円
純資産総額（ - ）	2,635,887,534 円
発行済数量	2,277,373,885 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	11,574 円

「標準型」

（平成24年9月28日現在）

資産総額	8,151,838,245 円
負債総額	4,763,847 円
純資産総額（ - ）	8,147,074,398 円
発行済数量	7,004,580,932 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	11,631 円

「株式重視型」

（平成24年9月28日現在）

資産総額	4,255,116,852 円
負債総額	2,913,779 円
純資産総額（ - ）	4,252,203,073 円
発行済数量	3,688,115,041 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	11,529 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

(1) 資本金の額

平成24年9月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間に於ける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

平成24年9月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです

（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	166	17,586
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	403
単位型公社債投資信託	0	0
合計	169	17,990

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

3【委託会社等の経理状況】

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

1. 財務諸表の作成方法について

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

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		6,270,894		1,324,746
有価証券		11,023,094		8,309,605
前払費用	1	195,613	1	200,463
未収委託者報酬		1,751,247		1,465,803
未収運用受託報酬	1	656,202	1	778,921
未収投資助言報酬	1	171,421	1	154,740
繰延税金資産		295,260		273,967
その他		64,039		44,410
流動資産合計		20,427,773		12,552,657
固定資産				
有形固定資産				
建物	2	133,329	2	115,964
車両	2	5,095	2	2,970
器具備品	2	179,790	2	148,251
有形固定資産合計		318,215		267,186
無形固定資産				
ソフトウェア		1,372,451		1,228,624
ソフトウェア仮勘定		51,575		55,978
その他		8,203		8,171
無形固定資産合計		1,432,230		1,292,774
投資その他の資産				
投資有価証券		16,986,491		25,328,584
差入保証金	1	284,824	1	283,591
繰延税金資産		500,589		437,364
その他		17		38

投資その他の資産合計		17,771,923		26,049,578
固定資産合計		19,522,370		27,609,540
資産合計		39,950,144		40,162,198
負債の部				
流動負債				
預り金		28,412		30,600
未払収益分配金		4,324		-
未払償還金		151,440		148,104
未払手数料	1	683,709	1	560,208
未払運用委託報酬		391,985		396,073
未払投資助言報酬		106,084		126,813
その他未払金	1	187,916	1	205,721
未払費用	1	119,099	1	122,185
未払法人税等		145,709		149,239
賞与引当金		552,829		538,159
その他		42,559		22,815
流動負債合計		2,414,070		2,299,923
固定負債				
退職給付引当金		644,223		767,977
役員退職慰労引当金		11,275		13,630
その他	1	66,068	1	4,973
固定負債合計		721,566		786,580
負債合計		3,135,637		3,086,503
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		17,625,364		17,833,930
利益剰余金合計		18,305,171		18,513,737
株主資本合計		36,587,011		36,795,577
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		227,494		280,116
評価・換算差額等合計		227,494		280,116
純資産合計		36,814,506		37,075,694
負債・純資産合計		39,950,144		40,162,198

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

前事業年度

当事業年度

	(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,004,207	9,952,331
運用受託報酬	3,873,347	3,987,169
投資助言報酬	751,384	705,920
業務受託料	47,100	47,100
営業収益計	15,676,039	14,692,522
営業費用		
支払手数料	4,548,772	4,131,652
広告宣伝費	110,792	27,241
公告費	466	323
調査費	2,708,450	2,700,559
支払運用委託報酬	1,442,927	1,294,778
支払投資助言報酬	448,879	479,438
委託調査費	20,521	42,633
調査費	796,121	883,708
委託計算費	104,902	101,748
営業雑経費	543,623	390,063
通信費	57,003	55,182
印刷費	175,972	133,820
協会費	17,084	17,984
その他営業雑経費	293,563	183,076
営業費用計	8,017,006	7,351,588
一般管理費		
役員報酬	1 62,167	1 59,718
給料・手当	2,985,814	3,012,857
賞与引当金繰入額	547,443	537,887
賞与	256,821	260,246
福利厚生費	550,141	566,829
退職給付費用	163,211	156,575
役員退職慰労引当金繰入額	5,550	5,455
役員退職慰労金	637	650
その他人件費	135,147	115,587
不動産賃借料	635,759	632,434
その他不動産経費	38,835	27,417
交際費	14,220	14,037
旅費交通費	87,941	90,473
固定資産減価償却費	627,055	654,122
租税公課	77,387	79,628
業務委託費	183,393	179,945
器具備品費	178,045	151,259
保守料	92,961	87,228
保険料	63,246	60,291
寄付金	820	5,000
諸経費	39,883	56,644
一般管理費計	6,746,486	6,754,291
営業利益	912,546	586,642
営業外収益		
受取利息	3,284	1,966
有価証券利息	107,994	93,236
受取配当金	102,558	45,856
その他営業外収益	22,945	17,359
営業外収益計	236,783	158,419

営業外費用				
為替差損		9,852		6,419
賃貸借契約解約損		-		4,124
その他営業外費用		15,292		1,248
営業外費用計		25,144		11,792
経常利益		1,124,185		733,269
特別利益				
投資有価証券売却益		35,991		25,290
投資有価証券償還益		351		-
事故受取保険金	3	5,462	3	14,136
清算配当金		-	5	59,327
特別利益計		41,804		98,754
特別損失				
投資有価証券売却損		17,676		1,778
投資有価証券償還損		355,993		87,378
投資有価証券評価損		5,706		-
固定資産除却損	4	16,762	4	19,104
事故損失賠償金	2	22,343	2	39,244
特別損失計		418,482		147,506
税引前当期純利益		747,507		684,516
法人税、住民税及び事業税		272,647		263,157
法人税等調整額		37,686		77,232
法人税等合計		310,333		340,390
当期純利益		437,174		344,126

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成22年4月 1 日 至 平成23年3月31日)		(自 平成23年4月 1 日 至 平成24年3月31日)	
株主資本				
資本金				
当期首残高		10,000,000		10,000,000
当期変動額				
当期変動額合計		-		-
当期末残高		10,000,000		10,000,000
資本剰余金				
資本準備金				
当期首残高		8,281,840		8,281,840
当期変動額				
当期変動額合計		-		-
当期末残高		8,281,840		8,281,840
資本剰余金合計				
当期首残高		8,281,840		8,281,840
当期変動額				
当期変動額合計		-		-
当期末残高		8,281,840		8,281,840
利益剰余金				
利益準備金				
当期首残高		139,807		139,807
当期変動額				
当期変動額合計		-		-

当期末残高	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
当期首残高	120,000	120,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	120,000	120,000
研究開発積立金		
当期首残高	70,000	70,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	70,000	70,000
別途積立金		
当期首残高	350,000	350,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	350,000	350,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	17,323,750	17,625,364
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	17,625,364	17,833,930
利益剰余金合計		
当期首残高	18,003,557	18,305,171
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	18,305,171	18,513,737
株主資本合計		
当期首残高	36,285,397	36,587,011
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
当期変動額合計	301,614	208,566
当期末残高	36,587,011	36,795,577
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	93,537	227,494
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	133,956	52,622
当期変動額合計	133,956	52,622
当期末残高	227,494	280,116
評価・換算差額等合計		
当期首残高	93,537	227,494
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	133,956	52,622
当期変動額合計	133,956	52,622
当期末残高	227,494	280,116
純資産合計		

当期首残高	36,378,935	36,814,506
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	437,174	344,126
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	133,956	52,622
当期変動額合計	435,570	261,188
当期末残高	36,814,506	37,075,694

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

満期保有目的の債券

償却原価法（定額法）によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

…移動平均法に基づく原価法によっております。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。

2．固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定率法によっております。

主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。

無形固定資産

定額法によっております。

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

3．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4．引当金の計上基準

賞与引当金

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

退職給付引当金

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

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

役員退職慰労引当金

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

5．リース取引の処理方法

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

6．消費税及び地方消費税の会計処理

税抜方式によっております。

（追加情報）

当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)

(貸借対照表関係)

1. 関係会社に対する資産及び負債は以下のとおりであり、すべて親会社に対するものであります。			
	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)	
前払費用	60,402千円	52,725千円	
未収運用受託報酬	296,706	383,091	
未収投資助言報酬	152,956	135,967	
差入保証金	280,262	280,262	
未払手数料	88,132	90,057	
その他未払金	14,956	19,525	
未払費用	60,986	59,677	
その他固定負債	66,068	4,973	
2. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。			
	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)	
建物	187,418千円	206,955千円	
車両	1,919	4,043	
器具備品	592,884	573,767	
計	782,221	784,767	

(損益計算書関係)

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。			
取締役	180,000千円		
監査役	30,000千円		
2. 事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。			
3. 事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。			
4. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。			
	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
建物	8,300千円	-千円	
器具備品	8,461	11,393	
その他	-	7,711	
計	16,762	19,104	
5. 清算配当金は、会社型投資信託の清算配当であります。			

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成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

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成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

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

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。

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成23年6月27日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23年6月27日

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

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

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月25日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

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

	前事業年度（平成23年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	3,237	2,461	776

(単位：千円)

	当事業年度（平成24年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	417	445

未経過リース料期末残高相当額等 (単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
1年内	342	174
1年超	462	287
合計	804	462

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
支払リース料	1,383	361
減価償却費相当額	1,258	330
支払利息相当額	53	19

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成23年3月31日） (単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	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	-

当事業年度（平成24年3月31日） (単位：千円)

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

(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は、決算日の市場価格等によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
非上場株式	132,500	67,500

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

前事業年度(平成23年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	6,270,894	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,000,000	10,400,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
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。

当事業年度(平成24年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)

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

（注）投資信託受益証券、国庫短期証券等であります

（有価証券関係）

1．満期保有目的の債券

前事業年度（平成23年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
時価が貸借対照 表計上額を超え るもの	(1)国債・地方債等	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

当事業年度（平成24年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日）

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

当事業年度（平成24年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

区分	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
非上場株式	132,500千円	67,500千円

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	561,210	35,991	17,676
合計	561,210	35,991	17,676

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
(1)退職給付債務	644,223千円	767,977千円
(2)退職給付引当金	644,223千円	767,977千円

（注）当社は退職給付債務の算定方法として簡便法を採用しております。

3．退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
(1)勤務費用	130,059千円	132,222千円
(2)退職給付負担金	33,151千円	24,353千円

（注）福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
福利厚生費として確定拠出型年金制度への拠出金	43,211千円	45,640千円

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法によっているため、該当事項はありません。

（税効果会計関係）

	前事業年度	当事業年度
	(平成23年3月31日)	(平成24年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	221,131千円	204,554千円
未払事業税	18,935	19,923
その他	<u>55,977</u>	<u>49,981</u>
繰延税金資産合計	296,044	274,458
繰延税金負債		
有価証券評価差額	<u>784</u>	<u>491</u>
繰延税金負債合計	<u>784</u>	<u>491</u>
繰延税金資産の純額	<u>295,260</u>	<u>273,967</u>
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	257,689	276,081
役員退職慰労引当金	4,510	4,857
税務上の繰延資産償却超過額	5,310	2,519
投資有価証券評価損	539,831	472,994
投資有価証券評価差額	261,653	212,965
その他	<u>30,323</u>	<u>6,911</u>
小計	<u>1,099,317</u>	<u>976,328</u>
評価性引当額	<u>120,282</u>	<u>106,755</u>
繰延税金資産合計	<u>979,034</u>	<u>869,573</u>
繰延税金負債		
特別分配金否認	58,098	50,467
投資有価証券評価差額	<u>420,346</u>	<u>381,742</u>
繰延税金負債合計	<u>478,445</u>	<u>432,209</u>
繰延税金資産の純額	<u>500,589</u>	<u>437,364</u>
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		
	前事業年度	当事業年度
	(平成23年3月31日)	(平成24年3月31日)
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。		法定実効税率 40.00% (調整) 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.93
		住民税均等割 0.85
		税率変更に伴う影響 9.27
		その他 <u>1.32</u>
		税効果会計適用後の法人税等の負担率 49.73
3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正		
「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）および「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が、平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率が変更されることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用される実効税率は、一時差異等に係る解消時期に応じて以下のとおりとなります。		
平成24年3月31日まで 40.00%		
平成24年4月1日から平成27年3月31日 38.01%		
平成27年4月1日以降 35.64%		
この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債を控除した金額）は48,216千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,484千円、その他有価証券評価差額金が15,268千円、それぞれ増加しています。		

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自平成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

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,205,257

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有) 直接 90.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	1,352,450	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
								業務受託料の受取	47,100	-	-

当事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
1株当たり純資産額	339,466円90銭	341,875円31銭
1株当たり当期純利益金額	4,031円18銭	3,173円18銭

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

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
当期純利益	437,174千円	344,126千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	437,174千円	344,126千円
期中平均株式数	108千株	108千株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年10月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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24年2月22日から平成24年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、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8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年2月22日から平成24年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次△](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年10月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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24年2月22日から平成24年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、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8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年2月22日から平成24年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次△](#)

独立監査人の監査報告書

平成24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 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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成24年10月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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24年2月22日から平成24年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、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8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年2月22日から平成24年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次△](#)