

## 【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25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 - 4608
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	DCニッセイ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25年5月22日（水）～平成26年5月21日（水）

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) <sup>※1</sup> の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33075%(税込)
信託財産留保額	ありません。

## 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 <sup>※2</sup> の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.2205%(税込)
信託財産留保額	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 (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) <sup>※3</sup> に連動する投資成果を目標に運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.315%(税込・上限)
信託財産留保額	購入時および換金時：基準価額に0.2%をかけた額

## 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) <sup>※4</sup> に連動する投資成果を目標に運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.2625%(税込)
信託財産留保額	購入時および換金時：基準価額に0.1%をかけた額

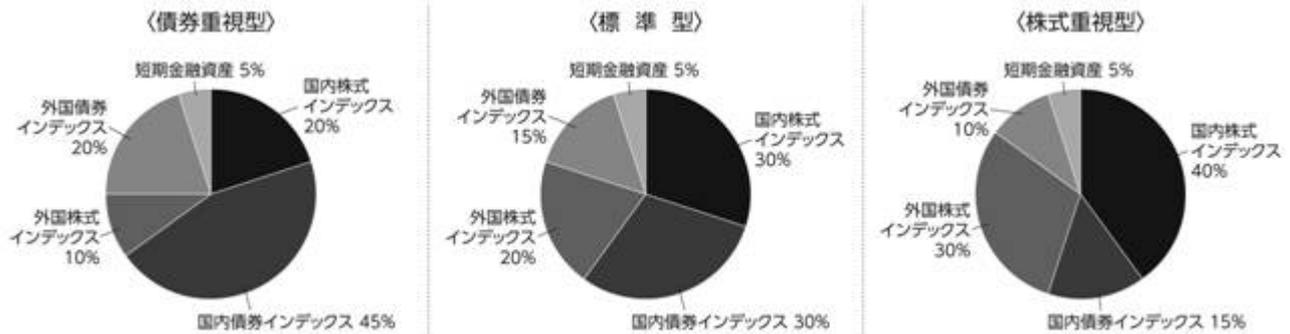
※1 TOPIX(東証株価指数)とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIX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		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1回 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	
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)		なし
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	一般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、対円で為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円で為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

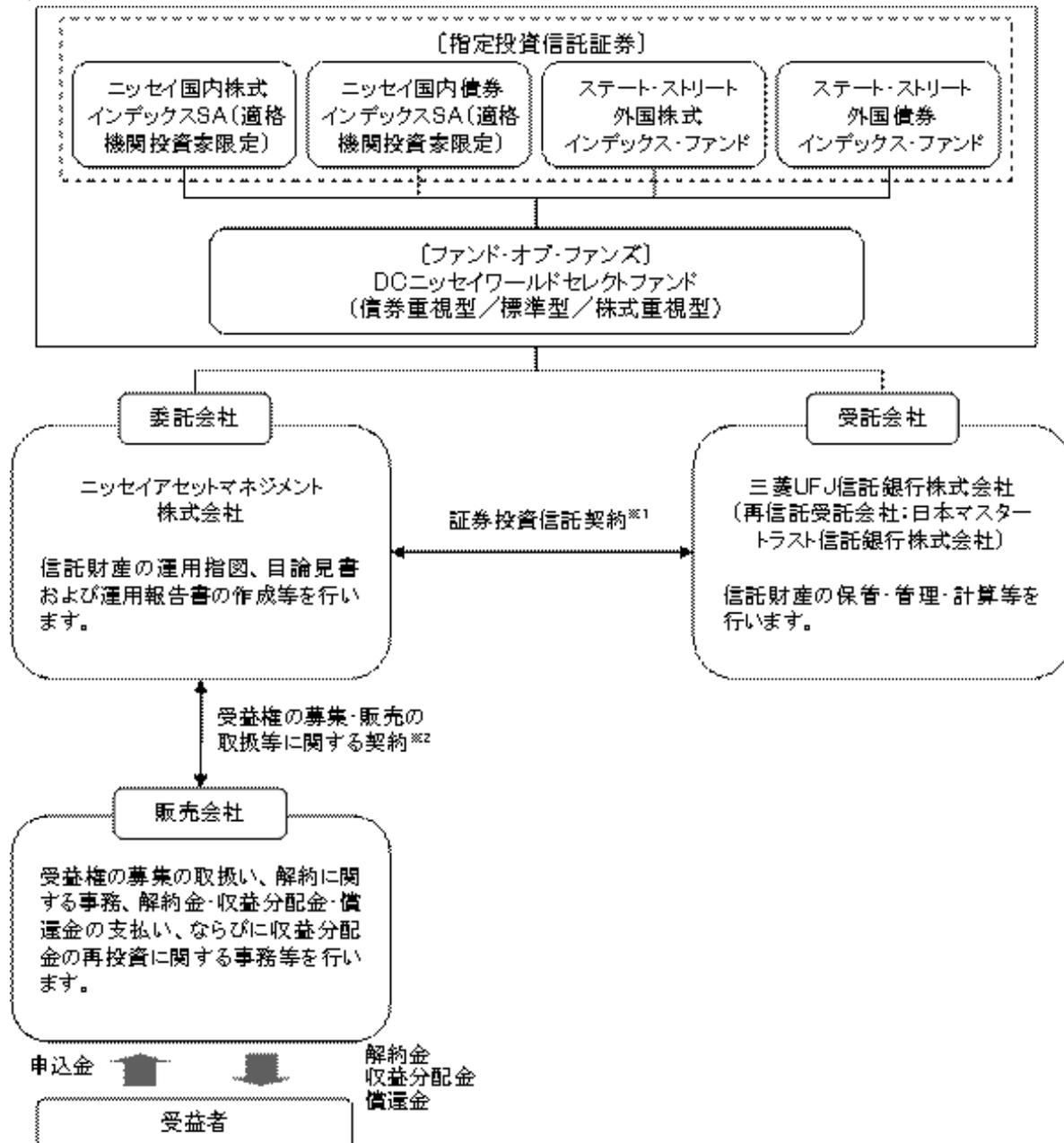
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<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】



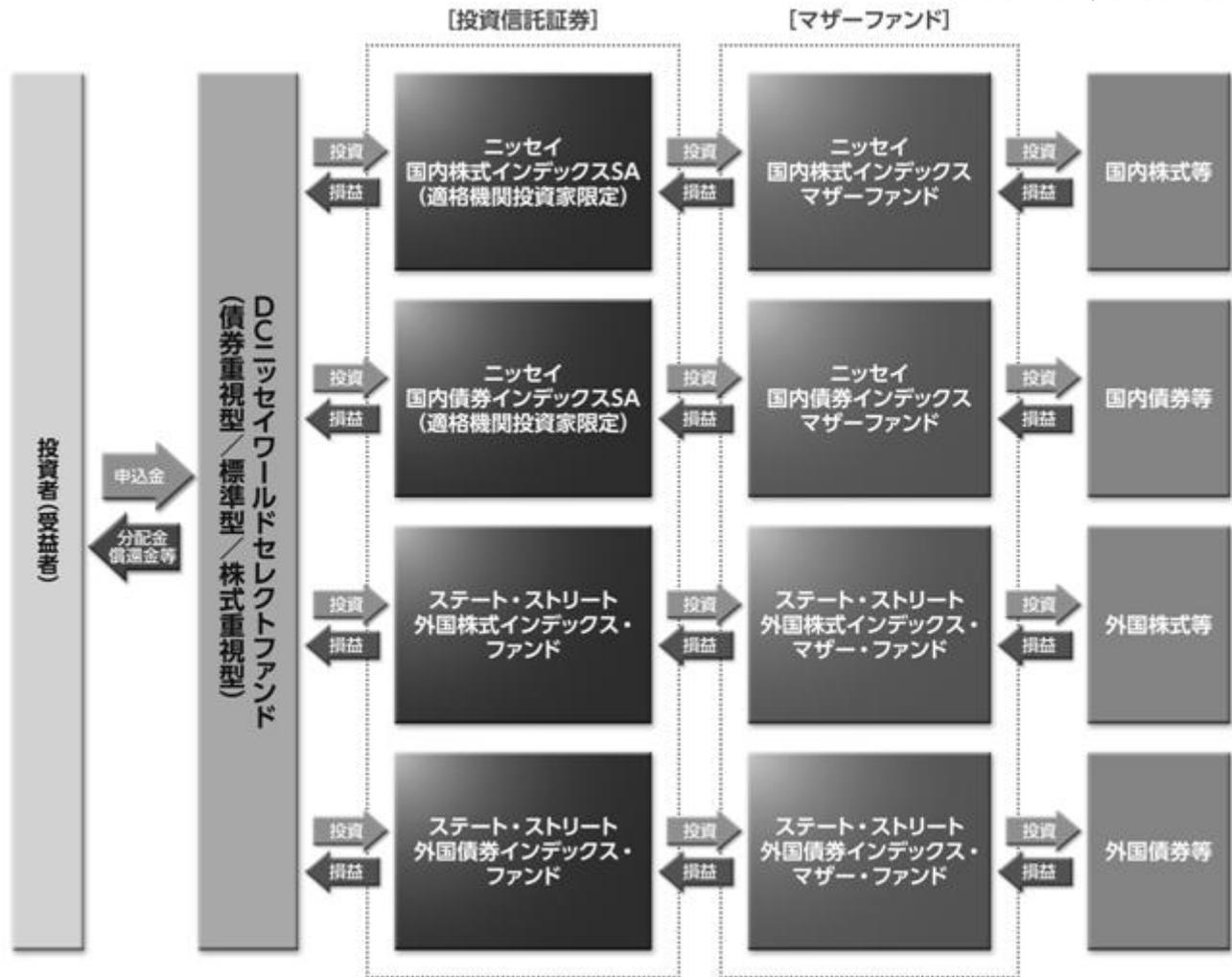
- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

## 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25年3月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 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・一部解約にもな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. 証券取引にともなう手数料等  
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ともな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・一部解約にともな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. 証券取引にともなう手数料等  
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ともな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

- 1．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。
- 2．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。
- 3．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。
- 4．公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- 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。

#### (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めざ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めざ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. 証券取引にともなう手数料等

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ともな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めざ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めざ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け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ともな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. 証券取引にともなう手数料等  
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ともな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めざ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け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

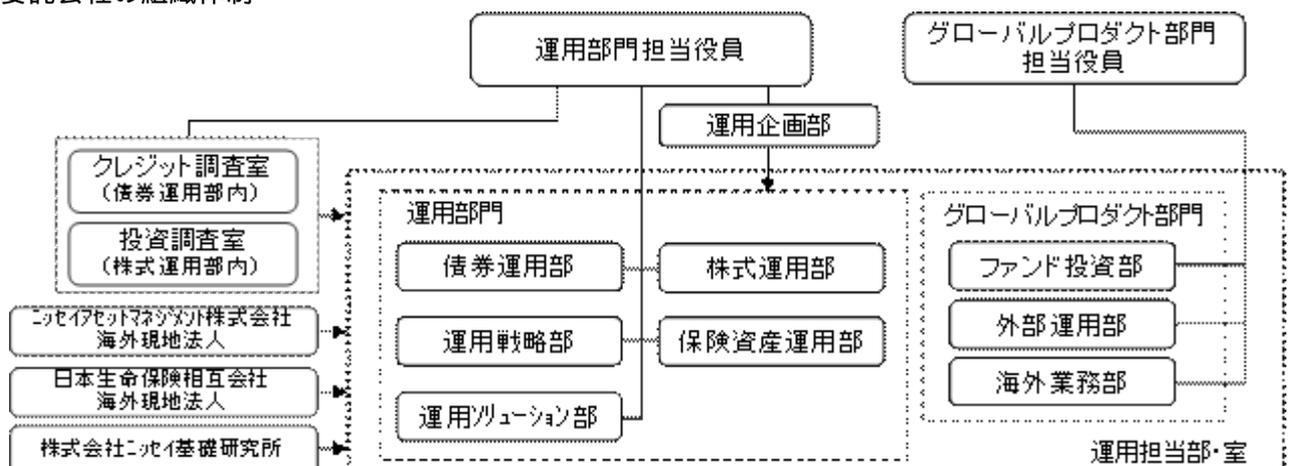
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ)により運用することができます。

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。

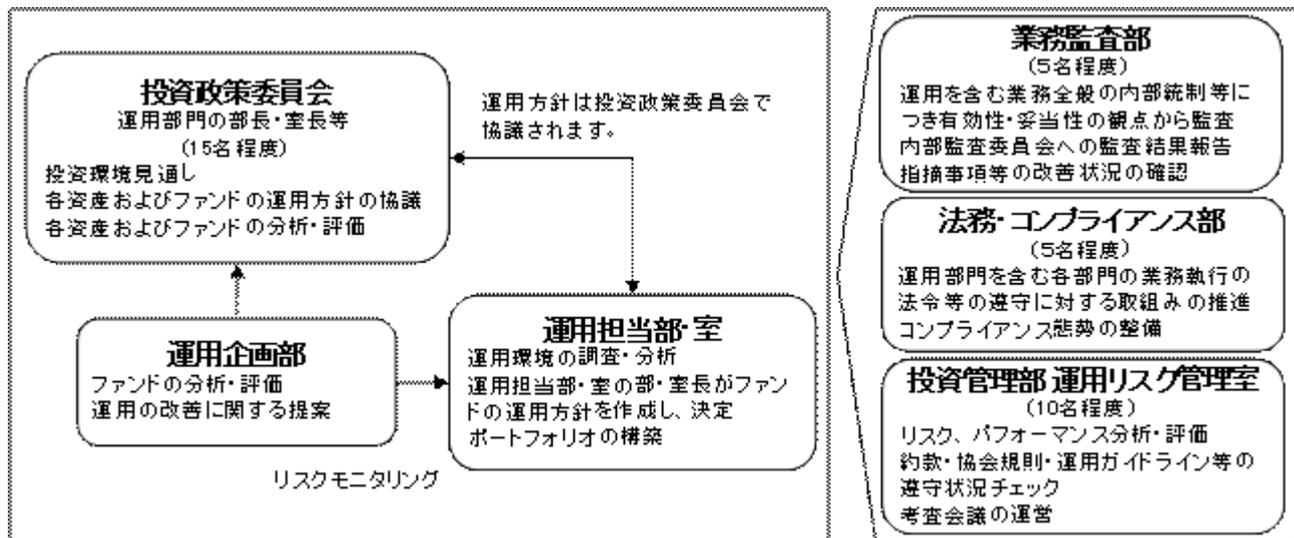
(3) 【運用体制】

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

##### 資金の借入れ

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

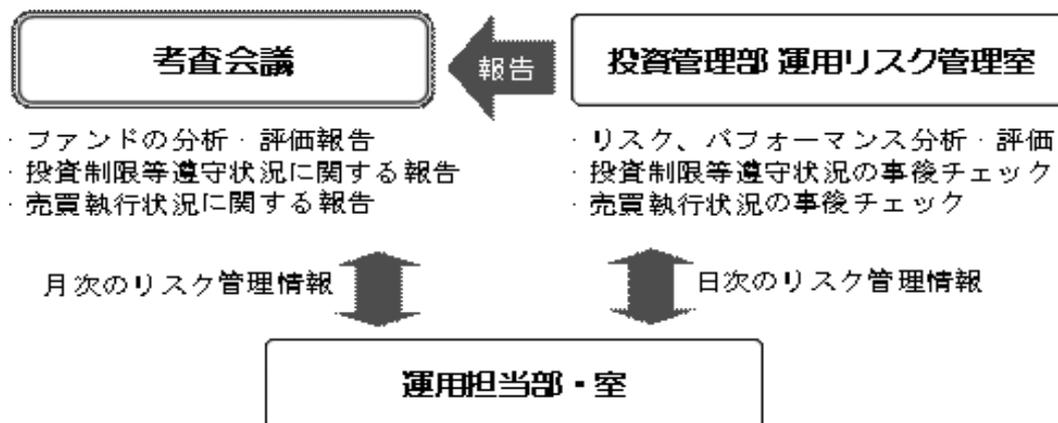
#### ・為替変動リスク

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、月次の審査会議で報告します。
- ・ 売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。

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

上記投資リスク管理体制は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。

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。

ただし、一部の指定投資信託証券（外国株式インデックス、外国債券インデックス）の購入および換金時には、信託財産留保額を信託財産中から支払います。その額については、前記「2 投資方針（2）投資対象 a 主な投資対象 各指定投資信託証券の概要」をご覧ください。

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25年3月29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	2,919,387,796	94.72
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		162,877,407	5.28
純資産総額		3,082,265,203	100.00

「標準型」

(平成25年3月29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	9,450,566,336	94.73
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		526,123,582	5.27
純資産総額		9,976,689,918	100.00

「株式重視型」

(平成25年3月29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	5,217,352,559	94.73
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		290,216,681	5.27
純資産総額		5,507,569,240	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25年3月29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	1,155,496,000	11,794	1,362,775,977	12,005	1,387,172,948	45.01
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	540,473,889	10,617	573,839,737	11,402	616,248,328	19.99
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	440,685,510	13,923	613,579,375	13,841	609,952,814	19.79
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	257,847,747	11,756	303,117,966	11,868	306,013,706	9.93
投資比率：合計									94.72

## 「標準型」

（平成25年3月29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	2,492,647,754	11,795	2,940,077,568	12,005	2,992,423,628	29.99
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	2,623,446,853	10,617	2,785,237,036	11,402	2,991,254,101	29.98
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	1,672,522,690	11,755	1,966,071,369	11,868	1,984,949,928	19.90
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	1,070,687,580	13,923	1,490,770,162	13,841	1,481,938,679	14.86
投資比率：合計									94.73

## 「株式重視型」

（平成25年3月29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	1,930,588,332	10,616	2,049,565,205	11,402	2,201,256,816	39.97
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	1,386,086,629	11,754	1,629,235,316	11,868	1,645,007,611	29.87
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	688,088,631	11,795	811,634,620	12,005	826,050,401	15.00
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	393,784,937	13,925	548,347,066	13,841	545,037,731	9.89
投資比率：合計									94.73

（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	-	94.72
合計		94.72

## 「標準型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	94.73
合計		94.73

## 「株式重視型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	94.73
合計		94.73

（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25年3月29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
第10期末	（平成25年2月21日）	分配付：	3,001,737,472	分配付：	13,114
		分配落：	3,001,737,472	分配落：	13,114
	平成24年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
	9月末日		2,635,887,534		11,574
	10月末日		2,653,309,663		11,627

	11月末日	2,727,041,182	11,910
	12月末日	2,835,790,031	12,331
	平成25年1月末日	2,969,993,201	12,875
	2月末日	2,955,643,832	12,957
	平成25年3月29日	3,082,265,203	13,412

## 「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
第10期末	（平成25年2月21日）	分配付：	9,660,248,526	分配付：	13,772
		分配落：	9,660,248,526	分配落：	13,772
	平成24年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		
	9月末日	8,147,074,398	11,631		
	10月末日	8,179,573,750	11,670		
	11月末日	8,455,594,043	12,042		
	12月末日	8,846,682,193	12,647		
	平成25年1月末日	9,452,798,698	13,436		
	2月末日	9,474,657,169	13,527		
	平成25年3月29日	9,976,689,918	14,167		

## 「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： 分配落：	3,578,213,433 3,578,213,433	分配付： 分配落：	17,319 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
第10期末	(平成25年2月21日)	分配付： 分配落：	5,347,012,544 5,347,012,544	分配付： 分配落：	14,248 14,248
	平成24年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
	9月末日		4,252,203,073		11,529
	10月末日		4,264,856,723		11,553
	11月末日		4,443,590,053		12,009
	12月末日		4,720,065,431		12,788
	平成25年1月末日		5,183,969,975		13,815
	2月末日		5,211,807,945		13,913
	平成25年3月29日		5,507,569,240		14,741

## 【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
第10期	(平成25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
第10期	（平成25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
第10期	（平成25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%
第10期	自平成24年2月22日 至平成25年2月21日	12.70%

## 「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%
第10期	自平成24年2月22日 至平成25年2月21日	16.90%

## 「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%
第10期	自平成24年2月22日 至平成25年2月21日	21.05%

（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、前期末未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25年3月29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25年3月29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25年3月29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	20,954,027,754	100.00
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		166,872	0.00
純資産総額		20,953,860,882	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	36,092,732,150	98.48
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		558,395,806	1.52
純資産総額		36,651,127,956	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） （2013年6月限）	東京証券取引所	567,086,975	571,175,000	1.56

## 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	6,672,480,341	100.00
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		37,253	0.00
純資産総額		6,672,443,088	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	15,704,140,390	99.32
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		106,839,165	0.68
純資産総額		15,810,979,555	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	3,943,608,857	99.99
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		368,380	0.01
純資産総額		3,943,977,237	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	11,814,297,887	54.92
	イギリス	2,035,055,478	9.46
	カナダ	1,019,156,913	4.74
	スイス	862,615,689	4.01

	フランス	842,929,319	3.92
	オーストラリア	803,172,870	3.73
	ドイツ	789,764,152	3.67
	スウェーデン	308,036,955	1.43
	香港	287,264,717	1.34
	スペイン	259,481,679	1.21
	オランダ	223,585,541	1.04
	イタリア	182,950,582	0.85
	シンガポール	158,393,839	0.74
	ベルギー	112,603,082	0.52
	デンマーク	109,320,868	0.51
	ノルウェー	82,513,099	0.38
	フィンランド	73,028,071	0.34
	イスラエル	50,835,869	0.24
	アイルランド	26,258,962	0.12
	オーストリア	25,745,612	0.12
	ポルトガル	15,821,718	0.07
	ニュージーランド	12,397,262	0.06
	ギリシャ	5,917,276	0.03
	小計	20,101,147,440	93.45
投資証券	アメリカ	329,792,602	1.53
	オーストラリア	60,173,376	0.28
	フランス	26,711,836	0.12
	イギリス	23,640,738	0.11
	香港	10,172,517	0.05
	シンガポール	8,304,960	0.04
	カナダ	5,496,196	0.03
	オランダ	2,526,531	0.01
	小計	466,818,756	2.17
	コール・ローン、その他資産（負債控除後）	942,495,239	4.38
	純資産総額	21,510,461,435	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	62	4,797,655.32	4,844,370.00	455,612,998	2.12
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	30	790,448.05	766,200.00	92,503,326	0.43
	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	9	578,194.62	571,590.00	81,828,824	0.38
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	3	438,023.41	437,340.00	40,488,937	0.19
	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	5	384,420.00	384,600.00	38,152,320	0.18
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラ リア・ドル	3	379,650.00	372,525.00	36,481,373	0.17

（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25年3月29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	2,634,368,380	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		42,858	0.00
純資産総額		2,634,325,522	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	106,814,826,879	40.83
	フランス	25,423,851,571	9.72
	イタリア	23,938,018,413	9.15
	ドイツ	22,694,281,001	8.68
	イギリス	19,256,575,705	7.36
	スペイン	11,883,966,027	4.54
	カナダ	7,047,657,257	2.69
	オランダ	6,868,543,975	2.63
	ベルギー	6,630,378,743	2.53
	オーストリア	4,507,015,540	1.72
	オーストラリア	4,189,315,637	1.60
	メキシコ	2,861,975,693	1.09
	デンマーク	2,172,652,017	0.83
	アイルランド	1,990,335,762	0.76
	ポーランド	1,978,467,918	0.76
	スウェーデン	1,669,659,134	0.64
	フィンランド	1,614,332,871	0.62
	南アフリカ	1,604,526,453	0.61
	マレーシア	1,486,800,850	0.57
	シンガポール	1,027,323,382	0.39
スイス	1,007,709,241	0.39	
ノルウェー	814,835,047	0.31	
	小計	257,483,049,116	98.42
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		4,136,500,514	1.58
純資産総額		261,619,549,630	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	21,617,690,864	9,658	20,878,639,699	9,693	20,954,027,754	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	323,800	4,820 4,860	1,560,716,000 1,573,668,000	4.29
2	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	1,883,600	533 558	1,003,958,800 1,051,048,800	2.87
3	日本	ホンダ	株式	輸送用機器	212,600	3,500 3,555	744,100,000 755,793,000	2.06
4	日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	188,100	3,825 3,775	719,482,500 710,077,500	1.94
5	日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	3,208,200	205 199	657,681,000 638,431,800	1.74
6	日本	キヤノン	株式	電気機器	156,600	3,345 3,400	523,827,000 532,440,000	1.45
7	日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	119,000	3,395 4,340	404,005,000 516,460,000	1.41
8	日本	武田薬品工業	株式	医薬品	98,900	4,790 5,030	473,731,000 497,467,000	1.36
9	日本	J T	株式	食料品	156,900	2,941 3,000	461,508,300 470,700,000	1.28
10	日本	三菱地所	株式	不動産業	174,000	2,136 2,596	371,664,000 451,704,000	1.23
11	日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	104,700	4,295 4,105	449,686,500 429,793,500	1.17
12	日本	ファナック	株式	電気機器	26,200	14,580 14,490	381,996,000 379,638,000	1.04
13	日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	46,500	6,840 7,720	318,060,000 358,980,000	0.98
14	日本	三菱商事	株式	卸売業	194,100	1,924 1,743	373,448,400 338,316,300	0.92
15	日本	日立製作所	株式	電気機器	605,000	524 543	316,930,900 328,515,000	0.90
16	日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	104,100	2,815 3,115	293,041,500 324,271,500	0.88

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	
17	日本	三井不動産	株式	不動産業	117,000	2,130 2,639	249,210,000 308,763,000	0.84
18	日本	アステラス製薬	株式	医薬品	58,600	5,020 5,060	294,172,000 296,516,000	0.81
19	日本	信越化学工業	株式	化学	47,300	5,740 6,250	271,502,000 295,625,000	0.81
20	日本	野村ホールディングス	株式	証券、商品先物取引業	508,500	544 577	276,624,000 293,404,500	0.80
21	日本	N T T ドコモ	株式	情報・通信業	2,050	141,100 142,100	289,255,000 291,305,000	0.79
22	日本	日産自動車	株式	輸送用機器	318,400	938 905	298,659,200 288,152,000	0.79

23	日本	三井物産	株式	卸売業	214,700	1,413 1,313	303,371,100 281,901,100	0.77
24	日本	コマツ	株式	機械	123,100	2,410 2,249	296,671,000 276,851,900	0.76
25	日本	KDDI	株式	情報・通信業	70,200	3,465 3,870	243,243,000 271,674,000	0.74
26	日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	82,800	2,809 3,170	232,585,200 262,476,000	0.72
27	日本	新日鐵住金	株式	鉄鋼	1,116,000	256 235	285,696,000 262,260,000	0.72
28	日本	ソニー	株式	電気機器	158,400	1,355 1,642	214,632,000 260,092,800	0.71
29	日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	96,400	2,885 2,650	278,114,000 255,460,000	0.70
30	日本	デンソー	株式	輸送用機器	62,300	3,670 3,985	228,641,000 248,265,500	0.68
投資比率：合計								36.16

(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	11.28
	輸送用機器	10.97
	銀行業	10.61
	情報・通信業	6.03
	化学	5.55
	医薬品	5.07
	機械	5.01
	卸売業	4.82
	小売業	4.35
	陸運業	4.35
	食料品	4.11
	不動産業	3.54
	建設業	2.31
	電気・ガス業	2.24
	保険業	2.23
	サービス業	2.12
	証券、商品先物取引業	1.62
	鉄鋼	1.54
	その他製品	1.35
	精密機器	1.24
	その他金融業	1.14
	非鉄金属	1.00
	ゴム製品	0.97
	ガラス・土石製品	0.87
	繊維製品	0.80
	石油・石炭製品	0.69
	金属製品	0.64
	鉱業	0.55
	空運業	0.52
	海運業	0.33
倉庫・運輸関連業	0.28	
パルプ・紙	0.27	
水産・農林業	0.08	
合計	98.48	

（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	5,356,410,325	12,334	6,606,430,196	12,457	6,672,480,341	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280回 利付国債(10年)	1.900	2016/6/20	国債証券	1,104,000,000	106.05 105.86	1,170,779,440 1,168,639,200	7.39
2	日本	第28回 利付国債(30年)	2.500	2038/3/20	国債証券	794,000,000	115.40 120.80	916,279,320 959,112,300	6.07
3	日本	第306回 利付国債(10年)	1.400	2020/3/20	国債証券	879,000,000	107.44 107.72	944,362,800 946,893,960	5.99
4	日本	第106回 利付国債(5年)	0.200	2017/9/20	国債証券	923,000,000	100.40 100.36	926,693,200 926,276,650	5.86
5	日本	第72回 利付国債(20年)	2.100	2024/9/20	国債証券	780,000,000	114.06 115.48	889,653,150 900,705,000	5.70
6	日本	第321回 利付国債(2年)	0.100	2014/10/15	国債証券	884,000,000	100.08 100.08	884,709,240 884,742,560	5.60
7	日本	第84回 利付国債(5年)	0.700	2014/6/20	国債証券	790,000,000	100.85 100.79	796,754,490 796,241,000	5.04
8	日本	第54回 利付国債(20年)	2.200	2021/12/20	国債証券	676,000,000	113.48 114.97	767,139,970 777,190,440	4.92
9	日本	第321回 利付国債(10年)	1.000	2022/3/20	国債証券	736,000,000	103.70 104.47	763,248,050 768,891,840	4.86
10	日本	第125回 利付国債(20年)	2.200	2031/3/20	国債証券	553,000,000	108.89 114.69	602,146,160 634,252,290	4.01
11	日本	第97回 利付国債(5年)	0.400	2016/6/20	国債証券	619,000,000	101.11 101.03	625,867,110 625,350,940	3.96
12	日本	第279回 利付国債(10年)	2.000	2016/3/20	国債証券	551,000,000	105.98 105.73	583,924,750 582,544,750	3.68
13	日本	第123回 利付国債(20年)	2.100	2030/12/20	国債証券	445,000,000	107.54 113.23	478,559,510 503,882,400	3.19
14	日本	第305回 利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	国債証券	398,000,000	106.38 106.97	423,398,870 425,748,560	2.69
15	日本	第93回 利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	国債証券	398,000,000	101.28 101.19	403,093,110 402,748,140	2.55
16	日本	第312回 利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	国債証券	364,000,000	105.38 106.31	383,590,700 386,957,480	2.45
17	日本	第121回 利付国債(20年)	1.900	2030/9/20	国債証券	350,000,000	104.69 110.19	366,429,290 385,658,000	2.44
18	日本	第313回 利付国債(10年)	1.300	2021/3/20	国債証券	313,000,000	106.11 107.11	332,120,530 335,257,430	2.12
19	日本	第270回 利付国債(10年)	1.300	2015/6/20	国債証券	322,000,000	102.91 102.76	331,366,040 330,874,320	2.09
20	日本	第64回 利付国債(20年)	1.900	2023/9/20	国債証券	243,000,000	111.05 113.08	269,841,020 274,791,690	1.74
21	日本	第130回 利付国債(20年)	1.800	2031/9/20	国債証券	243,000,000	102.08 107.93	248,062,060 262,265,040	1.66
22	日本	第32回 利付国債(30年)	2.300	2040/3/20	国債証券	220,000,000	111.27 117.16	244,784,900 257,747,600	1.63
23	日本	第296回 利付国債(10年)	1.500	2018/9/20	国債証券	239,000,000	107.32 107.35	256,486,630 256,568,890	1.62

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	
24	日本	第273回 利付国債(10年)	1.500	2015/9/20	国債証券	243,000,000	103.70 103.55	251,987,920 251,624,070	1.59

25	日本	第105回 利付国債(5年)	0.200	2017/6/20	国債証券	221,000,000	100.36 100.36	221,801,740 221,786,760	1.40
26	日本	第302回 利付国債(10年)	1.400	2019/6/20	国債証券	184,000,000	107.04 107.37	196,944,530 197,557,120	1.25
27	日本	第91回 利付国債(5年)	0.400	2015/9/20	国債証券	175,000,000	100.91 100.84	176,592,760 176,466,500	1.12
28	日本	第303回 利付国債(10年)	1.400	2019/9/20	国債証券	163,000,000	107.04 107.49	174,471,860 175,210,330	1.11
29	日本	第272回 利付国債(10年)	1.400	2015/9/20	国債証券	162,000,000	103.48 103.30	167,635,980 167,349,240	1.06
30	日本	第69回 利付国債(20年)	2.100	2024/3/20	国債証券	139,000,000	114.02 115.31	158,485,890 160,283,680	1.01
投資比率：合計									95.80

(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(%)
国債証券	-	99.32
合計		99.32

(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		2,971,598,868	1.3113	3,896,722,740	1.3271	3,943,608,857	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	8,178	43,262	353,797,122	41,629	340,444,836	1.58
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	39,872	8,401	334,946,570	8,475	337,909,039	1.57
3	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	91,676	2,234	204,775,535	2,174	199,343,594	0.93
4	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	28,200	6,359	179,315,904	6,810	192,044,256	0.89
5	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	17,156	10,902	187,039,447	11,175	191,718,660	0.89
6	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・サービス	9,422	18,840	177,511,384	20,061	189,013,470	0.88
7	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	24,195	7,238	175,125,539	7,668	185,524,755	0.86

8	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	66,262	2,638	174,805,947	2,691	178,295,834	0.83
9	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	64,424	2,606	167,897,029	2,714	174,864,967	0.81
10	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	2,340	75,884	177,569,127	74,679	174,747,740	0.81
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	23,878	7,278	173,774,270	7,247	173,055,637	0.80
12	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	49,638	3,355	166,523,750	3,451	171,285,573	0.80
13	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	160,947	1,042	167,739,735	1,006	161,864,236	0.75
14	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	43,688	3,305	144,385,213	3,479	151,986,598	0.71
15	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	33,231	4,651	154,549,820	4,464	148,330,323	0.69
16	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	6,143	20,911	128,458,484	21,923	134,674,217	0.63
17	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	20,112	6,379	128,285,598	6,691	134,570,196	0.63
18	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	35,338	3,543	125,197,710	3,803	134,403,913	0.62
19	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	14,595	8,588	125,337,561	8,719	127,259,285	0.59
20	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	24,993	4,185	104,601,328	4,623	115,531,579	0.54
21	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	429,998	233	100,340,377	267	114,868,185	0.53
22	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	26,604	3,971	105,638,923	4,160	110,668,157	0.51
23	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	166,669	638	106,417,089	658	109,733,676	0.51
24	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	94,213	1,146	108,012,331	1,146	107,923,723	0.50
25	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	25,643	4,185	107,321,724	4,161	106,694,676	0.50
26	アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	14,614	6,467	94,506,955	7,038	102,849,846	0.48
27	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	33,657	3,329	112,056,606	3,042	102,370,357	0.48
28	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	13,473	7,101	95,668,741	7,440	100,243,101	0.47
29	フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10,413	8,946	93,155,666	9,570	99,655,191	0.46
30	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	32,135	3,072	98,725,584	3,048	97,943,508	0.46
									投資比率：合計	21.71

(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25年3月29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	10.38
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.15
	銀行	7.44
	資本財	7.05
	食品・飲料・タバコ	6.80
	ソフトウェア・サービス	6.03
	素材	5.98
	各種金融	4.86

保険	4.31
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.83
電気通信サービス	3.57
公益事業	3.36
小売	2.88
ヘルスケア機器・サービス	2.82
メディア	2.72
食品・生活必需品小売り	2.26
家庭用品・パーソナル用品	1.89
運輸	1.78
消費者サービス	1.64
半導体・半導体製造装置	1.38
耐久消費財・アパレル	1.37
自動車・自動車部品	1.32
商業・専門サービス	0.95
不動産	0.68
小計	93.45
投資証券	2.17
合計	95.62

(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25年3月29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		1,451,122,827	1.8274	2,651,910,097	1.8154	2,634,368,380	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	9,409	2,973,376,830	9,412	2,974,060,386	1.14
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2015/06/15	27,000,000	9,414	2,541,736,989	9,425	2,544,708,028	0.97
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2014/07/15	20,700,000	9,456	1,957,484,187	9,456	1,957,406,314	0.75
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	17,800,000	10,453	1,860,600,366	10,429	1,856,281,214	0.71
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	18,000,000	10,308	1,855,452,258	10,285	1,851,220,008	0.71

6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2015/06/30	18,300,000	9,745	1,783,367,729	9,741	1,782,558,805	0.68
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	16,500,000	10,199	1,682,767,993	10,169	1,677,910,781	0.64
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2014/05/15	17,000,000	9,494	1,614,023,086	9,491	1,613,399,535	0.62
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	14,000,000	11,059	1,548,254,862	11,080	1,551,243,771	0.59
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2014/04/30	16,000,000	9,592	1,534,655,232	9,577	1,532,247,552	0.59
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	14,000,000	10,537	1,475,217,513	10,521	1,472,952,789	0.56
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11.250	2015/02/15	12,900,000	11,441	1,475,888,277	11,337	1,462,433,390	0.56
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/10/31	15,000,000	9,741	1,461,113,775	9,723	1,458,475,672	0.56
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/08/31	15,000,000	9,709	1,456,317,225	9,692	1,453,791,982	0.56
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2041/02/15	11,400,000	12,326	1,405,218,165	12,491	1,423,981,140	0.54
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	12,800,000	10,902	1,395,515,404	10,931	1,399,187,116	0.53
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2017/02/15	12,600,000	10,872	1,369,823,578	10,879	1,370,747,901	0.52
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/05/15	14,500,000	9,287	1,346,569,339	9,432	1,367,666,165	0.52
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/09/30	14,000,000	9,726	1,361,599,470	9,708	1,359,189,909	0.52
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2019/03/31	14,000,000	9,588	1,342,309,815	9,681	1,355,279,310	0.52
21	イタリア	国債証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	3.750	2015/08/01	10,800,000	12,535	1,353,826,668	12,431	1,342,505,044	0.51
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.250	2017/03/31	12,900,000	10,384	1,339,592,334	10,405	1,342,249,340	0.51
23	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	3.500	2015/04/25	10,400,000	12,896	1,341,209,562	12,903	1,341,951,617	0.51
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/11/15	13,000,000	10,134	1,317,405,375	10,258	1,333,544,355	0.51
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2014/10/15	14,000,000	9,443	1,322,045,802	9,445	1,322,256,474	0.51
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2017/05/15	11,800,000	10,894	1,285,447,561	10,904	1,286,668,330	0.49
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2016/03/31	12,800,000	9,927	1,270,713,312	9,934	1,271,556,000	0.49
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2014/11/30	13,000,000	9,715	1,263,009,676	9,700	1,260,955,624	0.48
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2014/06/30	13,000,000	9,710	1,262,288,313	9,689	1,259,525,124	0.48
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2015/02/15	12,000,000	10,095	1,211,394,096	10,063	1,207,602,000	0.46
										投資比率：合計	17.74

(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25年3月29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		98.42
合計		98.42

(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25年3月29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 （2013年6月限）	買建	55	567,086,975	571,175,000	1.56

（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	62	4,797,655.32	4,844,370.00	455,612,998	2.12
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	30	790,448.05	766,200.00	92,503,326	0.43
	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	9	578,194.62	571,590.00	81,828,824	0.38
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	3	438,023.41	437,340.00	40,488,937	0.19
	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	5	384,420.00	384,600.00	38,152,320	0.18
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリ ア・ドル	3	379,650.00	372,525.00	36,481,373	0.17

（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25年3月29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
第10期	自平成24年2月22日 至平成25年2月21日	319,638,084	233,074,514	2,289,002,662

## 「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
第10期	自平成24年2月22日 至平成25年2月21日	877,467,094	622,057,085	7,014,605,407

## 「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
第10期	自平成24年2月22日 至平成25年2月21日	616,265,141	446,761,756	3,752,789,219

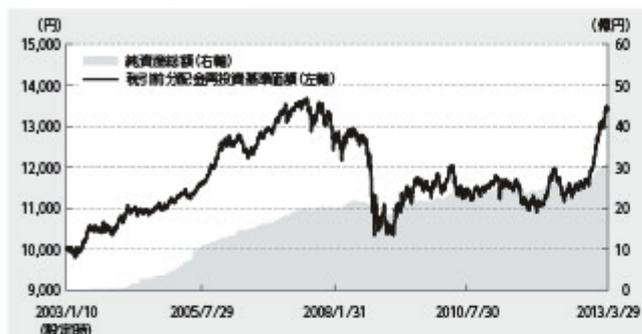
(注) 本邦外における販売又は解約の実績はありません。

〈参考情報〉

2013年3月末現在

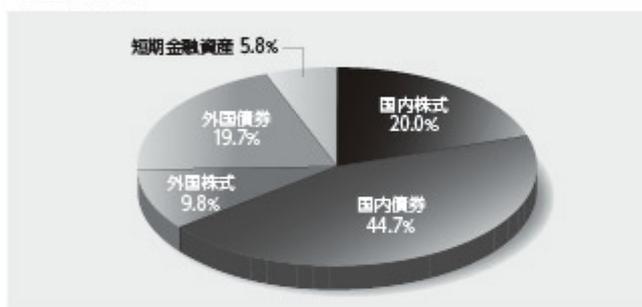
## DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

## ● 基準価額・純資産の推移



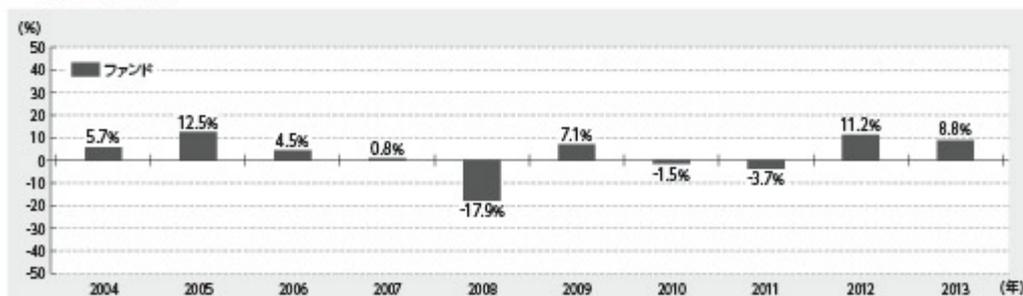
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ● 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。
- ・2013年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

## ● 基準価額および純資産総額

基準価額	13,412円
純資産総額	30億円

## ● 分配の推移 1万円当り(税引前)

期	日	金額
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
第10期	2013年2月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

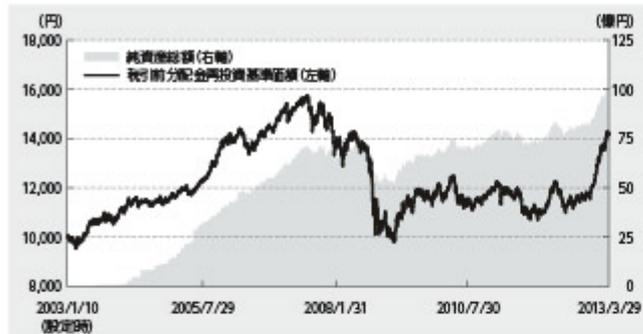
■ ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

■ 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。

2013年3月末現在

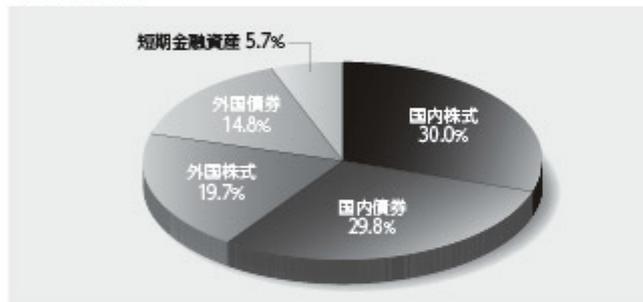
## DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

## ● 基準価額・純資産の推移



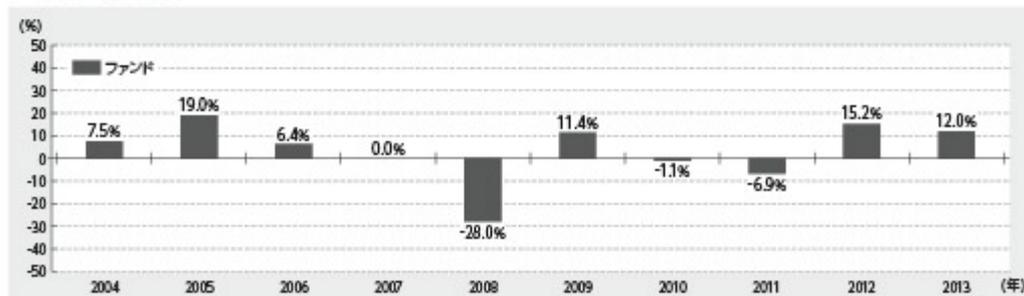
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ● 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。
- ・2013年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

## ● 基準価額および純資産総額

基準価額	14,167円
純資産総額	99億円

## ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

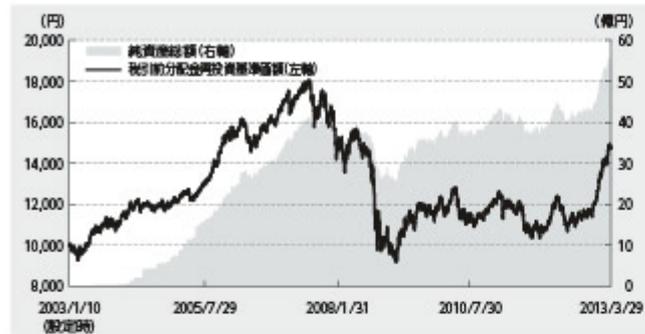
第6期	2009年2月23日	0円
第7期	2010年2月22日	0円
第8期	2011年2月21日	0円
第9期	2012年2月21日	0円
第10期	2013年2月21日	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

- 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。

2013年3月末現在

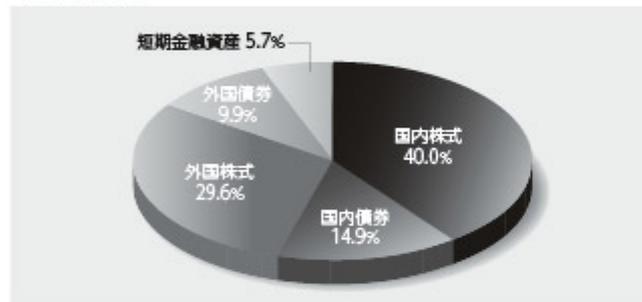
## DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

## ● 基準価額・純資産の推移



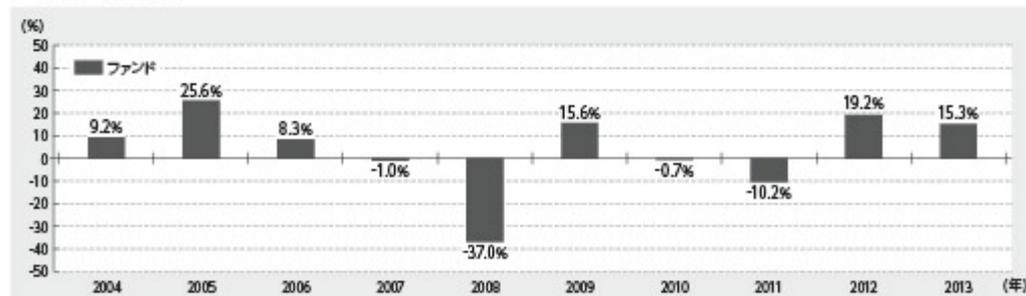
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ● 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。
- ・2013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	14,741円
純資産総額	55億円

## ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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
第10期	2013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）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金額をいいます。

ファンド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10期計算期間（平成24年2月22日から平成25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9期 （平成24年2月21日現在）	第10期 （平成25年2月21日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	91,311,554	115,094,016
投資信託受益証券	2,440,617,617	2,850,372,550
未収入金	36,000,000	44,000,000
流動資産合計	2,567,929,171	3,009,466,566
<b>資産合計</b>		
	2,567,929,171	3,009,466,566
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,229,053	5,595,724
未払受託者報酬	382,559	435,993
未払委託者報酬	1,084,018	1,235,410
その他未払費用	443,308	461,967
流動負債合計	5,138,938	7,729,094
<b>負債合計</b>		
	5,138,938	7,729,094
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,202,439,092	2,289,002,662
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	360,351,141	712,734,810
<b>純資産合計</b>	2,562,790,233	3,001,737,472
<b>負債純資産合計</b>	2,567,929,171	3,009,466,566

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）
営業収益		
受取配当金	33,468,208	22,934,129
受取利息	62,942	77,298
有価証券売買等損益	60,919,001	321,820,804
営業収益合計	27,387,851	344,832,231
営業費用		
受託者報酬	764,794	840,338
委託者報酬	2,167,131	2,381,102
その他費用	884,776	909,950
営業費用合計	3,816,701	4,131,390
営業利益又は営業損失（ ）	31,204,552	340,700,841
経常利益又は経常損失（ ）	31,204,552	340,700,841
当期純利益又は当期純損失（ ）	31,204,552	340,700,841
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（ ）	10,104,831	7,167,563
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	376,950,511	360,351,141
剰余金増加額又は欠損金減少額	53,829,623	57,005,705
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	53,829,623	57,005,705
剰余金減少額又は欠損金増加額	49,329,272	38,155,314
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	49,329,272	38,155,314
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（ ）	360,351,141	712,734,810

## (3) 【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、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 (自平成24年2月22日 至平成25年2月21日)
第10期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。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 (平成24年2月21日現在)	第10期 (平成25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	2,202,439,092口	2,289,002,662口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1636円 (11,636円)	1.3114円 (13,114円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25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(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。	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(22,728,623円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(128,452,719円)、収益調整金(501,028,472円)、及び分配準備積立金(137,628,632円)より、分配対象収益は789,838,446円(1口当たり0.345058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9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25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 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>
---	---

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期 (平成24年2月21日現在)	第10期 (平成25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。	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．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 (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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（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9期 （平成24年2月21日現在）	第10期 （平成25年2月21日現在）
期首元本額	2,091,782,212円	2,202,439,092円
期中追加設定元本額	387,759,923円	319,638,084円
期中一部解約元本額	277,103,043円	233,074,514円

2 有価証券関係

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

第10期（平成25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	295,853,403
合計	295,853,403

3 デリバティブ取引関係

第9期（平成24年2月21日現在）

該当事項はありません。

第10期（平成25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)	569,732,407	604,770,950	
	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)	1,140,309,416	1,344,652,863	
	ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	256,322,983	301,487,092	
	ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	430,400,377	599,461,645	
合計		2,396,765,183	2,850,372,550	

## 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9期 (平成24年2月21日現在)	第10期 (平成25年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	284,271,757	365,207,233
投資信託受益証券	7,584,157,806	9,171,690,262
未収入金	104,000,000	134,000,000
流動資産合計	7,972,429,563	9,670,897,495
資産合計	7,972,429,563	9,670,897,495
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,207,984	4,745,843
未払受託者報酬	1,165,555	1,358,873
未払委託者報酬	3,302,516	3,850,280
その他未払費用	654,178	693,973
流動負債合計	9,330,233	10,648,969
負債合計	9,330,233	10,648,969
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,759,195,398	7,014,605,407
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,203,903,932	2,645,643,119
純資産合計	7,963,099,330	9,660,248,526
負債純資産合計	7,972,429,563	9,670,897,495

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）
<b>営業収益</b>		
受取配当金	78,614,360	78,233,419
受取利息	192,687	238,086
有価証券売買等損益	373,919,619	1,336,299,038
<b>営業収益合計</b>	<b>295,112,572</b>	<b>1,414,770,543</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	2,371,478	2,611,464
委託者報酬	6,719,401	7,399,385
その他費用	1,314,128	1,362,113
<b>営業費用合計</b>	<b>10,405,007</b>	<b>11,372,962</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>305,517,579</b>	<b>1,403,397,581</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>305,517,579</b>	<b>1,403,397,581</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>305,517,579</b>	<b>1,403,397,581</b>
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（ ）	56,835,046	19,196,602
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>1,467,180,757</b>	<b>1,203,903,932</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	163,923,077	168,017,189
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	163,923,077	168,017,189
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>178,517,369</b>	<b>110,478,981</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	178,517,369	110,478,981
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	-	-
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>1,203,903,932</b>	<b>2,645,643,119</b>

## (3) 【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、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 (自平成24年2月22日 至平成25年2月21日)
第10期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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 (平成24年2月21日現在)	第10期 (平成25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	6,759,195,398口	7,014,605,407口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1781円 (11,781円)	1.3772円 (13,772円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25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(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。	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(77,829,088円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(230,326,708円)、収益調整金(2,174,990,040円)、及び分配準備積立金(630,624,822円)より、分配対象収益は3,113,770,658円(1口当たり0.443898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9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25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 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>
---	---

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期 (平成24年2月21日現在)	第10期 (平成25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。	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．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 (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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（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9期 （平成24年2月21日現在）	第10期 （平成25年2月21日現在）
期首元本額	6,459,025,690円	6,759,195,398円
期中追加設定元本額	1,099,851,674円	877,467,094円
期中一部解約元本額	799,681,966円	622,057,085円

2 有価証券関係

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

第10期（平成25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	1,255,435,630
合計	1,255,435,630

3 デリバティブ取引関係

第9期（平成24年2月21日現在）

該当事項はありません。

第10期（平成25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)	2,747,060,889	2,916,005,133	
	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)	2,443,650,579	2,881,552,762	
	ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	1,643,735,934	1,933,362,205	
	ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	1,034,441,530	1,440,770,162	
合計		7,868,888,932	9,171,690,262	

## 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9期 (平成24年2月21日現在)	第10期 (平成25年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	161,553,186	227,770,297
投資信託受益証券	4,014,381,342	5,070,699,379
未収入金	50,000,000	61,000,000
流動資産合計	4,225,934,528	5,359,469,676
資産合計	4,225,934,528	5,359,469,676
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,509,277	9,139,536
未払受託者報酬	604,866	720,365
未払委託者報酬	1,713,883	2,041,138
その他未払費用	517,411	556,093
流動負債合計	8,345,437	12,457,132
負債合計	8,345,437	12,457,132
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,583,285,834	3,752,789,219
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	634,303,257	1,594,223,325
純資産合計	4,217,589,091	5,347,012,544
負債純資産合計	4,225,934,528	5,359,469,676

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取配当金	28,083,004	45,765,535
受取利息	101,674	127,514
有価証券売買等損益	303,622,962	884,552,502
<b>営業収益合計</b>	<b>275,438,284</b>	<b>930,445,551</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,243,781	1,378,652
委託者報酬	3,524,210	3,906,373
その他費用	1,044,436	1,088,723
<b>営業費用合計</b>	<b>5,812,427</b>	<b>6,373,748</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>281,250,711</b>	<b>924,071,803</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>281,250,711</b>	<b>924,071,803</b>
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>281,250,711</b>	<b>924,071,803</b>
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( )	52,932,663	14,001,684
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>899,871,874</b>	<b>634,303,257</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	92,573,879	128,778,629
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	92,573,879	128,778,629
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>129,824,448</b>	<b>78,928,680</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	129,824,448	78,928,680
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	-	-
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>634,303,257</b>	<b>1,594,223,325</b>

## (3) 【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、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 (自平成24年2月22日 至平成25年2月21日)
第10期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。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 (平成24年2月21日現在)	第10期 (平成25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	3,583,285,834口	3,752,789,219口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1770円 (11,770円)	1.4248円 (14,248円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25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(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。	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(45,572,242円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(140,205,751円)、収益調整金(1,660,501,035円)、及び分配準備積立金(306,025,799円)より、分配対象収益は2,152,304,827円(1口当たり0.573521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9期 (自平成23年2月22日 至平成24年2月21日)	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25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 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>
---	---

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期 (平成24年2月21日現在)	第10期 (平成25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。	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．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 (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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 （自平成23年2月22日 至平成24年2月21日）	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（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9期 （平成24年2月21日現在）	第10期 （平成25年2月21日現在）
期首元本額	3,444,082,212円	3,583,285,834円
期中追加設定元本額	647,867,405円	616,265,141円
期中一部解約元本額	508,663,783円	446,761,756円

2 有価証券関係

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

第10期（平成25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	855,270,647
合計	855,270,647

3 デリバティブ取引関係

第9期（平成24年2月21日現在）

該当事項はありません。

第10期（平成25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）	2,023,072,490	2,147,491,448	
	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）	674,531,669	795,407,744	
	ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	1,358,997,723	1,598,453,121	
	ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	380,059,640	529,347,066	
合計		4,436,661,522	5,070,699,379	

## 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。

## &lt; 参考 &gt;

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、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24年2月20日現在 )	( 平成25年2月20日現在 )
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,198,007	25,126,420
親投資信託受益証券	17,567,591,828	20,209,053,694
未収入金	29,756,390	22,001,453
流動資産合計	17,620,546,225	20,256,181,567
資産合計	17,620,546,225	20,256,181,567
負債の部		
流動負債		
未払解約金	29,440,490	21,278,411
未払受託者報酬	5,248,245	5,696,384
未払委託者報酬	18,368,947	19,937,441
その他未払費用	357,716	373,683
流動負債合計	53,415,398	47,285,919
負債合計	53,415,398	47,285,919
純資産の部		
元本等		
元本	20,073,176,698	19,037,600,218
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	2,506,045,871	1,171,295,430
純資産合計	17,567,130,827	20,208,895,648
負債純資産合計	17,620,546,225	20,256,181,567

## ( 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2月20日現在 )	( 平成25年2月20日現在 )
1. 計算日における受益権総数	20,073,176,698口	19,037,600,218口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	2,506,045,871円	- 円
3. 1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	0.8752円 ( 8,752円 )	1.0615円 ( 10,615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23年3月11日 至平成24年2月20日 )	( 自平成24年3月13日 至平成25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 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>
--	--

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年2月20日現在）	（平成25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。	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．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 （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>

(関連当事者との取引に関する注記)

（自平成23年3月11日 至平成24年2月20日）	（自平成24年3月13日 至平成25年2月20日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（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24年2月20日現在）	（平成25年2月20日現在）
期首	平成23年3月11日	平成24年3月13日
期首元本額	20,488,170,086円	19,832,219,388円
期首から計算日までの追加設定元本額	2,135,649,603円	1,471,429,748円
期首から計算日までの一部解約元本額	2,550,642,991円	2,266,048,918円

2 有価証券関係

（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。

（平成25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	3,161,424,555
合計	3,161,424,555

（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24年3月13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24年2月20日現在）

該当事項はありません。

（平成25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	22,357,621,080	20,209,053,694	

合計	22,357,621,080	20,209,053,694	
----	----------------	----------------	--

## 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24年2月20日現在)	(平成25年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	228,695,144	355,030,995
株式	28,502,185,220	34,441,711,410
派生商品評価勘定	10,246,530	3,960,035
未収入金	335,046,440	226,853,598
未収配当金	30,808,593	39,226,802
差入委託証拠金	12,285,000	11,100,000
流動資産合計	29,119,266,927	35,077,882,840
資産合計	29,119,266,927	35,077,882,840
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	21,890
前受金	22,205,000	480,000
未払金	14,612,910	22,841,342
未払解約金	47,283,538	47,471,237

流動負債合計	84,101,448	70,814,469
負債合計	84,101,448	70,814,469
純資産の部		
元本等		
元本	39,093,719,161	38,727,108,836
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,058,553,682	3,720,040,465
純資産合計	29,035,165,479	35,007,068,371
負債純資産合計	29,119,266,927	35,077,882,840

## (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2月20日現在)	(平成25年2月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	39,093,719,161口	38,727,108,836口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損	10,058,553,682円	3,720,040,465円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7427円 (7,427円)	0.9039円 (9,039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23年3月11日 至平成24年2月20日)	(自平成24年3月13日 至平成25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>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>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>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>
--	--

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年2月20日現在)	(平成25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。	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。

<p>2. 時価の算定方法</p>	<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 （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>
-------------------	--	--

## （関連当事者との取引に関する注記）

（自平成23年3月11日 至平成24年2月20日）	（自平成24年3月13日 至平成25年2月20日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （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2月20日現在）	（平成25年2月20日現在）
期首	平成23年3月11日	平成24年3月13日
同期間の期首元本額	38,879,765,123円	38,559,318,270円
同期間中の追加設定元本額	5,286,578,890円	7,338,694,346円
同期間中の一部解約元本額	5,072,624,852円	7,170,903,780円
同期間末日の元本額	39,093,719,161円	38,727,108,836円
上記元本額の内訳		
ニッセイTOPIXオープン	10,699,762,197円	12,574,994,209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）	23,653,684,972円	22,357,621,080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）	188,809,005円	136,305,850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）	309,578,192円	237,305,200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）	364,167,872円	293,988,947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）	2,332,842,758円	1,638,573,542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）	1,544,874,165円	1,488,320,008円
合計	39,093,719,161円	38,727,108,836円

## 2 有価証券関係

(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。

(平成25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	5,711,894,485
合計	5,711,894,485

(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。

## 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。

(平成25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	375,336,855	-	379,275,000	3,938,145
合計		375,336,855	-	379,275,000	3,938,145

(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。

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ではありません。

## 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24年2月20日現在）	（平成25年2月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,102,347	5,865,483
親投資信託受益証券	5,341,349,965	6,357,246,321
未収入金	315,985	930,514
流動資産合計	5,346,768,297	6,364,042,318
資産合計	5,346,768,297	6,364,042,318
負債の部		
流動負債		
未払解約金	248,748	770,624
未払受託者報酬	719,131	830,476
未払委託者報酬	4,314,928	4,983,015
その他未払費用	233,483	247,094
流動負債合計	5,516,290	6,831,209
負債合計	5,516,290	6,831,209
純資産の部		
元本等		
元本	4,601,225,445	5,391,340,527
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	740,026,562	965,870,582
純資産合計	5,341,252,007	6,357,211,109
負債純資産合計	5,346,768,297	6,364,042,318

### （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2月20日現在）	（平成25年2月20日現在）
1. 計算日における受益権総数	4,601,225,445口	5,391,340,527口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1608円 （11,608円）	1.1792円 （11,792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23年3月11日 至平成24年2月20日）	（自平成24年3月13日 至平成25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 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>
--	--

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年2月20日現在)	(平成25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。	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. 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 (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>

(関連当事者との取引に関する注記)

（自平成23年3月11日 至平成24年2月20日）	（自平成24年3月13日 至平成25年2月20日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（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24年2月20日現在）	（平成25年2月20日現在）
期首	平成23年3月11日	平成24年3月13日
期首元本額	4,725,602,670円	4,816,466,324円
期首から計算日までの追加設定元本額	813,837,618円	1,117,245,066円
期首から計算日までの一部解約元本額	938,214,843円	542,370,863円

2 有価証券関係

（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。

（平成25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	97,514,630
合計	97,514,630

（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24年3月13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24年2月20日現在）

該当事項はありません。

（平成25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	5,192,556,009	6,357,246,321	

合計	5,192,556,009	6,357,246,321	
----	---------------	---------------	--

## 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24年2月20日現在)	(平成25年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	88,089,239	23,137,083
国債証券	13,816,162,110	15,143,967,660
未収利息	47,605,141	56,775,745
前払費用	12,599,965	9,758,899
流動資産合計	13,964,456,455	15,233,639,387
資産合計	13,964,456,455	15,233,639,387
負債の部		
流動負債		
未払金	142,134,860	-
未払解約金	5,566,050	9,664,972
流動負債合計	147,700,910	9,664,972
負債合計	147,700,910	9,664,972
純資産の部		
元本等		

元本	11,490,153,246	12,434,607,409
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2,326,602,299	2,789,367,006
純資産合計	13,816,755,545	15,223,974,415
負債純資産合計	13,964,456,455	15,233,639,387

## (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2月20日現在)	(平成25年2月20日現在)
1. 計算日における受益権総数	11,490,153,246口	12,434,607,409口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2025円 (12,025円)	1.2243円 (12,243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23年3月11日 至平成24年2月20日)	(自平成24年3月13日 至平成25年2月20日)
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>
(自平成23年3月11日 至平成24年2月20日)	(自平成24年3月13日 至平成25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 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>
---	---

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年2月20日現在）	（平成25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。	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>	<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>

## （関連当事者との取引に関する注記）

（自平成23年3月11日 至平成24年2月20日）	（自平成24年3月13日 至平成25年2月20日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （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2月20日現在）	（平成25年2月20日現在）
期首 同期間の期首元本額	平成23年3月11日 25,950,746,670円	平成24年3月13日 11,868,611,143円

同期間中の追加設定元本額	2,108,336,839円	2,665,623,717円
同期間中の一部解約元本額	16,568,930,263円	2,099,627,451円
同期間末日の元本額	11,490,153,246円	12,434,607,409円
上記元本額の内訳		
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)	4,441,871,073円	5,192,556,009円
DCニッセイ国内債券インデックス	4,229,699,124円	4,658,637,961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)	109,658,367円	94,666,176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)	96,843,352円	88,744,231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)	574,256,918円	549,823,727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)	1,559,383,894円	1,301,942,454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)	478,440,518円	548,236,851円
合計	11,490,153,246円	12,434,607,409円

## 2 有価証券関係

(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。

(平成25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	10,781,460
合計	10,781,460

(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。

## 3 デリバティブ取引関係

(平成24年2月20日現在)

該当事項はありません。

(平成25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12期	第13期
		(平成24年 2月20日現在)	(平成25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		4,661,941	5,601,841
親投資信託受益証券		3,202,357,307	3,904,423,385
未収利息		8	10
流動資産合計		3,207,019,256	3,910,025,236
資産合計		3,207,019,256	3,910,025,236
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金			74,887,855
未払受託者報酬		913,420	1,083,866
未払委託者報酬		3,653,588	4,335,383
流動負債合計		4,567,008	80,307,104
負債合計		4,567,008	80,307,104
純資産の部			
元本等			
元本	1	3,581,648,757	3,255,993,731
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )	3	379,196,509	573,724,401
(分配準備積立金)		(359,791,619)	(1,040,184,133)
元本等合計		3,202,452,248	3,829,718,132
純資産合計		3,202,452,248	3,829,718,132
負債純資産合計		3,207,019,256	3,910,025,236

#### (2) 損益及び剰余金計算書 (単位：円)

区 分	注記 番号	第12期	第13期
		自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日	自平成24年 2月21日 至平成25年 2月20日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		1,477	1,555
有価証券売買等損益		153,025,866	1,056,496,078
営業収益合計		153,024,389	1,056,497,633
営業費用			
受託者報酬		1,854,262	2,068,808
委託者報酬		7,416,928	8,275,101
営業費用合計		9,271,190	10,343,909
営業利益又は営業損失( )		162,295,579	1,046,153,724
経常利益又は経常損失( )		162,295,579	1,046,153,724
当期純利益又は当期純損失( )		162,295,579	1,046,153,724
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( )		82,006,348	58,719,054
期首剰余金又は期首欠損金( )		147,326,993	379,196,509
剰余金増加額又は欠損金減少額		57,772,058	81,573,009

当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		57,772,058	81,573,009
剰余金減少額又は欠損金増加額		209,352,343	41,198,914
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		209,352,343	41,198,914
分配金	1		74,887,855
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		379,196,509	573,724,401

## (3) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第12期 (平成24年 2月20日現在)	第13期 (平成25年 2月20日現在)
1 期首元本額	3,292,074,800円	3,581,648,757円
期中追加設定元本額	1,166,352,356円	434,198,923円
期中一部解約元本額	876,778,399円	759,853,949円
2 受益権の総数	3,581,648,757口	3,255,993,731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12期 自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日	第13期 自 平成24年 2月21日 至 平成25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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（77,495,082円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（747,889,711円）、収益調整金（3,086,714,022円）及び分配準備積立金（289,687,195円）より分配対象収益は4,201,786,010円（1万口当たり12,904円）であり、うち74,887,855円（1万口当たり230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

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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第12期 (平成24年 2月20日現在)	第13期 (平成25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12期 (平成24年 2月20日現在)	第13期 (平成25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	69,609,326	997,975,615

合計	69,609,326	997,975,615
----	------------	-------------

## (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。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第12期 自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日	第13期 自 平成24年 2月21日 至 平成25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12期 (平成24年 2月20日現在)	第13期 (平成25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)	0.8941 円 (8,941 円)	1.1762 円 (11,762 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	2,975,478,879	3,904,423,385	
合計		2,975,478,879	3,904,423,385	

## 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24年 2月20日現在)	(平成25年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		574,542,058	495,781,684
コール・ローン		5,436,767	3,480,042

株式		36,683,950,027	25,747,859,930
投資証券		724,477,878	599,993,579
派生商品評価勘定		63,017,328	32,133,447
未収入金		261,883	112,256
未収配当金		52,519,090	37,129,928
未収利息		10	6
差入委託証拠金		238,679,232	311,371,776
流動資産合計		38,342,884,273	27,227,862,648
資産合計		38,342,884,273	27,227,862,648
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		50,969	669,321
流動負債合計		50,969	669,321
負債合計		50,969	669,321
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,314,181,997	20,749,220,275
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	3	971,348,693	6,477,973,052
元本等合計		38,342,833,304	27,227,193,327
純資産合計		38,342,833,304	27,227,193,327
負債純資産合計		38,342,884,273	27,227,862,648

## (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、投資証券、新株予約権証券 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最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 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。  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。
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。

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 2月20日現在）	（平成25年 2月20日現在）
1 期首元本額	21,138,250,567円	39,314,181,997円
期中追加設定元本額	20,630,302,882円	10,358,934,558円
期中一部解約元本額	2,454,371,452円	28,923,896,280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	3,283,458,738円	2,975,478,879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	1,649,887,423円	1,129,176,273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＞	5,264,438,574円	4,067,372,759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＞	15,293,930,089円	299,329,518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＞	3,544,395,681円	1,983,000,607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＞	601,109,006円	585,436,007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＞	9,676,962,486円	9,709,426,232円
計	39,314,181,997円	20,749,220,275円
2 受益権の総数	39,314,181,997口	20,749,220,275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

--	--

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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	(平成24年 2月20日現在)	(平成25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。	(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）

種 類	（平成24年 2月20日現在）		（平成25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	40,630,921		2,789,297,547	
投資証券	23,120,647		71,559,820	
合計	17,510,274		2,860,857,367	

（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

（単位：円）

区分	種 類	（平成25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	451,687,288	472,372,031	20,684,743
	S&P 60	40,022,544	40,802,113	779,569
	SPI 200	45,726,728	49,046,579	3,319,851
	FTSE100INDEX	87,630,308	91,995,387	4,365,079
	FSMI INDEX	35,833,477	38,170,429	2,336,952
	EURO STOXX 50	103,842,636	103,822,270	20,366
	合 計	764,742,981	796,208,809	31,465,828

## (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。

## 通貨関連

(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

(単位：円)

区分	種 類	(平成25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	48,000,000		47,999,692	308
	カナダ・ドル	3,300,000		3,300,210	210
	オーストラリア・ドル	7,000,000		7,000,722	722
	イギリス・ポンド	8,600,000		8,600,523	523
	スイス・フラン	2,034,064		2,034,400	336
	シンガポール・ドル	9,000,000		9,000,177	177
	ユーロ	4,900,000		4,900,042	42
	合 計	82,834,064		82,835,766	1,702

## (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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25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24年 2月20日現在)	(平成25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)	0.9753 円 (9,753 円)	1.3122 円 (13,122 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11期 (平成24年 2月20日現在)	第12期 (平成25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		2,644,835	3,207,967
親投資信託受益証券		2,147,788,063	2,508,203,701
未収入金			72,313,000
未収利息		5	6
流動資産合計		2,150,432,903	2,583,724,674
資産合計		2,150,432,903	2,583,724,674
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		71,209,825	72,045,227
未払受託者報酬		413,300	490,728
未払委託者報酬		2,169,750	2,576,290
流動負債合計		73,792,875	75,112,245
負債合計		73,792,875	75,112,245
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,780,245,645	1,801,130,698
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		296,394,383	707,481,731
(分配準備積立金)		(125,521,103)	(160,677,857)

元本等合計		2,076,640,028	2,508,612,429
純資産合計		2,076,640,028	2,508,612,429
負債純資産合計		2,150,432,903	2,583,724,674

## (2) 損益及び剰余金計算書 (単位:円)

区 分	注記 番号	第11期	第12期
		自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月20日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		815	1,159
有価証券売買等損益		55,472,013	494,667,800
営業収益合計		55,472,828	494,668,959
営業費用			
受託者報酬		842,585	937,805
委託者報酬		4,423,445	4,923,375
営業費用合計		5,266,030	5,861,180
営業利益		50,206,798	488,807,779
経常利益		50,206,798	488,807,779
当期純利益		50,206,798	488,807,779
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( )		2,550,639	12,777,607
期首剰余金又は期首欠損金( )		305,793,633	296,394,383
剰余金増加額又は欠損金減少額		87,328,789	42,459,081
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		87,328,789	42,459,081
剰余金減少額又は欠損金増加額		78,275,651	35,356,678
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		78,275,651	35,356,678
分配金	1	71,209,825	72,045,227
期末剰余金又は期末欠損金( )		296,394,383	707,481,731

## (3) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第11期 (平成24年 2月20日現在)	第12期 (平成25年 2月20日現在)
1 期首元本額	1,723,893,652円	1,780,245,645円
期中追加設定元本額	498,626,974円	233,750,758円
期中一部解約元本額	442,274,981円	212,865,705円
2 受益権の総数	1,780,245,645口	1,801,130,698口

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

区分	第11期		第12期	
	自 平成23年 2月22日	至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日	至 平成25年 2月20日
1 分配金の計算過程	<p>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。</p>		<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（72,180,140円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（48,693,843円）、収益調整金（948,850,669円）及び分配準備積立金（111,849,101円）より分配対象収益は1,181,573,753円（1万口当たり6,560円）であり、うち72,045,227円（1万口当たり400円）を分配金額としております。</p>	

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の状況に関する事項

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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第11期	第12期
	(平成24年 2月20日現在)	(平成25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	<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）」に記載していません。</p> <p>(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。</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          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	第11期 (平成24年 2月20日現在)	第12期 (平成25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	58,793,069	471,128,514
合計	58,793,069	471,128,514

## (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。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第11期 自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日	第12期 自 平成24年 2月21日 至 平成25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24年 2月20日現在)	第12期 (平成25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)	1.1665 円 (11,665 円)	1.3928 円 (13,928 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	1,371,952,577	2,508,203,701	
合計		1,371,952,577	2,508,203,701	

(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24年 2月20日現在)	(平成25年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		1,009,803,843	701,928,131
コール・ローン		37,141,432	143,563,258
国債証券		234,868,184,150	266,617,400,849
派生商品評価勘定		2,408	144,000
未収利息		2,446,752,806	2,741,858,042
前払費用		160,457,627	102,468,302
流動資産合計		238,522,342,266	270,307,362,582
資産合計		238,522,342,266	270,307,362,582
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		75,518	276,000
未払解約金		16,818,650	130,382,671
流動負債合計		16,894,168	130,658,671
負債合計		16,894,168	130,658,671
純資産の部			
元本等			
元本	1	160,685,006,426	147,784,834,580
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		77,820,441,672	122,391,869,331
元本等合計		238,505,448,098	270,176,703,911
純資産合計		238,505,448,098	270,176,703,911
負債純資産合計		238,522,342,266	270,307,362,582

## (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	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。
-------------------	---

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。
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。

## （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 2月20日現在）	（平成25年 2月20日現在）
1 期首元本額	176,531,085,978円	160,685,006,426円
期中追加設定元本額	22,672,756,691円	17,900,351,139円
期中一部解約元本額	38,518,836,243円	30,800,522,985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	4,550,747,616円	4,918,104,048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	5,332,917円	10,176,260円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	1,447,004,018円	1,371,952,577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	1,704,498,028円	571,784,038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＞	2,570,984,105円	2,298,519,783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＞	32,434,302,825円	28,879,157,950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＞	137,929,331円	120,731,241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＞	11,765,953,779円	10,808,460,869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＞	9,809,398円	9,079,034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＞	98,104,583円	86,416,104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＞	17,372,327円	16,729,899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＞	18,585,620,597円	16,731,918,917円

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	3,030,451,634円	2,208,374,689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>	89,276,768円	83,182,285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>	11,988,462,014円	10,527,654,777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>	3,155,701,840円	2,791,048,227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>	101,533,566円	94,022,850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>	3,401,251,018円	2,678,495,259円
ステート・ストリート4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	9,278,930,630円	8,005,191,856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>	3,357,009,671円	2,870,669,073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>	9,361,424,898円	7,930,077,074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>	1,589,243,927円	1,413,103,309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>	2,337,992,314円	2,098,880,379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>	3,992,101,285円	4,223,855,236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>	205,761,170円	181,125,218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>	208,700,443円	167,589,753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>	159,594,930円	139,047,259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>	148,297,687円	192,862,828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>	182,627,285円	150,398,351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>	1,675,657,093円	1,373,741,525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>	17,502,816円	15,325,751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>	12,717,034円	11,579,325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>	102,937円	98,775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>	24,239,721,842円	27,689,823,908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>	473,406,631円	171,591,620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>	2,598,871,771円	2,220,221,148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>	4,606,947,816円	3,721,708,542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>	1,088,356,066円	904,970,171円

ステート・ストリート4資産インデックス スバランスVA30<適格機関投資家限定>	191,687円	円
ステート・ストリート4資産インデックス スバランスVA40<適格機関投資家限定>	163,287円	円
ステート・ストリート4資産インデックス スバランスVA50<適格機関投資家限定>	140,853円	4,704,944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>	55,205,989円	92,459,728円
計	160,685,006,426円	147,784,834,580円
2 受益権の総数	160,685,006,426口	147,784,834,580口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	(平成24年 2月20日現在)	(平成25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）」に記載しております。	(2)有価証券 売買目的有価証券 同左
		(3)デリバティブ取引 「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)デリバティブ取引 同左
		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
		「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)

売買目的有価証券（単位：円）

種類	(平成24年 2月20日現在)	(平成25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
国債証券	11,462,935,460	2,533,199,096
合計	11,462,935,460	2,533,199,096

(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

(単位：円)

区分	種類	(平成25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	159,383,000	159,239,000	144,000
	オーストラリア・ドル	9,681,000	9,692,000	11,000
	ユーロ	62,565,000	62,830,000	265,000
	合 計	231,629,000	231,761,000	132,000

## (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。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成23年 2月22日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25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24年 2月20日現在)	(平成25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)	1.4843 円 (14,843 円)	1.8282 円 (18,282 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25年3月29日現在)

資産総額	3,083,768,914 円
負債総額	1,503,711 円
純資産総額( - )	3,082,265,203 円
発行済数量	2,298,119,635 口
1万口当たり純資産額( / ×10000)	13,412 円

## DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

(平成25年3月29日現在)

資産総額	9,983,670,838 円
負債総額	6,980,920 円
純資産総額( - )	9,976,689,918 円
発行済数量	7,042,112,121 口
1万口当たり純資産額( / ×10000)	14,167 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25年3月29日現在)

資産総額	5,513,402,089 円
負債総額	5,832,849 円
純資産総額( - )	5,507,569,240 円
発行済数量	3,736,301,690 口
1万口当たり純資産額( / ×10000)	14,741 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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （1）資本金の額

平成25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25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	186	21,494
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	13	1,724
単位型公社債投資信託	0	0
合計	199	23,218

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17期事業年度（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。

また、第18期事業年度に係る中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。



## ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
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
<b>負債の部</b>				
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 (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)
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
其他人件費		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 (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)
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おりません。

## 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) 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 其他有価証券」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	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 其他(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	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの 其他(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		法定実効税率 40.00%
負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5		(調整)
以下であるため注記を省略しております。		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。

[次へ](#)

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第18期中間会計期間末  
(平成24年9月30日現在)

## 資産の部

## 流動資産

現金・預金		861,189
有価証券		7,213,238
前払費用		580,968
未収委託者報酬		1,413,920
未収運用受託報酬		974,209
未収投資助言報酬		153,445
繰延税金資産		193,172

その他		41,624
-----	--	--------

流動資産合計		11,431,768
--------	--	------------

## 固定資産

有形固定資産	1	262,947
--------	---	---------

無形固定資産		1,227,694
--------	--	-----------

## 投資その他の資産

投資有価証券		26,318,839
--------	--	------------

繰延税金資産		545,994
--------	--	---------

その他		283,609
-----	--	---------

投資その他の資産合計		27,148,443
------------	--	------------

固定資産合計		28,639,084
--------	--	------------

資産合計		40,070,853
------	--	------------

## 負債の部

## 流動負債

未払手数料		548,329
-------	--	---------

未払運用委託報酬		430,444
----------	--	---------

未払投資助言報酬		140,037
----------	--	---------

その他未払金		179,488
--------	--	---------

未払費用		99,347
------	--	--------

未払法人税等		129,746
--------	--	---------

前受投資助言報酬		70,261
----------	--	--------

賞与引当金		372,279
-------	--	---------

その他		219,373
-----	--	---------

流動負債合計		2,189,308
--------	--	-----------

## 固定負債

退職給付引当金		821,839
---------	--	---------

役員退職慰労引当金		9,100
-----------	--	-------

固定負債合計		830,939
--------	--	---------

負債合計		3,020,247
------	--	-----------

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	18,001,445
利益剰余金合計	18,681,252
株主資本合計	36,963,092
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	87,512
評価・換算差額等合計	87,512
純資産合計	37,050,605
負債・純資産合計	40,070,853

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第18期中間会計期間

(自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		4,485,618
運用受託報酬		2,469,602
投資助言報酬		338,891
業務受託料		23,614
営業収益計		7,317,725
営業費用		3,610,733
一般管理費	1	3,250,777
営業利益		456,214
営業外収益	2	88,157
営業外費用	3	15,890
経常利益		528,480
特別利益	4	107,408
特別損失	5	120,776
税引前中間純利益		515,112
法人税、住民税及び事業税		120,655
法人税等調整額		91,382
法人税等合計		212,037
中間純利益		303,074

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第18期中間会計期間

(自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	17,833,930	
当中間期変動額		
剰余金の配当	135,560	
中間純利益	303,074	
当中間期変動額合計	167,514	
当中間期末残高	18,001,445	
利益剰余金合計		
当期首残高	18,513,737	
当中間期変動額		
剰余金の配当	135,560	

中間純利益	303,074
当中間期変動額合計	167,514
当中間期末残高	18,681,252
株主資本合計	
当期首残高	36,795,577
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	303,074
当中間期変動額合計	167,514
当中間期末残高	36,963,092
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	280,116
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)	192,603
当中間期変動額合計	192,603
当中間期末残高	87,512
評価・換算差額等合計	
当期首残高	280,116
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)	192,603
当中間期変動額合計	192,603
当中間期末残高	87,512
純資産合計	
当期首残高	37,075,694
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	303,074
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	192,603
当中間期変動額合計	25,088
当中間期末残高	37,050,605

## （重要な会計方針）

項目	第18期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定額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。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>

## （会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以降に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当中間会計期間の減価償却費が911千円減少し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ911千円増加しております。

## （注記事項）

## [ 中間貸借対照表関係 ]

第18期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	822,082千円

## [ 中間損益計算書関係 ]

第18期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	37,633千円
無形固定資産	240,255千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
有価証券利息	44,672千円
受取配当金	31,458千円
補助金収入	9,500千円
受取利息	115千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	15,252千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	105,652千円
投資有価証券償還益	1,755千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	119,106千円
投資有価証券償還損	152千円
事故損失賠償金	1千円
固定資産除却損	
建物	1,481千円
器具備品	35千円
計	1,516千円

## [ 中間株主資本等変動計算書関係 ]

第18期中間会計期間  
(自 平成24年4月1日  
至 平成24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24年6月25日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成24年3月31日	平成24年6月25日

## [リース取引関係]

第18期中間会計期間  
 （自 平成24年4月1日  
 至 平成24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	千円	千円
	862	503	359

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1年内	177千円
1年超	198千円
合計	375千円

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	93千円
減価償却費相当額	86千円
支払利息相当額	6千円

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18期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成24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	861,189	861,189	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,013,898	4,022,770	8,871
その他有価証券	3,199,340	3,199,340	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	20,430,130	20,531,710	101,579
その他有価証券	5,821,209	5,821,209	-

（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18期中間会計期間末（平成24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	23,639,299	23,749,760	110,460
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	23,639,299	23,749,760	110,460
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	804,729	804,720	9
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	804,729	804,720	9
合計		24,444,029	24,554,480	110,450

## 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	2,899,052	2,899,430	377
	国債・地方債 等	2,899,052	2,899,430	377
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,675,650	3,428,202	752,552
	小計	5,574,702	6,327,632	752,930
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	299,928	299,910	18
	国債・地方債 等	299,928	299,910	18
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,999,200	2,393,007	606,192
	小計	3,299,128	2,692,917	606,211
合計		8,873,830	9,020,549	146,718

(注1) 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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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	1,254,877

## 〔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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔1株当たり情報〕

	第18期中間会計期間 （自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
1株当たり純資産額	341,643円97銭
1株当たり中間純利益	2,794円65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	303,074千円
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>303,074千円</u>
期中平均株式数	108千株

## 〔重要な後発事象〕

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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24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24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24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	1,250,000百万円	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25年4月12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

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25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。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成25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。

#### 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、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25年4月12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

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25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。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の平成25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。

#### 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、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。

[次△](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24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24年4月1日から平成25年3月31日までの第18期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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24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24年4月1日から平成24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25年4月12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

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25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。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成25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。

#### 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、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](#)