

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成25年11月21日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 宇治原 潔
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 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。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成25年5月21日をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、半期報告書の提出にともない新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出します。

【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

原届出書「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」の「ファンドの特色」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。なお、記載のない項目につきましては、変更はございません。

ファンドの特色

（略）

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。

（略）

〈指定投資信託証券の概要〉

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

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」を通じて、実質的に国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数) ^{*1} の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33075%*(税抜0.315%) ※消費税率が8%になった場合は、年率0.3402%
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 ^{*2} 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%*(税抜0.21%) ※消費税率が8%になった場合は、年率0.2268%
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 ^{*3})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、上限料率は年率0.315%*(税抜0.3%) ※消費税率が8%になった場合は、上限料率は年率0.324%
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) ^{*4} 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%*(税抜0.25%) ※消費税率が8%になった場合は、年率0.27%
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

（略）

（ 3 ）【ファンドの仕組み】**< 訂正前 >**

（ 略 ）

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

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

委託会社の概況（平成25年9月末現在）

1．委託会社の名称：ニッセイアセットマネジメント株式会社

（ 略 ）

2 【投資方針】**（ 2 ）【投資対象】****< 訂正前 >**

a 主な投資対象

（ 略 ）

各指定投資信託証券の概要

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）

（略）

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。

（略）

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）

（略）

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。

（略）

ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド

（略）

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%（ <u>税込</u> ）
純資産総額50億円超100億円以下の部分	年0.2625%（ <u>税込</u> ）
純資産総額100億円超の部分	年0.2100%（ <u>税込</u> ）

（略）

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

（略）

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。

(略)

(略)

<訂正後>

a 主な投資対象

(略)

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)

(略)

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% (税抜0.315%) をかけた額とします。

消費税率が8%になった場合は、年0.3402%となります。

(略)

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)

(略)

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% (税抜0.21%) をかけた額とします。

消費税率が8%になった場合は、年0.2268%となります。

(略)

ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド

(略)

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% (税抜0.30%)

純資産総額50億円超100億円以下の部分 年0.2625% (税抜0.25%)

純資産総額100億円超の部分 年0.2100% (税抜0.20%)

消費税率が8%になった場合は、以下の通りとなります。

純資産総額50億円以下の部分 年0.324% (税抜0.30%)

純資産総額50億円超100億円以下の部分 年0.270% (税抜0.25%)

純資産総額100億円超の部分 年0.216% (税抜0.20%)

(略)

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

(略)

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% (税抜0.25%) をかけた額とします。

消費税率が8%になった場合は、年0.27%となります。

(略)

(略)

4 【手数料等及び税金】

(3) 【信託報酬等】

< 訂正前 >

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%

(略)

(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
-------------------------------	------------

(略)

<訂正後>

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%（税抜0.115%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

消費税率が8%になった場合は、年0.1242%となります。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.010%	0.075%	0.030%

(略)

(参考1) 投資対象とする指定投資信託証券の信託報酬率（年率）

指定投資信託証券の名称	信託報酬率
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）	0.33075%（税抜0.315%）
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）	0.22050%（税抜0.210%）
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド	上限0.31500%（税抜0.300%）
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	0.26250%（税抜0.250%）

消費税率が8%になった場合、国内株式インデックスは年0.3402%、国内債券インデックスは年0.2268%、外国株式インデックスは年0.324%（上限）、外国債券インデックスは年0.27%となります。

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（年率）

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
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	0.3701%（税抜0.3525%）程度
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	0.3885%（税抜0.3700%）程度
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	0.4069%（税抜0.3875%）程度

消費税率が8%になった場合、債券重視型は年0.3807%程度、標準型は年0.3996%程度、株式重視型は年0.4185%程度となります。

(略)

(4)【その他の手数料等】

<訂正前>

(略)

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%

(略)

<訂正後>

(略)

監査費用

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

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.0021% (税抜0.002%)
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.0063% (税抜0.006%)
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.0105% (税抜0.010%)
10億円以下 の部分	年 0.0735% (税抜0.070%)

消費税率が8%になった場合は、以下の通りとなります。

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.00216% (税抜0.002%)
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00648% (税抜0.006%)
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.01080% (税抜0.010%)
10億円以下 の部分	年 0.07560% (税抜0.070%)

(略)

5【運用状況】

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

(1)【投資状況】

「債券重視型」

(平成25年9月30日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	3,110,895,145	95.95
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		131,197,737	4.05
純資産総額		3,242,092,882	100.00

「標準型」

(平成25年9月30日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	10,388,085,352	95.56
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		482,122,028	4.44
純資産総額		10,870,207,380	100.00

「株式重視型」

(平成25年9月30日現在)

資産の種類	国名又は地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	5,858,835,703	95.68
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		264,516,984	4.32
純資産総額		6,123,352,687	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9月30日現在)

順位	国名	銘柄名	種類	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	ニッセイ国内債券インデックスSA (適格機関投資家限定)	投資信託 受益証券	1,207,609,844	11,799	1,424,798,828	11,929	1,440,557,782	44.43

2	日本	ニッセイ国内株式 インデックスS A （適格機関投資家 限定）	投資信託 受益証券	510,280,372	10,882	555,274,889	13,475	687,602,801	21.21
3	日本	ステート・スト リート外国債券イ ンデックス・ファ ンド	投資信託 受益証券	442,265,410	13,966	617,664,444	14,718	650,926,230	20.08
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	241,737,092	11,837	286,132,946	13,726	331,808,332	10.23
投資比率：合計									95.95

「標準型」

（平成25年9月30日現在）

順位	国名	銘柄名	種類	口数（口）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	ニッセイ国内株式 インデックスS A （適格機関投資家 限定）	投資信託 受益証券	2,529,408,030	10,843	2,742,518,781	13,475	3,408,377,320	31.35
2	日本	ニッセイ国内債券 インデックスS A （適格機関投資家 限定）	投資信託 受益証券	2,661,903,519	11,800	3,141,065,648	11,929	3,175,384,707	29.21
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	1,596,265,488	11,807	1,884,757,696	13,726	2,191,034,008	20.16
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	1,096,133,522	13,965	1,530,777,881	14,718	1,613,289,317	14.84
投資比率：合計									95.56

「株式重視型」

（平成25年9月30日現在）

順位	国名	銘柄名	種類	口数（口）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
----	----	-----	----	-------	-----------------	-------------	-----------------	-------------	-----------------

1	日本	ニッセイ国内株式 インデックスS A （適格機関投資家 限定）	投資信託 受益証券	1,882,930,065	10,784	2,030,536,439	13,475	2,537,248,262	41.44
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	1,336,947,891	11,786	1,575,780,649	13,726	1,835,094,675	29.97
3	日本	ニッセイ国内債券 インデックスS A （適格機関投資家 限定）	投資信託 受益証券	742,895,486	11,799	876,579,499	11,929	886,200,025	14.47
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	407,862,985	14,006	571,272,804	14,718	600,292,741	9.80
投資比率：合計									95.68

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

（注2）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

「債券重視型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	95.95
合計		95.95

「標準型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	95.56
合計		95.56

「株式重視型」

種類	業種	投資比率（％）
投資信託受益証券	-	95.68
合計		95.68

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

「債券重視型」

		純資産総額（円）	1万口当たり純資産総額（円）
第1期末	（平成16年2月23日）	分配付： 47,417,429	分配付： 10,855
		分配落： 47,417,429	分配落： 10,855
第2期末	（平成17年2月21日）	分配付： 538,308,102	分配付： 11,316
		分配落： 538,308,102	分配落： 11,316
第3期末	（平成18年2月21日）	分配付： 1,314,616,710	分配付： 12,528
		分配落： 1,314,616,710	分配落： 12,528
第4期末	（平成19年2月21日）	分配付： 1,801,858,564	分配付： 13,421
		分配落： 1,801,858,564	分配落： 13,421
第5期末	（平成20年2月21日）	分配付： 2,005,643,716	分配付： 12,719
		分配落： 2,005,643,716	分配落： 12,719
第6期末	（平成21年2月23日）	分配付： 1,837,832,308	分配付： 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
	3月末日	3,082,265,203	13,412
	4月末日	3,204,734,279	13,996
	5月末日	3,197,016,192	13,934
	6月末日	3,109,440,747	13,619
	7月末日	3,166,304,319	13,903

	8月末日	3,151,280,591	13,807
	平成25年9月30日	3,242,092,882	14,265

「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
	3月末日	9,976,689,918	14,167
	4月末日	10,540,878,790	15,017
	5月末日	10,600,111,062	15,027
	6月末日	10,235,553,309	14,564
	7月末日	10,496,172,820	15,008
	8月末日	10,380,490,913	14,828
	平成25年9月30日	10,870,207,380	15,526

「株式重視型」

		純資産総額（円）	1万口当たり純資産総額（円）
第1期末	（平成16年2月23日）	分配付： 58,719,649	分配付： 11,659
		分配落： 58,719,649	分配落： 11,659
第2期末	（平成17年2月21日）	分配付： 875,027,196	分配付： 12,475
		分配落： 875,027,196	分配落： 12,475
第3期末	（平成18年2月21日）	分配付： 2,375,768,675	分配付： 15,253
		分配落： 2,375,768,675	分配落： 15,253
第4期末	（平成19年2月21日）	分配付： 3,578,213,433	分配付： 17,319
		分配落： 3,578,213,433	分配落： 17,319
第5期末	（平成20年2月21日）	分配付： 3,543,921,213	分配付： 14,897
		分配落： 3,543,921,213	分配落： 14,897
第6期末	（平成21年2月23日）	分配付： 2,565,505,965	分配付： 9,552
		分配落： 2,565,505,965	分配落： 9,552
第7期末	（平成22年2月22日）	分配付： 3,635,729,715	分配付： 11,734
		分配落： 3,635,729,715	分配落： 11,734
第8期末	（平成23年2月21日）	分配付： 4,343,954,086	分配付： 12,613
		分配落： 4,343,954,086	分配落： 12,613
第9期末	（平成24年2月21日）	分配付： 4,217,589,091	分配付： 11,770
		分配落： 4,217,589,091	分配落： 11,770
第10期末	（平成25年2月21日）	分配付： 5,347,012,544	分配付： 14,248
		分配落： 5,347,012,544	分配落： 14,248
	平成24年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
	3月末日	5,507,569,240	14,741
	4月末日	5,882,225,623	15,871
	5月末日	5,943,812,668	15,950
	6月末日	5,601,278,162	15,327
	7月末日	5,850,765,793	15,939
	8月末日	5,774,275,950	15,667
	平成25年9月30日	6,123,352,687	16,625

（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9月30日現在）

各ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）」、「ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」及び「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」の受益証券を主要な投資対象として

おります。各指定投資信託証券の平成25年9月30日現在の投資状況及び投資資産は次に示すとおりであります。

また、各指定投資信託証券は、それぞれ「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・マザー・ファンド」及び「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の受益証券を主要な投資対象としております。各マザーファンドの平成25年9月30日現在の投資状況及び投資資産は次に示すとおりであります。

(1) 投資状況

1. ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）

資産の種類	国名又は地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	21,686,292,203	100.00
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		577,485	0.00
純資産総額		21,685,714,718	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	36,708,132,450	97.35
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,001,008,882	2.65
純資産総額		37,709,141,332	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12月限）	東京証券取引所	977,896,545	969,165,000	2.57

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	6,995,704,300	100.00
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		125,325	0.00
純資産総額		6,995,578,975	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	16,372,511,120	99.32
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		112,637,854	0.68
純資産総額		16,485,148,974	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	4,294,728,307	100.02
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		725,912	0.02
純資産総額		4,294,002,395	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	12,927,435,045	54.07
	イギリス	2,252,920,815	9.42
	カナダ	1,041,667,557	4.36
	フランス	996,341,644	4.17
	スイス	942,351,116	3.94
	ドイツ	917,467,569	3.84
	オーストラリア	780,613,444	3.26
	スウェーデン	343,828,576	1.44
	スペイン	331,008,433	1.38
	香港	303,774,471	1.27
	オランダ	274,685,234	1.15
	イタリア	222,446,941	0.93
	シンガポール	154,724,472	0.65
	ベルギー	120,648,032	0.50
	デンマーク	118,560,476	0.50
	フィンランド	92,507,547	0.39
	ノルウェー	84,940,045	0.35
	イスラエル	46,760,417	0.20
	アイルランド	34,856,580	0.15
	オーストリア	31,072,310	0.13
ポルトガル	20,155,303	0.08	
ニュージーランド	13,381,130	0.06	
ギリシャ	4,703,789	0.02	
小計	22,056,850,946	92.26	
投資証券	アメリカ	317,981,009	1.33
	オーストラリア	57,370,472	0.24
	フランス	30,828,250	0.13
	イギリス	29,579,005	0.12
	香港	9,482,868	0.04
	シンガポール	8,629,646	0.04
	カナダ	5,014,742	0.02

	オランダ	2,627,181	0.01
	小計	461,513,173	1.93
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,388,745,831	5.81
純資産総額		23,907,109,950	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

4．ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,833,219,856	100.00
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		72,129	0.00
純資産総額		2,833,147,727	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	93,206,282,616	39.38
	フランス	23,817,349,323	10.06
	イタリア	22,625,944,476	9.56
	ドイツ	21,027,231,006	8.88
	イギリス	18,594,970,601	7.86
	スペイン	12,113,691,727	5.12
	ベルギー	6,514,293,110	2.75
	オランダ	6,453,344,653	2.73
	カナダ	5,912,655,472	2.50
	オーストリア	4,091,281,180	1.73
	オーストラリア	3,533,731,861	1.49
	メキシコ	2,345,607,447	0.99
	デンマーク	1,987,286,336	0.84
	アイルランド	1,915,015,662	0.81
	ポーランド	1,801,243,251	0.76
	フィンランド	1,605,342,469	0.68
	南アフリカ	1,325,630,378	0.56
	スウェーデン	1,276,146,353	0.54
	マレーシア	1,175,569,727	0.50
	スイス	905,771,358	0.38
シンガポール	867,961,317	0.37	
ノルウェー	747,907,274	0.31	
	小計	233,844,257,597	98.80
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		2,828,687,687	1.20
純資産総額		236,672,945,284	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

１．ニッセイ国内株式インデックスＳＡ（適格機関投資家限定）

順位	国名	銘柄名	種類	口数（口）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	ニッセイ国内株式 インデックスマ ザーファンド	親投資信託 受益証券	19,232,256,300	9,713	18,680,960,455	11,276	21,686,292,203	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）		投資 比率 （％）
						単価	金額	
1	日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	284,000	4,851 6,270	1,377,793,854 1,780,680,000	4.72
2	日本	三菱UFJフィナンシャルG	株式	銀行業	1,652,600	535 627	884,746,876 1,036,180,200	2.75
3	日本	三井住友フィナンシャル G	株式	銀行業	165,000	3,844 4,745	634,299,102 782,925,000	2.08
4	日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	105,700	3,452 6,790	364,903,375 717,703,000	1.90
5	日本	本田技研	株式	輸送用機器	186,500	3,507 3,735	654,008,118 696,577,500	1.85
6	日本	みずほフィナンシャルG	株式	銀行業	2,823,000	205 213	579,043,350 601,299,000	1.59
7	日本	日本たばこ産業	株式	食料品	137,700	2,958 3,530	407,346,975 486,081,000	1.29
8	日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	91,800	4,314 5,080	396,069,892 466,344,000	1.24
9	日本	三菱地所	株式	不動産業	153,000	2,147 2,896	328,523,690 443,088,000	1.18
10	日本	武田薬品	株式	医薬品	86,700	4,786 4,635	414,944,101 401,854,500	1.07

11	日本	キヤノン	株式	電気機器	128,200	3,345 3,130	428,874,940 401,266,000	1.06
12	日本	ファナック	株式	電気機器	23,000	14,579 16,210	335,319,420 372,830,000	0.99
13	日本	日立	株式	電気機器	531,000	527 647	279,853,000 343,557,000	0.91
14	日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	40,700	6,868 8,440	279,511,680 343,508,000	0.91
15	日本	野村ホールディングス	株式	証券、商品先物取引業	446,000	549 765	244,820,936 341,190,000	0.90
16	日本	三井不動産	株式	不動産業	103,000	2,154 3,295	221,898,200 339,385,000	0.90
17	日本	三菱商事	株式	卸売業	170,200	1,921 1,986	326,893,816 338,017,200	0.90
18	日本	新日鐵住金	株式	鉄鋼	984,000	256 333	252,125,860 327,672,000	0.87
19	日本	セブン&アイ・HLDGS	株式	小売業	91,300	2,834 3,580	258,788,188 326,854,000	0.87
20	日本	KDDI	株式	情報・通信業	61,600	3,502 5,040	215,724,053 310,464,000	0.82
21	日本	ソニー	株式	電気機器	138,900	1,373 2,098	190,757,396 291,412,200	0.77
22	日本	NTTドコモ	株式	情報・通信業	179,800	1,415 1,592	254,370,336 286,241,600	0.76
23	日本	日産自動車	株式	輸送用機器	279,300	940 984	262,649,606 274,831,200	0.73
24	日本	東京海上HD	株式	保険業	84,500	2,896 3,205	244,739,955 270,822,500	0.72
25	日本	三井物産	株式	卸売業	188,300	1,410 1,426	265,574,628 268,515,800	0.71
26	日本	小松製作所	株式	機械	108,000	2,408 2,439	260,115,746 263,412,000	0.70
27	日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	72,600	2,824 3,575	205,026,970 259,545,000	0.69
28	日本	アステラス製薬	株式	医薬品	50,200	5,020 5,000	252,004,000 251,000,000	0.67
29	日本	デンソー	株式	輸送用機器	54,600	3,694 4,580	201,686,962 250,068,000	0.66
30	日本	信越化学	株式	化学	41,500	5,761 6,000	239,083,640 249,000,000	0.66
投資比率：合計								35.87

(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	輸送用機器	11.43
	電気機器	11.11
	銀行業	9.86
	情報・通信業	6.63
	化学	5.28
	機械	5.10
	卸売業	4.47
	小売業	4.13
	医薬品	4.12
	食料品	3.88
	陸運業	3.87
	不動産業	3.69
	建設業	2.53
	電気・ガス業	2.41
	保険業	2.26
	サービス業	2.19
	鉄鋼	1.86
	証券、商品先物取引業	1.80
	その他金融業	1.32
	その他製品	1.31
	精密機器	1.25
	非鉄金属	1.02
	ガラス・土石製品	0.97
	ゴム製品	0.91
	繊維製品	0.71
	空運業	0.64
	金属製品	0.62
	石油・石炭製品	0.61
	鉱業	0.45
	海運業	0.36
パルプ・紙	0.26	
倉庫・運輸関連業	0.23	
水産・農林業	0.07	
	合計	97.35

（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	5,639,423,056	12,328	6,952,182,127	12,405	6,995,704,300	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)		投資 比率 (%)
							下段：評価額(円)		
							単価	金額	
1	日本	第26回 利付国債(30年)	2.400	2037/3/20	国債証券	961,000,000	114.02 114.82	1,095,713,410 1,103,439,420	6.69
2	日本	第92回 利付国債(20年)	2.100	2026/12/20	国債証券	917,000,000	113.12 114.24	1,037,307,160 1,047,589,970	6.35
3	日本	第117回 利付国債(20年)	2.100	2030/3/20	国債証券	922,000,000	109.56 111.53	1,010,186,340 1,028,297,380	6.24
4	日本	第310回 利付国債(10年)	1.000	2020/9/20	国債証券	925,000,000	103.65 104.03	958,740,150 962,286,750	5.84
5	日本	第102回 利付国債(5年)	0.300	2016/12/20	国債証券	855,000,000	100.21 100.53	856,822,900 859,514,400	5.21
6	日本	第287回 利付国債(10年)	1.900	2017/6/20	国債証券	800,000,000	106.53 106.45	852,251,170 851,560,000	5.17
7	日本	第321回 利付国債(10年)	1.000	2022/3/20	国債証券	793,000,000	102.66 103.47	814,076,200 820,525,030	4.98
8	日本	第285回 利付国債(10年)	1.700	2017/3/20	国債証券	764,000,000	105.41 105.38	805,300,960 805,072,640	4.88
9	日本	第321回 利付国債(2年)	0.100	2014/10/15	国債証券	797,000,000	100.07 100.01	797,573,990 797,079,700	4.84
10	日本	第87回 利付国債(5年)	0.500	2014/12/20	国債証券	785,000,000	100.52 100.50	789,057,010 788,909,300	4.79
11	日本	第99回 利付国債(5年)	0.400	2016/9/20	国債証券	691,000,000	100.78 100.80	696,420,520 696,514,180	4.23
12	日本	第72回 利付国債(20年)	2.100	2024/9/20	国債証券	526,000,000	113.89 114.26	599,049,650 601,002,340	3.65
13	日本	第54回 利付国債(20年)	2.200	2021/12/20	国債証券	529,000,000	113.40 113.24	599,900,060 599,029,020	3.63
14	日本	第309回 利付国債(10年)	1.100	2020/6/20	国債証券	480,000,000	103.29 104.75	495,814,640 502,790,400	3.05

15	日本	第280回 利付国債(10年)	1.900	2016/6/20	国債証券	406,000,000	105.93 104.82	430,071,440 425,557,020	2.58
16	日本	第313回 利付国債(10年)	1.300	2021/3/20	国債証券	398,000,000	105.75 105.98	420,872,830 421,816,320	2.56
17	日本	第306回 利付国債(10年)	1.400	2020/3/20	国債証券	323,000,000	107.19 106.70	346,232,740 344,650,690	2.09
18	日本	第106回 利付国債(5年)	0.200	2017/9/20	国債証券	341,000,000	100.27 100.08	341,905,070 341,265,980	2.07
19	日本	第28回 利付国債(30年)	2.500	2038/3/20	国債証券	291,000,000	115.58 117.16	336,332,690 340,941,420	2.07
20	日本	第69回 利付国債(20年)	2.100	2024/3/20	国債証券	250,000,000	112.44 113.98	281,099,530 284,952,500	1.73
21	日本	第292回 利付国債(10年)	1.700	2018/3/20	国債証券	218,000,000	106.46 106.64	232,081,900 232,464,300	1.41
22	日本	第97回 利付国債(5年)	0.400	2016/6/20	国債証券	227,000,000	101.05 100.76	229,376,380 228,718,390	1.39
23	日本	第125回 利付国債(20年)	2.200	2031/3/20	国債証券	204,000,000	109.35 112.01	223,066,190 228,502,440	1.39

順位	国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面	上段：帳簿価額 (円)		投資比率 (%)
							下段：評価額 (円)		
							単価	金額	
24	日本	第99回 利付国債(20年)	2.100	2027/12/20	国債証券	197,000,000	111.38 113.69	219,418,290 223,971,270	1.36
25	日本	第279回 利付国債(10年)	2.000	2016/3/20	国債証券	203,000,000	105.81 104.63	214,793,060 212,396,870	1.29
26	日本	第281回 利付国債(10年)	2.000	2016/6/20	国債証券	183,000,000	105.48 105.09	193,032,820 192,309,210	1.17
27	日本	第282回 利付国債(10年)	1.700	2016/9/20	国債証券	177,000,000	104.75 104.66	185,403,060 185,239,350	1.12
28	日本	第123回 利付国債(20年)	2.100	2030/12/20	国債証券	165,000,000	107.91 110.71	178,058,750 182,669,850	1.11
29	日本	第4回 利付国債(40年)	2.200	2051/3/20	国債証券	156,000,000	109.85 111.96	171,366,280 174,649,800	1.06
30	日本	第305回 利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	国債証券	147,000,000	106.28 106.04	156,228,430 155,874,390	0.95
							投資比率：合計		94.90

(注1) 投資有価証券の上位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		2,840,992,464	1.3158	3,738,423,010	1.5117	4,294,728,307	100.02
投資比率：合計									100.02	

(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		100.02
合計		100.02

(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	7,978	44,597	355,798,535	47,189	376,472,346	1.57
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	37,972	8,744	332,017,200	8,494	322,552,204	1.35
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	67,362	2,799	188,518,114	3,254	219,202,515	0.92
4	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	87,876	2,316	203,494,233	2,351	206,586,589	0.86
5	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	23,695	7,603	180,152,966	8,478	200,882,833	0.84
6	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	2,340	79,345	185,667,816	85,667	200,461,066	0.84
7	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	16,456	11,378	187,238,013	11,988	197,275,515	0.83
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	27,311	6,949	189,776,491	6,831	186,561,441	0.78
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	23,178	7,579	175,655,805	7,547	174,930,797	0.73
10	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	42,388	3,476	147,340,264	4,065	172,325,128	0.72
11	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	158,676	1,145	181,741,653	1,071	170,001,646	0.71
12	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	32,431	4,845	157,143,356	5,106	165,607,604	0.69
13	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・サービス	8,922	19,615	175,009,424	18,271	163,017,698	0.68

14	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	55,906	2,719	152,031,055	2,823	157,823,756	0.66
15	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	5,986	23,011	137,744,773	26,341	157,678,423	0.66
16	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	45,838	3,500	160,452,595	3,322	152,252,979	0.64
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	19,600	6,988	136,970,593	7,522	147,435,120	0.62
18	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	413,900	262	108,619,528	343	142,121,455	0.59
19	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	33,938	3,715	126,095,875	3,754	127,389,676	0.53
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	91,513	1,195	109,402,190	1,359	124,341,000	0.52
21	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	25,743	4,387	112,935,055	4,779	123,025,732	0.51
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	25,604	4,169	106,744,036	4,671	119,608,381	0.50
23	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	13,895	8,941	124,237,869	8,537	118,614,771	0.50
24	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	162,049	705	114,257,735	697	113,002,436	0.47
25	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	24,193	4,408	106,631,796	4,594	111,148,690	0.46
26	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	32,057	3,426	109,831,689	3,302	105,852,053	0.44
27	フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	18,239	5,049	92,090,570	5,759	105,046,101	0.44
28	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	32,332	3,390	109,611,707	3,221	104,144,079	0.44
29	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	41,994	2,375	99,734,077	2,480	104,130,071	0.44
30	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	45,072	2,107	94,944,731	2,282	102,875,149	0.43
									投資比率：合計	20.37

(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9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	9.86
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.24
	銀行	7.54
	資本財	7.24

ソフトウェア・サービス	6.03
食品・飲料・タバコ	5.98
各種金融	5.57
素材	5.43
保険	4.00
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.80
電気通信サービス	3.39
公益事業	3.13
小売	3.05
メディア	2.82
ヘルスケア機器・サービス	2.74
食品・生活必需品小売り	2.15
運輸	1.75
家庭用品・パーソナル用品	1.73
消費者サービス	1.63
自動車・自動車部品	1.63
耐久消費財・アパレル	1.61
半導体・半導体製造装置	1.42
商業・専門サービス	0.88
不動産	0.64
小 計	92.26
投資証券	1.93
合 計	94.19

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

（注2）平成25年9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

4．ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	日本	親投資信託受益証券	ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド		1,480,570,577	1.8327	2,713,441,697	1.9136	2,833,219,856	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	0.375	2015/06/15	27,000,000	9,784	2,641,730,895	9,791	2,643,578,370	1.12
2	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	17,800,000	10,864	1,933,797,829	10,629	1,891,917,233	0.80
3	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	18,000,000	10,714	1,928,447,190	10,493	1,888,788,060	0.80
4	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.875	2015/06/30	18,300,000	10,129	1,853,526,800	10,044	1,838,089,240	0.78
5	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	16,500,000	10,600	1,748,969,392	10,388	1,713,986,133	0.72
6	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	14,000,000	11,494	1,609,164,410	11,172	1,564,044,965	0.66
7	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/10/31	15,000,000	10,124	1,518,595,125	10,011	1,501,645,275	0.63
8	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	12,800,000	11,331	1,450,416,064	11,019	1,410,440,224	0.60
9	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	11.250	2015/02/15	12,400,000	11,890	1,474,398,440	11,252	1,395,187,705	0.59
10	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	0.500	2014/10/15	14,000,000	9,815	1,374,056,110	9,812	1,373,741,355	0.58
11	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/09/30	13,500,000	10,108	1,364,624,212	9,995	1,349,263,777	0.57
12	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.250	2016/03/31	12,800,000	10,318	1,320,704,160	10,209	1,306,728,256	0.55
13	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.500	2017/05/15	11,800,000	11,322	1,336,018,066	11,023	1,300,699,427	0.55
14	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.125	2014/11/30	13,000,000	10,098	1,312,697,457	9,999	1,299,888,297	0.55
15	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	0.375	2016/02/15	13,200,000	9,751	1,287,124,652	9,761	1,288,480,677	0.54
16	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	0.500	2016/06/15	13,000,000	9,755	1,268,168,789	9,763	1,269,161,562	0.54
17	フランス	国債 証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	3.500	2015/04/25	9,100,000	14,085	1,281,738,157	13,855	1,260,835,061	0.53
18	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4.000	2015/02/15	12,000,000	10,492	1,259,051,280	10,283	1,233,937,350	0.52
19	イタリア	国債 証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	3.750	2015/08/01	9,000,000	13,692	1,232,285,589	13,641	1,227,654,578	0.52
20	イタリア	国債 証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	3.000	2015/06/15	9,000,000	13,473	1,212,598,452	13,466	1,211,967,059	0.51

21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2014/12/31	12,000,000	10,201	1,224,177,990	10,075	1,208,964,180	0.51
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2015/01/31	12,000,000	10,148	1,217,726,490	10,043	1,205,210,580	0.51
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2018/04/30	11,500,000	10,613	1,220,462,512	10,368	1,192,280,698	0.50
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	10,000,000	11,245	1,124,506,225	10,856	1,085,640,825	0.46
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	10,000,000	11,024	1,102,434,275	10,736	1,073,646,900	0.45
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.125	2019/08/15	8,000,000	14,004	1,120,340,119	13,344	1,067,492,560	0.45
27	イタリア	国債証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	4.250	2015/02/01	7,500,000	13,831	1,037,346,783	13,694	1,027,024,329	0.43
28	ドイツ	国債証券	GERMAN GOVERNMENT BOND	3.500	2016/01/04	7,200,000	14,411	1,037,574,259	14,174	1,020,500,997	0.43
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2017/09/30	9,800,000	10,249	1,004,353,098	10,083	988,182,902	0.42
30	ドイツ	国債証券	GERMAN GOVERNMENT BOND	3.750	2015/01/04	7,100,000	14,074	999,284,696	13,795	979,449,668	0.41
										投資比率：合計	17.23

(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9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		98.80
合計		98.80

(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9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

その他投資資産の主要なもの

1. ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）

該当事項はありません。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

種類	取引所	資産の名称	買建 売建	数量（枚）	簿価（円）	時価（円）	投資 比率 （%）
株価指数 先物取引	東京証券 取引所	東証株価指数先物 （2013年12月限）	買建	81	977,896,545	969,165,000	2.57

(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

- 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。
- 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	99	8,404,020.00	8,347,680.00	815,985,720	3.41
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	50	1,442,420.00	1,453,500.00	191,673,045	0.80
	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	15	988,022.93	972,075.00	153,675,336	0.64
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	6	791,050.00	796,350.00	72,364,324	0.30
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	5	734,994.00	735,400.00	69,737,982	0.29
	FSMI INDEX	ユーレックス・チューリッヒ取引所	買建	スイス・フラン	8	643,180.00	644,000.00	69,552,000	0.29

- （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9月30日の国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています）の比率です。
- （注2）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。
- （注3）先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

4. ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド
該当事項はありません。

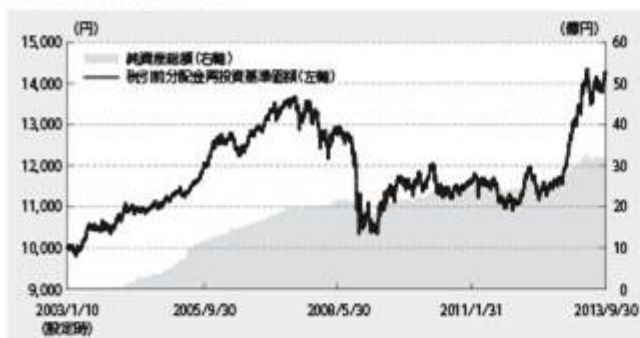
ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド
該当事項はありません。

〈参考情報〉

2013年9月末現在

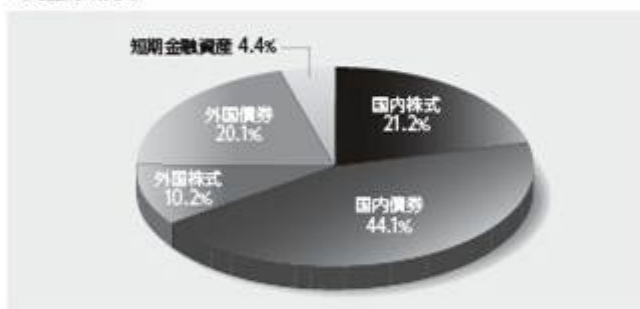
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

● 基準価額・純資産の推移



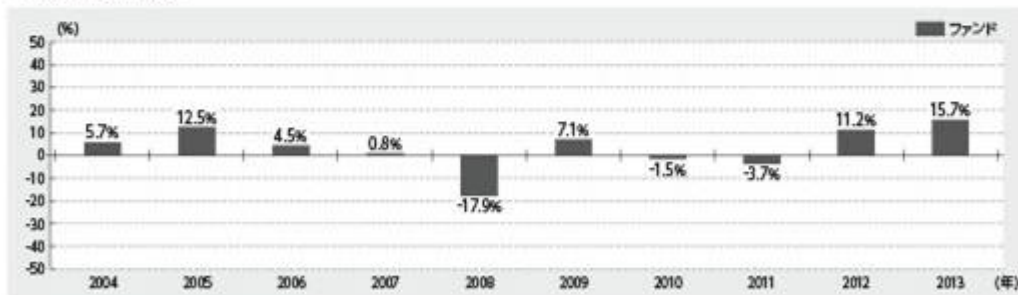
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実買入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。
- ・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	14,265円
純資産総額	32億円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

第6期	2009年2月	0円
第7期	2010年2月	0円
第8期	2011年2月	0円
第9期	2012年2月	0円
第10期	2013年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定以来累計		0円

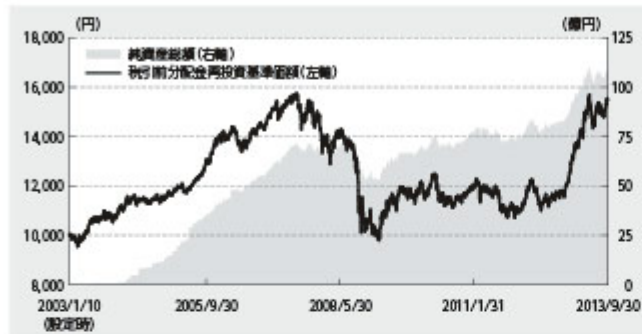
■ ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

■ 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9月末現在

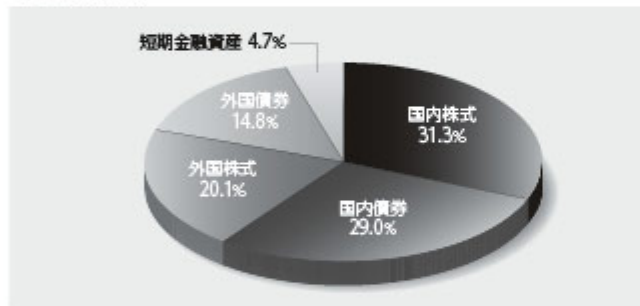
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

● 基準価額・純資産の推移



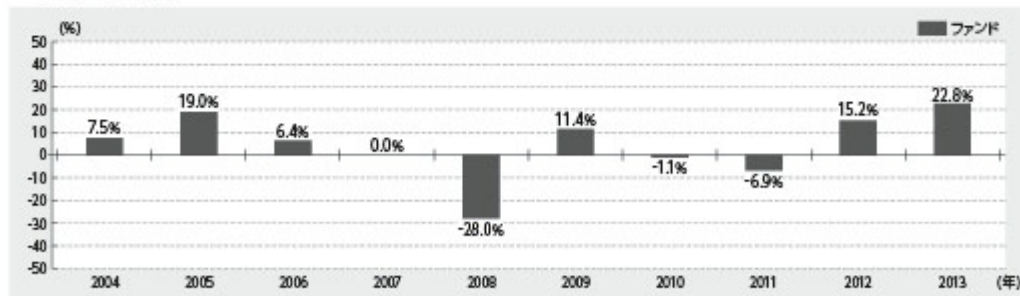
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・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	15,526円
純資産総額	108億円

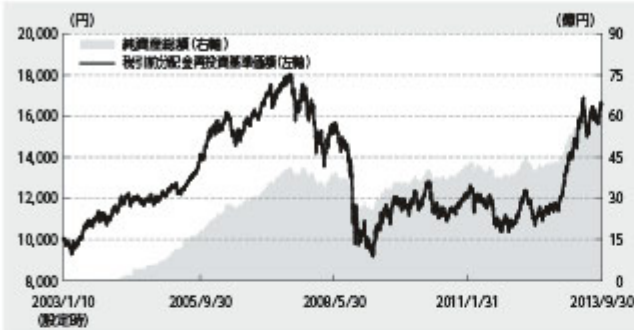
● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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

2013年9月末現在

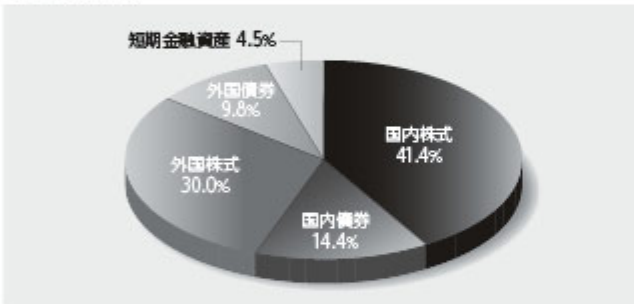
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

● 基準価額・純資産の推移



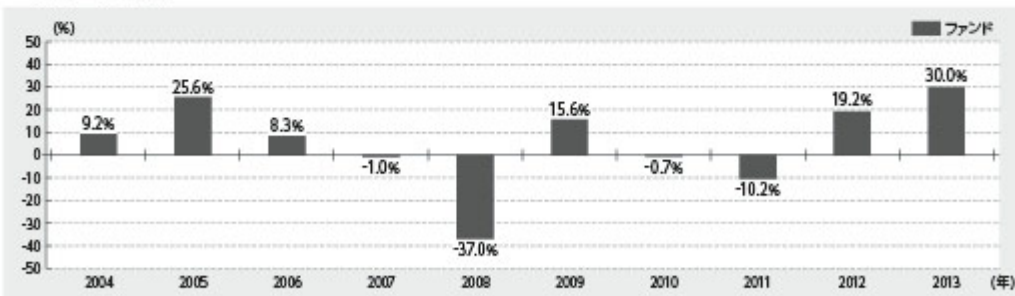
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・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	16,625円
純資産総額	61億円

● 分配の推移 1万円当り(税引前)

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

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

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

1）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成25年2月22日から平成25年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

1）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成25年2月22日から平成25年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

1）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成25年2月22日から平成25年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

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

（単位：円）

		第11期中間計算期間 （平成25年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		149,064,108
投資信託受益証券		3,005,589,398
流動資産合計		3,154,653,506
資産合計		3,154,653,506
負債の部		
流動負債		
未払解約金		36,872
未払受託者報酬		492,396
未払委託者報酬		1,395,248
その他未払費用		476,459
流動負債合計		2,400,975
負債合計		2,400,975
純資産の部		
元本等		
元本		2,280,374,058
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		871,878,473
純資産合計		3,152,252,531
負債純資産合計		3,154,653,506

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 （自平成25年2月22日 至平成25年8月21日）
営業収益	
受取利息	39,260
有価証券売買等損益	167,216,848
営業収益合計	167,256,108
営業費用	
受託者報酬	492,396
委託者報酬	1,395,248
その他費用	476,459
営業費用合計	2,364,103
営業利益又は営業損失（ ）	164,892,005
経常利益又は経常損失（ ）	164,892,005
中間純利益又は中間純損失（ ）	164,892,005
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	19,590,041
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	712,734,810
剰余金増加額又は欠損金減少額	98,082,847
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	98,082,847
剰余金減少額又は欠損金増加額	84,241,148
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	84,241,148
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	871,878,473

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあつては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
---------------------	--

(表示方法の変更に関する注記)

中間損益及び剰余金計算書の「中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」、「中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、従来、それぞれ剰余金増加額又は欠損金減少額、剰余金減少額又は欠損金増加額の総額を表示していましたが、剰余金の増減をより明瞭に表示するため、当中間計算期間から純額表示へと変更しております。変更の結果、中間損益及び剰余金計算書への影響はありません。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
1 . 当該中間計算期間の末日における受益権総口数	2,280,374,058口
2 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3823円 (13,823円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期中間計算期間 (自平成25年2月22日 至平成25年8月21日)
1 . 中間剰余金増加額・減少額及び 中間欠損金減少額・増加額	「中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ中間剰余金減少額と中間剰余金増加額との純額を表示しております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
1 . 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 . 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
期首元本額	2,289,002,662円
期中追加設定元本額	259,172,360円
期中一部解約元本額	267,800,964円

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

（単位：円）

		第11期中間計算期間 （平成25年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		493,041,886
投資信託受益証券		9,924,727,044
流動資産合計		10,417,768,930
資産合計		10,417,768,930
負債の部		
流動負債		
未払解約金		980,930
未払受託者報酬		1,618,372
未払委託者報酬		4,585,472
その他未払費用		731,789
流動負債合計		7,916,563
負債合計		7,916,563
純資産の部		
元本等		
元本		6,996,406,442
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		3,413,445,925
純資産合計		10,409,852,367
負債純資産合計		10,417,768,930

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第11期中間計算期間 （ 自平成25年2月22日 至平成25年8月21日 ）
営業収益	
受取利息	126,059
有価証券売買等損益	791,036,782
営業収益合計	791,162,841
営業費用	
受託者報酬	1,618,372
委託者報酬	4,585,472
その他費用	731,789
営業費用合計	6,935,633
営業利益又は営業損失（ ）	784,227,208
経常利益又は経常損失（ ）	784,227,208
中間純利益又は中間純損失（ ）	784,227,208
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	65,060,422
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,645,643,119
剰余金増加額又は欠損金減少額	278,861,518
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	278,861,518
剰余金減少額又は欠損金増加額	230,225,498
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	230,225,498
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,413,445,925

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあつては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	--

(表示方法の変更に関する注記)

中間損益及び剰余金計算書の「中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」、「中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、従来、それぞれ剰余金増加額又は欠損金減少額、剰余金減少額又は欠損金増加額の総額を表示していましたが、剰余金の増減をより明瞭に表示するため、当中間計算期間から純額表示へと変更しております。変更の結果、中間損益及び剰余金計算書への影響はありません。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総口数	6,996,406,442口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4879円 (14,879円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期中間計算期間 (自平成25年2月22日 至平成25年8月21日)
1. 中間剰余金増加額・減少額及び 中間欠損金減少額・増加額	「中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ中間剰余金減少額と中間剰余金増加額との純額を表示しております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
期首元本額	7,014,605,407円
期中追加設定元本額	586,630,531円
期中一部解約元本額	604,829,496円

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

（単位：円）

		第11期中間計算期間 （平成25年8月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		290,028,244
投資信託受益証券		5,518,288,453
流動資産合計		5,808,316,697
資産合計		5,808,316,697
負債の部		
流動負債		
未払解約金		3,214,206
未払受託者報酬		900,302
未払委託者報酬		2,550,919
その他未払費用		596,519
流動負債合計		7,261,946
負債合計		7,261,946
純資産の部		
元本等		
元本		3,681,759,749
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,119,295,002
純資産合計		5,801,054,751
負債純資産合計		5,808,316,697

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 （自平成25年2月22日 至平成25年8月21日）
営業収益	
受取利息	71,225
有価証券売買等損益	566,589,074
営業収益合計	566,660,299
営業費用	
受託者報酬	900,302
委託者報酬	2,550,919
その他費用	596,519
営業費用合計	4,047,740
営業利益又は営業損失（ ）	562,612,559
経常利益又は経常損失（ ）	562,612,559
中間純利益又は中間純損失（ ）	562,612,559
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	66,511,365
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,594,223,325
剰余金増加額又は欠損金減少額	249,248,013
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	249,248,013
剰余金減少額又は欠損金増加額	220,277,530
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	220,277,530
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,119,295,002

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあつては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	--

(表示方法の変更に関する注記)

中間損益及び剰余金計算書の「中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」、「中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、従来、それぞれ剰余金増加額又は欠損金減少額、剰余金減少額又は欠損金増加額の総額を表示していましたが、剰余金の増減をより明瞭に表示するため、当中間計算期間から純額表示へと変更しております。変更の結果、中間損益及び剰余金計算書への影響はありません。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総口数	3,681,759,749口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5756円 (15,756円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期中間計算期間 (自平成25年2月22日 至平成25年8月21日)
1. 中間剰余金増加額・減少額及び 中間欠損金減少額・増加額	「中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ中間剰余金減少額と中間剰余金増加額との純額を表示しております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第11期中間計算期間 (平成25年8月21日現在)
期首元本額	3,752,789,219円
期中追加設定元本額	440,326,851円
期中一部解約元本額	511,356,321円

（参考）

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

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

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

「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、同マザーファンド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。

「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、同マザーファンド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。

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

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

「ステート・ストリート外国株式インデックス・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」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。同マザーファンドの計算日の状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「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、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。同マザーファンドの計算日の状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックスS A（適格機関投資家限定）」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年8月20日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	31,574,075
親投資信託受益証券	20,636,350,321
未収入金	7,587,976
流動資産合計	20,675,512,372
資産合計	20,675,512,372
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,816,956
未払受託者報酬	7,132,168
未払委託者報酬	24,962,672
その他未払費用	413,400
流動負債合計	39,325,196
負債合計	39,325,196
純資産の部	
元本等	
元本	16,680,373,395
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,955,813,781
純資産合計	20,636,187,176
負債純資産合計	20,675,512,372

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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年8月20日現在）
1. 計算日における受益権総口数	16,680,373,395口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2372円 (12,372円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成25年8月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成25年8月20日現在）
期首元本額	18,765,167,862円
期首から計算日までの追加設定元本額	964,036,211円
期首から計算日までの一部解約元本額	3,048,830,678円

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年8月20日現在）
資産の部	
流動資産	

コール・ローン	437,245,512
株式	35,486,428,500
派生商品評価勘定	-
未収入金	-
未収配当金	32,248,930
差入委託証拠金	19,425,000
流動資産合計	35,975,347,942
資産合計	35,975,347,942
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,291,855
前受金	625,000
未払金	-
未払解約金	69,573,198
流動負債合計	78,490,053
負債合計	78,490,053
純資産の部	
元本等	
元本	34,019,898,984
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,876,958,905
純資産合計	35,896,857,889
負債純資産合計	35,975,347,942

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年8月20日現在)
1. 計算日における受益権総口数	34,019,898,984口

2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6 第10号に規定する額 元本の欠損	-
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0552円 (10,552円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

株式関連

種類	(平成25年8月20日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 先物取引 買建	447,590,000	-	439,335,000	8,255,000
合計	447,590,000	-	439,335,000	8,255,000

(注) 時価の算定方法

1. 株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
3. 評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

（その他の注記）

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当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25年8月20日現在）
同期間の期首元本額	38,349,017,922円
同期間中の追加設定元本額	3,917,821,052円
同期間中の一部解約元本額	8,246,939,990円
同期間末日の元本額	34,019,898,984円
上記元本額の内訳	
ニッセイTOPIXオープン	11,492,514,032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）	19,556,814,179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）	111,293,711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）	46,045,164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）	196,862,738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）	1,347,630,095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）	1,268,739,065円
計	34,019,898,984円

「ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年8月20日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,790,119
親投資信託受益証券	6,998,400,105
未収入金	246,576
流動資産合計	7,005,436,800
資産合計	7,005,436,800
負債の部	
流動負債	
未払解約金	71,155
未払受益者報酬	963,438
未払委託者報酬	5,780,887
その他未払費用	259,376
流動負債合計	7,074,856

負債合計	7,074,856
純資産の部	
元本等	
元本	5,908,509,420
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,089,852,524
純資産合計	6,998,361,944
負債純資産合計	7,005,436,800

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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年8月20日現在)
1. 計算日における受益権総口数	5,908,509,420口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1845円 (11,845円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	(平成25年8月20日現在)
期首元本額	5,496,535,422円
期首から計算日までの追加設定元本額	949,644,711円
期首から計算日までの一部解約元本額	537,670,713円

「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年8月20日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	87,064,696
国債証券	16,202,273,580
未収利息	54,564,262
前払費用	14,964,759
流動資産合計	16,358,867,297
資産合計	16,358,867,297
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,871,716
流動負債合計	8,871,716
負債合計	8,871,716
純資産の部	
元本等	
元本	13,280,252,260
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	3,069,743,321
純資産合計	16,349,995,581
負債純資産合計	16,358,867,297

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</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25年8月20日現在)
1. 計算日における受益権総口数	13,280,252,260口

2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2312円 (12,312円)
------------------------------	----------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

「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当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25年8月20日現在)
同期間の期首元本額	12,633,294,588円
同期間中の追加設定元本額	2,112,080,829円
同期間中の一部解約元本額	1,465,123,157円
同期間末日の元本額	13,280,252,260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)	5,684,210,612円
DCニッセイ国内債券インデックス	4,861,661,689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)	102,335,696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)	22,813,814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)	504,747,842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）	1,465,379,355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）	639,103,252円
計	13,280,252,260円

ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド

(1) 中間貸借対照表（単位：円）

区 分	注記 番号	当中間計算期間末 (平成25年 8月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		6,663,659
親投資信託受益証券		4,135,032,750
未収利息		5
流動資産合計		4,141,696,414
資産合計		4,141,696,414
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,292,578
未払委託者報酬		5,170,264
流動負債合計		6,462,842
負債合計		6,462,842
純資産の部		
元本等		
元本	1	3,169,033,788
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		966,199,784
(分配準備積立金)		(899,961,418)
元本等合計		4,135,233,572
純資産合計		4,135,233,572
負債純資産合計		4,141,696,414

(2) 中間損益及び剰余金計算書（単位：円）

区 分	注記 番号	当中間計算期間 自 平成25年 2月21日 至 平成25年 8月20日
		金 額
営業収益		
受取利息		1,040
有価証券売買等損益		458,089,366

営業収益合計		458,090,406
営業費用		
受託者報酬		1,292,578
委託者報酬		5,170,264
営業費用合計		6,462,842
営業利益		451,627,564
経常利益		451,627,564
中間純利益		451,627,564
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		53,770,395
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		573,724,401
剰余金増加額又は欠損金減少額		77,744,850
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		77,744,850
剰余金減少額又は欠損金増加額		83,126,636
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		83,126,636
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		966,199,784

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 (平成25年 8月20日現在)
1 期首元本額	3,255,993,731円
期中追加設定元本額	388,143,021円
期中一部解約元本額	475,102,964円
2 受益権の総数	3,169,033,788口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 (平成25年 8月20日現在)
----	-----------------------------

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

（有価証券関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	当中間計算期間末 (平成25年 8月20日現在)
1口当たり純資産額	1.3049 円
(1万口当たり純資産額)	(13,049 円)

「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

(1) 貸借対照表 (単位：円)

区 分	注記 番号	(平成25年 8月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		415,237,457
コール・ローン		3,457,761
株式		21,288,229,691

投資証券		435,069,543
派生商品評価勘定		1,164,537
未収入金		88,106
未収配当金		43,490,722
未収利息		2
差入委託証拠金		287,457,088
流動資産合計		22,474,194,907
資産合計		22,474,194,907
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		11,610,967
流動負債合計		11,610,967
負債合計		11,610,967
純資産の部		
元本等		
元本	1	15,406,518,809
剰余金		
剰余金又は欠損金()		7,056,065,131
元本等合計		22,462,583,940
純資産合計		22,462,583,940
負債純資産合計		22,474,194,907

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p>

	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成25年 8月20日現在)
1 期首元本額	20,749,220,275円
期中追加設定元本額	3,234,588,203円
期中一部解約元本額	8,577,289,669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	2,836,099,280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	1,364,349,046円
ステート・ストリート世界株式インデックス・ファンド (為替ヘッジ付き) <適格機関投資家限定>	3,158,598,614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>	273,594,696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>	1,503,801,440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>	573,071,863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>	5,697,003,870円

	計	15,406,518,809円
2 受益権の総数		15,406,518,809円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	（平成25年 8月20日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載してあります。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載してあります。</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

（有価証券関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（単位：円）

区分	種類	（平成25年 8月20日現在）		
		契約額等		時価
		うち1年超		
				評価損益

市場取引	株価指数先物取引 買建			
	MINI S&P 500	443,968,591	433,952,583	10,016,008
	S&P 60	40,764,341	40,872,048	107,707
	SPI 200	33,911,460	34,000,560	89,100
	FTSE100INDEX	79,921,782	78,909,005	1,012,777
	FSMI INDEX	42,258,946	41,957,632	301,314
	EURO STOXX 50	98,702,406	99,389,268	686,862
	合 計	739,527,526	729,081,096	10,446,430

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成25年 8月20日現在)
1口当たり純資産額	1.4580 円
(1万口当たり純資産額)	(14,580 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) 中間貸借対照表 (単位:円)

区 分	注記 番号	当中間計算期間末 (平成25年 8月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,750,179
親投資信託受益証券		2,776,547,055
未収利息		3
流動資産合計		2,780,297,237
資産合計		2,780,297,237
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		573,949
未払委託者報酬		3,013,168

流動負債合計		3,587,117
負債合計		3,587,117
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,941,427,256
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		835,282,864
（分配準備積立金）		(150,358,942)
元本等合計		2,776,710,120
純資産合計		2,776,710,120
負債純資産合計		2,780,297,237

(2) 中間損益及び剰余金計算書 (単位：円)

区 分	注記 番号	当中間計算期間
		自 平成25年 2月21日 至 平成25年 8月20日
		金 額
営業収益		
受取利息		445
有価証券売買等損益		76,639,111
営業収益合計		76,639,556
営業費用		
受託者報酬		573,949
委託者報酬		3,013,168
営業費用合計		3,587,117
営業利益		73,052,439
経常利益		73,052,439
中間純利益		73,052,439
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		9,003,212
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		707,481,731
剰余金増加額又は欠損金減少額		113,666,741
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		113,666,741
剰余金減少額又は欠損金増加額		49,914,835
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		49,914,835
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		835,282,864

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

--	--

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 (平成25年 8月20日現在)
1 期首元本額	1,801,130,698円
期中追加設定元本額	267,378,501円
期中一部解約元本額	127,081,943円
2 受益権の総数	1,941,427,256口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 (平成25年 8月20日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	中間貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ ん。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済 されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿 価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載してありま す。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合 には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定において は一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、 当該価額が異なることもあります。

(有価証券関係に関する注記)

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	当中間計算期間末 (平成25年 8月20日現在)
1口当たり純資産額	1.4302 円
(1万口当たり純資産額)	(14,302 円)

「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

(1) 貸借対照表 (単位: 円)

区 分	注記 番号	(平成25年 8月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		886,166,156
コール・ローン		10,687,173
国債証券		232,275,940,494
派生商品評価勘定		300
未収利息		2,310,308,430
前払費用		69,879,844
流動資産合計		235,552,982,397
資産合計		235,552,982,397
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		154,500
未払解約金		82,786,298
流動負債合計		82,940,798
負債合計		82,940,798
純資産の部		
元本等		
元本	1	125,278,698,683
剰余金		
剰余金又は欠損金()		110,191,342,916
元本等合計		235,470,041,599
純資産合計		235,470,041,599
負債純資産合計		235,552,982,397

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 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>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成25年 8月20日現在)
1 期首元本額	147,784,834,580円
期中追加設定元本額	3,822,526,107円
期中一部解約元本額	26,328,662,004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	4,997,544,863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	11,352,443円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	1,477,201,030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	562,326,737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 >	2,355,174,381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>	26,497,765,871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>	100,780,557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>	10,579,837,745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>	7,724,009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>	83,463,894円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50A<適格機関投資家限定>	16,406,661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>	16,476,458,758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>	1,436,991,484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>	79,220,004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>	10,244,773,140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>	2,722,315,917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>	95,279,592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>	979,534,051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>	3,819,158,925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>	1,518,146,292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>	7,513,106,493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>	1,183,302,278円
ステート・ストリート世界4資産バランスV A45<適格機関投資家限定>	1,918,217,605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 >	3,778,410,044円
ステート・ストリート世界4資産バランスV A20<適格機関投資家限定>	75,036,403円
ステート・ストリート・グローバル4資産3 0VA<適格機関投資家限定>	160,734,795円
ステート・ストリート・グローバル4資産4 5VA<適格機関投資家限定>	127,445,813円

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	230,832,953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>	88,224,130円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 2 5 B <適格機関投資家限定>	1,307,341,540円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家限定>	14,746,483円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 3 5 B <適格機関投資家限定>	9,973,098円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 5 0 D <適格機関投資家限定>	100,191円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドV A 3 <適格機関投資家限定>	18,174,483,529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>	209,979,802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>	2,046,595,932円
ステート・ストリート世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	3,561,427,411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>	736,478,129円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	16,153,526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>	64,652,174円
計	125,278,698,683円
2 受益権の総数	125,278,698,683口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	(平成25年 8月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

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

（有価証券関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

（単位：円）

区分	種類	（平成25年 8月20日現在）			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカ・ドル	122,105,300		122,125,000	19,700
	ユーロ	188,858,500		188,993,000	134,500
	合計	310,963,800		311,118,000	154,200

（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、以下の方法により評価しております。

- ・ 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る場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成25年 8月20日現在)
1口当たり純資産額	1.8796 円
(1万口当たり純資産額)	(18,796 円)

2【ファンドの現況】

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

【純資産額計算書】

「債券重視型」

（平成25年9月30日現在）

資産総額	3,243,886,396 円
負債総額	1,793,514 円
純資産総額（ - ）	3,242,092,882 円
発行済数量	2,272,741,364 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	14,265 円

「標準型」

（平成25年9月30日現在）

資産総額	10,883,577,167 円
負債総額	13,369,787 円
純資産総額（ - ）	10,870,207,380 円
発行済数量	7,001,394,321 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	15,526 円

「株式重視型」

（平成25年9月30日現在）

資産総額	6,132,062,014 円
負債総額	8,709,327 円
純資産総額（ - ）	6,123,352,687 円
発行済数量	3,683,298,556 口
1万口当たり純資産額（ / ×10000 ）	16,625 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

(1) 資本金の額

平成25年9月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間ににおける資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

平成25年9月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数(本)	純資産総額合計額 (単位:億円)
追加型株式投資信託	200	23,870
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	16	2,547
単位型公社債投資信託	0	0
合計	216	26,418

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

3【委託会社等の経理状況】

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

1.財務諸表の作成方法について

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

2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,324,746		1,199,671
有価証券		8,309,605		6,810,580
前払費用	1	200,463	1	420,669
未収委託者報酬		1,465,803		1,578,598
未収運用受託報酬	1	778,921	1	957,692
未収投資助言報酬	1	154,740	1	158,845
繰延税金資産		273,967		360,157
その他		44,410		50,805
流動資産合計		12,552,657		11,537,020
固定資産				
有形固定資産				
建物	2	115,964	2	123,366
車両	2	2,970	2	1,731
器具備品	2	148,251	2	125,394
有形固定資産合計		267,186		250,493
無形固定資産				
ソフトウェア		1,228,624		1,068,747
ソフトウェア仮勘定		55,978		51,802
その他		8,171		8,139
無形固定資産合計		1,292,774		1,128,689
投資その他の資産				
投資有価証券		25,328,584		28,546,974
関係会社株式		-		66,222
差入保証金	1	283,591	1	285,266
繰延税金資産		437,364		172,442
その他		38		17
投資その他の資産合計		26,049,578		29,070,923
固定資産合計		27,609,540		30,450,106
資産合計		40,162,198		41,987,127

負債の部

流動負債

預り金		30,600		29,275
未払償還金		148,104		144,737
未払手数料	1	560,208	1	587,015
未払運用委託報酬		396,073		488,571
未払投資助言報酬		126,813		163,129
その他未払金	1	205,721	1	219,369
未払費用	1	122,185	1	80,370
未払法人税等		149,239		437,800
前受運用受託報酬		-		58
賞与引当金		538,159		745,159
その他		22,815		68,729
流動負債合計		2,299,923		2,964,217

固定負債

退職給付引当金		767,977		929,869
役員退職慰労引当金		13,630		12,650
その他	1	4,973		-
固定負債合計		786,580		942,519

負債合計		3,086,503		3,906,737
------	--	-----------	--	-----------

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		17,833,930		18,272,607
利益剰余金合計		18,513,737		18,952,414
株主資本合計		36,795,577		37,234,254

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		280,116		846,135
--------------	--	---------	--	---------

評価・換算差額等合計		280,116		846,135
------------	--	---------	--	---------

純資産合計		37,075,694		38,080,390
-------	--	------------	--	------------

負債・純資産合計

40,162,198

41,987,127

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	9,952,331		9,738,507	
運用受託報酬	3,987,169		5,029,976	
投資助言報酬	705,920		681,350	
業務受託料	47,100		47,100	
営業収益計	14,692,522		15,496,935	
営業費用				
支払手数料	4,131,652		4,096,763	
広告宣伝費	27,241		4,527	
公告費	323		-	
調査費	2,700,559		3,009,996	
支払運用委託報酬	1,294,778		1,372,587	
支払投資助言報酬	479,438		751,264	
委託調査費	42,633		44,108	
調査費	883,708		842,036	
委託計算費	101,748		104,631	
営業雑経費	390,063		447,523	
通信費	55,182		56,472	
印刷費	133,820		142,821	
協会費	17,984		19,986	
その他営業雑経費	183,076		228,242	
営業費用計	7,351,588		7,663,442	
一般管理費				
役員報酬	1	59,718	1	57,777
給料・手当		3,012,857		2,915,416
賞与引当金繰入額		537,887		726,623
賞与		260,246		224,092
福利厚生費		566,829		559,429
退職給付費用		156,575		208,549
役員退職慰労引当金繰入額		5,455		7,100
役員退職慰労金		650		-
其他人件費		115,587		121,504
不動産賃借料		632,434		619,902
その他不動産経費		27,417		26,829
交際費		14,037		11,456

旅費交通費		90,473		74,226
固定資産減価償却費		654,122		583,306
租税公課		79,628		80,741
業務委託費		179,945		163,637
器具備品費		151,259		134,449
保守料		87,228		88,640
保険料		60,291		60,440
寄付金		5,000		-
諸経費		56,644		41,887
一般管理費計		6,754,291		6,706,012
営業利益		586,642		1,127,480
営業外収益				
受取利息		1,966		172
有価証券利息		93,236		86,415
受取配当金		45,856		79,789
補助金収入		-		9,500
その他営業外収益		17,359		10,147
営業外収益計		158,419		186,025
営業外費用				
為替差損		6,419		15,251
賃貸借契約解約損		4,124		-
控除対象外消費税		-		5,693
その他営業外費用		1,248		646
営業外費用計		11,792		21,591
経常利益		733,269		1,291,913
特別利益				
投資有価証券売却益		25,290		125,271
投資有価証券償還益		-		1,755
事故受取保険金	3	14,136		-
清算配当金	5	59,327		-
特別利益計		98,754		127,026
特別損失				
投資有価証券売却損		1,778		400,864
投資有価証券償還損		87,378		4,005
固定資産除却損	4	19,104	4	8,268
事故損失賠償金	2	39,244	2	58
特別損失計		147,506		413,196
税引前当期純利益		684,516		1,005,743
法人税、住民税及び事業税		263,157		557,322
法人税等調整額		77,232		125,815
法人税等合計		340,390		431,507
当期純利益		344,126		574,236

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成23年4月1日	(自	平成24年4月1日
	至	平成24年3月31日)	至	平成25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	17,625,364	17,833,930
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	17,833,930	18,272,607
利益剰余金合計		
当期首残高	18,305,171	18,513,737
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	18,513,737	18,952,414
株主資本合計		
当期首残高	36,587,011	36,795,577
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236
当期変動額合計	208,566	438,676
当期末残高	36,795,577	37,234,254
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	227,494	280,116
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	52,622	566,019
当期変動額合計	52,622	566,019
当期末残高	280,116	846,135
評価・換算差額等合計		
当期首残高	227,494	280,116
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	52,622	566,019
当期変動額合計	52,622	566,019
当期末残高	280,116	846,135
純資産合計		
当期首残高	36,814,506	37,075,694
当期変動額		
剰余金の配当	135,560	135,560
当期純利益	344,126	574,236

株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	52,622	566,019
当期変動額合計	261,188	1,004,695
当期末残高	37,075,694	38,080,390

（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。

関係会社株式

移動平均法に基づく原価法によっております。

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。

（会計方針の変更）

平成23年度の税制改正に伴い、当事業年度より、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。この結果、従来の方法に比べて、当事業年度の減価償却費が3,082千円減少し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益が3,082千円増加しております。

(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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
前払費用	52,725千円	54,152千円
未収運用受託報酬	383,091	493,954
未収投資助言報酬	135,967	133,324
差入保証金	280,262	280,262
未払手数料	90,057	112,306
その他未払金	19,525	35,771
未払費用	59,677	12,606
その他固定負債	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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
建物	206,955千円	232,440千円
車両	4,043	5,282
器具備品	573,767	599,393
計	784,767	837,116

(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	40,000千円

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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
器具備品	11,393千円	3,568千円
その他	7,711	4,700
計	19,104	8,268

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において、次のとおり決議しております。

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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24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24年3月31日

効力発生日 平成24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25年6月24日開催の定時株主総会において、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25年3月31日

効力発生日 平成25年6月24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
（単位：千円）			
	当事業年度（平成25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	589	273
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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）	
1年内	174	186	
1年超	287	108	
合計	462	295	
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23年4月1日 至平成24年3月31日）	当事業年度 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）	
支払リース料	361	186	
減価償却費相当額	330	172	
支払利息相当額	19	12	
<p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</p>			

（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さないよう、分離して行っております。

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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	-

当事業年度（平成25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	1,199,671	1,199,671	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,010,860	4,020,850	9,989
その他有価証券	2,799,720	2,799,720	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	21,902,802	22,023,000	120,197
その他有価証券	6,576,671	6,576,671	-

（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、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、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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	-	66,222

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。

また、関係会社株式は、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、記載しておりません。

(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。

当事業年度(平成25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	1,199,671	-	-	-
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	21,800,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	3,606,000	2,706,150	989,200	-
合計	8,805,671	24,506,150	989,200	-

(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

当事業年度（平成25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	25,913,663	26,043,000	130,186
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	25,913,663	26,043,000	130,186
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)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		25,913,663	26,043,000	130,186

2. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成25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	2,799,720	2,799,436	283
	国債・地方債等	2,799,720	2,799,436	283
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	5,851,826	4,439,350	1,412,476
	小計	8,651,546	7,238,786	1,412,760
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）	724,845	808,500	83,654
	小計	724,845	808,500	83,654
	合計	9,376,391	8,047,286	1,329,105

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式、関係会社株式については、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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
非上場株式	67,500千円	67,500千円
関係会社株式	- 千円	66,222千円

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	2,175,318	125,271	400,864
合計	2,175,318	125,271	400,864

(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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
(1)退職給付債務	767,977千円	929,869千円
(2)退職給付引当金	767,977千円	929,869千円

(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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
(1)勤務費用	132,222千円	186,034千円
(2)退職給付負担金	24,353千円	22,515千円

(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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25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	45,640千円	44,561千円

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 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25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	204,554千円	283,235千円
未払事業税	19,923	38,976
その他	49,981	38,054
繰延税金資産合計	274,458	360,265
繰延税金負債		
有価証券評価差額	491	107
繰延税金負債合計	491	107
繰延税金資産の純額	273,967	360,157
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	276,081	333,409
役員退職慰労引当金	4,857	2,339
税務上の繰延資産償却超過額	2,519	4,508
投資有価証券評価損	472,994	492,770
投資有価証券評価差額	212,965	31,716
その他	6,911	3,505
小計	976,328	868,247
評価性引当額	106,755	95,324
繰延税金資産合計	869,573	772,923
繰延税金負債		
特別分配金否認	50,467	85,903
投資有価証券評価差額	381,742	514,578
繰延税金負債合計	432,209	600,481
繰延税金資産の純額	437,364	172,442
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 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.00%	法定実効税率 38.01%
(調整)		(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.93	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.38
住民税均等割	0.85	住民税均等割 0.58
税率変更に伴う影響	9.27	税率変更に伴う影響 3.66
その他	1.32	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.44
税効果会計適用後の法人税等の負担率	49.73	その他 0.71
		税効果会計適用後の法人税等の負担率 42.90

（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

（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

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25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	2,745,589

[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	-	-

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25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	2,098,663	未収運用受託報酬	493,954
								投資助言報酬の受取	599,826	未収投資助言報酬	133,324
								業務受託料の受取	47,100	-	-
								関係会社株式の取得	66,222	-	-

(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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	341,875円31銭	351,139円62銭
1株当たり当期純利益金額	3,173円18銭	5,295円04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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益	344,126千円	574,236千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	344,126千円	574,236千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

平成25年10月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

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25年2月22日から平成25年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成25年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年2月22日から平成25年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年10月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

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25年2月22日から平成25年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の平成25年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年2月22日から平成25年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- 1．上記は、当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 - 2．中間財務諸表の範囲には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6月7日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成25年10月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

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25年2月22日から平成25年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成25年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年2月22日から平成25年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)