

【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26年3月7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（平成25年11月21日および平成25年12月13日をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み、以下「原届出書」ということがあります）の記載事項を、信託約款の変更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。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

<訂正前>

（略）

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。

<訂正後>

（略）

以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」、「ベビーファンド」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。

（４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

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。

（略）

<訂正後>

取得申込受付日の翌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。

（略）

（12）【その他】

原届出書「第一部 証券情報」「（12） その他」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

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まれます）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】

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」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。

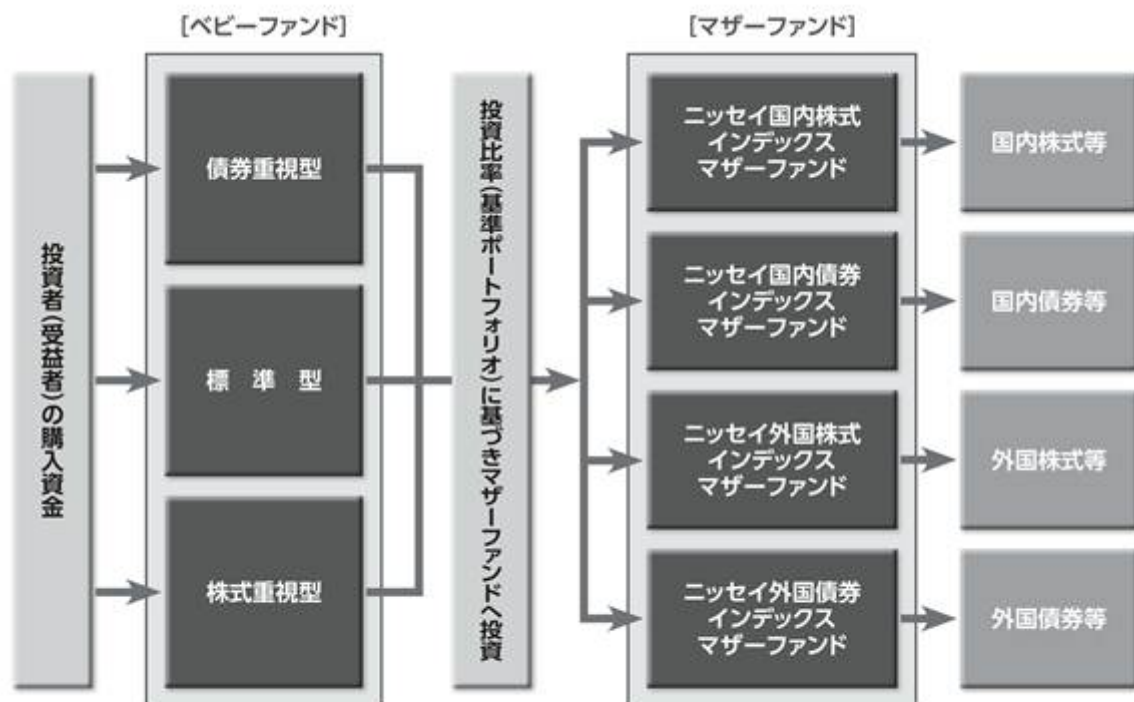
基本方針

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「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」、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ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

マザーファンドを通じて、実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券に投資します。

- ・各ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。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。



■ マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にもない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

主要投資対象とする4つのマザーファンドを通じて、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マザーファンド(以下「国内株式インデックス」ということ
があります)

- ・国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数)¹の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド(以下「国内債券インデックス」ということ
があります)

- ・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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(以下「外国株式インデックス」ということ
があります)

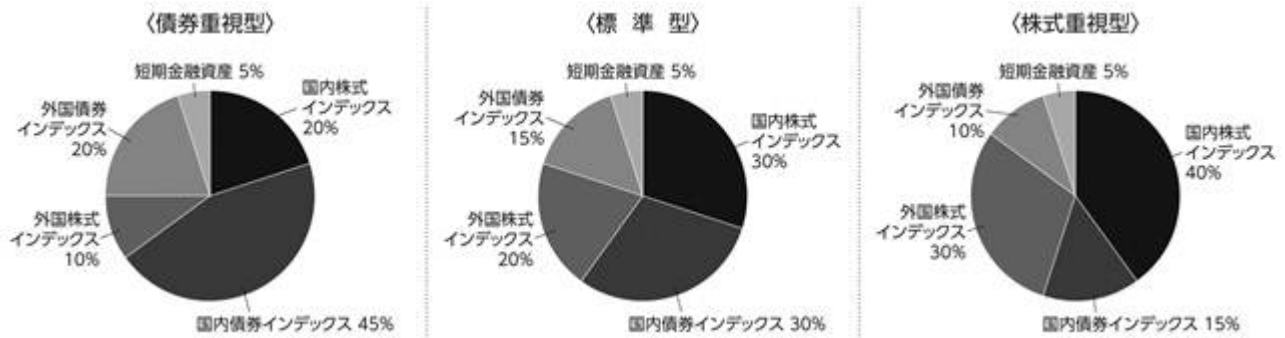
- ・日本を除く世界の主要先進国の株式に投資することにより、MSCI コクサイ指数(円換算ベース)³の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド(以下「外国債券インデックス」ということ
があります)

- ・日本を除く世界の主要国の国債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、円換算ベース)⁴の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

- 1 TOPIX(東証株価指数)とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行うことができます。
- 2 NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。
- 3 MSCI コクサイ指数(円換算ベース)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。
なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。
- 4 シティグループ世界国債指数(除く日本、円換算ベース)とは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した債券指数で、日本を除く世界の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・マーケッツ・インクに帰属します。シティグループ・グローバル・マーケッツ・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。
なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

- ・運用にあたっては、以下の各マザーファンドへの投資比率（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

(略)

ファンドの分類

(略)

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

(略)

属性区分表

その他資産 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(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う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。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での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の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】

<訂正前>

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

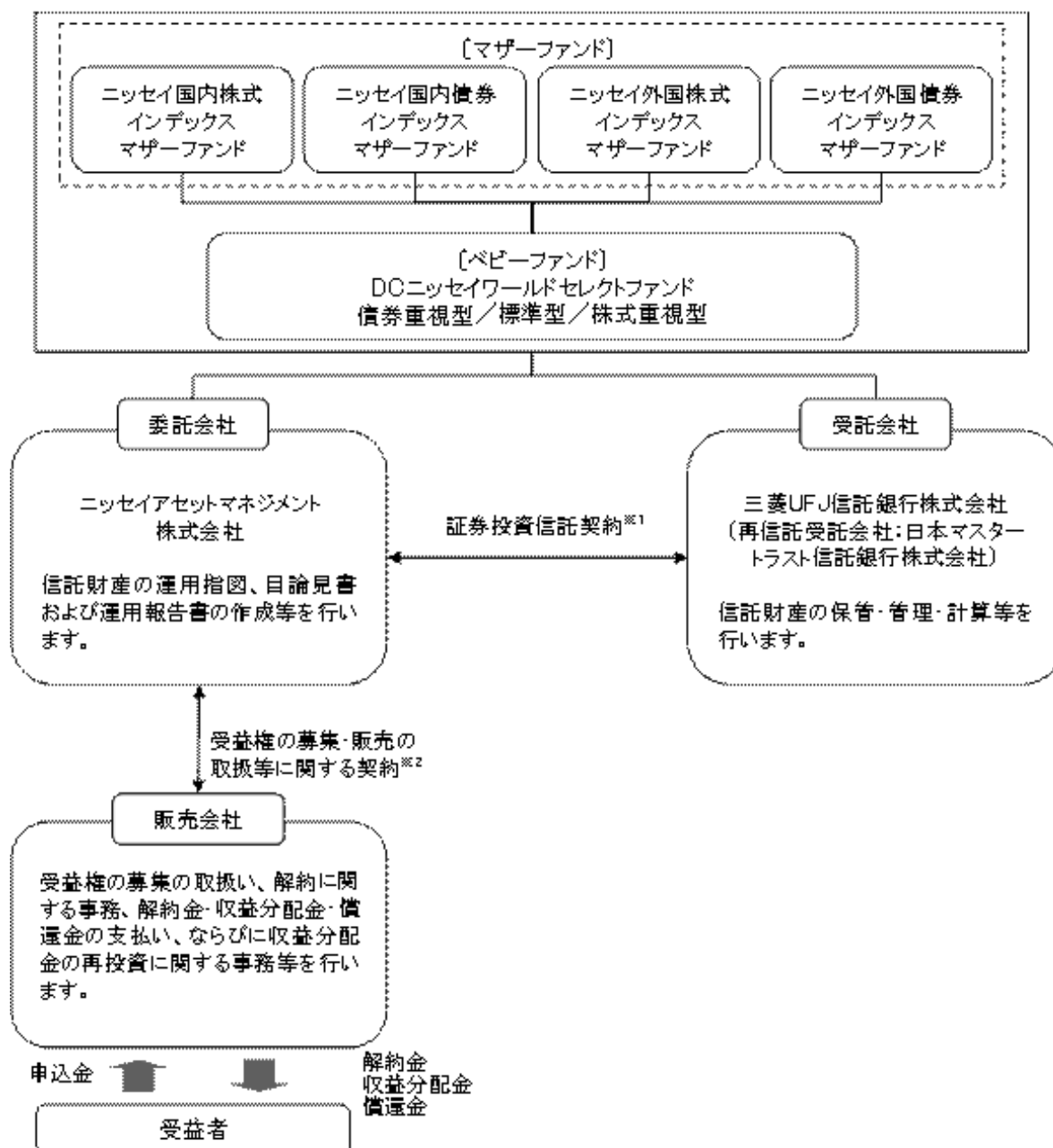
<訂正後>

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

平成26年3月7日 ファンドの仕組みをファンド・オブ・ファンズ方式から、ファミリーファンド方式へ変更し、購入・換金の際に適用される基準価額を購入・換金申込受付日の翌々営業日から翌営業日へ変更、換金代金の支払開始日を換金申込受付日から起算して、原則として6営業日目から5営業日目へと短縮する変更、および実質的な運用管理費用（信託報酬）の料率（年率）を引下げ

(3) 【ファンドの仕組み】

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」「(3) ファンドの仕組み」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 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。

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】

(1)【投資方針】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」「(1) 投資方針」について、以下の通り記載内容を訂正いたします。

下記の各マザーファンド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。

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

各マザーファンドへの投資比率（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。

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、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

a 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。

b 投資態度

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。

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。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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マザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、主に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

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

国内の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

同一銘柄の転換社債、ならびに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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、MSCI コクサイ指数(円換算ベース)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

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCI コクサイ指数(円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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。

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10%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割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、シティグループ世界国債指数(除く日本、円換算ベース)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

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

b 投資態度

主として、日本を除く世界主要先進国の国債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、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入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。

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、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)の新株予約権をいいます。

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。

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割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

(2) 【投資対象】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」「(2) 投資対象」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。

a 主な投資対象

下記の各マザーファンド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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

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. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記「(5)投資制限 b 約款に定めるその他の投資制限 先物取引等、スワップ取引 および 金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります)
 - ハ. 金銭債権(イ.およびニ.に掲げるものに該当するものを除きます)
 - ニ. 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
主にニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「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」、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」(以下「マザーファンド」といいます)のほか、次の1. から22. までに掲げる有価証券(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ます)に投資します。
 1. 株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 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(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます)の新株引受権証券を除きます)
 6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます)
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます)
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます)
 9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ)および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から11. の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(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)
 14. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます)
 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます)
 16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります)
 17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます)
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 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)

20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

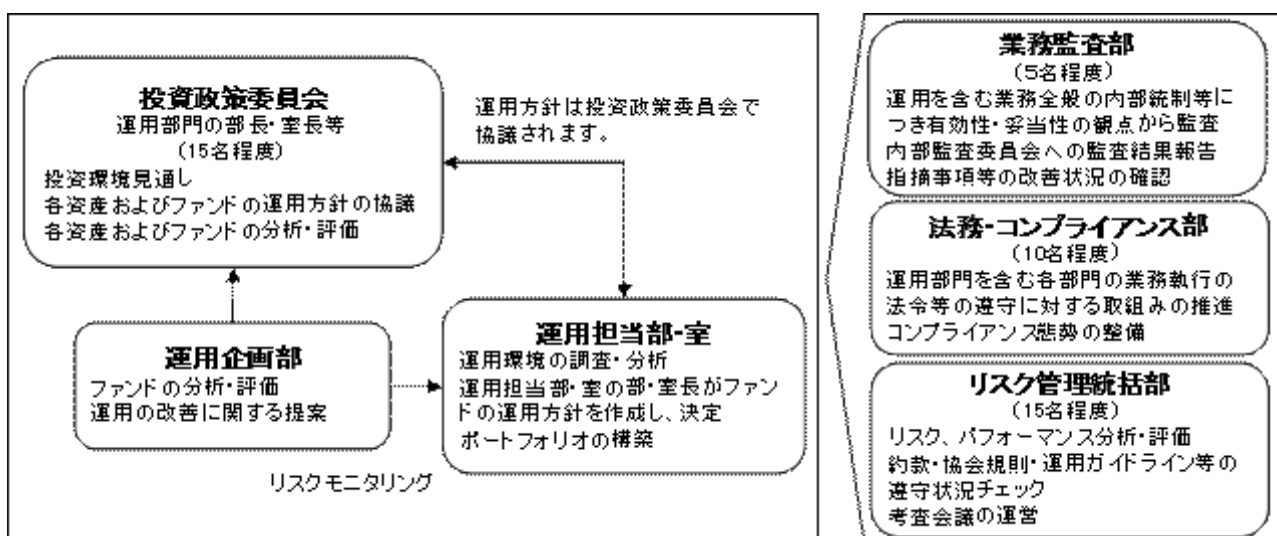
（略）

（3）【運用体制】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」「（3）運用体制」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。

（略）

内部管理体制および意思決定を監督する組織



（略）

(5)【投資制限】

<訂正前>

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せん。
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償還金の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合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れ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。

<訂正後>

a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合

<u>債券重視型</u>	信託財産の純資産総額の45%以下
<u>標準型</u>	信託財産の純資産総額の65%以下
<u>株式重視型</u>	信託財産の純資産総額の85%以下

外貨建資産への実質投資割合

<u>債券重視型</u>	信託財産の純資産総額の45%以下
<u>標準型</u>	信託財産の純資産総額の50%以下
<u>株式重視型</u>	信託財産の純資産総額の55%以下

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）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。

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10%以下とします。

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5%以下とします。

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。

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

1. 投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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。

2. 前記1.にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、投資することができます。

信用取引の範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

2. 前記1.の信用取引は、当該売付けにかかる建玉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.の売付けにかかる建玉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売付けの一部を決済するものとし、

先物取引等

1. 国内の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとし、（以下同じ）。

2. 国内の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことができます。

3. 国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

スワップ取引

1. 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。

2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部を解約するものとします。
 4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
 5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。
- 金利先渡取引および為替先渡取引
1. 信託財産を効率的に運用するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
 2. 金利先渡取引および為替先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 4. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。
- 有価証券の貸付けおよび範囲
1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
 - ・ 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ・ 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 2. 前記1.に定める限度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契約の一部を解約するものとします。
 3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとします。
- 有価証券の空売り
1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことができます。
 2. 前記1.の売付けは、当該売付けにかかる有価証券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.の売付けにかかる有価証券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売付けの一部を決済するものとします。
- 有価証券の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券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有価証券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.の借入れにかかる有価証券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有価証券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。

外国為替予約等

1. 信託財産を効率的に運用するため、外国為替の売買の予約取引を行うことができます。
2. 前記1.の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。
3. 前記2.の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。
4. 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。
5. 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

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償還金の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、資金借入額は借入れ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。

c 法令に定める投資制限

デリバティブ取引等(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)

金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます)を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「3 投資リスク」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（マザーファンドを含みます）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

（略）

・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。

・ファミリーファンド方式に関する留意点

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

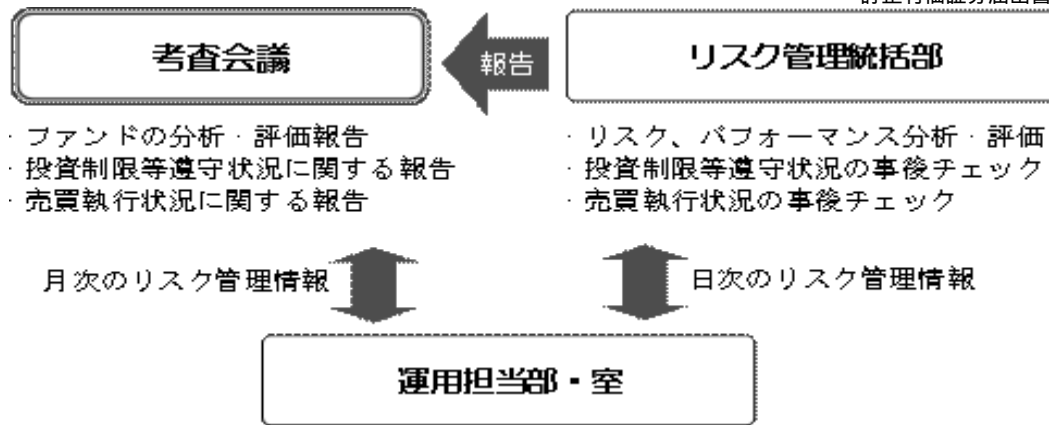
・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社および委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は平成26年1月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に保有しています。

当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた実質保有比率（％）	
	委託会社	日本生命保険相互会社
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	-	51.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	20.7	-

（2）投資リスク管理体制



1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
(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%

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（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。

「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。

<訂正後>

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以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

ファンド	信託報酬率	配分（税抜）		
		委託会社	販売会社	受託会社
債券重視型	0.189% ¹ （税抜0.18%）	0.08%	0.07%	0.03%
標準型	0.210% ² （税抜0.20%）	0.09%	0.08%	0.03%
株式重視型	0.231% ³ （税抜0.22%）	0.10%	0.09%	0.03%

1 消費税率が8%になった場合は、年0.1944%となります。

2 消費税率が8%になった場合は、年0.2160%となります。

3 消費税率が8%になった場合は、年0.2376%となります。

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。

（4）【その他の手数料等】

<訂正前>

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
-------	-------

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)

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。（略）

< 訂正後 >

証券取引の手数料等

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

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 0.00210%	(税抜0.002%)
50億円超	100億円以下	の部分	年 0.00525%
			(税抜0.005%)
10億円超	50億円以下	の部分	年 0.00735%
			(税抜0.007%)
	10億円以下	の部分	年 0.04200%
			(税抜0.040%)

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 0.00540%
			(税抜0.005%)
10億円超	50億円以下	の部分	年 0.00756%
			(税抜0.007%)
	10億円以下	の部分	年 0.04320%
			(税抜0.040%)

(略)

信託財産留保額

ありません。

(略)

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

申込受付

（略）

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、申込みの受付けを中止することおよび既に受付けた申込みの受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。

（略）

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。

（略）

<訂正後>

申込受付

（略）

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、申込みの受付けを中止することおよび既に受付けた申込みの受付けを取消すことがあります。

（略）

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（略）

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

（略）

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。

（略）

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。

（略）

<訂正後>

（略）

換金価額

換金請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

換金手数料はありません。

（略）

支払開始日

換金請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

(略)

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<訂正前>

(略)

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。

(略)

<訂正後>

(略)

ファンドおよびマザー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
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	証券取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。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、償却原価法で評価します。
外国株式	証券取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
外国債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。
国内債券先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

(略)