

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年5月21日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 宇治原 潔
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集(売 出)内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	継続募集額 各ファンドにつき以下を上限とします。 DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) 1兆円 DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) 1兆円 DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) 1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

- DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）
- DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）
- DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」、「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。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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。

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

なお、委託会社へは後記「（8）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成26年5月22日（木）～平成27年5月21日（木）

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

（８）【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時~午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

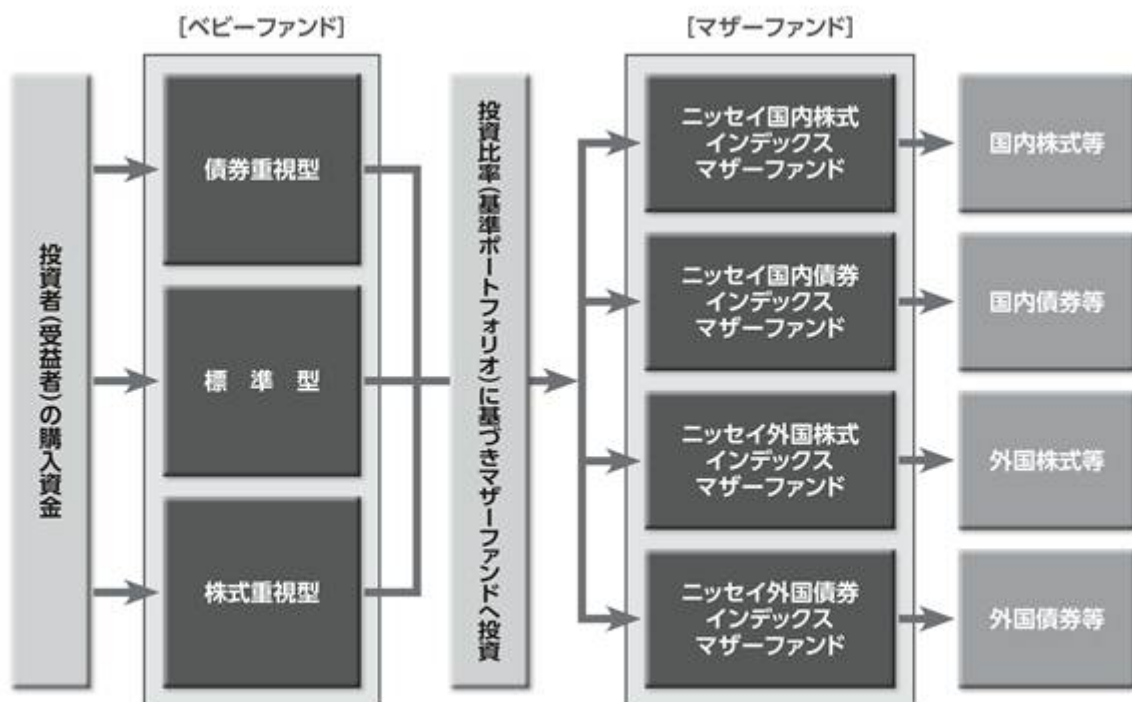
基本方針

ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度向けのファンドであり、主として「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）

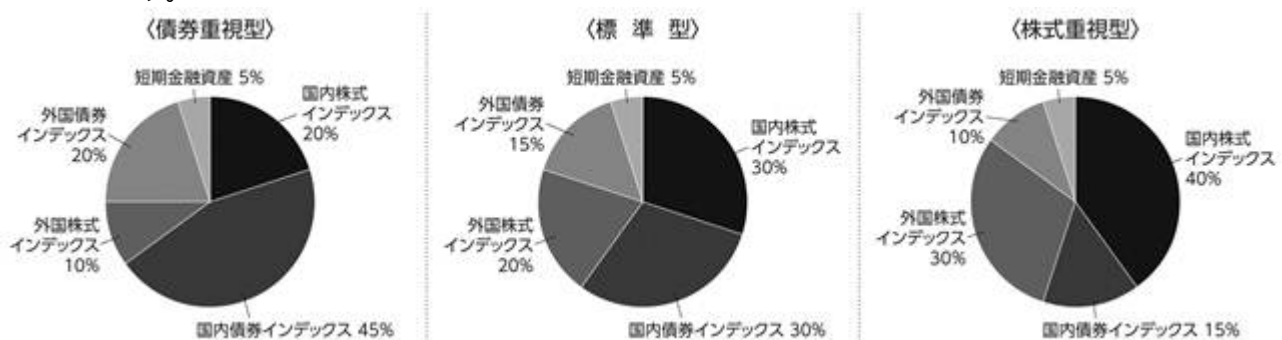
- ・国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数)¹の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

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。

- 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。
 - 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。
 - 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。
- 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

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

ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
追 加 型	海 外	債 券
	内 外	不動産投信
		その他資産
		()
		資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ

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

商品分類表

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

属性区分表

その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式・債券)資 産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(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。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式および公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本含む)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	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。

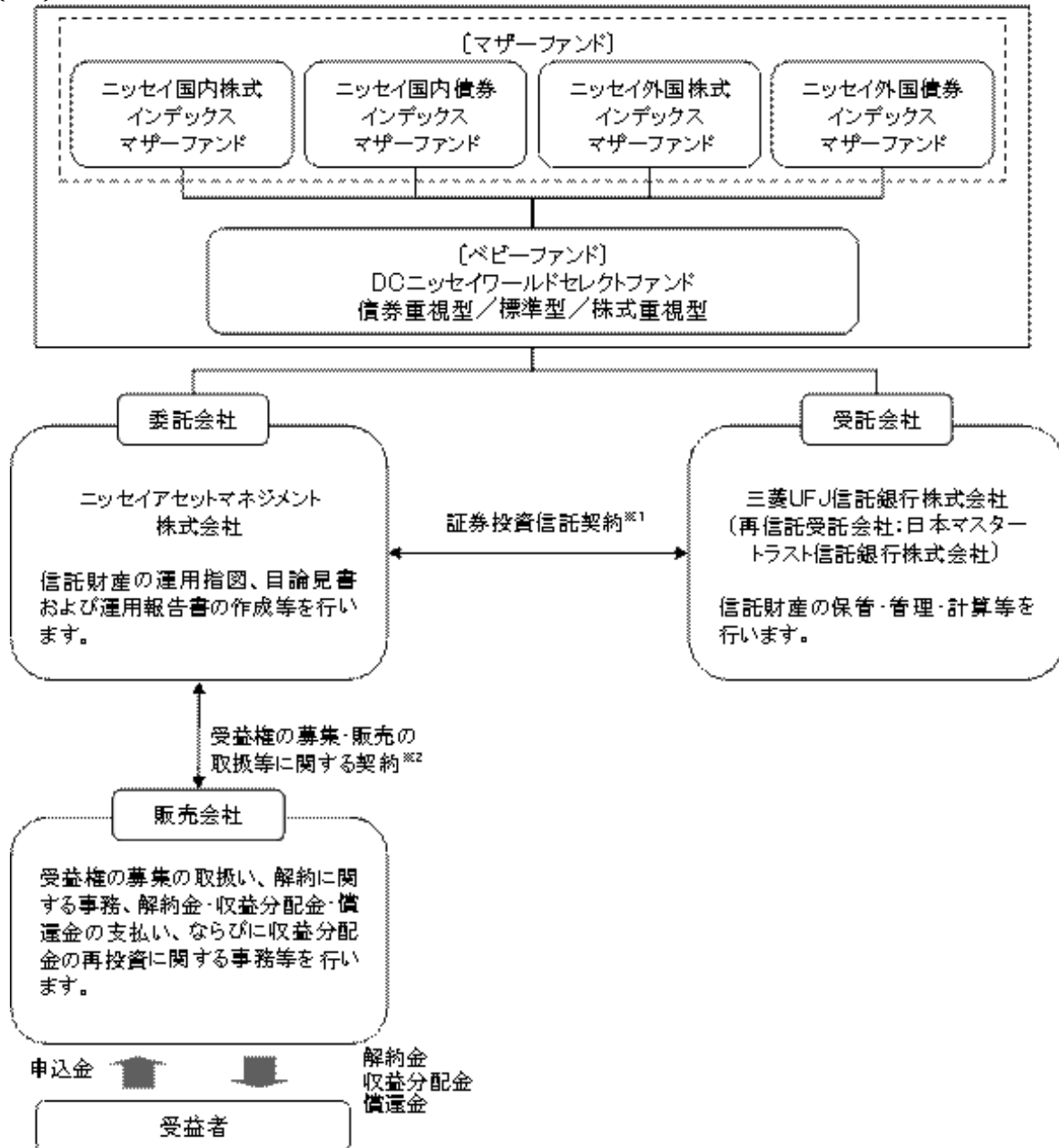
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、
一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

(2) 【ファンドの沿革】

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】



- 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對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26年3月末現在）

- 1 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
- 2 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号

3. 資本金の額 : 100億円
 4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 宇治原 潔
 5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
 6. 設立年月日 : 平成7年4月4日
 7. 沿革

- 昭和60年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
- 平成7年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
- 平成10年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
- 平成12年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

8. 大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等と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】

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)

ハ. 金銭債権(イ.および二.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ます。有価証券にかかるものに限りません)
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せん)
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

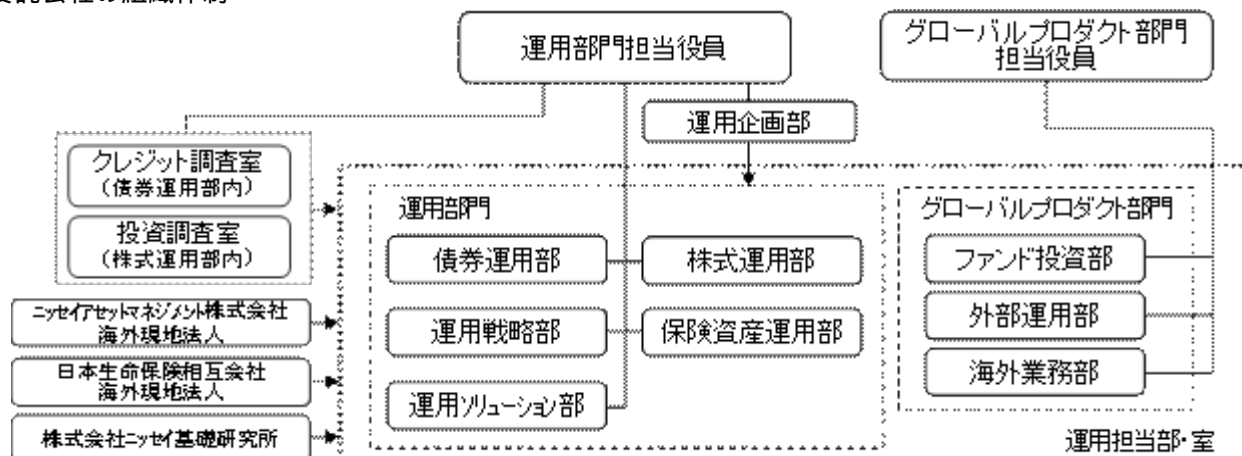
信託金を前記に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下において同じ)により運用することができます。

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

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

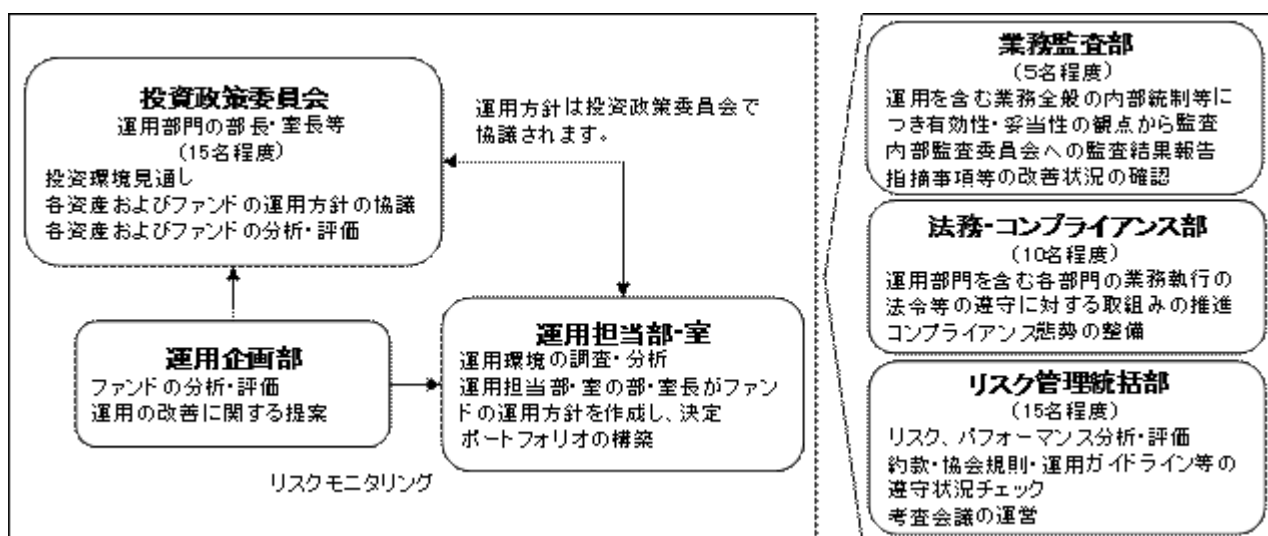
(3) 【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性について、監査人による報告書を定期的に受託会社より受取っています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

分配時期

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

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。

< 分配金再投資コースの場合 >

自動的に再投資されます。

将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合

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

債券重視型	信託財産の純資産総額の45%以下
標準型	信託財産の純資産総額の50%以下
株式重視型	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ます(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し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解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入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券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】

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・短期金融資産の運用に関するリスク

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

・為替変動リスク

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

・流動性リスク

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

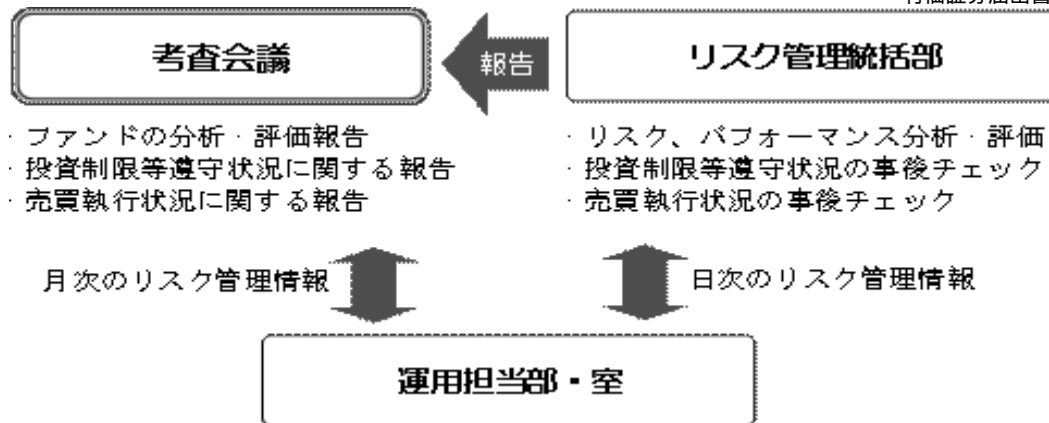
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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	0.1944%（税抜 0.18%）	0.08%	0.07%	0.03%
標準型	0.2160%（税抜 0.20%）	0.09%	0.08%	0.03%
株式重視型	0.2376%（税抜 0.22%）	0.10%	0.09%	0.03%

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】

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	0.00216%	(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%)

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

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

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」

(平成26年3月31日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	3,240,607,124	94.97
内 日本	3,240,607,124	94.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	171,579,002	5.03
純資産総額	3,412,186,126	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。

「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」

(平成26年3月31日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	10,775,677,352	94.96
内 日本	10,775,677,352	94.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	572,246,569	5.04
純資産総額	11,347,923,921	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。

「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」

(平成26年3月31日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	6,117,676,710	94.91
内 日本	6,117,676,710	94.91
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	328,281,909	5.09
純資産総額	6,445,958,619	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。

(参考情報)

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」

(平成26年3月31日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	36,808,056,270	94.99
内 日本	36,808,056,270	94.99

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,943,160,114	5.01
純資産総額	38,751,216,384	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。

その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）	1,900,740,000	4.90
内 日本	1,900,740,000	4.90

（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。

その他資産として、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。

（参考情報）

「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」

（平成26年3月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	26,655,063,490	99.34
内 日本	26,655,063,490	99.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	177,054,194	0.66
純資産総額	26,832,117,684	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。

（参考情報）

「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」

（平成26年3月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	31,797,431,737	99.22
内 アメリカ	18,008,699,192	56.20
内 イギリス	2,862,531,185	8.93
内 スイス	1,516,124,968	4.73
内 カナダ	1,465,056,084	4.57
内 フランス	1,424,820,635	4.45
内 ドイツ	1,352,292,464	4.22
内 オーストラリア	1,050,826,947	3.28
内 オランダ	685,119,871	2.14

内	スペイン	524,666,670	1.64
内	スウェーデン	493,967,052	1.54
内	香港	360,271,751	1.12
内	イタリア	343,444,085	1.07
内	アイルランド	315,862,125	0.99
内	デンマーク	208,464,662	0.65
内	シンガポール	207,597,993	0.65
内	ベルギー	184,707,124	0.58
内	ジャージー	140,546,422	0.44
内	オランダ領キュラソー	139,411,758	0.44
内	ノルウェー	124,805,779	0.39
内	フィンランド	120,103,165	0.37
内	イスラエル	55,728,671	0.17
内	バミューダ	49,719,732	0.16
内	オーストリア	38,866,944	0.12
内	ルクセンブルグ	37,178,016	0.12
内	ケイマン諸島	21,258,229	0.07
内	イギリス領バージン諸島	20,657,176	0.06
内	ポルトガル	19,425,151	0.06
内	マン島	13,833,729	0.04
内	ガーンジー	11,444,157	0.04
投資証券		651,868,392	2.03
	内 アメリカ	478,091,498	1.49
	内 オーストラリア	89,450,439	0.28
	内 フランス	33,691,849	0.11
	内 イギリス	32,071,892	0.10
	内 香港	18,562,714	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		403,252,759	1.26
純資産総額		32,046,047,370	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。

その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）	852,725,728	2.66
内 アメリカ	571,329,504	1.78
内 ドイツ	281,396,224	0.88

（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。

その他資産として、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。

（参考情報）

「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」

（平成26年3月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	6,034,135,392	97.95
内 アメリカ	2,294,398,843	37.24
内 ドイツ	650,875,425	10.57
内 イタリア	646,101,832	10.49
内 フランス	633,474,245	10.28
内 イギリス	477,318,817	7.75
内 スペイン	346,030,335	5.62
内 ベルギー	178,006,891	2.89
内 オランダ	171,760,354	2.79
内 カナダ	138,385,565	2.25
内 オーストリア	107,375,910	1.74
内 オーストラリア	96,991,279	1.57
内 メキシコ	62,741,252	1.02
内 アイルランド	52,278,254	0.85
内 ポーランド	42,614,993	0.69
内 スウェーデン	33,273,982	0.54
内 マレーシア	31,288,636	0.51
内 南アフリカ	29,559,289	0.48
内 ノルウェー	20,848,316	0.34
内 シンガポール	20,811,174	0.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	126,161,382	2.05
純資産総額	6,160,296,774	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】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成26年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 （%） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,233,020,881	1.2528 1,544,767,074	1.2511 1,542,632,424	- -	45.21%
2	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	558,803,756	1.2083 675,227,356	1.2270 685,652,208	- -	20.09%
3	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	586,510,941	1.1510 675,114,488	1.1483 673,490,513	- -	19.74%
4	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	292,373,785	1.1454 334,893,004	1.1589 338,831,979	- -	9.93%

（注）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	国内 / 外国	業種	投資比率（%）
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	94.97
	小計		94.97
合 計（対純資産総額比）			94.97

（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。

【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。

「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 （%） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,741,763,726	1.2526 3,434,545,384	1.2511 3,430,220,597	- -	30.23%

2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	2,934,698,184	1.1525 3,382,458,566	1.1483 3,369,913,924	- -	29.70%
3	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,950,406,643	1.1451 2,233,414,771	1.1589 2,260,326,258	- -	19.92%
4	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,397,894,518	1.2082 1,689,019,334	1.2270 1,715,216,573	- -	15.11%

（注）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	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	94.96
	小計		94.96
合 計（対純資産総額比）			94.96

（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。

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。

「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 （％） 償還日	投資 比率
1	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	2,228,269,903	1.1532 2,569,713,666	1.1483 2,558,722,329	- -	39.69%
2	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	1,666,132,469	1.1451 1,907,891,744	1.1589 1,930,880,918	- -	29.95%

3	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	780,772,505	1.2526 978,052,237	1.2511 976,824,481	- -	15.15%
4	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	530,765,267	1.2082 641,323,410	1.2270 651,248,982	- -	10.10%

（注）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	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	94.91
	小計		94.91
合 計（対純資産総額比）			94.91

（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。

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。

（参考情報）

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 （％） 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	299,900	5,869.06 1,760,134,000	5,826.00 1,747,217,400	- -	4.51%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,610,700	603.00 971,252,100	567.00 913,266,900	- -	2.36%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	104,400	7,561.15 789,384,800	7,800.00 814,320,000	- -	2.10%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	160,800	4,764.14 766,075,200	4,409.00 708,967,200	- -	1.83%

5	本田技研 日本	株式 輸送用機器	193,900	3,655.97 708,892,800	3,634.00 704,632,600	- -	1.82%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	2,753,100	212.28 584,437,400	204.00 561,632,400	- -	1.45%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	83,600	5,639.66 471,476,300	5,619.00 469,748,400	- -	1.21%
8	ファナック 日本	株式 電気機器	24,000	16,694.41 400,666,000	18,205.00 436,920,000	- -	1.13%
9	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	133,800	3,298.35 441,319,800	3,240.00 433,512,000	- -	1.12%
10	武田薬品 日本	株式 医薬品	84,500	4,792.63 404,978,000	4,892.00 413,374,000	- -	1.07%
11	キヤノン 日本	株式 電気機器	124,900	3,093.94 386,433,600	3,191.00 398,555,900	- -	1.03%
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	66,000	5,739.18 378,786,300	5,976.00 394,416,000	- -	1.02%
13	日立 日本	株式 電気機器	517,000	791.09 408,996,000	762.00 393,954,000	- -	1.02%
14	三菱地所 日本	株式 不動産業	149,000	2,473.57 368,563,000	2,446.00 364,454,000	- -	0.94%
15	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	88,900	3,940.35 350,297,500	3,944.00 350,621,600	- -	0.90%
16	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	260,000	1,232.73 320,510,400	1,224.00 318,240,000	- -	0.82%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	165,900	1,961.95 325,488,800	1,916.00 317,864,400	- -	0.82%
18	三井不動産 日本	株式 不動産業	100,000	3,155.00 315,500,000	3,149.00 314,900,000	- -	0.81%
19	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	39,600	7,561.53 299,436,800	7,606.00 301,197,600	- -	0.78%
20	パナソニック 日本	株式 電気機器	246,100	1,135.04 279,335,800	1,173.00 288,675,300	- -	0.74%
21	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先物取引業	434,700	693.70 301,551,600	662.00 287,771,400	- -	0.74%
22	三井物産 日本	株式 卸売業	195,800	1,556.99 304,859,400	1,459.00 285,672,200	- -	0.74%

23	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	175,200	1,654.22 289,820,800	1,628.00 285,225,600	- -	0.74%
24	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	302,400	910.27 275,266,800	920.00 278,208,000	- -	0.72%
25	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	954,000	298.42 284,700,000	282.00 269,028,000	- -	0.69%
26	デンソー 日本	株式 輸送用機器	53,200	5,391.97 286,853,000	4,948.00 263,233,600	- -	0.68%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	70,700	3,594.57 254,136,700	3,660.00 258,762,000	- -	0.67%
28	東京海上HD 日本	株式 保険業	82,400	3,080.56 253,838,800	3,098.00 255,275,200	- -	0.66%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	215,000	1,165.88 250,665,000	1,162.00 249,830,000	- -	0.64%
30	信越化学 日本	株式 化学	40,500	5,543.34 224,505,600	5,898.00 238,869,000	- -	0.62%

（注）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	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	12.05
		輸送用機器	11.17
		銀行業	8.88
		情報・通信業	6.95
		化学	5.15
		機械	4.92
		卸売業	4.40
		医薬品	4.36
		小売業	4.05
		食料品	3.74
		陸運業	3.61
		不動産業	3.15
		建設業	2.40
		サービス業	2.32
		保険業	2.10
電気・ガス業	2.05		
証券、商品先物取引業	1.57		

	鉄鋼	1.50
	その他製品	1.39
	精密機器	1.35
	その他金融業	1.22
	ガラス・土石製品	0.99
	非鉄金属	0.96
	ゴム製品	0.88
	繊維製品	0.69
	金属製品	0.67
	石油・石炭製品	0.56
	空運業	0.49
	鉱業	0.46
	海運業	0.35
	パルプ・紙	0.28
	倉庫・運輸関連業	0.22
	水産・農林業	0.07
	小計	94.99
合計（対純資産総額比）		94.99

（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。

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

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2606月	買建	158	1,888,714,310	1,900,740,000	4.90%

（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す。

（注2）先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

（参考情報）

「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	第105回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	2,018,000,000	100.29 2,023,922,620	100.27 2,023,488,960	0.200000 2017/6/20	7.54%
2	第303回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	1,886,000,000	106.62 2,010,942,620	106.40 2,006,779,440	1.400000 2019/9/20	7.48%
3	第72回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	1,747,000,000	114.95 2,008,223,030	114.54 2,001,171,030	2.100000 2024/9/20	7.46%
4	第125回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	1,743,000,000	115.13 2,006,889,060	114.66 1,998,523,800	2.200000 2031/3/20	7.45%
5	第26回 利付国債(30年) 日本	国債 証券	1,728,000,000	115.90 2,002,840,300	114.68 1,981,774,080	2.400000 2037/3/20	7.39%
6	第92回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	1,524,000,000	115.67 1,762,932,680	115.13 1,754,718,360	2.100000 2026/12/20	6.54%
7	第271回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	1,452,000,000	101.47 1,473,367,980	101.36 1,471,848,840	1.200000 2015/6/20	5.49%
8	第285回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	1,084,000,000	104.87 1,136,858,720	104.72 1,135,251,520	1.700000 2017/3/20	4.23%
9	第103回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	1,003,000,000	100.59 1,008,930,250	100.57 1,008,777,280	0.300000 2017/3/20	3.76%
10	第318回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	967,000,000	104.49 1,010,447,400	104.23 1,007,971,790	1.000000 2021/9/20	3.76%
11	第287回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	899,000,000	105.90 952,070,960	105.73 950,575,630	1.900000 2017/6/20	3.54%
12	第312回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	802,000,000	105.99 850,090,440	105.78 848,411,740	1.200000 2020/12/20	3.16%
13	第117回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	715,000,000	114.32 817,452,670	113.88 814,299,200	2.100000 2030/3/20	3.03%
14	第313回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	677,000,000	106.67 722,196,770	106.45 720,720,660	1.300000 2021/3/20	2.69%

15	第329回 利付国債(2年) 日本	国債 証券	678,000,000	100.16 679,087,110	100.14 678,976,320	0.200000 2015/6/15	2.53%
16	第327回 利付国債(2年) 日本	国債 証券	667,000,000	100.03 667,225,850	100.02 667,133,400	0.100000 2015/4/15	2.49%
17	第106回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	637,000,000	100.27 638,741,860	100.25 638,649,830	0.200000 2017/9/20	2.38%
18	第321回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	591,000,000	104.41 617,121,030	104.10 615,278,280	1.000000 2022/3/20	2.29%
19	第28回 利付国債(30年) 日本	国債 証券	472,000,000	118.19 557,864,450	116.90 551,796,320	2.500000 2038/3/20	2.06%
20	第310回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	523,000,000	104.66 547,394,360	104.47 546,399,020	1.000000 2020/9/20	2.04%
21	第99回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	522,000,000	100.79 526,130,020	100.75 525,920,220	0.400000 2016/9/20	1.96%
22	第102回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	482,000,000	100.56 484,745,970	100.54 484,612,440	0.300000 2016/12/20	1.81%
23	第54回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	348,000,000	113.69 395,670,920	113.26 394,158,720	2.200000 2021/12/20	1.47%
24	第4回 利付国債(40年) 日本	国債 証券	337,000,000	113.88 383,791,990	111.98 377,389,450	2.200000 2051/3/20	1.41%
25	第320回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	357,000,000	104.44 372,885,820	104.14 371,783,370	1.000000 2021/12/20	1.39%
26	第309回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	250,000,000	105.29 263,238,610	105.07 262,685,000	1.100000 2020/6/20	0.98%
27	第92回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	238,000,000	100.34 238,832,400	100.32 238,766,360	0.300000 2015/9/20	0.89%
28	第69回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	180,000,000	114.58 206,258,730	114.10 205,385,400	2.100000 2024/3/20	0.77%
29	第280回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	127,000,000	104.17 132,304,610	104.01 132,099,050	1.900000 2016/6/20	0.49%
30	第305回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	123,000,000	106.28 130,725,310	106.03 130,426,740	1.300000 2019/12/20	0.49%

(注) 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	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	国内	国債証券	99.34
	小計		99.34
合 計（対純資産総額比）			99.34

（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。

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。

（参考情報）

「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面 金額	簿価単価 （円） 簿価金額 （円）	評価単価 （円） 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	9,645	53,930.69 520,161,537	55,253.63 532,921,272	- -	1.66%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	46,271	9,781.75 452,611,691	10,055.28 465,268,045	- -	1.45%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	84,698	3,817.80 323,360,346	4,147.67 351,299,861	- -	1.10%
4	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	2,959	109,651.97 324,460,187	115,285.83 341,130,794	- -	1.06%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	29,615	9,727.60 288,082,994	10,028.52 296,994,761	- -	0.93%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	106,437	2,746.58 292,337,751	2,663.56 283,502,357	- -	0.88%
7	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	52,112	4,565.36 237,910,385	5,072.92 264,360,361	- -	0.82%

8	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	33,978	7,807.86 265,295,748	7,705.88 261,830,696	- -	0.82%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	39,982	5,831.80 233,167,116	6,179.31 247,061,444	- -	0.77%
10	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	20,175	12,362.00 249,403,490	12,196.01 246,054,703	- -	0.77%
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	28,352	8,537.88 242,065,976	8,208.89 232,738,710	- -	0.73%
12	ROCHE HOLDING AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,468	29,723.22 221,973,081	30,858.39 230,450,516	- -	0.72%
13	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,774	3,261.54 221,047,768	3,281.08 222,372,566	- -	0.69%
14	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	10,992	19,031.96 209,199,398	19,601.11 215,455,445	- -	0.67%
15	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	43,828	5,152.98 225,844,941	4,880.46 213,901,081	- -	0.67%
16	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	196,823	1,161.11 228,534,517	1,046.70 206,015,441	- -	0.64%
17	NOVARTIS AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	24,314	8,358.23 203,222,162	8,414.34 204,586,335	- -	0.64%
18	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	55,360	3,622.45 200,539,171	3,609.40 199,816,627	- -	0.62%
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	114,073	1,603.77 182,947,488	1,747.58 199,351,875	- -	0.62%
20	MERCK & CO INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	30,468	5,141.50 156,651,252	5,761.46 175,540,212	- -	0.55%
21	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	40,967	4,094.66 167,746,079	4,008.73 164,225,805	- -	0.51%
22	BP PLC イギリス	株式 エネルギー	196,148	835.01 163,786,546	829.31 162,667,831	- -	0.51%

23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS オランダ	株式 エネルギー	42,720	3,612.68 154,333,754	3,757.68 160,528,296	- -	0.50%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	32,579	5,212.43 169,815,966	4,862.96 158,430,699	- -	0.49%
25	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	38,810	3,686.03 143,055,076	4,072.54 158,055,448	- -	0.49%
26	TOTAL SA フランス	株式 エネルギー	22,753	6,303.53 143,424,395	6,803.44 154,798,886	- -	0.48%
27	QUALCOMM INC アメリカ	株式 テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	17,902	7,518.48 134,595,883	8,159.49 146,071,326	- -	0.46%
28	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	17,584	7,346.25 129,176,479	8,129.65 142,951,779	- -	0.45%
29	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B アメリカ	株式 保険	11,225	11,929.46 133,908,250	12,713.70 142,711,367	- -	0.45%
30	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス	51,384	2,801.58 143,956,752	2,771.79 142,425,955	- -	0.44%

（注）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	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	10.46
		銀行	10.16
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.16
		資本財	7.83
		ソフトウェア・サービス	6.89
		食品・飲料・タバコ	6.18
		素材	5.85
		保険	4.71
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.01
		各種金融	3.68
		公益事業	3.43
		電気通信サービス	3.29

		ヘルスケア機器・サービス	3.13
		小売	3.09
		メディア	3.02
		食品・生活必需品小売り	2.14
		自動車・自動車部品	1.95
		運輸	1.92
		消費者サービス	1.81
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		半導体・半導体製造装置	1.58
		耐久消費財・アパレル	1.51
		商業・専門サービス	0.97
		不動産	0.71
	小計		99.22
投資証券	外国	投資証券	2.03
	小計		2.03
合 計（対純資産総額比）			101.26

（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。

株式（外国）の業種はG I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & P及びMSCI Inc.に帰属します。

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

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先 物取引	シカゴ商品取引所	S & P 500 FUTUR E 201406	買建	12	571,913,369	571,329,504	1.78%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX X 50 201406	買建	64	269,995,948	281,396,224	0.88%

（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す。

（注2）先物取引の時価は、原則として、計算日に知りうる直近の日の取引所の発表する清算値段で評価しております。

（参考情報）

「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 または額面金額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 評価金額(円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	168,788,800	101.68 171,634,491	101.51 171,352,701	1.250000 2015/10/31	2.78%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	155,409,200	102.27 158,951,427	102.08 158,644,819	1.750000 2015/7/31	2.58%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	121,445,600	108.62 131,915,352	107.69 130,795,696	4.500000 2016/2/15	2.12%
4	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債 証券	117,569,500	106.51 125,230,158	105.93 124,542,547	3.500000 2016/1/4	2.02%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	116,299,600	102.46 119,171,219	102.06 118,697,697	1.500000 2016/7/31	1.93%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	113,212,000	105.00 118,873,405	104.42 118,226,159	2.625000 2016/4/30	1.92%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	114,241,200	101.04 115,430,186	100.66 114,999,761	1.000000 2016/10/31	1.87%
8	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債 証券	97,738,500	114.14 111,562,562	113.81 111,242,051	4.000000 2018/1/4	1.81%
9	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債 証券	83,573,500	106.61 89,103,940	106.24 88,791,829	3.250000 2016/4/25	1.44%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	79,248,400	107.14 84,908,917	106.35 84,281,465	3.125000 2017/1/31	1.37%
11	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債 証券	80,740,500	104.22 84,152,641	104.04 84,010,490	3.750000 2015/8/1	1.36%
12	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債 証券	77,907,500	103.98 81,013,147	104.46 81,382,953	3.150000 2016/1/31	1.32%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	72,044,000	111.88 80,607,289	110.75 79,788,730	4.500000 2017/5/15	1.30%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	75,131,600	103.02 77,403,652	102.31 76,868,642	1.875000 2017/10/31	1.25%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	71,014,800	105.03 74,593,493	104.15 73,966,175	2.375000 2017/7/31	1.20%
16	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債 証券	66,575,500	110.43 73,523,531	110.28 73,420,127	3.750000 2017/4/25	1.19%
17	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債 証券	60,909,500	109.02 66,409,004	112.17 68,323,404	4.300000 2019/10/31	1.11%

18	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	61,752,000	111.81 69,046,263	110.62 68,313,150	4.000000 2018/8/15	1.11%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	64,839,600	105.55 68,440,225	104.95 68,055,644	2.750000 2019/2/15	1.10%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	62,781,200	103.14 64,756,903	102.52 64,367,680	2.500000 2015/4/30	1.04%
21	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債 証券	58,076,500	110.41 64,127,986	109.86 63,804,585	3.750000 2017/1/4	1.04%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	58,664,400	109.28 64,113,476	108.34 63,558,770	3.500000 2020/5/15	1.03%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	61,752,000	103.39 63,851,421	102.61 63,368,049	2.625000 2020/11/15	1.03%
24	CANADIAN GOVERNMENT カナダ	国債 証券	59,628,800	106.74 63,651,899	106.24 63,353,214	4.000000 2016/6/1	1.03%
25	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債 証券	55,243,500	113.41 62,655,562	113.50 62,706,344	4.000000 2018/4/25	1.02%
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	59,693,600	105.77 63,137,994	104.82 62,575,607	2.625000 2018/4/30	1.02%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	59,693,600	103.55 61,814,265	102.85 61,395,464	2.625000 2020/8/15	1.00%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	55,576,800	110.70 61,526,454	109.59 60,908,282	3.750000 2018/11/15	0.99%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債 証券	55,576,800	109.31 60,756,536	108.17 60,122,426	3.500000 2018/2/15	0.98%
30	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債 証券	52,410,500	106.92 56,037,745	108.01 56,613,822	4.000000 2017/2/1	0.92%

(注) 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	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	97.95
	小計		97.95
合計 (対純資産総額比)			97.95

(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。

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】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」

【純資産の推移】

平成26年3月31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。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第2計算期間末 (平成17年2月21日)	538,308,102	538,308,102	1.1316	1.1316
第3計算期間末 (平成18年2月21日)	1,314,616,710	1,314,616,710	1.2528	1.2528
第4計算期間末 (平成19年2月21日)	1,801,858,564	1,801,858,564	1.3421	1.3421
第5計算期間末 (平成20年2月21日)	2,005,643,716	2,005,643,716	1.2719	1.2719
第6計算期間末 (平成21年2月23日)	1,837,832,308	1,837,832,308	1.0431	1.0431
第7計算期間末 (平成22年2月22日)	2,226,476,366	2,226,476,366	1.1509	1.1509
第8計算期間末 (平成23年2月21日)	2,468,732,723	2,468,732,723	1.1802	1.1802
第9計算期間末 (平成24年2月21日)	2,562,790,233	2,562,790,233	1.1636	1.1636
第10計算期間末 (平成25年2月21日)	3,001,737,472	3,001,737,472	1.3114	1.3114
第11計算期間末 (平成26年2月21日)	3,385,973,341	3,385,973,341	1.4672	1.4672
平成25年3月末日	3,082,265,203	-	1.3412	-
4月末日	3,204,734,279	-	1.3996	-
5月末日	3,197,016,192	-	1.3934	-

6月末日	3,109,440,747	-	1.3619	-
7月末日	3,166,304,319	-	1.3903	-
8月末日	3,151,280,591	-	1.3807	-
9月末日	3,242,092,882	-	1.4265	-
10月末日	3,284,421,250	-	1.4348	-
11月末日	3,348,230,452	-	1.4643	-
12月末日	3,390,002,442	-	1.4835	-
平成26年1月末日	3,361,638,676	-	1.4588	-
2月末日	3,387,374,726	-	1.4657	-
3月末日	3,412,186,126	-	1.4700	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第2計算期間	4.3
第3計算期間	10.7
第4計算期間	7.1
第5計算期間	5.2
第6計算期間	18.0
第7計算期間	10.3
第8計算期間	2.5
第9計算期間	1.4
第10計算期間	12.7
第11計算期間	11.9

(注)収益率は、以下の計算式により算出しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

$$\text{収益率} = (\text{当計算期間末分配付基準価額} - \text{前計算期間末分配落基準価額}) \div \text{前計算期間末分配落基準価額} \times 100$$

「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」

純資産の推移

平成26年3月31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。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第2計算期間末 (平成17年2月21日)	1,685,435,357	1,685,435,357	1.1884	1.1884
第3計算期間末 (平成18年2月21日)	4,211,489,449	4,211,489,449	1.3838	1.3838
第4計算期間末 (平成19年2月21日)	6,194,491,862	6,194,491,862	1.5275	1.5275
第5計算期間末 (平成20年2月21日)	6,484,983,703	6,484,983,703	1.3809	1.3809
第6計算期間末 (平成21年2月23日)	5,244,908,506	5,244,908,506	1.0030	1.0030
第7計算期間末 (平成22年2月22日)	6,824,522,532	6,824,522,532	1.1685	1.1685
第8計算期間末 (平成23年2月21日)	7,926,206,447	7,926,206,447	1.2272	1.2272
第9計算期間末 (平成24年2月21日)	7,963,099,330	7,963,099,330	1.1781	1.1781
第10計算期間末 (平成25年2月21日)	9,660,248,526	9,660,248,526	1.3772	1.3772
第11計算期間末 (平成26年2月21日)	11,279,655,180	11,279,655,180	1.6089	1.6089
平成25年3月末日	9,976,689,918	-	1.4167	-
4月末日	10,540,878,790	-	1.5017	-
5月末日	10,600,111,062	-	1.5027	-
6月末日	10,235,553,309	-	1.4564	-
7月末日	10,496,172,820	-	1.5008	-

8月末日	10,380,490,913	-	1.4828	-
9月末日	10,870,207,380	-	1.5526	-
10月末日	10,989,659,413	-	1.5631	-
11月末日	11,230,453,475	-	1.6077	-
12月末日	11,402,175,944	-	1.6389	-
平成26年1月末日	11,206,404,450	-	1.5941	-
2月末日	11,263,364,879	-	1.6060	-
3月末日	11,347,923,921	-	1.6122	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000

収益率の推移

	収益率(%)
第2計算期間	5.6
第3計算期間	16.4
第4計算期間	10.4
第5計算期間	9.6
第6計算期間	27.4
第7計算期間	16.5
第8計算期間	5.0
第9計算期間	4.0
第10計算期間	16.9
第11計算期間	16.8

(注)収益率は、以下の計算式により算出しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

収益率 = (当計算期間末分配付基準価額 - 前計算期間末分配落基準価額) ÷ 前計算期間末分配落基準価額 × 100

「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」

純資産の推移

平成26年3月31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。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第2計算期間末 (平成17年2月21日)	875,027,196	875,027,196	1.2475	1.2475
第3計算期間末 (平成18年2月21日)	2,375,768,675	2,375,768,675	1.5253	1.5253
第4計算期間末 (平成19年2月21日)	3,578,213,433	3,578,213,433	1.7319	1.7319
第5計算期間末 (平成20年2月21日)	3,543,921,213	3,543,921,213	1.4897	1.4897
第6計算期間末 (平成21年2月23日)	2,565,505,965	2,565,505,965	0.9552	0.9552
第7計算期間末 (平成22年2月22日)	3,635,729,715	3,635,729,715	1.1734	1.1734
第8計算期間末 (平成23年2月21日)	4,343,954,086	4,343,954,086	1.2613	1.2613
第9計算期間末 (平成24年2月21日)	4,217,589,091	4,217,589,091	1.1770	1.1770
第10計算期間末 (平成25年2月21日)	5,347,012,544	5,347,012,544	1.4248	1.4248
第11計算期間末 (平成26年2月21日)	6,450,070,317	6,450,070,317	1.7349	1.7349
平成25年3月末日	5,507,569,240	-	1.4741	-
4月末日	5,882,225,623	-	1.5871	-
5月末日	5,943,812,668	-	1.5950	-
6月末日	5,601,278,162	-	1.5327	-
7月末日	5,850,765,793	-	1.5939	-
8月末日	5,774,275,950	-	1.5667	-

9月末日	6,123,352,687	-	1.6625	-
10月末日	6,174,851,784	-	1.6753	-
11月末日	6,391,975,595	-	1.7361	-
12月末日	6,567,053,056	-	1.7804	-
平成26年1月末日	6,397,052,002	-	1.7130	-
2月末日	6,439,414,928	-	1.7303	-
3月末日	6,445,958,619	-	1.7386	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000

収益率の推移

	収益率(%)
第2計算期間	7.0
第3計算期間	22.3
第4計算期間	13.5
第5計算期間	14.0
第6計算期間	35.9
第7計算期間	22.8
第8計算期間	7.5
第9計算期間	6.7
第10計算期間	21.1
第11計算期間	21.8

(注)収益率は、以下の計算式により算出してあります。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示してあります。

収益率 = (当計算期間末分配付基準価額 - 前計算期間末分配落基準価額) ÷ 前計算期間末分配落基準価額 × 100

(4) 【設定及び解約の実績】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第2計算期間	489,629,732	57,586,807	475,725,495
第3計算期間	734,634,479	161,022,679	1,049,337,295
第4計算期間	455,517,896	162,320,721	1,342,534,470
第5計算期間	504,409,601	270,097,830	1,576,846,241
第6計算期間	512,581,327	327,540,966	1,761,886,602
第7計算期間	367,240,452	194,490,691	1,934,636,363
第8計算期間	333,709,523	176,563,674	2,091,782,212
第9計算期間	387,759,923	277,103,043	2,202,439,092
第10計算期間	319,638,084	233,074,514	2,289,002,662
第11計算期間	433,711,623	414,973,021	2,307,741,264

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
第2計算期間	1,400,565,557	75,026,595	1,418,233,971
第3計算期間	1,960,859,580	335,731,584	3,043,361,967
第4計算期間	1,394,017,782	382,068,206	4,055,311,543
第5計算期間	1,292,543,957	651,710,119	4,696,145,381
第6計算期間	1,260,534,424	727,669,423	5,229,010,382
第7計算期間	1,066,340,314	454,795,045	5,840,555,651
第8計算期間	987,847,202	369,377,163	6,459,025,690
第9計算期間	1,099,851,674	799,681,966	6,759,195,398
第10計算期間	877,467,094	622,057,085	7,014,605,407
第11計算期間	1,017,362,567	1,021,084,150	7,010,883,824

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」

	設定数量（口）	解約数量（口）	発行済数量（口）
--	---------	---------	----------

第2計算期間	716,961,838	65,907,199	701,420,506
第3計算期間	1,116,762,077	260,594,832	1,557,587,751
第4計算期間	880,091,639	371,661,429	2,066,017,961
第5計算期間	873,103,865	560,232,208	2,378,889,618
第6計算期間	700,741,378	393,780,964	2,685,850,032
第7計算期間	732,174,234	319,548,038	3,098,476,228
第8計算期間	629,814,287	284,208,303	3,444,082,212
第9計算期間	647,867,405	508,663,783	3,583,285,834
第10計算期間	616,265,141	446,761,756	3,752,789,219
第11計算期間	756,063,221	791,114,819	3,717,737,621

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2014年3月末現在

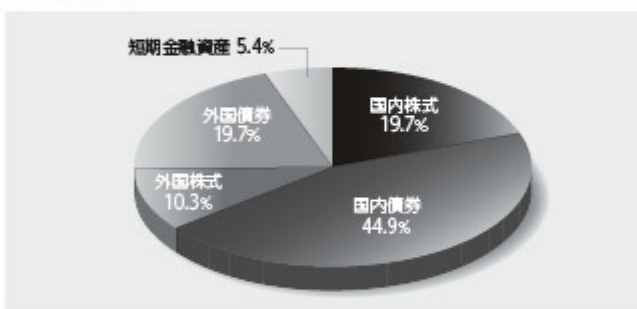
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

● 基準価額・純資産の推移



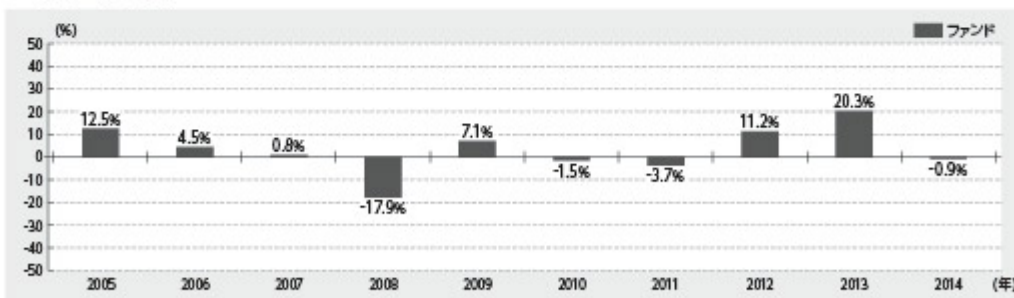
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2014年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

■ 最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

● 基準価額および純資産総額

基準価額	14,700円
純資産総額	34億円

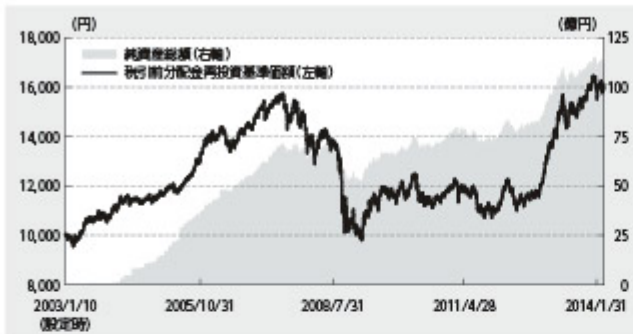
● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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
第11期	2014年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2014年3月末現在

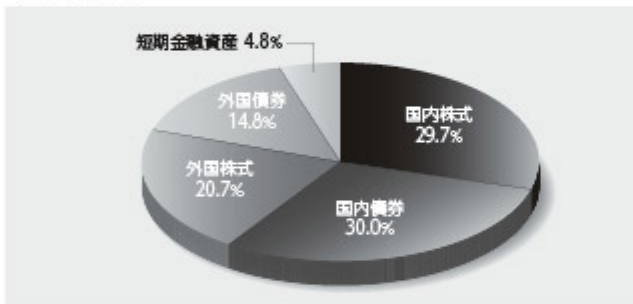
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

● 基準価額・純資産の推移



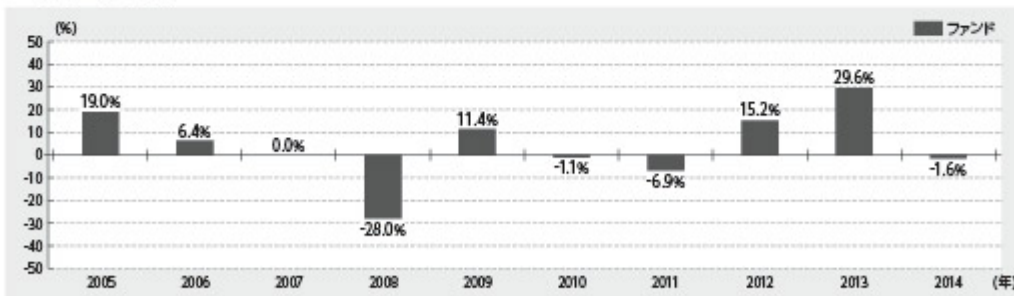
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2014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	16,122円
純資産総額	113億円

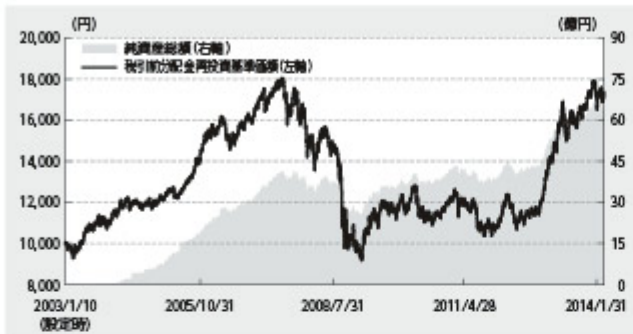
● 分配の推移 1万円当り(税引前)

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
第11期	2014年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2014年3月末現在

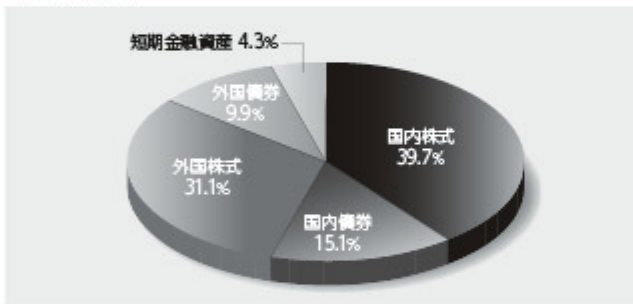
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

● 基準価額・純資産の推移



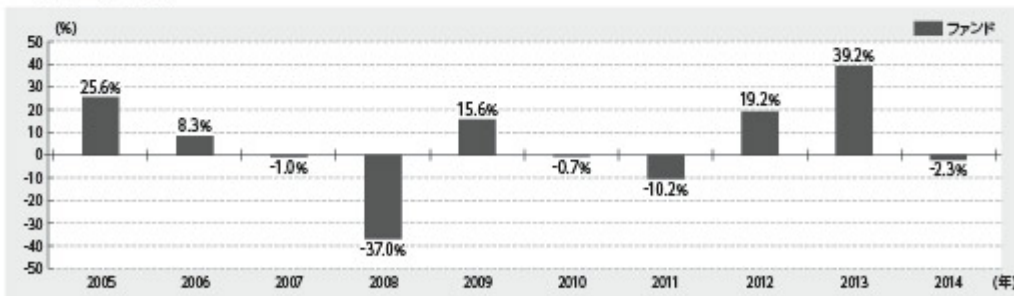
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2014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	17,386円
純資産総額	64億円

● 分配の推移 1万円当り(税引前)

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
第11期	2014年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受け付けを行います。

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

1円以上1円単位とします。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

2【換金（解約）手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受け付けを行います。

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

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

換金単位

1口単位とします。

換金価額

換金請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

換金請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金額をいいます。

ファンド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。

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

（2）【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限です。

(4) 【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

(5) 【その他】**繰上償還**

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

約款の変更

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

4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記1.から5.の規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 反対者の買取請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 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、第11期計算期間（平成25年2月22日から平成26年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 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、第11期計算期間（平成25年2月22日から平成26年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 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、第11期計算期間（平成25年2月22日から平成26年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	115,094,016	144,351,936
投資信託受益証券	2,850,372,550	843,471,432
親投資信託受益証券	-	1,683,318,742
派生商品評価勘定	-	9,067,080
未収入金	44,000,000	674,048,929
前払金	-	7,120,000
差入委託証拠金	-	29,400,000
流動資産合計	3,009,466,566	3,390,778,119
資産合計	3,009,466,566	3,390,778,119
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,595,724	2,305,516
未払受託者報酬	435,993	523,592
未払委託者報酬	1,235,410	1,483,623
その他未払費用	461,967	492,047
流動負債合計	7,729,094	4,804,778
負債合計	7,729,094	4,804,778
純資産の部		
元本等		
元本	2,289,002,662	2,307,741,264
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	712,734,810	1,078,232,077
純資産合計	3,001,737,472	3,385,973,341
負債純資産合計	3,009,466,566	3,390,778,119

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）
営業収益		
受取配当金	22,934,129	-
受取利息	77,298	81,109
有価証券売買等損益	321,820,804	353,664,053
派生商品取引等損益	-	9,635,190
営業収益合計	344,832,231	363,380,352
営業費用		
受託者報酬	840,338	1,015,988
委託者報酬	2,381,102	2,878,871
その他費用	909,950	968,506
営業費用合計	4,131,390	4,863,365
営業利益又は営業損失（ ）	340,700,841	358,516,987
経常利益又は経常損失（ ）	340,700,841	358,516,987
当期純利益又は当期純損失（ ）	340,700,841	358,516,987
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	7,167,563	37,405,981
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	360,351,141	712,734,810
剰余金増加額又は欠損金減少額	57,005,705	176,090,217
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	57,005,705	176,090,217
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,155,314	131,703,956
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,155,314	131,703,956
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	712,734,810	1,078,232,077

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</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、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。</p> <p>親投資信託受益証券</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、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。</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>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、計算期間末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。</p>

（表示方法の変更に関する注記）

損益及び剰余金計算書の「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」及び「当期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、損益及び剰余金計算書への影響はありません。

（追加情報）

当ファンドは、平成26年3月7日の効力発生日をもって、当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、投資対象を「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」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」から、「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」へ変更することを主な変更点とする信託約款の変更を行いますが、この投資対象変更に伴い、当期末時点で投資対象の一部変更を実施しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総口数	2,289,002,662口	2,307,741,264口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3114円 (13,114円)	1.4672円 (14,672円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25年2月21日)	第11期 (自平成25年2月22日 至平成26年2月21日)
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,728,623円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(128,452,719円)、収益調整金(501,028,472円)及び分配準備積立金(137,628,632円)より分配対象収益は789,838,446円(1口当たり0.345058円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(74,740円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(321,036,266円)、収益調整金(555,408,490円)及び分配準備積立金(240,901,838円)より分配対象収益は1,117,421,334円(1口当たり0.484206円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。
2. 剰余金増加額・減少額及び欠損金減少額・増加額	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金増加額と剰余金減少額との純額を表示しております。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25年2月21日)	第11期 (自平成25年2月22日 至平成26年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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。	(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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額(円)
投資信託受益証券	295,853,403	16,530,837
親投資信託受益証券	-	10,478,742
合計	295,853,403	27,009,579

(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	第10期 (平成25年2月21日現在)				第11期 (平成26年2月21日現在)			
	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	-	-	-	-	674,920,000	-	684,040,000	9,120,000
合計	-	-	-	-	674,920,000	-	684,040,000	9,120,000

(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。
原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 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。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

第11期 (平成26年2月21日現在)

当ファンドは、平成26年3月7日の効力発生日をもって、当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、投資対象を「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」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」から、「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」へ変更することを主な変更点とする信託約款の変更を行いました。

(その他の注記)

開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
期首元本額	2,202,439,092円	2,289,002,662円
期中追加設定元本額	319,638,084円	433,711,623円
期中一部解約元本額	233,074,514円	414,973,021円

(4)【附属明細表】(平成26年2月21日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	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）	700,208,727	843,471,432	
投資信託受益証券	合計	700,208,727	843,471,432	
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	538,779,748	674,929,390	
	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	557,671,455	673,778,651	
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	292,210,900	334,610,701	
親投資信託受益証券	合計	1,388,662,103	1,683,318,742	
合計		-	2,526,790,174	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （平成25年2月21日現在）	第11期 （平成26年2月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	365,207,233	370,849,777
投資信託受益証券	9,171,690,262	-
親投資信託受益証券	-	7,315,176,587
派生商品評価勘定	-	55,992,290
未収入金	134,000,000	3,379,163,060
前払金	-	24,365,000
差入委託証拠金	-	145,950,000
流動資産合計	9,670,897,495	11,291,496,714
資産合計	9,670,897,495	11,291,496,714
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,745,843	4,383,699
未払受託者報酬	1,358,873	1,749,395
未払委託者報酬	3,850,280	4,956,718
その他未払費用	693,973	751,722
流動負債合計	10,648,969	11,841,534
負債合計	10,648,969	11,841,534
純資産の部		
元本等		
元本	7,014,605,407	7,010,883,824
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,645,643,119	4,268,771,356
純資産合計	9,660,248,526	11,279,655,180
負債純資産合計	9,670,897,495	11,291,496,714

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）
営業収益		
受取配当金	78,233,419	-
受取利息	238,086	266,162
有価証券売買等損益	1,336,299,038	1,585,522,112
派生商品取引等損益	-	58,832,840
営業収益合計	1,414,770,543	1,644,621,114
営業費用		
受託者報酬	2,611,464	3,367,767
委託者報酬	7,399,385	9,542,190
その他費用	1,362,113	1,483,511
営業費用合計	11,372,962	14,393,468
営業利益又は営業損失（ ）	1,403,397,581	1,630,227,646
経常利益又は経常損失（ ）	1,403,397,581	1,630,227,646
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,403,397,581	1,630,227,646
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	19,196,602	143,173,664
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,203,903,932	2,645,643,119
剰余金増加額又は欠損金減少額	168,017,189	528,684,959
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	168,017,189	528,684,959
剰余金減少額又は欠損金増加額	110,478,981	392,610,704
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	110,478,981	392,610,704
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,645,643,119	4,268,771,356

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（表示方法の変更に関する注記）

損益及び剰余金計算書の「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」及び「当期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、損益及び剰余金計算書への影響はありません。

（追加情報）

当ファンドは、平成26年3月7日の効力発生日をもって、当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、投資対象を「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」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」から、「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」へ変更することを主な変更点とする信託約款の変更を行います。この投資対象変更に伴い、当期末時点で投資対象の一部変更を実施しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総口数	7,014,605,407口	7,010,883,824口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3772円 (13,772円)	1.6089円 (16,089円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第10期 (自平成24年2月22日 至平成25年2月21日)	第11期 (自平成25年2月22日 至平成26年2月21日)

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（77,829,088円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（230,326,708円）、収益調整金（2,174,990,040円）及び分配準備積立金（630,624,822円）より分配対象収益は3,113,770,658円（1口当たり0.443898円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（247,829円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,486,806,153円）、収益調整金（2,300,548,086円）及び分配準備積立金（811,583,361円）より分配対象収益は4,599,185,429円（1口当たり0.656007円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。
2. 剰余金増加額・減少額及び欠損金減少額・増加額	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金増加額と剰余金減少額との純額を表示しております。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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。	(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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額(円)
投資信託受益証券	1,255,435,630	-
親投資信託受益証券	-	42,716,587
合計	1,255,435,630	42,716,587

(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	第10期 (平成25年2月21日現在)				第11期 (平成26年2月21日現在)			
	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	-	-	-	-	3,339,515,000	-	3,395,770,000	56,255,000
合計	-	-	-	-	3,339,515,000	-	3,395,770,000	56,255,000

(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。
原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 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。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

第11期 (平成26年2月21日現在)

当ファンドは、平成26年3月7日の効力発生日をもって、当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、投資対象を「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」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」から、「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」へ変更することを主な変更点とする信託約款の変更を行いました。

(その他の注記)

開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
期首元本額	6,759,195,398円	7,014,605,407円
期中追加設定元本額	877,467,094円	1,017,362,567円
期中一部解約元本額	622,057,085円	1,021,084,150円

(4)【附属明細表】(平成26年2月21日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	2,694,447,990	3,375,334,997	
	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,396,089,173	1,686,754,938	
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,967,589,427	2,253,086,652	
親投資信託受益証券 合計		6,058,126,590	7,315,176,587	
合計		6,058,126,590	7,315,176,587	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （平成25年2月21日現在）	第11期 （平成26年2月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	227,770,297	562,109,681
投資信託受益証券	5,070,699,379	-
親投資信託受益証券	-	4,193,476,443
派生商品評価勘定	-	24,669,745
未収入金	61,000,000	1,589,778,011
前払金	-	21,290,000
差入委託証拠金	-	83,475,000
流動資産合計	5,359,469,676	6,474,798,880
資産合計	5,359,469,676	6,474,798,880
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,139,536	20,305,981
未払受託者報酬	720,365	991,512
未払委託者報酬	2,041,138	2,809,400
その他未払費用	556,093	621,670
流動負債合計	12,457,132	24,728,563
負債合計	12,457,132	24,728,563
純資産の部		
元本等		
元本	3,752,789,219	3,717,737,621
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,594,223,325	2,732,332,696
純資産合計	5,347,012,544	6,450,070,317
負債純資産合計	5,359,469,676	6,474,798,880

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）
営業収益		
受取配当金	45,765,535	-
受取利息	127,514	156,758
有価証券売買等損益	884,552,502	1,129,476,825
派生商品取引等損益	-	26,482,185
営業収益合計	930,445,551	1,156,115,768
営業費用		
受託者報酬	1,378,652	1,891,814
委託者報酬	3,906,373	5,360,319
その他費用	1,088,723	1,218,189
営業費用合計	6,373,748	8,470,322
営業利益又は営業損失（ ）	924,071,803	1,147,645,446
経常利益又は経常損失（ ）	924,071,803	1,147,645,446
当期純利益又は当期純損失（ ）	924,071,803	1,147,645,446
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	14,001,684	133,467,365
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	634,303,257	1,594,223,325
剰余金増加額又は欠損金減少額	128,778,629	470,138,639
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	128,778,629	470,138,639
剰余金減少額又は欠損金増加額	78,928,680	346,207,349
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	78,928,680	346,207,349
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,594,223,325	2,732,332,696

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（表示方法の変更に関する注記）

損益及び剰余金計算書の「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」、「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」及び「当期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、損益及び剰余金計算書への影響はありません。

（追加情報）

当ファンドは、平成26年3月7日の効力発生日をもって、当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、投資対象を「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」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」から、「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」へ変更することを主な変更点とする信託約款の変更を行いますが、この投資対象変更に伴い、当期末時点で投資対象の一部変更を実施しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第10期 （平成25年2月21日現在）	第11期 （平成26年2月21日現在）
1. 当該計算期間の末日における受益権総口数	3,752,789,219口	3,717,737,621口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4248円 (14,248円)	1.7349円 (17,349円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（45,572,242円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（140,205,751円）、収益調整金（1,660,501,035円）及び分配準備積立金（306,025,799円）より分配対象収益は2,152,304,827円（1口当たり0.573521円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（144,461円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,014,033,620円）、収益調整金（1,735,052,451円）及び分配準備積立金（397,161,109円）より分配対象収益は3,146,391,641円（1口当たり0.846319円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。
2. 剰余金増加額・減少額及び欠損金減少額・増加額	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金増加額と剰余金減少額との純額を表示しております。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 （自平成24年2月22日 至平成25年2月21日）	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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。	(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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額(円)
投資信託受益証券	855,270,647	-
親投資信託受益証券	-	46,516,443
合計	855,270,647	46,516,443

(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	第10期 (平成25年2月21日現在)				第11期 (平成26年2月21日現在)			
	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	-	-	-	-	1,917,365,000	-	1,942,185,000	24,820,000
合計	-	-	-	-	1,917,365,000	-	1,942,185,000	24,820,000

(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。
原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 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。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

第11期 (平成26年2月21日現在)

当ファンドは、平成26年3月7日の効力発生日をもって、当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、投資対象を「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」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」から、「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」へ変更することを主な変更点とする信託約款の変更を行いました。

(その他の注記)

開示対象ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第10期 (平成25年2月21日現在)	第11期 (平成26年2月21日現在)
期首元本額	3,583,285,834円	3,752,789,219円
期中追加設定元本額	616,265,141円	756,063,221円
期中一部解約元本額	446,761,756円	791,114,819円

(4)【附属明細表】(平成26年2月21日現在)

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	769,886,727	964,437,102	
	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	566,439,388	654,577,356	
	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	532,141,476	642,933,331	
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,686,777,272	1,931,528,654	
親投資信託受益証券 合計		3,555,244,863	4,193,476,443	
合計		3,555,244,863	4,193,476,443	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

(参考)

「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)」は、「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)」、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている投資信託受益証券及び親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。

「ニッセイ国内債券インデックスS A (適格機関投資家限定)」は、ニッセイアセットマネジメント株式会社の設定・運用する追加型証券投資信託であり、それらの計算期間は原則として、毎年3月11日から翌年の3月10日までであります。開示対象各ファンドの計算期間末日時点で知りうる直近日(以下、「計算日」という。)における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。

なお、「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)」は、「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)」の前営業日時点の基準価額を時価として採用しているため、平成26年2月20日時点の状況について開示しております。

「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)」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年2月20日現在)	(平成26年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,865,483	7,275,052
親投資信託受益証券	6,357,246,321	6,713,591,943
未収入金	930,514	674,484,011
流動資産合計	6,364,042,318	7,395,351,006
資産合計	6,364,042,318	7,395,351,006
負債の部		

流動負債		
未払解約金	770,624	674,391,473
未払受託者報酬	830,476	1,020,139
未払委託者報酬	4,983,015	6,120,998
その他未払費用	247,094	266,045
流動負債合計	6,831,209	681,798,655
負債合計	6,831,209	681,798,655
純資産の部		
元本等		
元本	5,391,340,527	5,573,209,572
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	965,870,582	1,140,342,779
純資産合計	6,357,211,109	6,713,552,351
負債純資産合計	6,364,042,318	7,395,351,006

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2月20日現在）	（平成26年2月20日現在）
1. 計算日における受益権総口数	5,391,340,527口	5,573,209,572口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1792円 （11,792円）	1.2046円 （12,046円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自平成24年3月13日 至平成25年2月20日）	（自平成25年3月12日 至平成26年2月20日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年2月20日現在)	(平成26年2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	（平成25年2月20日現在）	（平成26年2月20日現在）
	当期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当期間の損益に含まれた評価差額 （円）
親投資信託受益証券	97,514,630	105,836,860
合計	97,514,630	105,836,860

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「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（平成25年3月12日）から計算日までの期間に対応するものであります。

（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。

（関連当事者との取引に関する注記）

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元本額の変動

項目	（平成25年2月20日現在）	（平成26年2月20日現在）
期首	平成24年3月13日	平成25年3月12日
期首元本額	4,816,466,324円	5,496,535,422円
期首から計算日までの追加設定元本額	1,117,245,066円	1,532,389,899円
期首から計算日までの一部解約元本額	542,370,863円	1,455,715,749円

附属明細表（平成26年2月20日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	5,355,449,859	6,713,591,943	
親投資信託受益証券 合計		5,355,449,859	6,713,591,943	
合計		5,355,449,859	6,713,591,943	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成26年2月21日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,174,897,458
国債証券	23,992,514,430
未収利息	84,008,301
前払費用	13,901,560
流動資産合計	29,265,321,749
資産合計	29,265,321,749
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,025,630,416
流動負債合計	5,025,630,416
負債合計	5,025,630,416
純資産の部	
元本等	

元本	19,350,145,636
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,889,545,697
純資産合計	24,239,691,333
負債純資産合計	29,265,321,749

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26年2月21日現在）
1. 計算日における受益権総口数	19,350,145,636口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2527円 (12,527円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年2月22日 至 平成26年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	17,800,350
合計	17,800,350

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

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計算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26年2月21日現在)
同計算期間の期首元本額	12,507,141,338円
同計算期間中の追加設定元本額	13,531,644,734円
同計算期間中の一部解約元本額	6,688,640,436円
同計算期間末日の元本の内訳	

ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）	1,889,654,219円
DCニッセイ国内債券インデックス	5,079,950,176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）	90,122,303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）	10,688,802円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	538,779,748円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	2,694,447,990円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	769,886,727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）	475,316,950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）	1,445,643,404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）	638,665,914円
ニッセイ厚生年金型バランス運用（現物型）DB（適格機関投資家限定）	5,716,989,403円
計	19,350,145,636円

附属明細表（平成26年2月21日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
国債証券	第329回 利付国債（2年）	1,218,000,000	1,219,973,160	
	第92回 利付国債（5年）	463,000,000	464,629,760	
	第97回 利付国債（5年）	106,000,000	106,770,620	
	第99回 利付国債（5年）	936,000,000	943,422,480	
	第102回 利付国債（5年）	867,000,000	871,985,250	
	第103回 利付国債（5年）	1,802,000,000	1,812,721,900	
	第106回 利付国債（5年）	274,000,000	274,728,840	
	第4回 利付国債（40年）	291,000,000	330,468,330	
	第271回 利付国債（10年）	1,526,000,000	1,548,539,020	
	第279回 利付国債（10年）	71,000,000	73,815,150	

第280回 利付国債(10年)	364,000,000	379,262,520	
第281回 利付国債(10年)	43,000,000	44,902,320	
第282回 利付国債(10年)	34,000,000	35,406,240	
第285回 利付国債(10年)	1,085,000,000	1,138,002,250	
第287回 利付国債(10年)	808,000,000	855,768,960	
第292回 利付国債(10年)	92,000,000	97,797,840	
第306回 利付国債(10年)	245,000,000	262,218,600	
第309回 利付国債(10年)	474,000,000	499,046,160	
第310回 利付国債(10年)	938,000,000	981,541,960	
第312回 利付国債(10年)	1,440,000,000	1,526,054,400	
第313回 利付国債(10年)	354,000,000	377,438,340	
第320回 利付国債(10年)	642,000,000	670,177,380	
第321回 利付国債(10年)	802,000,000	836,967,200	
第26回 利付国債(30年)	1,514,000,000	1,751,985,660	
第28回 利付国債(30年)	421,000,000	496,754,740	
第54回 利付国債(20年)	626,000,000	711,405,180	
第69回 利付国債(20年)	362,000,000	414,511,720	
第72回 利付国債(20年)	996,000,000	1,143,318,360	
第92回 利付国債(20年)	1,556,000,000	1,798,455,920	
第99回 利付国債(20年)	135,000,000	155,864,250	
第117回 利付国債(20年)	934,000,000	1,066,590,640	
第123回 利付国債(20年)	16,000,000	18,154,560	
第125回 利付国債(20年)	944,000,000	1,083,834,720	
国債証券 合計	22,379,000,000	23,992,514,430	
合計	22,379,000,000	23,992,514,430	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ外国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26年2月21日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	87,817,894
コール・ローン	272,491,303
株式	28,977,223,491
投資証券	586,496,596
派生商品評価勘定	15,193,390
未収入金	246,441
未収配当金	43,502,857
差入委託証拠金	569,726,723
流動資産合計	30,552,698,695
資産合計	30,552,698,695
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	497,219
未払金	2,225,098
未払解約金	4,307,563
流動負債合計	7,029,880
負債合計	7,029,880
純資産の部	
元本等	

元本	26,676,145,239
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,869,523,576
純資産合計	30,545,668,815
負債純資産合計	30,552,698,695

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</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。</p> <p>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。</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>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。</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、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
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>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成26年2月21日現在）
1. 計算日における受益権総口数	26,676,145,239口
2. 1口当たり純資産額	1.1451円
（1万口当たり純資産額）	(11,451円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年2月22日 至 平成26年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成26年2月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月21日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	718,494,937	
投資証券	20,320,432	
合計	738,815,369	

（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26年2月21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	847,932,770	-	862,628,941	14,696,171
合計	847,932,770	-	862,628,941	14,696,171

（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。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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計算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26年2月21日現在）
同計算期間の期首元本額	14,705,080,003円
同計算期間中の追加設定元本額	14,347,089,353円
同計算期間中の一部解約元本額	2,376,024,117円
同計算期間末日の元本の内訳	
ファンド名	
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	292,210,900円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,967,589,427円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	1,686,777,272円
ニッセイ外国株式インデックスファンドII（適格機関投資家限定）	11,533,877,599円
ニッセイ厚生年金型バランス運用DB（適格機関投資家限定）	9,782,896,794円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	1,412,793,247円
計	26,676,145,239円

附属明細表（平成26年2月21日現在）

第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	5,974	131.56	785,939.44	
	ABBOTT LABORATORIES	15,059	38.95	586,548.05	
	ABBVIE INC	15,653	51.86	811,764.58	
	ACCENTURE PLC	6,431	83.38	536,216.78	
	ACE LTD	3,204	96.78	310,083.12	
	ACTAVIS PLC	1,698	220.37	374,188.26	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	5,133	19.63	100,760.79	
	ADOBE SYSTEMS INC	4,822	68.48	330,210.56	
	ADT CORP/THE	2,542	30.86	78,446.12	
	ADVANCE AUTO PARTS	888	127.56	113,273.28	

AES CORP	7,988	14.52	115,985.76	
AETNA INC	3,718	69.89	259,851.02	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	757	189.30	143,300.10	
AFLAC INC	4,521	62.92	284,461.32	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,652	57.29	209,223.08	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,152	117.71	253,311.92	
AIRGAS INC	956	105.42	100,781.52	
AKAMAII TECHNOLOGIES INC	2,094	61.55	128,885.70	
ALCOA INC	16,013	11.78	188,633.14	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,971	179.06	352,927.26	
ALLERGAN INC	3,081	127.25	392,057.25	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	628	284.23	178,496.44	
ALLIANT ENERGY CORP	1,765	53.70	94,780.50	
ALLSTATE CORP	4,462	53.47	238,583.14	
ALTERA CORP	3,804	35.65	135,612.60	
ALTRIA GROUP INC	18,988	35.53	674,643.64	
AMAZON.COM INC	3,592	349.80	1,256,481.60	
AMEREN CORPORATION	2,944	38.81	114,256.64	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	4,669	50.34	235,037.46	
AMERICAN EXPRESS CO	9,287	89.01	826,635.87	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	13,539	49.22	666,389.58	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,338	44.06	103,012.28	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,205	106.20	234,171.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,409	68.39	164,751.51	
AMETEK INC	3,022	52.26	157,929.72	
AMGEN INC	7,293	123.49	900,612.57	
AMPHENOL CORP-CL A	1,801	88.95	160,198.95	
ANADARKO PETROLEUM CORP	5,042	83.21	419,544.82	
ANALOG DEVICES INC	3,592	51.40	184,628.80	
ANSYS INC	1,218	83.11	101,227.98	
AON PLC	2,773	85.41	236,841.93	
APACHE CORP	3,972	84.36	335,077.92	

APPLE INC	8,959	531.15	4,758,572.85	
APPLIED MATERIALS INC	12,575	18.99	238,799.25	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,631	55.69	90,830.39	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,763	40.12	271,331.56	
ASHLAND INC	999	94.89	94,795.11	
AT&T INC	51,938	33.18	1,723,302.84	
AUTODESK INC	2,676	54.90	146,912.40	
AUTOLIV INC	1,265	95.73	121,098.45	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	4,797	76.51	367,018.47	
AUTOZONE INC	395	538.59	212,743.05	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	2,766	59.00	163,194.00	
AVON PRODUCTS INC	5,452	15.04	81,998.08	
BAKER HUGHES INC	4,798	61.23	293,781.54	
BALL CORP	2,205	54.75	120,723.75	
BANK OF AMERICA CORP	105,490	16.30	1,719,487.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	11,542	31.18	359,879.56	
BARD (C.R.) INC	904	140.30	126,831.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,438	69.35	377,125.30	
BB&T CORPORATION	7,057	37.18	262,379.26	
BE AEROSPACE INC	1,316	82.85	109,030.60	
BEAM INC	1,844	83.21	153,439.24	
BECTON DICKINSON & CO	2,111	115.52	243,862.72	
BED BATH & BEYOND INC	2,260	65.13	147,193.80	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	10,225	113.10	1,156,447.50	
BEST BUY CO INC	2,831	24.84	70,322.04	
BIOGEN IDEC INC	2,325	335.11	779,130.75	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,506	80.13	120,675.78	
BLACKROCK INC	1,315	300.52	395,183.80	
BOEING CO	6,841	129.56	886,319.96	
BORGWARNER INC	2,627	60.42	158,723.34	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	14,055	13.23	185,947.65	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	15,913	53.85	856,915.05	
BROADCOM CORP	5,937	30.95	183,750.15	

BROWN-FORMAN CORP -CL B	1,518	81.54	123,777.72	
BUNGE LIMITED	1,817	79.14	143,797.38	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,920	54.16	103,987.20	
CA Inc	3,857	32.67	126,008.19	
CABOT OIL & GAS CORP	4,422	39.28	173,696.16	
CALPINE CORP	4,524	20.04	90,660.96	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	2,887	62.14	179,398.18	
CAMPBELL SOUP CO	2,615	43.69	114,249.35	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,751	70.84	407,400.84	
CARDINAL HEALTH INC	3,448	71.51	246,566.48	
CAREFUSION CORP	2,801	41.63	116,605.63	
CARMAX INC	2,722	47.33	128,832.26	
CARNIVAL CORP	4,199	39.11	164,222.89	
CATERPILLAR INC	6,512	96.92	631,143.04	
CBRE GROUP INC	4,358	27.35	119,191.30	
CBS CORP-CL B	5,889	65.91	388,143.99	
CELANESE CORP-SERIES A	2,008	52.92	106,263.36	
CELGENE CORP	4,009	163.58	655,792.22	
CENTERPOINT ENERGY INC	4,774	24.28	115,912.72	
CENTURYLINK INC	6,578	31.12	204,707.36	
CERNER CORP	3,239	60.68	196,542.52	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	642	240.86	154,632.12	
CHARLES SCHWAB CORP	11,793	26.12	308,033.16	
CHARTER COMMUNICATION-A	714	131.84	94,133.76	
CHENIERE ENERGY INC	2,284	48.60	111,002.40	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,807	26.65	154,756.55	
CHEVRON CORP	18,650	114.60	2,137,290.00	
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	1,310	79.86	104,616.60	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	317	550.28	174,438.76	
CHUBB CORP	2,386	86.49	206,365.14	
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,704	66.27	112,924.08	
CIGNA CORP	2,850	77.10	219,735.00	

CIMAREX ENERGY CO	1,000	113.92	113,920.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,886	46.79	88,245.94	
CISCO SYSTEMS INC	52,767	22.30	1,176,704.10	
CIT GROUP INC	2,486	47.77	118,756.22	
CITIGROUP INC	29,981	48.13	1,442,985.53	
CITRIX SYSTEMS INC	2,192	60.59	132,813.28	
CLOROX CO	1,550	86.95	134,772.50	
CME GROUP INC	3,119	73.76	230,057.44	
CMS ENERGY CORP	3,710	28.61	106,143.10	
COACH INC	3,056	47.64	145,587.84	
COCA-COLA CO	37,952	37.30	1,415,609.60	
COCA-COLA ENTERPRISES	3,292	46.88	154,328.96	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	3,141	100.66	316,173.06	
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,713	61.86	538,986.18	
COMCAST CORP	21,045	51.76	1,089,289.20	
COMCAST CORP	4,407	50.11	220,834.77	
COMERICA INC	2,422	46.71	113,131.62	
COMPUTER SCIENCES CORP	1,786	62.35	111,357.10	
CONAGRA FOODS INC	5,070	28.56	144,799.20	
CONCHO RESOURCES INC	1,234	116.27	143,477.18	
CONOCOPHILLIPS	10,833	64.92	703,278.36	
CONSOL ENERGY INC	2,793	39.92	111,496.56	
CONSOLIDATED EDISON INC	2,729	55.30	150,913.70	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,728	80.60	139,276.80	
CORE LABORATORIES N.V.	567	189.28	107,321.76	
CORNING INC	14,875	19.00	282,625.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,158	115.06	478,419.48	
COVIDIEN PLC	4,625	71.28	329,670.00	
CROWN HOLDINGS INC	2,513	44.20	111,074.60	
CSX CORP	10,758	27.35	294,231.30	
CUMMINS INC	1,876	141.75	265,923.00	
CVS CAREMARK CORP	11,724	71.31	836,038.44	
DANAHER CORP	5,560	76.11	423,171.60	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,752	50.50	88,476.00	

DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	2,120	65.78	139,453.60	
DEERE & CO	3,672	85.12	312,560.64	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	2,909	65.71	191,150.39	
DENBURY RESOURCES INC	5,691	15.95	90,771.45	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,337	45.47	106,263.39	
DEVON ENERGY CORPORATION	4,056	64.56	261,855.36	
DIRECTV	5,392	75.08	404,831.36	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,849	57.07	276,732.43	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	2,504	82.43	206,404.72	
DISH NETWORK CORP	2,360	57.07	134,685.20	
DOLLAR GENERAL CORP	3,235	57.10	184,718.50	
DOLLAR TREE INC	2,431	51.52	125,245.12	
DOMINION RESOURCES INC/VA	5,154	71.50	368,511.00	
DOVER CORP	1,873	88.58	165,910.34	
DOW CHEMICAL CO	12,100	47.14	570,394.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	2,661	51.47	136,961.67	
DTE ENERGY COMPANY	1,844	72.33	133,376.52	
DUKE ENERGY CORP	6,320	71.74	453,396.80	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,796	82.81	148,726.76	
EATON CORP PLC	4,785	72.97	349,161.45	
EATON VANCE CORP	2,227	36.81	81,975.87	
EBAY INC	11,620	54.96	638,635.20	
ECOLAB INC	2,553	101.87	260,074.11	
EDISON INTERNATIONAL	3,087	51.22	158,116.14	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,333	68.10	90,777.30	
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	8,907	65.35	582,072.45	
ELECTRONIC ARTS INC	3,648	27.79	101,377.92	
ELI LILLY & CO	9,760	58.05	566,568.00	
EMC CORP/MASSACHUSETTS	20,565	25.47	523,790.55	
EMERSON ELECTRIC CO	6,729	63.56	427,695.24	
ENERGIZER HOLDINGS INC	810	96.43	78,108.30	
ENSCO PLC	2,954	51.94	153,430.76	

ENERGY CORP	1,913	65.05	124,440.65	
EOG RESOURCES INC	2,640	180.03	475,279.20	
EQT CORP	1,670	100.03	167,050.10	
EQUIFAX INC	1,670	69.74	116,465.80	
EQUINIX INC	652	187.95	122,543.40	
ESTEE LAUDER COS INC	2,428	67.86	164,764.08	
EXELON CORP	8,361	30.23	252,753.03	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	2,728	41.70	113,757.60	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	8,059	77.12	621,510.08	
EXXON MOBIL CORP	42,841	95.37	4,085,746.17	
FACEBOOK INC-A	17,045	69.63	1,186,843.35	
FAMILY DOLLAR STORES	1,241	65.07	80,751.87	
FASTENAL CO	3,039	45.53	138,365.67	
FEDEX CORP	2,941	132.99	391,123.59	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	3,423	54.27	185,766.21	
FIFTH THIRD BANCORP	8,713	21.34	185,935.42	
FIRSTENERGY CORP	4,441	32.26	143,266.66	
FISERV INC	3,117	57.18	178,230.06	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	807	119.32	96,291.24	
FLOWSERVE CORP	1,839	81.55	149,970.45	
FLUOR CORP	1,939	80.01	155,139.39	
FMC CORP	1,690	73.08	123,505.20	
FMC TECHNOLOGIES INC	2,975	50.82	151,189.50	
FORD MOTOR CO	35,659	15.27	544,512.93	
FOREST LABORATORIES INC	2,971	97.30	289,078.30	
FRANKLIN RESOURCES INC	4,320	52.54	226,972.80	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	10,620	33.75	358,425.00	
GAP INC	3,360	42.34	142,262.40	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,842	107.75	306,225.50	
GENERAL ELECTRIC CO	99,146	25.12	2,490,547.52	
GENERAL MILLS INC	6,136	49.78	305,450.08	
GENERAL MOTORS CO	9,323	36.51	340,382.73	
GENUINE PARTS CO	1,881	87.05	163,741.05	
GILEAD SCIENCES INC	14,957	82.81	1,238,589.17	

GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,200	164.50	690,900.00	
GOOGLE INC-CL A	2,699	1,204.11	3,249,892.89	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	1,339	123.74	165,687.86	
H&R BLOCK INC	3,289	31.53	103,702.17	
HALLIBURTON CO	8,674	55.38	480,366.12	
HARLEY-DAVIDSON INC	2,350	64.31	151,128.50	
HARRIS CORP	1,808	72.64	131,333.12	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	4,953	34.34	170,086.02	
HCA HOLDINGS INC	3,170	50.23	159,229.10	
HELMERICH & PAYNE	1,423	94.66	134,701.18	
HENRY SCHEIN INC	1,160	118.00	136,880.00	
HERSHEY CO/THE	1,530	107.71	164,796.30	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	4,889	27.09	132,443.01	
HESS CORP	3,203	81.61	261,396.83	
HEWLETT-PACKARD CO	19,238	30.19	580,795.22	
HOLLYFRONTIER CORP	2,154	45.66	98,351.64	
HOME DEPOT INC	13,857	77.48	1,073,640.36	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,018	93.56	656,604.08	
HOSPIRA INC	2,148	43.98	94,469.04	
HUMANA INC	1,625	102.24	166,140.00	
IHS INC-CLASS A	761	117.32	89,280.52	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	4,084	80.76	329,823.84	
ILLUMINA INC	1,319	173.70	229,110.30	
INGERSOLL-RAND PLC	3,097	59.72	184,952.84	
INTEL CORP	48,147	24.74	1,191,156.78	
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP INC	1,190	210.25	250,197.50	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	10,215	184.26	1,882,215.90	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,588	49.37	226,509.56	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	6,167	17.02	104,962.34	
INTUIT INC	3,026	73.85	223,470.10	
INTUITIVE SURGICAL INC	420	438.04	183,976.80	
INVESCO LTD	5,151	33.69	173,537.19	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,805	61.04	110,177.20	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,256	71.65	89,992.40	
JM SMUCKER CO	1,228	98.28	120,687.84	
JOHNSON & JOHNSON	27,150	92.38	2,508,117.00	
JOHNSON CONTROLS INC	6,813	49.86	339,696.18	
JPMORGAN CHASE & CO	36,776	57.58	2,117,562.08	
JUNIPER NETWORKS INC	6,506	27.41	178,329.46	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,298	94.23	122,310.54	
KELLOGG CO	2,661	60.24	160,298.64	
KEYCORP	10,480	12.76	133,724.80	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,601	109.97	396,001.97	
KINDER MORGAN INC	6,896	33.23	229,154.08	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	1,362	74.33	101,237.46	
KLA-TENCOR CORP	1,994	64.65	128,912.10	
KOHL'S CORP	2,360	51.87	122,413.20	
KRAFT FOODS GROUP INC	6,066	55.20	334,843.20	
KROGER CO	5,082	39.28	199,620.96	
L BRANDS INC	2,661	53.31	141,857.91	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,139	115.65	131,725.35	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	1,159	92.69	107,427.71	
LAM RESEARCH CORP	2,121	52.35	111,034.35	
LAS VEGAS SANDS CORP	4,123	80.59	332,272.57	
LEUCADIA NATIONAL CORP	4,238	27.80	117,816.40	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,910	87.89	343,649.90	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	5,818	29.31	170,525.58	
LIBERTY MEDIA CORP	1,084	136.48	147,944.32	
LINCOLN NATIONAL CORP	3,124	49.81	155,606.44	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	3,130	46.12	144,355.60	
LINKEDIN CORP - A	1,027	193.39	198,611.53	
LKQ CORP	3,542	29.09	103,036.78	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,464	164.27	404,761.28	
LOEWS CORP	3,537	43.67	154,460.79	
LORILLARD INC	3,883	48.22	187,238.26	

LOWE'S COS INC	10,237	46.66	477,658.42	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,139	85.80	355,126.20	
M&T BANK CORP	1,234	112.43	138,738.62	
MACY'S INC	4,114	53.46	219,934.44	
MANPOWER GROUP	1,170	74.25	86,872.50	
MARATHON OIL CORP	7,447	33.48	249,325.56	
MARATHON PETROLEUM CORP	3,222	87.95	283,374.90	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	3,123	51.79	161,740.17	
MARSH & MCLENNAN COS INC	5,151	48.10	247,763.10	
MASCO CORP	4,524	22.30	100,885.20	
MASTERCARD INC-CLASS A	10,151	75.86	770,054.86	
MATTEL INC	3,803	35.55	135,196.65	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,840	31.30	120,192.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,611	66.13	106,535.43	
MCDONALD'S CORP	9,313	95.75	891,719.75	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	2,605	80.64	210,067.20	
MCKESSON CORP	2,222	177.58	394,582.76	
MDU RESOURCES GROUP INC	2,795	34.83	97,349.85	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	2,128	80.73	171,793.44	
MEADWESTVACO CORP	2,858	35.86	102,487.88	
MEDTRONIC INC	9,467	57.00	539,619.00	
MERCK & CO INC	27,887	55.81	1,556,373.47	
METLIFE INC	9,228	50.71	467,951.88	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	443	245.04	108,552.72	
MGM MIRAGE	5,085	26.83	136,430.55	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	2,038	98.00	199,724.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,671	45.20	120,729.20	
MICRON TECHNOLOGY INC	10,472	25.49	266,931.28	
MICROSOFT CORP	77,769	37.75	2,935,779.75	
MOHAWK INDUSTRIES INC	792	145.94	115,584.48	
MOLSON COORS BREWING CO - B	1,963	56.13	110,183.19	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	16,148	34.48	556,783.04	
MONSANTO CO	5,145	110.70	569,551.50	

MONSTER BEVERAGE CORP	1,542	74.70	115,187.40	
MOODY'S CORP	2,089	78.93	164,884.77	
MORGAN STANLEY	14,848	29.33	435,491.84	
MOSAIC CO/THE	3,215	48.37	155,509.55	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,916	65.22	190,181.52	
MURPHY OIL CORP	2,119	58.11	123,135.09	
MYLAN LABORATORIES	4,108	52.26	214,684.08	
NATIONAL-OILWELL INC	4,459	76.38	340,578.42	
NETAPP INC	3,581	40.18	143,884.58	
NETFLIX INC	533	434.95	231,828.35	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	6,679	15.58	104,058.82	
NEWELL RUBBERMAID INC	3,940	31.81	125,331.40	
NEWMONT MINING CORP	6,957	24.46	170,168.22	
NEXTERA ENERGY INC	3,817	92.45	352,881.65	
NIELSEN HOLDINGS NV	3,120	46.40	144,768.00	
NIKE INC	6,882	75.58	520,141.56	
NISOURCE INC	3,490	35.31	123,231.90	
NOBLE CORP PLC	3,368	31.28	105,351.04	
NOBLE ENERGY INC	3,743	67.12	251,230.16	
NORDSTROM INC	2,216	59.44	131,719.04	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,247	91.02	295,541.94	
NORTHEAST UTILITIES	3,303	44.67	147,545.01	
NORTHERN TRUST CORP	2,735	61.54	168,311.90	
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,060	120.61	248,456.60	
NRG ENERGY INC	3,700	28.72	106,264.00	
NUCOR CORP	3,490	51.09	178,304.10	
NVIDIA CORP	6,984	18.78	131,159.52	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,148	154.26	177,090.48	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	7,847	95.40	748,603.80	
OCEANEERING INTL INC	1,614	70.63	113,996.82	
OGE ENERGY CORP	2,427	36.17	87,784.59	
OMNICOM GROUP	3,216	74.92	240,942.72	
ONEOK INC	2,134	60.98	130,131.32	
ORACLE CORP	34,014	38.27	1,301,715.78	
PACCAR INC	3,848	62.00	238,576.00	

PALL CORP	1,458	85.59	124,790.22	
PARKER HANNIFIN CORP	1,646	117.79	193,882.34	
PAYCHEX INC	3,710	41.27	153,111.70	
PENTAIR LTD-REGISTERED	2,129	78.99	168,169.71	
PEPSICO INC	14,508	78.01	1,131,769.08	
PERRIGO CO PLC	1,453	161.03	233,976.59	
PETSMART INC	1,261	64.78	81,687.58	
PFIZER INC	63,619	31.55	2,007,179.45	
PG&E CORP	4,251	43.66	185,598.66	
PHARMACYCLICS INC	643	142.68	91,743.24	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	15,601	79.71	1,243,555.71	
PHILLIPS 66	5,712	75.29	430,056.48	
PINNACLE WEST CAPITAL	1,648	55.10	90,804.80	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,400	189.60	265,440.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,068	79.98	405,338.64	
POLARIS INDUSTRIES INC	823	129.46	106,545.58	
PPG INDUSTRIES INC	1,418	188.75	267,647.50	
PPL CORPORATION	6,066	31.79	192,838.14	
PRAXAIR INC	2,848	128.07	364,743.36	
PRECISION CASTPARTS CORP	1,394	258.47	360,307.18	
PRICELINE.COM INC	506	1,283.00	649,198.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,405	44.09	150,126.45	
PROCTER & GAMBLE CO	26,341	77.92	2,052,490.72	
PROGRESSIVE CORP	5,757	23.97	137,995.29	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,677	84.49	395,159.73	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	4,865	36.53	177,718.45	
PVH CORP	947	118.09	111,831.23	
QUALCOMM INC	16,890	75.95	1,282,795.50	
QUEST DIAGNOSTICS	1,888	52.97	100,007.36	
RALPH LAUREN CORP	748	157.66	117,929.68	
RANGE RESOURCES CORP	1,880	87.52	164,537.60	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,008	52.11	104,636.88	
RAYTHEON CO	3,047	96.35	293,578.45	

REALOGY HOLDINGS CORP	2,227	45.40	101,105.80	
RED HAT INC	2,383	59.30	141,311.90	
REGENERON PHARMACEUTICALS	767	327.62	251,284.54	
REGIONS FINANCIAL CORP	15,600	10.22	159,432.00	
REPUBLIC SERVICES INC	3,545	33.74	119,608.30	
RESMED INC	1,706	46.54	79,397.24	
REYNOLDS AMERICAN INC	3,194	48.51	154,940.94	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,503	118.99	178,841.97	
ROCKWELL COLLINS INC.	1,670	80.98	135,236.60	
ROPER INDUSTRIES INC	1,180	135.54	159,937.20	
ROSS STORES INC	2,298	67.65	155,459.70	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,120	51.37	108,904.40	
SAFEWAY INC	2,783	35.32	98,295.56	
SALESFORCE.COM INC	5,814	63.01	366,340.14	
SANDISK CORP	2,575	75.31	193,923.25	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,621	99.21	160,819.41	
SCANA CORP	2,122	49.08	104,147.76	
SCHLUMBERGER LTD	12,974	91.03	1,181,023.22	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,251	80.02	100,105.02	
SEAGATE TECHNOLOGY	3,264	50.02	163,265.28	
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,640	34.39	90,789.60	
SEMPRA ENERGY	2,054	92.93	190,878.22	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	870	193.40	168,258.00	
SIGMA-ALDRICH	1,563	94.03	146,968.89	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,823	3.60	125,362.80	
SLM CORP	5,017	23.41	117,447.97	
SOUTHERN CO	7,860	42.40	333,264.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	3,890	42.28	164,469.20	
SPECTRA ENERGY CORP	6,658	37.73	251,206.34	
SPRINT CORP	10,294	8.27	85,131.38	
ST JUDE MEDICAL INC	3,018	67.93	205,012.74	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,724	81.43	140,385.32	
STAPLES INC	7,611	13.10	99,704.10	
STARBUCKS CORP	7,143	73.55	525,367.65	

STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	2,297	78.64	180,636.08	
STATE STREET CORP	4,441	67.82	301,188.62	
STERICYCLE INC	1,134	115.99	131,532.66	
STRYKER CORP	3,128	82.65	258,529.20	
SUNTRUST BANKS INC	5,766	37.08	213,803.28	
SYMANTEC CORP	7,625	20.51	156,388.75	
SYSCO CORP	6,485	35.85	232,487.25	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,859	80.10	229,005.90	
TARGET CORP	5,902	56.62	334,171.24	
TE CONNECTIVITY LTD	4,353	57.48	250,210.44	
TERADATA CORP	2,031	44.96	91,313.76	
TESLA MOTORS INC	825	209.97	173,225.25	
TESORO CORP	1,584	50.32	79,706.88	
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,742	44.20	474,796.40	
TEXTRON INC	3,720	38.53	143,331.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,599	124.71	448,831.29	
TIFFANY & CO	1,528	89.44	136,664.32	
TIME WARNER CABLE	2,937	141.66	416,055.42	
TIME WARNER INC	9,006	64.98	585,209.88	
TJX COS INC	6,955	60.02	417,439.10	
TORCHMARK CORP	1,337	76.09	101,732.33	
TOWERS WATSON & CO-CL A	799	110.03	87,913.97	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,583	65.77	104,113.91	
TRANSDIGM GROUP INC	627	177.82	111,493.14	
TRAVELERS COS INC/THE	3,413	83.81	286,043.53	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,241	38.64	125,232.24	
TRIPADVISOR INC	1,213	96.80	117,418.40	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	1,408	82.16	115,681.28	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	5,741	31.80	182,563.80	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	13,370	32.67	436,797.90	
TYCO INTERNATIONAL LTD	5,197	42.25	219,573.25	
TYSON FOODS INC-CL A	3,231	39.17	126,558.27	

ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	693	86.15	59,701.95	
UNION PACIFIC CORP	4,441	177.87	789,920.67	
UNITED PARCEL SERVICE INC	6,694	95.67	640,414.98	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	8,253	115.05	949,507.65	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,824	73.48	721,867.52	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,235	82.19	101,504.65	
UNUM GROUP	3,534	33.57	118,636.38	
US BANCORP	16,810	40.32	677,779.20	
VALERO ENERGY CORP	5,627	49.59	279,042.93	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,377	84.10	115,805.70	
VERISIGN INC	1,852	55.70	103,156.40	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	1,824	66.05	120,475.20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	28,030	48.12	1,348,803.60	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,397	84.01	201,371.97	
VF CORP	3,741	58.03	217,090.23	
VIACOM INC-CLASS B	4,239	86.51	366,715.89	
VISA INC-CLASS A SHARES	4,967	223.46	1,109,925.82	
VULCAN MATERIALS CO	1,616	65.30	105,524.80	
WAL-MART STORES INC	15,388	73.52	1,131,325.76	
WALGREEN CO	8,737	66.55	581,447.35	
WALT DISNEY CO	16,474	79.19	1,304,576.06	
WASTE MANAGEMENT INC	4,672	40.98	191,458.56	
WATERS CORP	1,149	114.94	132,066.06	
WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	9,446	15.14	143,012.44	
WELLPOINT INC	3,009	87.71	263,919.39	
WELLS FARGO & CO	48,190	45.63	2,198,909.70	
WESTERN DIGITAL CORP	2,206	86.24	190,245.44	
WESTERN UNION CO	6,449	15.99	103,119.51	
WEYERHAEUSER CO	6,732	30.45	204,989.40	
WHIRLPOOL CORP	898	138.01	123,932.98	
WHITING PETROLEUM CORP	1,553	62.60	97,217.80	

	WHOLE FOODS MARKET INC	3,612	52.35	189,088.20	
	WILLIAMS COS INC	7,116	42.00	298,872.00	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	2,199	42.55	93,567.45	
	WISCONSIN ENERGY CORP	2,520	43.89	110,602.80	
	WW GRAINGER INC	613	248.04	152,048.52	
	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	1,720	69.23	119,075.60	
	WYNN RESORTS LTD	905	223.50	202,267.50	
	XCEL ENERGY INC	4,971	29.83	148,284.93	
	XEROX CORP	13,101	10.74	140,704.74	
	XILINX INC	3,091	50.74	156,837.34	
	XL GROUP PLC	4,065	29.30	119,104.50	
	XYLEM INC	2,597	38.71	100,529.87	
	YAHOO! INC	9,696	37.79	366,411.84	
	YUM! BRANDS INC	4,402	72.98	321,257.96	
	ZIMMER HOLDINGS INC	1,917	95.30	182,690.10	
	ZOETIS INC	5,758	29.97	172,567.26	
アメリカ・ドル	小計	2,954,844		166,782,085.55 (17,093,495,949)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	12,544	3.86	48,419.84	
	AGGREKO PLC	3,451	16.27	56,147.77	
	ARM HOLDINGS PLC	14,579	9.47	138,063.13	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,805	29.67	112,894.35	
	ASTRAZENECA PLC	12,171	39.96	486,353.16	
	AVIVA PLC	32,268	4.68	151,111.04	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	5,494	14.28	78,454.32	
	BAE SYSTEMS PLC	33,320	4.00	133,413.28	
	BARCLAYS PLC	151,999	2.55	387,901.44	
	BG GROUP PLC	33,833	10.96	370,809.68	
	BHP BILLITON PLC	21,515	19.79	425,781.85	
	BP PLC	182,685	4.99	912,511.57	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	18,340	31.52	578,076.80	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	12,295	9.17	112,745.15	
	BT GROUP PLC	80,592	4.15	334,698.57	

BUNZL PLC	4,869	14.89	72,499.41	
BURBERRY GROUP PLC	5,309	15.26	81,015.34	
CAPITA PLC	8,383	10.82	90,704.06	
CARNIVAL PLC	2,602	24.51	63,775.02	
CENTRICA PLC	49,380	3.20	158,312.28	
COMPASS GROUP PLC	18,892	9.17	173,239.64	
DIAGEO PLC	24,223	19.03	461,084.80	
EXPERIAN PLC	11,247	10.94	123,042.18	
GKN PLC	20,951	4.08	85,542.93	
GLAXOSMITHKLINE PLC	47,464	16.84	799,531.08	
GLENCORE XSTRATA PLC	107,102	3.40	364,575.20	
HSBC HOLDINGS PLC	179,386	6.52	1,169,776.10	
IMI PLC	4,068	15.65	63,664.20	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	9,760	23.60	230,336.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,042	19.75	79,829.50	
INTERTEK GROUP PLC	2,359	30.11	71,029.49	
ITV PLC	48,305	2.07	100,377.79	
JOHNSON MATTHEY PLC	2,615	32.88	85,981.20	
KINGFISHER PLC	27,120	3.97	107,910.48	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	66,158	2.40	158,977.67	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	491,371	0.81	398,501.88	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	18,848	5.03	94,899.68	
MEGGITT PLC	13,750	5.14	70,743.75	
MORRISON WM SUPERMARKETS	30,870	2.42	74,736.27	
NATIONAL GRID PLC	34,414	8.36	287,701.04	
NEXT PLC	1,841	65.40	120,401.40	
OLD MUTUAL PLC	57,814	1.84	106,435.57	
PEARSON PLC	9,756	11.10	108,291.60	
PRUDENTIAL PLC	25,631	13.55	347,300.05	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	6,208	49.75	308,848.00	
REED ELSEVIER PLC	14,323	9.13	130,768.99	
RESOLUTION LTD	20,663	3.71	76,804.37	
REXAM PLC	13,277	5.15	68,376.55	
RIO TINTO PLC	12,874	35.93	462,627.19	

	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	18,690	10.10	188,769.00	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	23,843	3.55	84,809.55	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	39,004	21.95	856,332.82	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	22,037	23.56	519,301.90	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	55,192	0.99	54,971.23	
	SABMILLER PLC	9,479	27.99	265,364.60	
	SAGE GROUP PLC	19,421	4.24	82,345.04	
	SEVERN TRENT PLC	3,017	17.98	54,245.66	
	SHIRE PLC	5,746	33.31	191,399.26	
	SMITH & NEPHEW PLC	11,940	9.58	114,444.90	
	SMITHS GROUP PLC	5,934	13.90	82,482.60	
	SSE PLC	9,656	14.20	137,115.20	
	STANDARD CHARTERED PLC	24,296	13.20	320,707.20	
	STANDARD LIFE PLC	28,623	3.88	111,257.60	
	TATE & LYLE PLC	7,745	6.51	50,419.95	
	TESCO PLC	81,089	3.34	271,242.70	
	TRAVIS PERKINS PLC	3,599	19.66	70,756.34	
	TULLOW OIL PLC	10,909	7.80	85,090.20	
	UNILEVER PLC	12,753	24.38	310,918.14	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,132	7.73	70,590.36	
	VODAFONE GROUP PLC	475,595	2.29	1,091,966.12	
	WEIR GROUP PLC/THE	2,891	23.28	67,302.48	
	WHITBREAD PLC	2,283	41.57	94,904.31	
	WOLSELEY PLC	3,226	33.17	107,006.42	
	WPP PLC	15,160	13.57	205,721.20	
	イギリス・ポンド 小計	2,931,078		17,248,395.52 (2,945,163,535)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	19,960	18.53	369,858.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	27,019	13.05	352,597.95	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	9,191	169.40	1,556,955.40	
	イスラエル・シュケル 小計	56,170		2,279,412.15 (66,536,041)	

オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	8,077	15.92	128,585.84	
	AMCOR LTD	16,254	10.56	171,642.24	
	AMP LTD	38,180	4.92	187,845.60	
	ASCIANO LTD	20,312	5.60	113,747.20	
	ASX LTD	3,930	37.45	147,178.50	
	AURIZON HOLDINGS LTD	31,742	5.04	159,979.68	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	27,585	31.60	871,686.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	9,860	11.74	115,756.40	
	BHP BILLITON LTD	32,590	38.70	1,261,233.00	
	BRAMBLES LTD	20,882	9.19	191,905.58	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	9,649	11.47	110,674.03	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	15,969	74.60	1,191,287.40	
	CROWN RESORTS LTD	7,074	17.23	121,885.02	
	CSL LIMITED	5,019	70.31	352,885.89	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	18,599	5.87	109,176.13	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	26,626	5.52	146,975.52	
	MACQUARIE GROUP LTD	3,524	55.26	194,736.24	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	23,812	35.16	837,229.92	
	ORICA LTD	5,737	24.14	138,491.18	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	13,773	14.55	200,397.15	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	13,471	11.40	153,569.40	
	RIO TINTO LTD	5,103	69.59	355,117.77	
	SANTOS LTD	12,414	14.27	177,147.78	
	SUNCORP GROUP LTD	16,042	12.70	203,733.40	
	SYDNEY AIRPORT	3,043	3.98	12,111.14	
	TATTS GROUP LTD	35,242	2.96	104,316.32	
	TELSTRA CORP LTD	49,901	5.27	262,978.27	
	WESFARMERS LIMITED	10,676	43.05	459,601.80	
	WESTPAC BANKING CORP	31,011	33.10	1,026,464.10	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	7,301	38.60	281,818.60	
WOOLWORTHS LTD	13,435	36.19	486,212.65		

オーストラリア・ドル 小計		536,833		10,276,369.75 (947,686,818)	
カナダ・ドル	AGRIUM INC	1,823	98.65	179,838.95	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,636	87.47	143,100.92	
	ARC RESOURCES LTD	4,095	29.80	122,031.00	
	BANK OF MONTREAL	6,098	72.44	441,739.12	
	BANK OF NOVA SCOTIA	11,381	63.95	727,814.95	
	BARRICK GOLD CORP	13,856	23.29	322,706.24	
	BAYTEX ENERGY CORP	2,353	40.76	95,908.28	
	BCE INC	3,452	47.57	164,211.64	
	BOMBARDIER INC	20,252	3.56	72,097.12	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	6,733	44.55	299,955.15	
	CAE INC	7,547	14.85	112,072.95	
	CAMECO CORP	5,705	23.29	132,869.45	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	3,853	90.13	347,270.89	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	8,557	61.85	529,250.45	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	11,542	40.89	471,952.38	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	6,852	20.84	142,795.68	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,894	173.64	328,874.16	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,160	97.98	113,656.80	
	CATAMARAN CORP	2,406	57.41	138,128.46	
	CENOVUS ENERGY INC	8,805	28.40	250,062.00	
	CGI GROUP INC	2,646	37.23	98,510.58	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	4,564	38.82	177,174.48	
	ENBRIDGE INC	8,296	47.61	394,972.56	
	ENCANA CORP	8,674	20.66	179,204.84	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,367	21.59	159,053.53		
FORTIS INC	4,390	30.67	134,641.30		
FRANCO-NEVADA CORP	2,517	59.12	148,805.04		
GOLDCORP INC	10,359	30.71	318,124.89		
GREAT-WEST LIFECO INC	3,615	31.00	112,065.00		

	HUSKY ENERGY INC	4,414	33.47	147,736.58	
	IMPERIAL OIL LTD	3,539	48.62	172,066.18	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,914	66.85	127,950.90	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	2,382	96.09	228,886.38	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	19,157	21.19	405,936.83	
	NATIONAL BANK OF CANADA	3,676	43.85	161,192.60	
	ONEX CORPORATION	1,929	58.99	113,791.71	
	PEMBINA PIPELINE CORP	4,060	39.92	162,075.20	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	9,070	37.30	338,311.00	
	POWER CORP OF CANADA	5,430	30.11	163,497.30	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	4,247	42.90	182,196.30	
	ROYAL BANK OF CANADA	13,670	72.80	995,176.00	
	SAPUTO INC	2,270	54.04	122,670.80	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,506	25.36	164,992.16	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	1,889	59.34	112,093.26	
	SILVER WHEATON CORP	6,804	28.79	195,887.16	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	2,001	47.46	94,967.46	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	6,541	39.47	258,173.27	
	SUNCOR ENERGY INC	15,259	36.73	560,463.07	
	TALISMAN ENERGY INC	12,244	11.74	143,744.56	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	7,186	25.93	186,332.98	
	THOMSON REUTERS CORP	4,712	38.10	179,527.20	
	TIM HORTONS INC	2,185	58.98	128,871.30	
	TORONTO-DOMINION BANK	17,386	49.84	866,518.24	
	TOURMALINE OIL CORP	2,188	50.83	111,216.04	
	TRANSCANADA CORP	7,455	48.83	364,027.65	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	3,209	163.73	525,409.57	
	VERMILION ENERGY INC	1,843	63.31	116,680.33	
	YAMANA GOLD INC	13,773	11.69	161,006.37	
	カナダ・ドル 小計	369,367		14,350,287.21 (1,322,378,967)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND LTD	56,000	2.86	160,160.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	21,000	16.62	349,020.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	110,000	1.40	154,000.00	

	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	54,000	2.86	154,440.00	
	KEPPEL CORP LTD	25,600	10.45	267,520.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	34,000	9.58	325,720.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	18,000	10.18	183,240.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	99,000	3.58	354,420.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	16,000	20.70	331,200.00	
	シンガポール・ドル 小計	433,600		2,279,720.00 (184,839,697)	
スイス・フラン	ABB LTD	22,513	22.35	503,165.55	
	ACTELION LTD-REG	1,281	89.30	114,393.30	
	ADECCO SA-REG	1,949	71.60	139,548.40	
	ARYZTA AG	1,481	72.50	107,372.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	5,381	88.10	474,066.10	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	16,137	28.10	453,449.70	
	GEBERIT AG-REG	541	268.90	145,474.90	
	GIVAUDAN-REG	106	1,376.00	145,856.00	
	HOLCIM LTD-REG	2,960	68.60	203,056.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,125	40.91	127,843.75	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	868	122.40	106,243.20	
	NESTLE SA	31,339	65.60	2,055,838.40	
	NOVARTIS AG	22,373	73.05	1,634,347.65	
	ROCHE HOLDING AG	6,854	265.00	1,816,310.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	924	131.70	121,690.80	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	78	2,190.00	170,820.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	765	124.30	95,089.50	
	SWATCH GROUP AG	423	581.50	245,974.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	576	199.20	114,739.20	
	SWISS RE AG	3,712	83.20	308,838.40	
	SWISSCOM AG	370	516.50	191,105.00	
	SYNGENTA AG	984	326.00	320,784.00	
	TRANSOCEAN LTD	4,304	38.45	165,488.80	

	UBS AG	37,066	18.51	686,091.66	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,561	264.60	413,040.60	
スイス・フラン	小計	167,671		10,860,627.91 (1,251,470,154)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	5,106	169.90	867,509.40	
	ASSA ABLOY AB	3,999	330.80	1,322,869.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	10,714	178.90	1,916,734.60	
	HENNES & MAURITZ AB	9,435	287.60	2,713,506.00	
	HEXAGON AB-B SHS	3,304	223.70	739,104.80	
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	2,801	246.00	689,046.00	
	INVESTOR AB	5,780	220.60	1,275,068.00	
	NORDEA BANK AB	31,195	89.50	2,791,952.50	
	SANDVIK AB	13,654	88.40	1,207,013.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	17,529	87.60	1,535,540.40	
	SKANSKA AB-B SHS	6,989	132.90	928,838.10	
	SKF AB	5,348	173.20	926,273.60	
	SVENSKA CELLULOSA AB	6,380	191.30	1,220,494.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	5,489	326.30	1,791,060.70	
	SWEDBANK AB - A SHARES	9,637	178.00	1,715,386.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	32,619	81.80	2,668,234.20	
TELIASONERA AB	28,373	49.41	1,401,909.93		
VOLVO AB	17,301	93.85	1,623,698.85		
スウェーデン・クローナ	小計	215,653		27,334,239.88 (428,874,223)	
デンマーク・ク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	22	64,250.00	1,413,500.00	
	CARLSBERG AS-B	1,391	587.00	816,517.00	
	COLOPLAST-B	1,620	433.10	701,622.00	
	DANSKE BANK A/S	7,742	138.50	1,072,267.00	
	NOVO-NORDISK A/S	19,915	240.00	4,779,600.00	
	NOVOZYMES A/S	2,786	247.80	690,370.80	
	TDC A/S	15,983	52.15	833,513.45	
デンマーク・クローネ	小計	49,459		10,307,390.25 (194,191,232)	

ノルウェー・クローネ	DNB ASA	11,350	106.60	1,209,910.00	
	ORKLA ASA	14,325	46.65	668,261.25	
	SEADRILL LTD	4,723	221.30	1,045,199.90	
	STATOIL ASA	11,347	161.10	1,828,001.70	
	TELENOR ASA	8,631	133.40	1,151,375.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,694	246.60	664,340.40	
ノルウェー・クローネ 小計		53,070		6,567,088.65 (110,458,431)	
ユーロ	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	6,420	17.05	109,461.00	
	ACCOR	2,532	36.52	92,481.30	
	ADIDAS AG	2,403	84.80	203,774.40	
	AEGON NV	20,374	6.35	129,537.89	
	AGEAS	3,831	31.85	122,036.50	
	AIR LIQUIDE	3,241	98.58	319,497.78	
	AIRBUS GROUP NV	5,859	52.57	308,007.63	
	AKZO NOBEL NV	2,648	59.49	157,529.52	
	ALCATEL-LUCENT	31,638	3.10	98,299.26	
	ALLIANZ SE	4,599	129.75	596,720.25	
	ALSTOM RGPT	3,060	19.58	59,914.80	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	4,400	31.46	138,424.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	8,151	74.03	603,418.53	
	ARCELORMITTAL	11,965	12.01	143,759.47	
	ARKEMA	897	81.08	72,728.76	
	ASML HOLDING NV	3,495	64.66	225,986.70	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	12,891	16.71	215,408.61	
	ATLANTIA SPA	5,179	18.04	93,429.16	
	AXA	18,828	19.55	368,087.40	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	58,972	8.92	526,089.21	
	BANCO DE SABADELL SA	40,716	2.30	93,931.81	
	BANCO POPULAR ESPANOL	15,960	5.07	80,965.08	
	BANCO SANTANDER SA	113,304	6.50	736,476.00	
	BANK OF IRELAND	250,272	0.34	85,092.48	
BASF SE	9,181	82.30	755,596.30		

BAYER AG	8,251	101.20	835,001.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,575	84.39	301,694.25	
BEIERSDORF AG	1,266	73.45	92,987.70	
BNP PARIBAS	10,118	58.52	592,105.36	
BOUYGUES	2,715	28.85	78,341.32	
BRENNTAG AG	728	133.90	97,479.20	
BUREAU VERITAS SA	3,317	20.42	67,749.72	
CAIXABANK	21,603	4.60	99,568.22	
CAP GEMINI SA	1,944	56.31	109,466.64	
CARREFOUR SA	6,805	26.42	179,788.10	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,040	82.63	85,935.20	
CHRISTIAN DIOR SA	759	143.45	108,878.55	
CIE DE SAINT-GOBAIN	4,723	41.22	194,705.67	
CNH INDUSTRIAL NV	12,012	8.09	97,237.14	
COMMERZBANK AG	10,945	13.02	142,503.90	
CONTINENTAL AG	1,175	168.30	197,752.50	
CREDIT AGRICOLE SA	12,143	11.17	135,698.02	
CRH PLC	8,236	20.05	165,172.98	
DAIMLER AG	9,573	66.47	636,317.31	
DANONE	5,769	51.70	298,257.30	
DASSAULT SYSTEMES SA	890	83.79	74,573.10	
DEUTSCHE BANK AG	10,622	35.30	374,956.60	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,256	58.23	131,380.41	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	4,508	18.37	82,848.02	
DEUTSCHE POST AG	9,453	26.11	246,817.83	
DEUTSCHE TELEKOM AG	30,354	12.17	369,559.95	
E.ON SE	18,631	14.10	262,697.10	
EDENRED	3,252	22.87	74,373.24	
EDF	2,516	28.35	71,328.60	
ENEL SPA	69,501	3.77	262,435.77	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	37,087	2.95	109,703.34	
ENI -ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	25,633	17.32	443,963.56	
ERSTE GROUP BANK AG	3,506	29.06	101,901.89	
ESSILOR INTERNATIONA	2,247	76.84	172,659.48	
FERROVIAL S.A.	6,768	14.40	97,493.04	

FIAT SPA	11,829	7.61	90,018.69	
FORTUM OYJ	5,366	17.90	96,051.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	2,497	53.20	132,840.40	
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,441	119.40	172,055.40	
GAS NATURAL SDG SA	4,407	18.57	81,837.99	
GDF SUEZ	13,526	17.88	241,912.51	
GEA GROUP AG	2,731	34.29	93,659.64	
GEMALTO	864	79.12	68,359.68	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,668	69.15	115,342.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	1,903	57.30	109,041.90	
HEINEKEN NV	2,423	48.93	118,557.39	
HENKEL AG & CO KGAA	3,235	74.62	241,395.70	
IBERDROLA SA	48,957	4.68	229,216.67	
IMMOFINANZ AG	24,618	3.62	89,117.16	
INDITEX SA	2,181	105.70	230,531.70	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,110	7.67	100,619.25	
ING GROEP NV	39,137	10.52	411,916.92	
INTESA SANPAOLO	127,261	2.23	284,301.07	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	16,454	5.47	90,003.38	
KBC GROUP SA	2,895	44.82	129,753.90	
KERING	880	155.00	136,400.00	
KERRY GROUP PLC-A	1,963	51.60	101,290.80	
KONE OYJ	3,648	31.55	115,094.40	
KONINKLIJKE AHOLD NV	11,042	13.33	147,245.07	
KONINKLIJKE DSM NV	1,714	48.00	82,272.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,835	25.61	251,874.35	
L'OREAL SA	2,364	122.55	289,708.20	
LAFARGE SA	2,372	54.01	128,111.72	
LEGRAND SA	3,320	43.24	143,573.40	
LINDE AG	1,976	148.00	292,448.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	2,273	39.68	90,192.64	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	2,630	137.15	360,704.50	
MERCK KGAA	732	123.05	90,072.60	

MICHELIN (C.G.D.E.)	2,074	87.50	181,475.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	1,872	157.49	294,838.12	
NOKIA OYJ	38,325	5.30	203,122.50	
OMV AG	2,231	34.03	75,920.93	
ORANGE S.A.	21,015	9.38	197,204.76	
PERNOD-RICARD	2,365	85.56	202,349.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	1,675	78.52	131,521.00	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG- REG	2,551	34.62	88,328.37	
PUBLICIS GROUPE	2,430	67.83	164,826.90	
RANDSTAD HOLDINGS NV	1,639	43.99	72,107.80	
RED ELECTRICA DE ESPANA	1,520	54.40	82,688.00	
REED ELSEVIER NV	8,393	15.85	133,029.05	
RENAULT SA	2,141	73.36	157,063.76	
REPSOL SA	9,376	17.98	168,627.36	
ROYAL KPN NV	35,155	2.69	94,848.19	
RWE AG	5,423	29.60	160,520.80	
SAFRAN SA	2,967	52.43	155,559.81	
SAMPO OYJ	4,911	36.71	180,282.81	
SANOFI	11,806	73.57	868,567.42	
SAP AG	9,274	57.98	537,706.52	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	5,533	65.39	361,802.87	
SIEMENS AG	7,851	94.84	744,588.84	
SNAM SPA	25,971	4.09	106,325.27	
SOCIETE GENERALE	7,448	46.72	347,970.56	
SODEXO	1,287	76.08	97,914.96	
SOLVAY SA	925	112.25	103,831.25	
TECHNIP SA	1,485	69.99	103,935.15	
TELECOM ITALIA SPA	169,129	0.86	146,465.71	
TELEFONICA SA	42,553	11.34	482,551.02	
TENARIS SA	6,332	16.02	101,438.64	
TERNA SPA	25,941	3.74	97,071.22	
THYSSENKRUPP AG	4,808	19.85	95,438.80	
TOTAL SA	20,892	44.89	937,841.88	
UCB SA	1,764	53.75	94,815.00	

	UNICREDIT SPA	45,141	5.87	264,977.67	
	UNILEVER NV	15,856	28.48	451,578.88	
	UPM-KYMMENE OYJ	7,830	12.76	99,910.80	
	VALEO SA	1,068	87.96	93,941.28	
	VINCI SA	5,227	52.12	272,431.24	
	VIVENDI SA	12,950	20.81	269,489.50	
	VOLKSWAGEN AG	1,657	198.15	328,334.55	
	WARTSILA OYJ	2,567	42.14	108,173.38	
	WOLTERS KLUWER NV	4,990	20.05	100,049.50	
ユーロ 小計		1,952,337		29,046,973.15 (4,084,585,364)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	121,814	37.35	4,549,752.90	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	49,621	24.15	1,198,347.15	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	17,333	116.10	2,012,361.30	
	CLP HOLDINGS LTD	24,492	59.55	1,458,498.60	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	24,148	71.70	1,731,411.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	39,659	21.55	854,651.45	
	HANG SENG BANK LTD	9,955	122.60	1,220,483.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	75,164	15.90	1,195,107.60	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,621	121.80	1,780,837.80	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	25,331	101.40	2,568,563.40	
	LI & FUNG LTD	77,446	10.18	788,400.28	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,263	62.35	1,138,698.05	
	SANDS CHINA LTD	26,670	57.80	1,541,526.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	20,244	98.15	1,986,948.60	
	SWIRE PACIFIC LTD	12,990	83.75	1,087,912.50	
WHARF HOLDINGS LTD	21,032	55.90	1,175,688.80		
香港・ドル 小計		578,783		26,289,189.03 (347,543,080)	
合計		10,298,865		28,977,223,491 (28,977,223,491)	

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	5,503.00	121,946.48	
		AMERICAN TOWER REIT INC	4,124.00	348,519.24	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	13,968.00	151,552.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,420.00	183,023.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,852.00	204,942.32	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	3,603.00	274,872.87	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,844.00	225,758.12	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	6,089.00	136,028.26	
		HCP INC	5,330.00	201,687.20	
		HEALTH CARE REIT INC	3,291.00	186,204.78	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	9,517.00	185,105.65	
		KIMCO REALTY CORP	6,410.00	139,097.00	
		MACERICH CO/THE	2,443.00	146,873.16	
		PLUM CREEK TIMBER CO	3,004.00	128,691.36	
		PROLOGIS INC	5,954.00	240,482.06	
		PUBLIC STORAGE	1,508.00	251,398.68	
		REALTY INCOME CORP	3,041.00	130,489.31	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,148.00	503,428.16	
		SL GREEN REALTY CORP	1,420.00	137,456.00	
	VENTAS INC	3,412.00	208,643.80		
VORNADO REALTY TRUST	2,027.00	192,625.81			
	アメリカ・ドル 小計		90,908.00	4,298,826.86 (440,586,765)	
イギリス・ポンド		BRITISH LAND CO PLC	13,896.00	96,716.16	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	10,712.00	116,867.92	
	イギリス・ポンド 小計		24,608.00	213,584.08 (36,469,481)	
オーストラリア・ドル		GOODMAN GROUP	26,533.00	128,685.05	
		STOCKLAND	33,067.00	129,953.31	
		WESTFIELD GROUP	24,665.00	256,022.70	

	WESTFIELD RETAIL TRUST	48,993.00	152,858.16	
オーストラリア・ドル 小計		133,258.00	667,519.22	(61,558,623)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,178.00	225,056.90	
ユーロ 小計		1,178.00	225,056.90	(31,647,501)
香港・ドル	LINK REIT	33,876.00	1,228,005.00	
香港・ドル 小計		33,876.00	1,228,005.00	(16,234,226)
投資証券 合計			586,496,596	(586,496,596)
合計			586,496,596	(586,496,596)

- (注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合 計金額に対す る比率
アメリカ・ドル	株式 486銘柄	55.96%	-%	59.31%
	投資証券 21銘柄	-%	1.44%	
イギリス・ポンド	株式 75銘柄	9.64%	-%	10.09%
	投資証券 2銘柄	-%	0.12%	
イスラエル・シケル	株式 3銘柄	0.22%	-%	0.23%
オーストラリア・ドル	株式 31銘柄	3.10%	-%	3.41%
	投資証券 4銘柄	-%	0.20%	
カナダ・ドル	株式 58銘柄	4.33%	-%	4.47%
シンガポール・ドル	株式 9銘柄	0.61%	-%	0.63%
スイス・フラン	株式 25銘柄	4.10%	-%	4.23%
スウェーデン・クローナ	株式 18銘柄	1.40%	-%	1.45%
デンマーク・クローネ	株式 7銘柄	0.64%	-%	0.66%
ノルウェー・クローネ	株式 6銘柄	0.36%	-%	0.37%
ユーロ	株式 136銘柄	13.37%	-%	13.92%
	投資証券 1銘柄	-%	0.10%	

香港・ドル	株式	16銘柄	1.14%	-%	1.23%
	投資証券	1銘柄	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ外国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26年2月21日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	107,321,948
コール・ローン	44,980,402
国債証券	5,336,306,163
派生商品評価勘定	77,423
未収利息	16,012,088

前払費用	37,813,339
流動資産合計	5,542,511,363
資産合計	5,542,511,363
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,588
未払金	122,611,816
未払解約金	301,831
流動負債合計	122,923,235
負債合計	122,923,235
純資産の部	
元本等	
元本	4,485,540,763
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	934,047,365
純資産合計	5,419,588,128
負債純資産合計	5,542,511,363

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。</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。</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、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</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>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成26年2月21日現在）
1. 計算日における受益権総口数	4,485,540,763口
2. 1口当たり純資産額	1.2082円

(1万口当たり純資産額)

(12,082円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成25年2月22日 至 平成26年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	6,006,484
合計	6,006,484

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成26年2月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	49,684,640	-	49,752,475	67,835
アメリカ・ドル	34,101,088	-	34,174,975	73,887
イギリス・ポンド	2,218,969	-	2,219,550	581
ユーロ	13,364,583	-	13,357,950	6,633
合計	49,684,640	-	49,752,475	67,835

（注） 時価の算定方法

1．国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、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たレートをを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

2．上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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計算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26年2月21日現在）
同計算期間の期首元本額	399,963,178円
同計算期間中の追加設定元本額	4,122,059,058円
同計算期間中の一部解約元本額	36,481,473円
同計算期間末日の元本の内訳	
ファンド名	
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	557,671,455円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,396,089,173円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	532,141,476円
ニッセイ外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	398,245,757円
ニッセイ厚生年金型バランス運用（現物型）DB（適格機関投資家限定）	1,257,933,535円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	343,459,367円
計	4,485,540,763円

附属明細表（平成26年2月21日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	110,000.00	136,107.40	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	80,000.00	101,000.00	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	50,000.00	65,312.50	
		US TREASURY N/B 0.875 2019/07/31	310,000.00	295,926.00	
		US TREASURY N/B 1 2016/10/31	1,110,000.00	1,121,444.10	
		US TREASURY N/B 1.25 2015/10/31	1,290,000.00	1,311,310.80	
		US TREASURY N/B 1.25 2019/10/31	340,000.00	329,585.80	

US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	420,000.00	407,530.20	
US TREASURY N/B 1.5 2016/07/31	1,090,000.00	1,116,225.40	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	230,000.00	212,623.50	
US TREASURY N/B 1.75 2015/07/31	1,220,000.00	1,246,925.40	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	200,000.00	188,952.00	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	430,000.00	397,444.70	
US TREASURY N/B 1.875 2017/10/31	640,000.00	658,944.00	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	310,000.00	301,958.60	
US TREASURY N/B 2.375 2017/07/31	690,000.00	723,258.00	
US TREASURY N/B 2.5 2015/04/30	1,010,000.00	1,037,966.90	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	440,000.00	432,951.20	
US TREASURY N/B 2.625 2016/04/30	1,100,000.00	1,152,932.00	
US TREASURY N/B 2.625 2018/04/30	550,000.00	580,547.00	
US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	380,000.00	393,326.60	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	380,000.00	392,350.00	
US TREASURY N/B 2.75 2019/02/15	300,000.00	317,061.00	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	210,000.00	173,250.00	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	170,000.00	148,563.00	
US TREASURY N/B 3.125 2017/01/31	630,000.00	674,295.30	
US TREASURY N/B 3.125 2019/05/15	280,000.00	300,759.20	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	290,000.00	307,400.00	

	US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	50,000.00	44,968.50	
	US TREASURY N/B 3.5 2018/02/15	540,000.00	588,600.00	
	US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	390,000.00	425,587.50	
	US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	540,000.00	530,631.00	
	US TREASURY N/B 3.75 2018/11/15	480,000.00	530,097.60	
	US TREASURY N/B 4 2018/08/15	510,000.00	568,609.20	
	US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	140,000.00	154,655.20	
	US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	60,000.00	66,225.00	
	US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	50,000.00	56,304.50	
	US TREASURY N/B 4.5 2016/02/15	1,180,000.00	1,277,066.80	
	US TREASURY N/B 4.5 2017/05/15	610,000.00	680,912.50	
	US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	70,000.00	80,455.90	
	US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	60,000.00	68,830.80	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	230,000.00	258,963.90	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	200,000.00	225,062.00	
	アメリカ・ドル 小計	19,370,000.00	20,082,921.00 (2,058,298,573)	
イギリス・ボンド	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	120,000.00	130,761.60	
	TSY 4 1/2% 2019 4.5 2019/03/07	160,000.00	180,352.00	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	140,000.00	164,655.40	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	130,000.00	145,407.60	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	60,000.00	68,284.80	

	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	100,000.00	112,263.00	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	130,000.00	145,580.50	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	100,000.00	116,348.00	
	TSY 4 3/4% 2015 4.75 2015/09/07	10,000.00	10,648.70	
	TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	140,000.00	160,923.00	
	TSY 4% 2016 4 2016/09/07	240,000.00	259,183.20	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	140,000.00	155,213.80	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	40,000.00	44,595.20	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	160,000.00	193,296.00	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	50,000.00	59,852.00	
	TSY 5% 2018 5 2018/03/07	180,000.00	204,699.60	
	UK TREASURY 8.75 2017/08/25	110,000.00	138,054.40	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	80,000.00	76,350.40	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	30,000.00	29,913.00	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	50,000.00	57,515.00	
イギリス・ボンド 小計		2,170,000.00	2,453,897.20 (419,002,947)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2016/06/15	280,000.00	292,216.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	170,000.00	184,312.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	220,000.00	247,687.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 6.25 2015/04/15	20,000.00	20,845.60	
	Australia Government Bond 4.75 2027/04/21	130,000.00	134,595.50	
オーストラリア・ドル 小計		820,000.00	879,656.80 (81,121,950)	
カナダ・ドル	CANADA GOVT 5.75 2029/06/01	70,000.00	95,487.70	

	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	130,000.00	134,499.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	90,000.00	98,055.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	250,000.00	275,490.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2016/06/01	580,000.00	618,628.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	90,000.00	120,065.40	
カナダ・ドル 小計		1,210,000.00	1,342,225.40 (123,686,071)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	200,000.00	203,254.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.75 2016/09/01	30,000.00	32,536.20	
シンガポール・ドル 小計		230,000.00	235,790.20 (19,117,869)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	340,000.00	374,612.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.75 2017/08/12	1,380,000.00	1,501,785.00	
スウェーデン・クローナ 小計		1,720,000.00	1,876,397.00 (29,440,669)	
ノルウェー・クロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	820,000.00	913,357.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 5 2015/05/15	130,000.00	135,590.00	
ノルウェー・クローネ 小計		950,000.00	1,048,947.00 (17,643,289)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	150,000.00	144,112.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2017/10/25	1,010,000.00	1,067,267.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	160,000.00	171,644.80	
ポーランド・ズロチ 小計		1,320,000.00	1,383,024.30 (46,663,240)	
マレーシア・リン ギット	MALAYSIAN GOVERNMENT 3.741 2015/02/27	270,000.00	271,933.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	630,000.00	631,127.70	

マレーシア・リングgit 小計		900,000.00	903,060.90 (28,049,072)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 6 2015/06/18	640,000.00	659,276.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	1,910,000.00	2,040,453.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2017/12/14	2,970,000.00	3,273,623.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	900,000.00	1,002,708.00	
メキシコ・ペソ 小計		6,420,000.00	6,976,060.90 (53,785,430)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 2.75 2016/03/28	210,000.00	220,779.30	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	160,000.00	182,097.60	
	BELGIUM KINGDOM 4 2018/03/28	170,000.00	191,646.10	
	BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	150,000.00	173,149.50	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	60,000.00	70,490.40	
	BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	80,000.00	103,062.40	
	BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	90,000.00	118,386.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.15 2016/01/31	480,000.00	500,136.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2017/01/31	350,000.00	373,415.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	360,000.00	395,654.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2015/01/31	90,000.00	93,289.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	180,000.00	195,730.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	120,000.00	128,846.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	30,000.00	32,921.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	130,000.00	149,838.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	140,000.00	165,898.60	
BTPS 6.5 11/01/27 6.5 2027/11/01	180,000.00	228,004.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	300,000.00	299,469.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	420,000.00	442,688.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	220,000.00	240,979.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2020/01/04	110,000.00	125,250.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	110,000.00	125,255.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2016/01/04	690,000.00	733,670.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2019/07/04	130,000.00	149,037.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.75 2017/01/04	360,000.00	396,648.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2018/01/04	690,000.00	786,317.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	80,000.00	100,221.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	170,000.00	223,912.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	70,000.00	95,328.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2015/08/01	440,000.00	458,726.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2016/08/01	380,000.00	403,047.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	300,000.00	315,867.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2017/02/01	370,000.00	397,065.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	240,000.00	258,619.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	90,000.00	88,175.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/02/01	120,000.00	131,700.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	130,000.00	142,382.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/02/01	320,000.00	350,876.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	200,000.00	220,618.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	30,000.00	31,215.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	160,000.00	178,113.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	130,000.00	142,500.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	130,000.00	141,035.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	150,000.00	169,815.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	200,000.00	231,810.00	
DEUTSCH REP 6.25 2024/01/04	60,000.00	85,294.80	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	150,000.00	197,505.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	90,000.00	129,153.60	
FRANCE (GOVT OF) 3 2015/10/25	150,000.00	157,005.00	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	200,000.00	217,820.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2016/04/25	530,000.00	564,333.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	30,000.00	29,780.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	250,000.00	282,367.50	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	200,000.00	219,960.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2017/04/25	370,000.00	408,209.90	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	250,000.00	286,930.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2018/04/25	350,000.00	396,798.50	

FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	80,000.00	91,456.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	50,000.00	57,265.50	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	40,000.00	45,852.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2019/04/25	280,000.00	325,180.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	240,000.00	284,104.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	80,000.00	98,757.60	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	80,000.00	100,912.00	
FRANCE O.A.T. 5.75 2032/10/25	100,000.00	140,140.00	
FRENCH OAT 5.5 2029/04/25	140,000.00	186,873.40	
ITALY BTP 6 2031/05/01	100,000.00	122,380.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2015/07/15	280,000.00	291,956.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	200,000.00	232,050.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2019/07/15	260,000.00	300,458.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	110,000.00	134,609.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	70,000.00	95,739.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	130,000.00	149,054.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	80,000.00	98,416.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.3 2017/09/15	130,000.00	147,192.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.35 2019/03/15	160,000.00	186,825.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	60,000.00	76,232.40	
SPANISH GVOT 5.75 07 5.75 2032/07/30	120,000.00	144,792.00	
TREASURY 4 1/2% 2018 4.5 2018/10/18	230,000.00	259,633.20	

	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	60,000.00	70,789.20	
ユーロ 小計		15,430,000.00	17,319,521.20 (2,435,471,071)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	1,900,000.00	2,163,340.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2017/09/15	410,000.00	414,555.10	
南アフリカ・ランド 小計		2,310,000.00	2,577,895.10 (24,025,982)	
国債証券 合計			5,336,306,163 (5,336,306,163)	
合計			5,336,306,163 (5,336,306,163)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注) 2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 43銘柄	37.98%	38.57%
イギリス・ポンド	国債証券 20銘柄	7.73%	7.85%
オーストラリア・ドル	国債証券 5銘柄	1.50%	1.52%
カナダ・ドル	国債証券 6銘柄	2.28%	2.32%
シンガポール・ドル	国債証券 2銘柄	0.35%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.54%	0.55%
ノルウェー・クローネ	国債証券 2銘柄	0.33%	0.33%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	0.86%	0.87%
マレーシア・リングギット	国債証券 2銘柄	0.52%	0.53%
メキシコ・ペソ	国債証券 4銘柄	0.99%	1.01%
ユーロ	国債証券 80銘柄	44.94%	45.64%
南アフリカ・ランド	国債証券 2銘柄	0.44%	0.45%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

（参考）

「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」は、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」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、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの計算期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンド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。

（参考）

「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」は、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」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、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの計算期間末日（以下、「計算日」という。）における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成26年2月21日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,064,702,053

株式	32,103,450,210
派生商品評価勘定	5,664,090
未収配当金	35,026,168
前払金	5,320,000
差入委託証拠金	19,950,000
流動資産合計	33,234,112,521
資産合計	33,234,112,521
負債の部	
流動負債	
未払解約金	669,777,694
流動負債合計	669,777,694
負債合計	669,777,694
純資産の部	
元本等	
元本	28,179,989,310
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,384,345,517
純資産合計	32,564,334,827
負債純資産合計	33,234,112,521

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26年2月21日現在）
1. 計算日における受益権総口数	28,179,989,310口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1556円 (11,556円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年2月22日 至 平成26年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成26年2月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	728,758,930
合計	728,758,930

（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26年2月21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	458,470,000	-	464,170,000	5,700,000
合計	458,470,000	-	464,170,000	5,700,000

（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。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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計算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26年2月21日現在)
同計算期間の期首元本額	38,535,873,339円
同計算期間中の追加設定元本額	10,048,705,621円
同計算期間中の一部解約元本額	20,404,589,650円
同計算期間末日の元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	10,548,302,283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）	12,171,873,018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）	97,042,774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）	21,368,580円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	566,439,388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）	181,354,924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）	1,297,141,376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）	1,236,492,425円
ニッセイ厚生年金型バランス運用（現物型）DB（適格機関投資家限定）	2,059,974,542円
計	28,179,989,310円

附属明細表（平成26年2月21日現在）

第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	8,000	271	2,168,000	
日本水産	25,400	231	5,867,400	
マル八ニチロホールディングス	40,000	175	7,000,000	
サカタのタネ	3,100	1,341	4,157,100	
ホクト	2,300	1,954	4,494,200	
ショーボンドHD	1,800	4,645	8,361,000	
ミライト・ホールディングス	5,900	947	5,587,300	

タマホーム	1,200	866	1,039,200
住石ホールディングス	4,500	127	571,500
日鉄鉱業	5,000	433	2,165,000
三井松島	14,000	158	2,212,000
国際石油開発帝石	100,800	1,310	132,048,000
日本海洋掘削	500	4,900	2,450,000
石油資源開発	3,000	3,830	11,490,000
K & Oエナジーグループ	1,100	1,331	1,464,100
安藤・間	13,800	377	5,202,600
東急建設	7,400	413	3,056,200
コムシスホールディングス	10,100	1,662	16,786,200
ミサワホーム	2,200	1,340	2,948,000
高松建設	1,600	1,795	2,872,000
東建コーポレーション	780	4,635	3,615,300
ヤマウラ	4,100	278	1,139,800
大成建設	105,000	453	47,565,000
大林組	62,000	606	37,572,000
清水建設	63,000	539	33,957,000
飛島建設	12,700	151	1,917,700
長谷工コーポレーション	27,600	688	18,988,800
松井建設	3,000	404	1,212,000
鹿島建設	91,000	366	33,306,000
不動テトラ	14,600	179	2,613,400
鉄建建設	13,000	271	3,523,000
日鉄住金テックスエンジ	3,000	370	1,110,000
西松建設	27,000	357	9,639,000
三井住友建設	55,700	108	6,015,600
大豊建設	6,000	336	2,016,000
前田建設	13,000	638	8,294,000
佐田建設	9,000	125	1,125,000
ナカノフドー建設	4,800	228	1,094,400
奥村組	18,000	454	8,172,000
大和小田急建設	4,500	247	1,111,500
東鉄工業	2,500	2,037	5,092,500
戸田建設	24,000	321	7,704,000
熊谷組	21,000	253	5,313,000
青木あすなろ建設	2,000	568	1,136,000

北野建設	4,000	268	1,072,000	
植木組	6,000	198	1,188,000	
三井ホーム	3,000	472	1,416,000	
矢作建設	2,800	963	2,696,400	
大東建託	7,900	9,615	75,958,500	
新日本建設	3,700	309	1,143,300	
NIPPON	5,000	1,496	7,480,000	
東亜道路	4,000	454	1,816,000	
前田道路	6,000	1,600	9,600,000	
日本道路	6,000	502	3,012,000	
東亜建設	18,000	212	3,816,000	
若築建設	11,000	135	1,485,000	
東洋建設	6,400	341	2,182,400	
五洋建設	24,500	376	9,212,000	
大林道路	2,000	568	1,136,000	
世紀東急	11,000	117	1,287,000	
福田組	3,000	412	1,236,000	
住友林業	14,300	1,070	15,301,000	
日本基礎技術	3,400	338	1,149,200	
日成ビルド工業	5,000	234	1,170,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	9,000	116	1,044,000	
巴コーポレーション	2,600	419	1,089,400	
パナホーム	8,000	707	5,656,000	
大和ハウス	57,000	1,884	107,388,000	
ライト工業	4,300	836	3,594,800	
積水ハウス	54,400	1,335	72,624,000	
日特建設	2,700	373	1,007,100	
北陸電気工事	2,000	473	946,000	
ユアテック	3,000	346	1,038,000	
西部電気工業	2,000	465	930,000	
四電工	3,000	354	1,062,000	
中電工	3,000	1,678	5,034,000	
関電工	9,000	538	4,842,000	
きんでん	14,000	1,060	14,840,000	
東京エネシス	2,000	468	936,000	
トーエネック	3,000	602	1,806,000	
住友電設	1,400	1,330	1,862,000	

日本電設工業	3,000	1,336	4,008,000
協和エクシオ	8,100	1,427	11,558,700
新日本空調	1,800	629	1,132,200
日本工営	6,000	453	2,718,000
N D S	4,000	291	1,164,000
九電工	4,000	787	3,148,000
三機工業	4,000	575	2,300,000
日 揮	21,000	3,702	77,742,000
中外炉工業	6,000	227	1,362,000
太平電業	3,000	646	1,938,000
高砂熱学	5,900	1,037	6,118,300
三晃金属	4,000	272	1,088,000
N E C ネットズエスアイ	2,000	2,299	4,598,000
明星工業	3,000	438	1,314,000
アタカ大機	3,000	390	1,170,000
大 氣 社	2,700	2,014	5,437,800
ダイダン	3,000	537	1,611,000
日比谷総合設備	2,500	1,173	2,932,500
東芝プラントシステム	3,400	1,378	4,685,200
日本製粉	13,000	512	6,656,000
日清製粉G本社	20,700	1,054	21,817,800
日東富士製粉	4,000	320	1,280,000
昭和産業	9,000	348	3,132,000
協同飼料	10,000	109	1,090,000
中部飼料	2,000	623	1,246,000
日本配合飼料	10,000	122	1,220,000
東洋精糖	11,000	100	1,100,000
日本甜菜糖	11,000	196	2,156,000
三井製糖	8,000	420	3,360,000
ネクスト	1,600	859	1,374,400
日本M & A センター	1,000	8,390	8,390,000
ノバレーゼ	1,300	930	1,209,000
アコーディア・ゴルフ	7,900	1,301	10,277,900
タケエイ	1,300	984	1,279,200
パソナグループ	1,700	659	1,120,300
リンクアンドモチベーション	52	21,670	1,126,840
G C A サヴィアン	1,300	829	1,077,700

エス・エム・エス	1,100	2,173	2,390,300	
テンプホールディングス	4,200	3,000	12,600,000	
リニカル	1,200	915	1,098,000	
クックパッド	900	2,823	2,540,700	
森永製菓	21,000	224	4,704,000	
中村屋	5,000	403	2,015,000	
江崎グリコ	7,000	1,425	9,975,000	
名糖産業	1,100	1,037	1,140,700	
不二家	12,000	190	2,280,000	
山崎製パン	15,000	1,153	17,295,000	
モロゾフ	4,000	314	1,256,000	
亀田製菓	1,200	2,906	3,487,200	
カルビー	7,600	2,555	19,418,000	
森永乳業	17,000	318	5,406,000	
ヤクルト	12,100	5,040	60,984,000	
明治ホールディングス	6,100	6,320	38,552,000	
雪印メグミルク	4,500	1,309	5,890,500	
プリマハム	10,000	188	1,880,000	
日本ハム	14,000	1,637	22,918,000	
伊藤ハム	11,000	443	4,873,000	
林兼産業	14,000	78	1,092,000	
丸大食品	10,000	308	3,080,000	
S Foods	1,500	1,066	1,599,000	
スタジオアリス	800	1,342	1,073,600	
シミックホールディングス	800	1,422	1,137,600	
システナ	1,800	751	1,351,800	
NECフィールディング	1,600	1,576	2,521,600	
デジタルアーツ	1,400	756	1,058,400	
新日鉄住金SOL	1,500	2,760	4,140,000	
総合警備保障	7,000	2,041	14,287,000	
日本駐車場開発	19,800	105	2,079,000	
コア	1,500	737	1,105,500	
カカクコム	11,700	1,695	19,831,500	
ルネサンス	1,400	818	1,145,200	
SBSホールディングス	700	1,700	1,190,000	
新日本科学	1,600	1,238	1,980,800	
ツクイ	2,100	1,040	2,184,000	

エムスリー	64	315,500	20,192,000	
アウトソーシング	1,000	1,074	1,074,000	
ディー・エヌ・エー	10,400	2,117	22,016,800	
博報堂D Y H L D G S	26,800	795	21,306,000	
ぐるなび	1,300	3,525	4,582,500	
一休	14	130,400	1,825,600	
ジェイコムホールディングス	1,500	730	1,095,000	
P G Mホールディングス	2,700	935	2,524,500	
バリューコマース	1,200	1,051	1,261,200	
サッポロホールディングス	34,000	380	12,920,000	
アサヒグループホールディン	41,600	2,666	110,905,600	
麒麟H D	89,000	1,371	122,019,000	
宝ホールディングス	16,000	801	12,816,000	
オエノンホールディングス	5,000	217	1,085,000	
養命酒	2,000	847	1,694,000	
コカ・コーラウエスト	6,400	1,869	11,961,600	
コカ・コーライーストジャパン	4,300	2,328	10,010,400	
サントリー食品インター	10,600	3,490	36,994,000	
ダイドードリンコ	1,000	4,130	4,130,000	
伊藤園	5,600	2,250	12,600,000	
キーコーヒー	2,000	1,592	3,184,000	
ユニカフェ	1,800	649	1,168,200	
ジャパンフーズ	900	1,235	1,111,500	
日清オイリオグループ	9,000	334	3,006,000	
不二製油	5,000	1,389	6,945,000	
かどや製油	400	2,683	1,073,200	
J - オイルミルズ	9,000	275	2,475,000	
ローソン	7,500	7,280	54,600,000	
サンエー	1,400	2,957	4,139,800	
ダイユーエイト	1,600	660	1,056,000	
カワチ薬品	1,300	1,892	2,459,600	
エービーシー・マート	2,600	4,395	11,427,000	
ハードオフコーポレーション	1,300	873	1,134,900	
高千穂交易	1,000	1,030	1,030,000	
アスクル	1,900	3,670	6,973,000	
ゲオホールディングス	3,100	940	2,914,000	
アダストリアホールディング	1,400	2,482	3,474,800	

伊藤忠食品	400	3,500	1,400,000	
くらコーポレーション	1,100	1,733	1,906,300	
キャンドウ	900	1,555	1,399,500	
エレマテック	900	1,909	1,718,100	
バル	1,100	1,928	2,120,800	
JALUX	1,000	1,185	1,185,000	
エディオン	8,400	537	4,510,800	
あらた	4,000	333	1,332,000	
サーラコーポレーション	2,200	508	1,117,600	
トーメンデバイス	600	1,770	1,062,000	
J Pホールディングス	3,200	473	1,513,600	
ひらまつ	1,900	735	1,396,500	
双日	122,200	183	22,362,600	
ゲンキー	500	2,245	1,122,500	
アルフレッサホールディングス	5,400	6,010	32,454,000	
大黒天物産	400	2,722	1,088,800	
ハニーズ	1,440	893	1,285,920	
キッコーマン	17,000	1,917	32,589,000	
味の素	49,000	1,562	76,538,000	
キューピー	10,500	1,439	15,109,500	
ハウス食品G本社	7,300	1,612	11,767,600	
カゴメ	8,000	1,743	13,944,000	
アリアケジャパン	1,900	2,445	4,645,500	
ニチレイ	22,000	443	9,746,000	
横浜冷凍	4,500	805	3,622,500	
東洋水産	10,000	3,360	33,600,000	
日清食品HD	8,100	4,575	37,057,500	
永谷園	2,000	968	1,936,000	
フジッコ	2,000	1,201	2,402,000	
ロックフィールド	1,100	1,820	2,002,000	
日本たばこ産業	114,800	3,356	385,268,800	
ケンコーマヨネーズ	1,200	881	1,057,200	
わらべや日洋	1,200	1,923	2,307,600	
なとり	1,000	1,143	1,143,000	
片倉工業	2,200	1,122	2,468,400	
ゲンゼ	16,000	269	4,304,000	
ヒューリック	30,800	1,288	39,670,400	

山下医科器械	700	1,655	1,158,500	
ラサ商事	2,400	469	1,125,600	
アルペン	1,600	1,774	2,838,400	
クオール	1,800	602	1,083,600	
アルコニックス	500	2,244	1,122,000	
ジェイアイエヌ	900	2,677	2,409,300	
ビックカメラ	69	60,500	4,174,500	
D C Mホールディングス	9,000	675	6,075,000	
MonotaRO	2,800	2,162	6,053,600	
あいホールディングス	2,900	1,528	4,431,200	
J. フロントリテイリング	43,000	706	30,358,000	
ドトール・日レスHD	3,200	1,711	5,475,200	
マツモトキヨシHLDGS	3,800	3,285	12,483,000	
スタートトゥデイ	5,700	2,348	13,383,600	
物語コーポレーション	400	3,070	1,228,000	
ココカラファイン	1,900	2,699	5,128,100	
三越伊勢丹HD	36,300	1,206	43,777,800	
東洋紡	82,000	184	15,088,000	
ユニチカ	53,000	63	3,339,000	
富士紡ホールディングス	10,000	212	2,120,000	
日清紡ホールディングス	12,000	899	10,788,000	
倉敷紡績	20,000	183	3,660,000	
ダイワボウHD	17,000	186	3,162,000	
シキボウ	11,000	121	1,331,000	
日東紡績	14,000	435	6,090,000	
トヨタ紡織	6,500	1,080	7,020,000	
ウエルシアHD	700	5,730	4,011,000	
クリエイトSDH	800	3,420	2,736,000	
バイタルKSKHD	3,400	703	2,390,200	
UKCホールディングス	1,200	1,794	2,152,800	
TOKAIホールディングス	8,900	336	2,990,400	
日本毛織	6,000	737	4,422,000	
ダイドーリミテッド	2,200	653	1,436,600	
東京建物不動産販	2,700	403	1,088,100	
野村不動産HLDGS	12,100	2,226	26,934,600	
プレサンスコーポレーション	400	2,766	1,106,400	
常和ホールディングス	600	3,275	1,965,000	

フージャースHD	2,700	614	1,657,800
オープンハウス	700	2,002	1,401,400
東急不動産HD	40,500	837	33,898,500
飯田GHD	8,000	1,603	12,824,000
帝国繊維	2,000	1,445	2,890,000
ブックオフコーポレーション	1,500	721	1,081,500
日本コークス工業	15,700	132	2,072,400
あさひ	1,100	1,358	1,493,800
日本調剤	400	2,771	1,108,400
コスモス薬品	1,000	12,850	12,850,000
シップヘルスケアHD	2,600	3,695	9,607,000
セブン&アイ・HLDGS	76,300	4,016	306,420,800
ツルハホールディングス	1,800	9,740	17,532,000
サンマルクホールディングス	600	4,800	2,880,000
フェリシモ	1,100	1,001	1,101,100
トリドール	1,600	975	1,560,000
クスリのアオキ	300	5,710	1,713,000
帝人	79,000	242	19,118,000
東レ	141,000	713	100,533,000
クラレ	30,800	1,149	35,389,200
旭化成	121,000	739	89,419,000
サカイオーベックス	6,000	183	1,098,000
稲葉製作所	900	1,237	1,113,300
宮地エンジニアリングG	6,000	242	1,452,000
トーカロ	1,200	1,638	1,965,600
アルファCO	1,100	998	1,097,800
SUMCO	11,800	798	9,416,400
川田テクノロジーズ	400	2,577	1,030,800
住江織物	5,000	299	1,495,000
日本フェルト	2,400	471	1,130,400
日本バイリン	2,000	614	1,228,000
芦森工業	9,000	124	1,116,000
アツギ	16,000	115	1,840,000
ダイニック	6,000	180	1,080,000
共和レザー	2,200	513	1,128,600
セーレン	5,200	834	4,336,800
東海染工	9,000	122	1,098,000

小松精練	3,000	476	1,428,000
ワコールホールディングス	12,000	1,101	13,212,000
ホギメディカル	1,200	5,450	6,540,000
T S Iホールディングス	9,300	623	5,793,900
I Tホールディングス	6,600	1,770	11,682,000
電算システム	1,000	1,108	1,108,000
グリー	10,900	1,158	12,622,200
コーエーテクモHD	3,600	1,228	4,420,800
三菱総合研究所	700	2,128	1,489,600
ヒト・コミュニケーションズ	600	1,851	1,110,600
K L a b	1,500	707	1,060,500
ポルトゥウィン・ピットクル	1,100	1,626	1,788,600
ネクソン	15,100	894	13,499,400
アイスタイル	2,100	552	1,159,200
エムアップ	1,500	745	1,117,500
エイチーム	200	6,730	1,346,000
ブロードリーフ	1,800	1,470	2,646,000
特種東海製紙	11,000	215	2,365,000
ドワンゴ	1,600	2,635	4,216,000
ティーガイア	1,800	1,074	1,933,200
GMOペイメントゲートウェイ	700	5,170	3,619,000
ザッパラス	1,500	715	1,072,500
インターネットイニシアティブ	2,700	2,050	5,535,000
ビットアイル	1,600	737	1,179,200
S R Aホールディングス	900	1,363	1,226,700
王子ホールディングス	86,000	504	43,344,000
日本製紙	10,000	2,072	20,720,000
三菱製紙	28,000	94	2,632,000
北越紀州製紙	13,000	457	5,941,000
中越パルプ	7,000	215	1,505,000
大王製紙	7,000	997	6,979,000
レンゴー	16,000	598	9,568,000
トーモク	6,000	318	1,908,000
ザ・バック	1,400	1,872	2,620,800
コ・ブケミカル	8,000	132	1,056,000
昭和電工	129,000	152	19,608,000
住友化学	143,000	422	60,346,000

日本化成	8,000	138	1,104,000	
住友精化	4,000	809	3,236,000	
日産化学	13,300	1,527	20,309,100	
ラサ工業	7,000	156	1,092,000	
クレハ	14,000	491	6,874,000	
石原産業	35,000	111	3,885,000	
片倉チツカリン	4,000	270	1,080,000	
日本曹達	12,000	564	6,768,000	
東ソー	52,000	417	21,684,000	
トクヤマ	30,000	379	11,370,000	
セントラル硝子	19,000	344	6,536,000	
東亜合成	23,000	429	9,867,000	
ダイソー	8,000	346	2,768,000	
関東電化	5,000	271	1,355,000	
電気化学	39,000	398	15,522,000	
イビデン	11,300	2,012	22,735,600	
信越化学	34,700	5,722	198,553,400	
日本カ - バイド	6,000	233	1,398,000	
堺 化 学	8,000	316	2,528,000	
エア・ウォーター	16,000	1,563	25,008,000	
大陽日酸	25,000	791	19,775,000	
日本パ - カライジング	5,000	2,282	11,410,000	
高圧ガス	3,000	581	1,743,000	
四国化成	3,000	746	2,238,000	
ステラ ケミファ	1,000	1,408	1,408,000	
保土谷化学	6,000	188	1,128,000	
日本触媒	16,000	1,224	19,584,000	
大日精化	7,000	443	3,101,000	
カネカ	24,000	647	15,528,000	
協和発酵キリン	23,000	1,109	25,507,000	
三菱瓦斯化学	31,000	704	21,824,000	
三井化学	88,000	270	23,760,000	
J S R	17,800	1,780	31,684,000	
東京応化工業	3,700	2,136	7,903,200	
大阪有機化学	1,200	468	561,600	
三菱ケミカルH L D G S	121,100	466	56,432,600	
日本合成化学	4,000	874	3,496,000	

ダイセル	25,000	912	22,800,000	
住友ベークライト	15,000	395	5,925,000	
積水化学	40,000	1,153	46,120,000	
日本ゼオン	15,000	1,048	15,720,000	
アイカ工業	5,400	2,129	11,496,600	
宇部興産	98,000	192	18,816,000	
積水樹脂	2,700	1,399	3,777,300	
タキロン	5,000	440	2,200,000	
旭有機材	7,000	234	1,638,000	
日立化成	8,400	1,456	12,230,400	
リケンテクノス	3,000	566	1,698,000	
大倉工業	5,000	318	1,590,000	
積水化成成品	6,000	262	1,572,000	
群栄化学	5,000	406	2,030,000	
タイガース ポリマー	2,400	444	1,065,600	
ミライアル	800	1,421	1,136,800	
日本化薬	14,000	1,370	19,180,000	
イーピーエス	21	118,500	2,488,500	
パナソニック インフォシス	400	2,779	1,111,600	
プレステージ・インター	1,300	948	1,232,400	
フェイス	1,000	1,053	1,053,000	
アミューズ	600	1,844	1,106,400	
野村総合研究所	10,300	3,500	36,050,000	
サイバネットシステム	2,900	377	1,093,300	
T A C	2,000	371	742,000	
ケネディクス	22,800	382	8,709,600	
電通	18,200	3,980	72,436,000	
インテージホールディングス	1,000	1,375	1,375,000	
テイクアンドグヴニーズ	800	2,194	1,755,200	
イオンファンタジー	800	1,474	1,179,200	
日本精化	1,700	643	1,093,100	
A D E K A	8,300	1,144	9,495,200	
日油	16,000	705	11,280,000	
新日本理化	4,700	242	1,137,400	
ハリマ化成グループ	2,400	473	1,135,200	
花王	50,400	3,420	172,368,000	
第一工業製薬	4,000	324	1,296,000	

三洋化成	6,000	696	4,176,000	
武田薬品	72,500	4,857	352,132,500	
アステラス製薬	44,600	6,300	280,980,000	
大日本住友製薬	13,700	1,799	24,646,300	
塩野義製薬	30,200	2,103	63,510,600	
田辺三菱製薬	16,100	1,499	24,133,900	
わかもと製薬	4,000	281	1,124,000	
あすか製薬	2,300	919	2,113,700	
日本新薬	4,000	1,982	7,928,000	
ピオフェルミン製薬	400	2,759	1,103,600	
中外製薬	19,300	2,454	47,362,200	
科研製薬	7,000	1,592	11,144,000	
エーザイ	23,800	3,947	93,938,600	
ロート製薬	8,100	1,718	13,915,800	
小野薬品	8,800	9,970	87,736,000	
久光製薬	6,000	4,740	28,440,000	
持田製薬	1,400	6,880	9,632,000	
参天製薬	7,100	4,675	33,192,500	
扶桑薬品	7,000	342	2,394,000	
日本ケミファ	3,000	544	1,632,000	
ツムラ	5,700	2,756	15,709,200	
日医工	4,500	1,573	7,078,500	
テルモ	14,200	4,440	63,048,000	
みらかホールディングス	5,100	4,705	23,995,500	
キッセイ薬品工業	3,600	2,768	9,964,800	
生化学工業	4,000	1,398	5,592,000	
栄研化学	1,500	1,775	2,662,500	
日水製薬	1,000	1,070	1,070,000	
鳥居薬品	1,300	3,290	4,277,000	
JCRファーマ	1,100	2,400	2,640,000	
東和薬品	1,000	5,030	5,030,000	
富士製薬工業	600	1,893	1,135,800	
沢井製薬	3,100	6,300	19,530,000	
ゼリア新薬工業	3,000	2,665	7,995,000	
第一三共	61,100	1,726	105,458,600	
キョーリン製薬HD	5,200	2,215	11,518,000	
大幸薬品	900	2,260	2,034,000	

ダイト	700	1,525	1,067,500
大塚ホールディングス	38,500	3,134	120,659,000
大正製薬HD	4,700	7,680	36,096,000
大日本塗料	11,000	164	1,804,000
日本ペイント	17,000	1,547	26,299,000
関西ペイント	23,000	1,362	31,326,000
中国塗料	6,000	571	3,426,000
日本特殊塗料	1,800	729	1,312,200
藤倉化成	2,400	608	1,459,200
太陽ホールディングス	1,600	3,395	5,432,000
D I C	69,000	286	19,734,000
サカタインクス	4,000	928	3,712,000
東洋インキS Cホールディン	17,000	485	8,245,000
T & K T O K A	700	2,199	1,539,300
アルプス技研	1,200	962	1,154,400
サニックス	2,800	966	2,704,800
日本空調サービス	900	1,236	1,112,400
オリエンタルランド	5,200	15,460	80,392,000
ダスキン	5,200	1,937	10,072,400
パーク24	9,600	2,143	20,572,800
明光ネットワークジャパン	1,900	1,132	2,150,800
ファルコSDホールディングス	1,000	1,326	1,326,000
クレスコ	1,200	1,073	1,287,600
フジ・メディア・HD	17,600	1,860	32,736,000
秀英予備校	3,400	331	1,125,400
田谷	1,500	745	1,117,500
ラウンドワン	5,500	772	4,246,000
リゾートトラスト	6,500	1,736	11,284,000
オービック	6,300	3,305	20,821,500
T D Cソフトウェアエンジニア	1,400	819	1,146,600
ヤフー	132,100	630	83,223,000
ビー・エム・エル	1,300	3,590	4,667,000
トレンドマイクロ	8,100	3,420	27,702,000
もしもしホットライン	3,600	1,001	3,603,600
日本オラクル	2,900	4,385	12,716,500
アルファシステムズ	800	1,389	1,111,200
フューチャーアーキテクト	2,200	619	1,361,800

シーエーシー	1,200	954	1,144,800
ソフトバンク・テクノ	800	1,384	1,107,200
トーセ	1,500	763	1,144,500
ユー・エス・エス	23,400	1,432	33,508,800
オービックビジネスC	900	3,610	3,249,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,100	4,680	9,828,000
アイティフォー	2,400	468	1,123,200
東計電算	700	1,433	1,003,100
楽天	62,700	1,463	91,730,100
エクスネット	800	1,357	1,085,600
大塚商会	1,600	12,870	20,592,000
総合メディカル	400	3,920	1,568,000
サイボウズ	3,100	359	1,112,900
アグレックス	1,100	1,067	1,173,700
セントラルスポーツ	700	1,507	1,054,900
バラカ	1,100	740	814,000
電通国際情報S	1,100	1,055	1,160,500
イーエムシステムズ	500	2,341	1,170,500
ウェザーニューズ	500	2,635	1,317,500
C I J	2,700	405	1,093,500
WOWOW	600	3,450	2,070,000
富士フイルムHLDGS	44,300	2,957	130,995,100
コニカミノルタ	49,000	1,078	52,822,000
資生堂	34,400	1,746	60,062,400
ライオン	22,000	559	12,298,000
高砂香料	7,000	592	4,144,000
マンダム	1,900	3,575	6,792,500
ミルボン	1,200	3,465	4,158,000
ファンケル	4,500	1,208	5,436,000
コーセー	3,100	3,275	10,152,500
ドクターシーラボ	1,300	3,100	4,030,000
ポーラ・オルビスHD	2,000	4,005	8,010,000
ノエビアホールディングス	1,300	1,827	2,375,100
エステー	1,200	989	1,186,800
コニシ	1,400	1,786	2,500,400
長谷川香料	2,500	1,507	3,767,500
星光PMC	1,400	874	1,223,600

小林製薬	3,200	5,670	18,144,000	
荒川化学工業	1,600	906	1,449,600	
メック	1,500	988	1,482,000	
日本高純度化学	5	218,000	1,090,000	
J C U	300	5,790	1,737,000	
新田ゼラチン	1,200	946	1,135,200	
アース製薬	1,400	3,530	4,942,000	
イハラケミカル	3,000	762	2,286,000	
大成ラミック	500	2,639	1,319,500	
クミアイ化学	4,000	573	2,292,000	
日本農薬	4,000	1,469	5,876,000	
昭和シエル石油	17,400	1,012	17,608,800	
コスモ石油	54,000	204	11,016,000	
ニチレキ	2,000	1,086	2,172,000	
東燃ゼネラル石油	29,000	908	26,332,000	
ユシロ化学	1,200	1,043	1,251,600	
富士石油	5,000	310	1,550,000	
M O R E S C O	700	1,700	1,190,000	
出光興産	9,200	2,234	20,552,800	
J X ホールディングス	215,000	528	113,520,000	
横浜ゴム	22,000	969	21,318,000	
東洋ゴム	16,000	716	11,456,000	
ブリヂストン	60,700	3,620	219,734,000	
住友ゴム	15,100	1,350	20,385,000	
藤倉ゴム	1,200	1,071	1,285,200	
オカモト	7,000	346	2,422,000	
アキレス	15,000	143	2,145,000	
フ コ ク	400	1,018	407,200	
ニッタ	1,900	2,339	4,444,100	
東海ゴム工業	3,600	1,023	3,682,800	
三ツ星ベルト	5,000	555	2,775,000	
バンドー化学	7,000	397	2,779,000	
鬼怒川ゴム	3,000	457	1,371,000	
旭硝子	95,000	559	53,105,000	
日本板硝子	93,000	132	12,276,000	
石塚硝子	4,000	318	1,272,000	
有沢製作所	3,200	595	1,904,000	

日本山村硝子	8,000	171	1,368,000
日本電気硝子	40,000	457	18,280,000
オハラ	1,900	600	1,140,000
住友大阪セメント	37,000	394	14,578,000
太平洋セメント	114,000	376	42,864,000
デイ・シイ	2,000	553	1,106,000
リゾートソリューション	5,000	243	1,215,000
日本ヒコ - ム	2,000	835	1,670,000
日本コンクリ - ト	3,000	411	1,233,000
三谷セキサン	1,000	1,295	1,295,000
ジャパンパイル	1,700	891	1,514,700
東海カーボン	18,000	318	5,724,000
日本カーボン	10,000	189	1,890,000
東洋炭素	1,200	2,093	2,511,600
ノリタケ	11,000	244	2,684,000
TOTO	28,000	1,459	40,852,000
日本碍子	24,000	2,133	51,192,000
日本特殊陶業	17,000	2,289	38,913,000
MARUWA	500	3,745	1,872,500
品川リフラクトリーズ	5,000	221	1,105,000
ヨータイ	4,000	305	1,220,000
東京窯業	5,000	216	1,080,000
ニッカトー	2,000	406	812,000
フジミインコーポレーテッド	1,800	1,126	2,026,800
ニチアス	9,000	709	6,381,000
新日鐵住金	818,000	305	249,490,000
神戸製鋼所	268,000	142	38,056,000
合同製鐵	10,000	168	1,680,000
JFEホールディングス	49,400	2,105	103,987,000
日新製鋼HD	8,200	1,022	8,380,400
東京製鐵	10,600	487	5,162,200
共英製鋼	1,800	2,014	3,625,200
大和工業	4,000	3,135	12,540,000
東京鐵鋼	4,000	396	1,584,000
大阪製鐵	1,000	1,780	1,780,000
淀川製鋼所	14,000	431	6,034,000
東洋鋼鈑	5,000	514	2,570,000

丸一鋼管	6,500	2,762	17,953,000	
モリ工業	3,000	400	1,200,000	
大同特殊鋼	32,000	479	15,328,000	
日本高周波	11,000	101	1,111,000	
日本冶金工	15,000	269	4,035,000	
山陽特殊製鋼	11,000	421	4,631,000	
愛知製鋼	10,000	426	4,260,000	
日立金属	17,000	1,543	26,231,000	
日本金属	8,000	126	1,008,000	
大平洋金属	13,000	338	4,394,000	
日本電工	8,000	278	2,224,000	
栗本鉄工所	10,000	248	2,480,000	
日本鑄鉄管	5,000	218	1,090,000	
日本製鋼所	28,000	513	14,364,000	
三菱製鋼	12,000	239	2,868,000	
日亜鋼業	3,000	347	1,041,000	
大紀アルミニウム	4,000	240	960,000	
日本軽金属HD	43,800	143	6,263,400	
三井金属	49,000	271	13,279,000	
東邦亜鉛	11,000	338	3,718,000	
三菱マテリアル	121,000	332	40,172,000	
住友鉱山	50,000	1,389	69,450,000	
DOWAホールディングス	21,000	883	18,543,000	
古河機金	33,000	185	6,105,000	
大阪チタニウム	2,100	1,584	3,326,400	
東邦チタニウム	3,300	639	2,108,700	
UACJ	25,000	403	10,075,000	
古河電工	61,000	272	16,592,000	
住友電工	72,900	1,601	116,712,900	
フジクラ	31,000	480	14,880,000	
昭和電線HLDGS	25,000	103	2,575,000	
タツタ電線	2,800	627	1,755,600	
沖電線	6,000	177	1,062,000	
カナレ電気	500	1,439	719,500	
リョービ	12,000	357	4,284,000	
アサヒHD	2,900	1,765	5,118,500	
東洋製罐グループHD	13,800	1,876	25,888,800	

ホッカホールディングス	5,000	298	1,490,000	
コロナ	500	1,084	542,000	
横河ブリッジHLDGS	4,000	1,304	5,216,000	
駒井ハルテック	4,000	304	1,216,000	
高田機工	5,000	206	1,030,000	
三和ホールディングス	16,000	693	11,088,000	
文化シヤッタ-	5,000	616	3,080,000	
三協立山	2,400	2,317	5,560,800	
東洋シヤッタ-	1,800	613	1,103,400	
LIXILグループ	27,000	2,925	78,975,000	
日本ファイルコン	2,700	438	1,182,600	
ノーリツ	3,800	2,123	8,067,400	
長府製作所	2,100	2,426	5,094,600	
リンナイ	3,000	8,360	25,080,000	
ユニプレス	3,000	1,824	5,472,000	
ダイニチ工業	1,600	712	1,139,200	
岡 部	3,800	1,355	5,149,000	
東 プ レ	3,700	1,266	4,684,200	
高周波熱錬	2,800	731	2,046,800	
東京製綱	13,000	166	2,158,000	
サンコール	2,000	645	1,290,000	
パイオラックス	900	3,740	3,366,000	
日本発条	15,400	1,070	16,478,000	
三浦工業	2,900	2,687	7,792,300	
タ ク マ	6,000	870	5,220,000	
リブセンス	1,000	1,654	1,654,000	
ツ ガ ミ	6,000	595	3,570,000	
オークマ	13,000	920	11,960,000	
東芝機械	11,000	503	5,533,000	
ア マ ダ	30,000	836	25,080,000	
アイダエンジニア	4,500	1,101	4,954,500	
富士機械製造	5,900	897	5,292,300	
牧野フライス	10,000	823	8,230,000	
オーエスジー	8,000	1,850	14,800,000	
ダイジェット	7,000	148	1,036,000	
旭ダイヤモンド	5,000	1,184	5,920,000	
DMG森精機	10,200	1,631	16,636,200	

ディスコ	2,100	6,600	13,860,000	
日東工器	1,100	1,871	2,058,100	
豊田自動織機	16,800	4,885	82,068,000	
豊和工業	1,400	781	1,093,400	
大阪機工	8,000	136	1,088,000	
東洋機械金属	1,900	606	1,151,400	
津田駒工業	7,000	162	1,134,000	
島精機製作所	2,500	1,725	4,312,500	
日阪製作所	2,000	916	1,832,000	
やまびこ	800	3,565	2,852,000	
ペガサスミシン製造	3,100	403	1,249,300	
ナプテスコ	8,800	2,477	21,797,600	
三井海洋開発	1,600	2,588	4,140,800	
レオン自動機	2,000	568	1,136,000	
S M C	5,500	25,555	140,552,500	
新川	2,000	542	1,084,000	
ホソカワミクロン	3,000	618	1,854,000	
ユニオンツール	800	2,417	1,933,600	
オイレス工業	1,800	2,258	4,064,400	
日精エーエスピー	500	2,141	1,070,500	
サト - ホールディングス	2,000	2,437	4,874,000	
日本エア-テック	2,300	492	1,131,600	
日精樹脂工業	2,000	608	1,216,000	
ワイエイシイ	2,100	574	1,205,400	
小松製作所	90,300	2,108	190,352,400	
住友重機械	53,000	480	25,440,000	
日立建機	9,900	2,000	19,800,000	
日 工	3,000	545	1,635,000	
巴工業	700	1,631	1,141,700	
井関農機	20,000	290	5,800,000	
T O W A	2,300	501	1,152,300	
丸山製作所	5,000	249	1,245,000	
北川鉄工所	9,000	185	1,665,000	
シンニッタン	2,900	387	1,122,300	
クボタ	101,000	1,441	145,541,000	
荏原実業	800	1,353	1,082,400	
東洋エンジニア	11,000	476	5,236,000	

三菱化工機	7,000	168	1,176,000	
月島機械	3,000	1,099	3,297,000	
帝国電機製作所	700	3,095	2,166,500	
新東工業	4,500	744	3,348,000	
渋谷工業	1,200	2,069	2,482,800	
アイチ コーポレーション	2,700	441	1,190,700	
小森コーポレーション	4,700	1,330	6,251,000	
鶴見製作所	1,000	1,314	1,314,000	
住友精密	3,000	404	1,212,000	
酒井重工業	4,000	394	1,576,000	
荏原製作所	43,000	698	30,014,000	
西島製作所	2,100	1,133	2,379,300	
千代田化工建	16,000	1,536	24,576,000	
ダイキン工業	25,200	5,800	146,160,000	
オルガノ	3,000	469	1,407,000	
ト・ヨ・カネツ	10,000	291	2,910,000	
栗田工業	11,600	2,153	24,974,800	
椿本チエイン	10,000	815	8,150,000	
大同工業	4,000	285	1,140,000	
日 機 装	6,000	1,307	7,842,000	
木村化工機	2,200	501	1,102,200	
新興プランテック	4,300	784	3,371,200	
アネスト岩田	3,000	619	1,857,000	
ダイフク	8,000	1,381	11,048,000	
加藤製作所	4,000	642	2,568,000	
油研工業	5,000	229	1,145,000	
タダノ	8,000	1,337	10,696,000	
フジテック	5,000	1,271	6,355,000	
C K D	5,200	1,002	5,210,400	
キトー	1,100	1,905	2,095,500	
平和	4,000	1,713	6,852,000	
理想科学工業	1,400	2,294	3,211,600	
S A N K Y O	5,600	4,140	23,184,000	
日本金銭機械	1,700	1,807	3,071,900	
マースエンジニアリング	1,000	1,842	1,842,000	
福島工業	1,000	1,507	1,507,000	
オーイズミ	1,100	986	1,084,600	

ダイコク電機	800	2,447	1,957,600	
ア マ ノ	5,300	1,073	5,686,900	
J U K I	12,000	223	2,676,000	
サンデン	10,000	540	5,400,000	
蛇の目ミシン	18,000	83	1,494,000	
ブラザー工業	23,900	1,415	33,818,500	
マックス	3,000	1,180	3,540,000	
モリタホールディングス	3,000	839	2,517,000	
グローリー	5,500	2,632	14,476,000	
新晃工業	1,500	766	1,149,000	
大和冷機工業	3,000	703	2,109,000	
セガサミーホールディングス	19,900	2,301	45,789,900	
日本ピストンリング	7,000	193	1,351,000	
リ ケ ン	7,000	470	3,290,000	
T P R	2,100	1,650	3,465,000	
ホシザキ電機	4,000	3,695	14,780,000	
大豊工業	1,300	1,009	1,311,700	
日本精工	41,000	1,147	47,027,000	
N T N	43,000	375	16,125,000	
ジェイテクト	19,600	1,576	30,889,600	
不 二 越	17,000	602	10,234,000	
ミネベア	25,000	859	21,475,000	
日本トムソン	6,000	527	3,162,000	
T H K	11,500	2,357	27,105,500	
ユーシン精機	800	2,536	2,028,800	
前澤給装工業	900	1,301	1,170,900	
イーグル工業	2,300	1,555	3,576,500	
日本ビラ - 工業	2,000	726	1,452,000	
キッツ	8,300	494	4,100,200	
日 立	444,000	812	360,528,000	
東 芝	365,000	441	160,965,000	
三菱電機	185,000	1,204	222,740,000	
富士電機	51,000	441	22,491,000	
東洋電機製造	4,000	346	1,384,000	
安川電機	20,000	1,498	29,960,000	
シンフォニア テクノロジー	11,000	161	1,771,000	
明 電 舎	17,000	419	7,123,000	

オリジン電気	4,000	314	1,256,000	
山洋電気	3,000	667	2,001,000	
デンヨー	1,800	1,541	2,773,800	
日立工機	4,900	755	3,699,500	
三菱工業	2,300	676	1,554,800	
マキタ	12,100	5,700	68,970,000	
東芝テック	12,000	659	7,908,000	
芝浦メカトロニクス	5,000	233	1,165,000	
マブチモーター	2,600	6,230	16,198,000	
日本電産	10,000	12,175	121,750,000	
東光高岳HD	1,000	1,642	1,642,000	
ダイヘン	11,000	429	4,719,000	
JVCケンウッド	12,800	221	2,828,800	
第一精工	1,000	1,252	1,252,000	
日新電機	4,000	529	2,116,000	
大崎電気	3,000	607	1,821,000	
オムロン	20,900	4,290	89,661,000	
日東工業	2,700	2,067	5,580,900	
I D E C	2,400	902	2,164,800	
ジーエス・ユアサ コーポ	36,000	591	21,276,000	
サクサホールディングス	7,000	153	1,071,000	
メルコホールディングス	900	1,606	1,445,400	
テクノメディカ	500	2,127	1,063,500	
日本電気	254,000	308	78,232,000	
富士通	178,000	645	114,810,000	
沖電気	72,000	230	16,560,000	
電気興業	5,000	683	3,415,000	
サンケン電気	10,000	698	6,980,000	
ナカヨ通信機	3,000	318	954,000	
アイホン	1,100	1,517	1,668,700	
ルネサスエレクトロニクス	9,600	690	6,624,000	
セイコーエプソン	12,600	2,950	37,170,000	
ワコム	14,600	630	9,198,000	
アルバック	3,400	1,973	6,708,200	
アクセル	900	1,662	1,495,800	
E I Z O	1,700	2,769	4,707,300	
日本信号	4,700	918	4,314,600	

京三製作所	4,000	336	1,344,000	
能美防災	2,000	1,087	2,174,000	
エレコム	800	1,507	1,205,600	
日本無線	5,000	331	1,655,000	
パナソニック	211,300	1,170	247,221,000	
シャープ	133,000	328	43,624,000	
アンリツ	10,700	1,168	12,497,600	
富士通ゼネラル	4,000	1,100	4,400,000	
日立国際電気	4,000	1,327	5,308,000	
ソ ニ ー	101,400	1,766	179,072,400	
T D K	11,200	4,435	49,672,000	
帝国通信工業	6,000	173	1,038,000	
ミツミ電機	7,000	765	5,355,000	
タムラ製作所	7,000	282	1,974,000	
アルプス電気	13,600	1,321	17,965,600	
バイオニア	25,600	225	5,760,000	
日本電波工業	1,700	863	1,467,100	
日本トリム	400	6,390	2,556,000	
ローランド ディー . ジー .	800	3,590	2,872,000	
フォスタ - 電機	1,900	1,733	3,292,700	
クラリオン	11,000	145	1,595,000	
S M K	5,000	482	2,410,000	
ヨコオ	2,100	566	1,188,600	
東 光	9,000	383	3,447,000	
ティアック	14,000	77	1,078,000	
ホシデン	5,400	495	2,673,000	
ヒロセ電機	3,200	14,890	47,648,000	
日本航空電子	5,000	1,538	7,690,000	
T O A	2,000	974	1,948,000	
古野電気	1,800	707	1,272,600	
ユニデン	6,000	274	1,644,000	
アルパイン	4,000	1,454	5,816,000	
スミダコーポレーション	2,200	519	1,141,800	
アイコム	1,000	2,322	2,322,000	
リオン	700	1,489	1,042,300	
船井電機	1,900	1,122	2,131,800	
横河電機	20,100	1,526	30,672,600	

新電元工業	6,000	524	3,144,000
アズビル	5,600	2,494	13,966,400
日本光電工業	3,900	4,210	16,419,000
チノール	5,000	226	1,130,000
共和電業	3,000	431	1,293,000
堀場製作所	3,400	4,055	13,787,000
アドバンテスト	12,600	1,125	14,175,000
小野測器	2,000	462	924,000
エスペック	1,900	822	1,561,800
パナソニックデバイス	2,400	465	1,116,000
キーエンス	4,200	43,255	181,671,000
日置電機	1,000	1,402	1,402,000
シスメックス	7,700	5,780	44,506,000
メガチップス	1,700	1,258	2,138,600
OBARA GROUP	1,200	3,960	4,752,000
日本電産コパル電子	1,900	753	1,430,700
澤藤電機	5,000	218	1,090,000
デンソー	45,700	5,438	248,516,600
コーセル	2,700	1,183	3,194,100
オブテックス	1,200	1,606	1,927,200
千代田インテグレ	800	1,797	1,437,600
レーザーテック	1,400	1,051	1,471,400
スタンレー電気	13,300	2,303	30,629,900
岩崎電気	7,000	244	1,708,000
ウシオ電機	11,200	1,275	14,280,000
岡谷電機	2,900	391	1,133,900
ヘリオステクノH	3,200	320	1,024,000
日本セラミック	1,100	1,705	1,875,500
遠藤照明	800	2,066	1,652,800
日本デジタル研究所	1,400	1,420	1,988,000
双信電機	2,900	385	1,116,500
図研	1,300	793	1,030,900
日本電子	6,000	399	2,394,000
カシオ	19,200	1,156	22,195,200
ファナック	20,600	16,965	349,479,000
日本シイエムケイ	4,400	262	1,152,800
エンプラス	700	6,280	4,396,000

ローム	9,800	5,340	52,332,000	
浜松ホトニクス	7,200	4,300	30,960,000	
三井ハイテック	2,400	683	1,639,200	
新光電気工業	6,200	773	4,792,600	
京セラ	33,000	4,651	153,483,000	
太陽誘電	9,000	1,342	12,078,000	
村田製作所	19,400	9,532	184,920,800	
ユーシン	2,600	643	1,671,800	
双葉電子工業	3,400	1,300	4,420,000	
日東電工	16,000	4,629	74,064,000	
北陸電気工業	8,000	143	1,144,000	
東海理化電機	4,900	1,843	9,030,700	
ニチコン	5,800	871	5,051,800	
日本ケミコン	13,000	338	4,394,000	
K O A	2,300	1,109	2,550,700	
三井造船	72,000	207	14,904,000	
日立造船	13,700	595	8,151,500	
佐世保重工業	13,000	141	1,833,000	
三菱重工業	329,000	615	202,335,000	
川崎重工業	144,000	414	59,616,000	
I H I	126,000	463	58,338,000	
名村造船所	2,700	1,108	2,991,600	
サノヤスホールディングス	5,300	239	1,266,700	
日本車輛	7,000	496	3,472,000	
ニチュ三菱フォークリフト	2,000	726	1,452,000	
近畿車輛	3,000	332	996,000	
F P G	1,200	887	1,064,400	
島根銀行	800	1,313	1,050,400	
じもとホールディングス	13,100	196	2,567,600	
全国保証	2,200	4,275	9,405,000	
足利ホールディングス	7,200	494	3,556,800	
日産自動車	259,600	919	238,572,400	
いすゞ自動車	107,000	631	67,517,000	
トヨタ自動車	257,400	5,982	1,539,766,800	
日野自動車	23,100	1,535	35,458,500	
三菱自動車工業	57,900	1,109	64,211,100	
エフテック	800	1,343	1,074,400	

G M B	500	1,348	674,000	
武蔵精密工業	2,000	1,944	3,888,000	
日産車体	9,000	1,417	12,753,000	
新明和工業	7,000	849	5,943,000	
極東開発工業	3,200	1,344	4,300,800	
日信工業	3,800	2,022	7,683,600	
トピー工業	15,000	181	2,715,000	
ティラド	7,000	288	2,016,000	
曙ブレーキ	8,600	475	4,085,000	
タチエス	2,700	1,465	3,955,500	
N O K	8,900	1,744	15,521,600	
フタバ産業	5,600	449	2,514,400	
カヤバ工業	17,000	486	8,262,000	
シロキ工業	5,000	220	1,100,000	
市光工業	8,000	141	1,128,000	
大同メタル工業	3,000	986	2,958,000	
プレス工業	7,000	414	2,898,000	
カルソニックカンセイ	13,000	548	7,124,000	
太平洋工業	3,800	648	2,462,400	
ケーヒン	4,200	1,586	6,661,200	
河西工業	2,000	706	1,412,000	
アイシン精機	16,900	3,590	60,671,000	
マ ッ ダ	276,000	493	136,068,000	
ダイハツ	19,600	1,646	32,261,600	
今仙電機製作所	1,400	1,374	1,923,600	
本田技研	166,400	3,699	615,513,600	
スズキ	38,700	2,614	101,161,800	
富士重工業	62,900	2,798	175,994,200	
ヤマハ発動機	28,100	1,526	42,880,600	
ショーワ	4,400	1,300	5,720,000	
小糸製作所	10,000	1,891	18,910,000	
T B K	2,000	532	1,064,000	
エクセディ	2,200	3,040	6,688,000	
ミツバ	3,400	1,751	5,953,400	
豊田合成	6,000	2,182	13,092,000	
愛三工業	2,200	857	1,885,400	
ヨ ロ ズ	1,400	2,138	2,993,200	

エフ・シー・シー	3,000	1,824	5,472,000
新家工業	8,000	152	1,216,000
シマノ	8,000	8,750	70,000,000
タカタ	3,300	3,070	10,131,000
テイ・エス テック	3,900	3,400	13,260,000
小野建	1,600	1,308	2,092,800
はるやま商事	1,500	788	1,182,000
佐鳥電機	1,800	616	1,108,800
カップ・クリエイトHD	1,350	1,977	2,668,950
エコートレーディング	1,600	722	1,155,200
伯東	1,100	991	1,090,100
コンドーテック	1,600	700	1,120,000
ライトオン	1,600	688	1,100,800
ナガイレーベン	2,400	1,775	4,260,000
ジーンズメイト	4,900	233	1,141,700
三菱食品	2,000	2,312	4,624,000
良品計画	1,900	9,880	18,772,000
三城ホールディングス	2,400	477	1,144,800
松田産業	1,300	1,293	1,680,900
メディパルHD	18,300	1,583	28,968,900
アドヴァン	1,000	1,142	1,142,000
アズワン	1,200	2,529	3,034,800
尾家産業	1,400	832	1,164,800
シモジマ	1,300	1,007	1,309,100
ドウシシャ	1,900	1,449	2,753,100
コナカ	2,300	788	1,812,400
高速	1,300	905	1,176,500
ハウス ローゼ	800	1,400	1,120,000
イオン北海道	1,600	704	1,126,400
ヒマラヤ	1,100	1,068	1,174,800
コーナン商事	2,400	1,058	2,539,200
黒田電気	2,600	1,604	4,170,400
ネットワンシステムズ	7,200	674	4,852,800
ワタミ	2,200	1,530	3,366,000
マルシェ	1,200	834	1,000,800
ドンキホーテホールディング	6,300	6,000	37,800,000
丸文	1,900	581	1,103,900

西松屋チェーン	3,600	748	2,692,800
ゼンショーホールディングス	7,000	1,207	8,449,000
ハピネット	1,200	920	1,104,000
幸楽苑	1,100	1,346	1,480,600
トーマンエレクトロニクス	900	1,656	1,490,400
ハークスレイ	1,400	793	1,110,200
サイゼリヤ	2,700	1,247	3,366,900
アルゴグラフィックス	700	1,713	1,199,100
ガリバーインターナショナル	6,100	792	4,831,200
日本エム・ディ・エム	3,800	298	1,132,400
ユナイテッドアローズ	2,400	3,495	8,388,000
進和	1,100	1,204	1,324,400
エスケイジャパン	3,800	289	1,098,200
ダイトエレクトロン	2,700	419	1,131,300
ハイデイ日高	1,000	2,517	2,517,000
シークス	1,200	1,651	1,981,200
京都きもの友禅	1,200	1,069	1,282,800
コロワイド	6,000	1,096	6,576,000
壱番屋	700	3,785	2,649,500
マクニカ	900	2,959	2,663,100
白銅	1,200	940	1,128,000
トップカルチャー	2,400	456	1,094,400
スギホールディングス	3,300	4,060	13,398,000
島津製作所	24,000	874	20,976,000
スター精密	3,500	1,174	4,109,000
東京精密	3,300	1,938	6,395,400
ニコン	34,500	1,843	63,583,500
トプコン	5,000	1,551	7,755,000
オリンパス	32,100	3,305	106,090,500
大日本スクリーン	17,000	524	8,908,000
キヤノン電子	1,700	1,891	3,214,700
タムロン	1,400	2,431	3,403,400
HOYA	45,000	2,906	130,770,000
キヤノン	107,200	3,123	334,785,600
リコー	55,600	1,255	69,778,000
シチズンホールディングス	22,700	849	19,272,300
パラマウントベッドHD	1,800	3,210	5,778,000

SHOBI	2,700	408	1,101,600	
前田工織	1,300	1,496	1,944,800	
永大産業	2,000	612	1,224,000	
アートネイチャー	600	2,555	1,533,000	
ダンロップスポーツ	1,000	1,235	1,235,000	
バンダイナムコHLDGS	20,400	2,316	47,246,400	
共立印刷	4,000	279	1,116,000	
フランスベッドHLDGS	12,000	190	2,280,000	
マーベラスAQL	2,800	629	1,761,200	
パイロットコーポレーション	1,600	3,570	5,712,000	
エイベックス・グループHD	3,400	1,964	6,677,600	
トッパン・フォームズ	3,300	885	2,920,500	
フジシールインターナショナル	2,200	3,650	8,030,000	
タカラトミー	6,100	452	2,757,200	
アーク	5,500	303	1,666,500	
レック	900	1,188	1,069,200	
タカノ	2,200	522	1,148,400	
プロネクサス	1,900	688	1,307,200	
ホクシン	7,600	151	1,147,600	
大建工業	8,000	263	2,104,000	
きもと	1,500	706	1,059,000	
凸版印刷	52,000	755	39,260,000	
大日本印刷	56,000	1,023	57,288,000	
図書印刷	3,000	455	1,365,000	
共同印刷	6,000	281	1,686,000	
日本写真印刷	3,100	1,497	4,640,700	
光村印刷	4,000	267	1,068,000	
藤森工業	1,700	2,381	4,047,700	
前澤化成工業	1,400	1,053	1,474,200	
アシックス	18,400	1,915	35,236,000	
ツツミ	900	2,338	2,104,200	
ジェイエスピー	1,300	1,499	1,948,700	
ニチハ	2,400	1,269	3,045,600	
ローランド	1,800	1,413	2,543,400	
エフピコ	1,000	6,020	6,020,000	
小松ウオール工業	600	1,998	1,198,800	
ヤマハ	13,600	1,386	18,849,600	

河合楽器	6,000	178	1,068,000	
クリナップ	1,900	837	1,590,300	
ビジョン	3,000	4,545	13,635,000	
天馬	1,500	1,402	2,103,000	
キングジム	1,600	684	1,094,400	
リンテック	4,400	1,988	8,747,200	
信越ポリマー	3,800	366	1,390,800	
イトーキ	3,900	635	2,476,500	
任 天 堂	11,400	12,580	143,412,000	
三菱鉛筆	1,500	2,392	3,588,000	
タカラスタンダ - ド	8,000	753	6,024,000	
コ ク ヨ	9,600	727	6,979,200	
ナカバヤシ	6,000	208	1,248,000	
ニ フ コ	4,300	2,809	12,078,700	
グローブライド	10,000	145	1,450,000	
岡村製作所	7,000	865	6,055,000	
日本バルカー	8,000	284	2,272,000	
MUTOHホールディングス	3,000	523	1,569,000	
伊 藤 忠	145,600	1,288	187,532,800	
丸 紅	160,000	719	115,040,000	
スクロール	3,600	294	1,058,400	
高 島	5,000	238	1,190,000	
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,624	2,273,600	
三陽商会	10,000	287	2,870,000	
長瀬産業	10,300	1,250	12,875,000	
蝶 理	1,200	1,119	1,342,800	
豊田通商	20,300	2,473	50,201,900	
オンワ - ドホールディングス	13,000	754	9,802,000	
三共生興	3,100	364	1,128,400	
兼 松	39,000	169	6,591,000	
美 津 濃	9,000	561	5,049,000	
ファミリーマート	6,200	4,655	28,861,000	
ルック	4,000	264	1,056,000	
三井物産	168,000	1,573	264,264,000	
日本紙パルプ	9,000	324	2,916,000	
東京エレクトロン	16,600	5,746	95,383,600	
日立ハイテクノロジーズ	5,500	2,465	13,557,500	

カメイ	2,400	785	1,884,000	
東都水産	5,000	224	1,120,000	
スターゼン	7,000	275	1,925,000	
セイコーHD	12,000	436	5,232,000	
山 善	7,000	613	4,291,000	
椿本興業	4,000	289	1,156,000	
住友商事	107,700	1,331	143,348,700	
日本ユニシス	4,400	1,120	4,928,000	
内田洋行	4,000	274	1,096,000	
三菱商事	142,400	1,993	283,803,200	
第一実業	4,000	452	1,808,000	
キヤノンマーケティングJPN	5,200	1,330	6,916,000	
西華産業	6,000	249	1,494,000	
佐藤商事	1,600	700	1,120,000	
菱洋エレクトロ	2,100	1,091	2,291,100	
東京産業	2,900	394	1,142,600	
ユアサ商事	19,000	209	3,971,000	
神鋼商事	5,000	206	1,030,000	
小林産業	3,800	298	1,132,400	
阪和興業	18,000	479	8,622,000	
カナデン	2,000	703	1,406,000	
菱電商事	3,000	729	2,187,000	
ニプロ	9,800	890	8,722,000	
フルサト工業	1,000	1,145	1,145,000	
岩谷産業	20,000	623	12,460,000	
すてきナイスグループ	8,000	217	1,736,000	
昭光通商	7,000	144	1,008,000	
イ ワ キ	6,000	202	1,212,000	
兼松エレクトロニクス	1,200	1,365	1,638,000	
三愛石油	4,000	537	2,148,000	
稲畑産業	4,500	1,072	4,824,000	
ゴ-ルドウイン	4,000	484	1,936,000	
ユニ・チャ-ム	11,900	5,869	69,841,100	
デサント	4,000	696	2,784,000	
キ ン グ	2,500	450	1,125,000	
ワ キ タ	3,000	1,181	3,543,000	
ヤマトインタ-ナショナル	2,500	443	1,107,500	

東邦ホールディングス	5,800	2,050	11,890,000	
サンゲツ	3,200	2,545	8,144,000	
ミツウロコグループ	2,900	565	1,638,500	
シナネン	4,000	403	1,612,000	
伊藤忠エネクス	4,000	590	2,360,000	
サンリオ	4,600	3,925	18,055,000	
サンワ テクノス	1,200	869	1,042,800	
リョーサン	2,700	2,173	5,867,100	
新光商事	2,000	916	1,832,000	
トーヨー	4,000	364	1,456,000	
三信電気	2,200	723	1,590,600	
東陽テクニカ	2,500	1,012	2,530,000	
モスフード サービス	2,400	2,111	5,066,400	
加賀電子	1,600	1,260	2,016,000	
三益半導体	1,600	869	1,390,400	
ソーダニツカ	3,000	447	1,341,000	
立花エレテック	1,100	1,302	1,432,200	
木曽路	2,200	1,858	4,087,600	
サトレストランシステムズ	1,700	744	1,264,800	
千 趣 会	3,300	795	2,623,500	
ケーヨー	3,100	464	1,438,400	
アデランス	2,300	1,128	2,594,400	
上新電機	4,000	783	3,132,000	
日本瓦斯	2,700	1,135	3,064,500	
ベスト電器	7,800	135	1,053,000	
マルエツ	4,000	372	1,488,000	
ロイヤルホールディングス	3,000	1,433	4,299,000	
いなげや	2,000	999	1,998,000	
島 忠	4,100	2,212	9,069,200	
チヨダ	2,200	2,033	4,472,600	
ライフコーポレーション	1,400	1,561	2,185,400	
カ ス ミ	3,700	686	2,538,200	
リンガーハット	1,800	1,506	2,710,800	
MR MAX	3,300	324	1,069,200	
テンアライド	3,500	306	1,071,000	
AOKIホールディングス	3,100	1,553	4,814,300	
オークワ	3,000	861	2,583,000	

コメリ	2,800	2,483	6,952,400
青山商事	4,600	2,555	11,753,000
しまむら	2,100	9,080	19,068,000
C F Sコーポレーション	2,600	436	1,133,600
高島屋	25,000	913	22,825,000
松屋	3,700	936	3,463,200
エイチ・ツー・オーリテイリング	11,000	737	8,107,000
近鉄百貨店	7,000	351	2,457,000
ニッセンHD	3,600	411	1,479,600
パルコ	1,700	917	1,558,900
丸井グループ	23,800	896	21,324,800
クレディセゾン	14,900	2,329	34,702,100
アクシアルリテイリング	1,000	1,547	1,547,000
ダイエー	11,250	310	3,487,500
イズミヤ	7,000	464	3,248,000
イオン	72,900	1,296	94,478,400
ユニーグループ・HD	17,500	632	11,060,000
イズミ	4,100	3,005	12,320,500
平和堂	3,700	1,418	5,246,600
フジ	2,000	1,745	3,490,000
ヤオコー	900	4,345	3,910,500
ゼビオ	2,200	1,901	4,182,200
ケーズホールディングス	3,900	2,973	11,594,700
P a l t a c	2,600	1,372	3,567,200
新生銀行	158,000	207	32,706,000
あおぞら銀行	95,000	295	28,025,000
三菱UFJフィナンシャルG	1,382,500	611	844,707,500
りそなホールディングス	173,500	543	94,210,500
三井住友トラストHD	359,000	499	179,141,000
三井住友フィナンシャルG	138,000	4,827	666,126,000
第四銀行	24,000	362	8,688,000
北越銀行	20,000	204	4,080,000
西日本シティ銀行	64,000	249	15,936,000
千葉銀行	70,000	627	43,890,000
横浜銀行	120,000	516	61,920,000
常陽銀行	68,000	495	33,660,000
群馬銀行	41,000	547	22,427,000

武蔵野銀行	2,900	3,285	9,526,500	
千葉興業銀行	3,800	661	2,511,800	
筑波銀行	7,600	376	2,857,600	
東京都民銀行	3,200	1,016	3,251,200	
七十七銀行	29,000	463	13,427,000	
青森銀行	13,000	270	3,510,000	
秋田銀行	13,000	262	3,406,000	
山形銀行	11,000	400	4,400,000	
岩手銀行	1,200	4,440	5,328,000	
東邦銀行	16,000	309	4,944,000	
東北銀行	9,000	151	1,359,000	
みちのく銀行	10,000	204	2,040,000	
ふくおかフィナンシャルG	74,000	413	30,562,000	
静岡銀行	53,000	1,001	53,053,000	
十六銀行	23,000	345	7,935,000	
スルガ銀行	18,000	1,750	31,500,000	
八十二銀行	34,000	563	19,142,000	
山梨中央銀行	12,000	421	5,052,000	
大垣共立銀行	23,000	275	6,325,000	
福井銀行	16,000	236	3,776,000	
北國銀行	21,000	341	7,161,000	
清水銀行	600	2,527	1,516,200	
滋賀銀行	17,000	527	8,959,000	
南都銀行	18,000	359	6,462,000	
百五銀行	16,000	400	6,400,000	
京都銀行	35,000	805	28,175,000	
紀陽銀行	7,200	1,316	9,475,200	
三重銀行	8,000	216	1,728,000	
ほくほくフィナンシャルG	124,000	195	24,180,000	
広島銀行	54,000	398	21,492,000	
山陰合同銀行	11,000	698	7,678,000	
中国銀行	13,600	1,295	17,612,000	
鳥取銀行	6,000	182	1,092,000	
伊予銀行	19,500	952	18,564,000	
百十四銀行	20,000	332	6,640,000	
四国銀行	13,000	220	2,860,000	
阿波銀行	15,000	501	7,515,000	

鹿児島銀行	13,000	607	7,891,000	
大分銀行	11,000	380	4,180,000	
宮崎銀行	12,000	289	3,468,000	
肥後銀行	15,000	522	7,830,000	
佐賀銀行	11,000	209	2,299,000	
十八銀行	11,000	218	2,398,000	
沖縄銀行	1,400	3,935	5,509,000	
琉球銀行	3,500	1,257	4,399,500	
八千代銀行	900	2,598	2,338,200	
セブン銀行	68,400	370	25,308,000	
みずほフィナンシャルG	2,363,000	215	508,045,000	
山口フィナンシャルG	18,000	925	16,650,000	
芙蓉総合リース	1,900	3,495	6,640,500	
興銀リース	3,200	2,627	8,406,400	
東京センチュリーリース	4,300	2,959	12,723,700	
SBIホールディングス	21,900	1,240	27,156,000	
日本証券金融	8,000	663	5,304,000	
アイフル	33,200	368	12,217,600	
日本アジア投資	12,000	106	1,272,000	
ポケットカード	1,800	667	1,200,600	
長野銀行	6,000	180	1,080,000	
名古屋銀行	16,000	342	5,472,000	
北洋銀行	27,500	405	11,137,500	
愛知銀行	700	4,715	3,300,500	
第三銀行	10,000	171	1,710,000	
中京銀行	7,000	170	1,190,000	
東日本銀行	8,000	261	2,088,000	
大光銀行	6,000	205	1,230,000	
愛媛銀行	11,000	213	2,343,000	
トマト銀行	7,000	172	1,204,000	
みなと銀行	17,000	170	2,890,000	
京葉銀行	15,000	429	6,435,000	
関西アーバン銀行	25,000	117	2,925,000	
栃木銀行	9,000	382	3,438,000	
北日本銀行	600	2,550	1,530,000	
東和銀行	22,000	101	2,222,000	
福島銀行	22,000	86	1,892,000	

大東銀行	12,000	104	1,248,000	
リコーリース	1,300	2,662	3,460,600	
イオンフィナンシャルサービス	10,600	2,537	26,892,200	
アコム	36,700	320	11,744,000	
ジャックス	11,000	444	4,884,000	
オリコ	40,800	214	8,731,200	
日立キャピタル	3,600	2,544	9,158,400	
アプラスフィナンシャル	1,400	122	170,800	
オリックス	112,800	1,546	174,388,800	
三菱UFJリース	46,300	548	25,372,400	
ジャフコ	2,500	5,190	12,975,000	
トモニホールディングス	14,000	412	5,768,000	
大和証券G本社	181,000	959	173,579,000	
野村ホールディングス	373,100	714	266,393,400	
岡三証券グループ	14,000	902	12,628,000	
丸三証券	5,400	894	4,827,600	
東洋証券	7,000	367	2,569,000	
東海東京HD	19,300	895	17,273,500	
光世証券	4,000	250	1,000,000	
水戸証券	6,000	437	2,622,000	
いちよし証券	3,600	1,528	5,500,800	
松井証券	9,300	1,117	10,388,100	
NKSJホールディングス	40,500	2,726	110,403,000	
日本取引所グループ	26,800	2,517	67,455,600	
マネックスG	19,900	415	8,258,500	
カブドットコム証券	7,100	536	3,805,600	
極東証券	2,300	1,815	4,174,500	
岩井コスモホールディング	1,700	1,243	2,113,100	
フィデアホール	10,500	192	2,016,000	
池田泉州HD	13,700	462	6,329,400	
MS&AD	54,500	2,538	138,321,000	
SONY FH	17,500	1,722	30,135,000	
マネーパートナーズGP	4,500	253	1,138,500	
第一生命	91,900	1,552	142,628,800	
東京海上HD	70,700	3,145	222,351,500	
イー・ギャランティ	500	2,095	1,047,500	
アサックス	800	1,324	1,059,200	

NECキャピタルソリューション	600	2,208	1,324,800	
T&Dホールディングス	62,700	1,282	80,381,400	
三井不動産	86,000	3,193	274,598,000	
三菱地所	128,000	2,512	321,536,000	
平和不動産	3,700	1,557	5,760,900	
東京建物	37,000	885	32,745,000	
ダイビル	5,400	1,106	5,972,400	
京阪神ビルディング	3,000	533	1,599,000	
住友不動産	44,000	4,326	190,344,000	
大京	31,000	238	7,378,000	
テーオーシー	6,300	758	4,775,400	
東京楽天地	3,000	462	1,386,000	
レオパレス21	21,000	534	11,214,000	
フジ住宅	2,300	680	1,564,000	
空港施設	2,200	768	1,689,600	
住友不動産販売	1,300	3,150	4,095,000	
ゴールドクレスト	1,400	2,226	3,116,400	
リロ・ホールディング	700	5,510	3,857,000	
日神不動産	2,900	382	1,107,800	
タカラレーベン	6,100	306	1,866,600	
サンヨーハウジ 名古屋	1,000	1,066	1,066,000	
イオンモール	11,800	2,957	34,892,600	
トーセイ	2,500	689	1,722,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	11,300	932	10,531,600	
サンフロンティア不動産	1,700	1,336	2,271,200	
ランドビジネス	2,700	399	1,077,300	
東武鉄道	105,000	496	52,080,000	
相鉄ホールディングス	32,000	370	11,840,000	
東京急行	109,000	642	69,978,000	
京浜急行	47,000	870	40,890,000	
小田急電鉄	59,000	924	54,516,000	
京王電鉄	52,000	725	37,700,000	
京成電鉄	28,000	911	25,508,000	
富士急行	5,000	917	4,585,000	
新京成電鉄	3,000	371	1,113,000	
東日本旅客鉄道	34,000	7,723	262,582,000	
西日本旅客鉄道	16,700	4,253	71,025,100	

東海旅客鉄道	16,600	11,895	197,457,000	
鴻池運輸	1,000	1,400	1,400,000	
西日本鉄道	24,000	405	9,720,000	
ハマキョウレックス	500	3,110	1,555,000	
サカイ引越センター	300	3,515	1,054,500	
近畿日本鉄道	186,000	361	67,146,000	
阪急阪神HLDGS	124,000	555	68,820,000	
南海電鉄	39,000	378	14,742,000	
京阪電鉄	39,000	402	15,678,000	
神戸電鉄	5,000	337	1,685,000	
名古屋鉄道	65,000	309	20,085,000	
山陽電鉄	7,000	409	2,863,000	
トランコム	500	3,530	1,765,000	
日本通運	73,000	482	35,186,000	
ヤマトホールディングス	34,400	2,055	70,692,000	
山 九	22,000	445	9,790,000	
日 新	7,000	284	1,988,000	
丸全昭和運輸	6,000	333	1,998,000	
センコー	7,000	511	3,577,000	
トナミホールディングス	6,000	199	1,194,000	
日本梱包運輸	5,600	1,796	10,057,600	
日石輸送	5,000	232	1,160,000	
福山通運	11,000	582	6,402,000	
セイノーホールディングス	13,000	1,056	13,728,000	
日立物流	3,900	1,619	6,314,100	
日本郵船	157,000	321	50,397,000	
商船三井	104,000	416	43,264,000	
川崎汽船	81,000	234	18,954,000	
NSユニテッド海運	8,000	254	2,032,000	
乾 汽 船	3,300	344	1,135,200	
飯野海運	7,700	520	4,004,000	
第一中央汽船	14,000	96	1,344,000	
日本航空	15,600	5,050	78,780,000	
ANAホールディングス	363,000	228	82,764,000	
スカイマーク	4,000	339	1,356,000	
パスコ	2,000	436	872,000	
三菱倉庫	12,000	1,444	17,328,000	

三井倉庫	9,000	425	3,825,000
住友倉庫	12,000	519	6,228,000
渋沢倉庫	4,000	337	1,348,000
ヤマタネ	9,000	162	1,458,000
東陽倉庫	4,000	258	1,032,000
日本トランスシティ	4,000	330	1,320,000
ケイヒン	7,000	152	1,064,000
安田倉庫	1,400	1,028	1,439,200
東洋埠頭	5,000	210	1,050,000
宇徳	3,000	364	1,092,000
上組	22,000	970	21,340,000
サンリツ	2,000	563	1,126,000
キューソー流通システム	1,100	1,013	1,114,300
郵船ロジスティクス	1,700	1,322	2,247,400
近鉄エクスプレス	1,700	4,245	7,216,500
東京放送HD	9,800	1,118	10,956,400
日本テレビHLD S	18,200	1,673	30,448,600
テレビ朝日	4,600	2,022	9,301,200
スカパーJ S A T H D	13,900	536	7,450,400
テレビ東京HD	1,500	1,649	2,473,500
コネクシオ	1,600	847	1,355,200
日本電信電話	71,700	5,688	407,829,600
K D D I	56,700	5,866	332,602,200
光通信	1,600	9,040	14,464,000
N T T ドコモ	150,400	1,673	251,619,200
G M O インターネット	6,100	1,109	6,764,900
学研ホールディングス	6,000	274	1,644,000
ゼンリン	2,400	968	2,323,200
昭文社	1,600	710	1,136,000
K A D O K A W A	1,800	3,440	6,192,000
インプレスホールディングス	4,400	146	642,400
東京電力	156,900	463	72,644,700
中部電力	60,900	1,245	75,820,500
関西電力	75,500	1,140	86,070,000
中国電力	25,600	1,454	37,222,400
北陸電力	18,100	1,314	23,783,400
東北電力	46,200	1,163	53,730,600

四国電力	16,700	1,545	25,801,500
九州電力	40,800	1,271	51,856,800
北海道電力	17,300	1,046	18,095,800
沖縄電力	1,200	3,415	4,098,000
電源開発	11,500	3,180	36,570,000
東京瓦斯	217,000	494	107,198,000
大阪瓦斯	191,000	411	78,501,000
東邦瓦斯	47,000	502	23,594,000
北海道瓦斯	3,000	282	846,000
西部瓦斯	21,000	239	5,019,000
静岡瓦斯	4,900	604	2,959,600
アイネット	1,400	772	1,080,800
松竹	12,000	920	11,040,000
東宝	13,000	2,039	26,507,000
エイチ・アイ・エス	1,600	5,660	9,056,000
東映	8,000	599	4,792,000
NTTデータ	12,900	4,090	52,761,000
共立メンテナンス	1,000	3,755	3,755,000
イチネンホールディングス	2,000	770	1,540,000
建設技術研究所	1,100	1,107	1,217,700
スペース	1,300	887	1,153,100
アインファーマシーズ	1,000	4,970	4,970,000
燦ホールディングス	800	1,377	1,101,600
東京テアトル	7,000	157	1,099,000
よみうりランド	4,000	593	2,372,000
東京都競馬	15,000	327	4,905,000
常磐興産	7,000	147	1,029,000
カナモト	2,500	2,807	7,017,500
東京ドーム	14,000	599	8,386,000
D T S	1,700	1,895	3,221,500
スクウェア・エニックス・HD	6,600	2,426	16,011,600
シーイーシー	1,700	648	1,101,600
カプコン	4,700	2,021	9,498,700
西尾レントオール	1,000	3,065	3,065,000
日本空港ビルデング	6,300	2,284	14,389,200
トランス・コスモス	2,500	2,226	5,565,000
乃村工藝社	3,800	806	3,062,800

SCSK	4,300	3,080	13,244,000	
藤田観光	5,000	329	1,645,000	
KNT-CTホールディングス	6,000	190	1,140,000	
日本管財	800	1,991	1,592,800	
トーカイ	900	2,967	2,670,300	
白洋舎	5,000	231	1,155,000	
セコム	20,100	5,806	116,700,600	
セントラル警備保障	1,100	1,005	1,105,500	
アイネス	2,500	745	1,862,500	
丹青社	2,400	488	1,171,200	
メイテック	2,700	2,665	7,195,500	
TKC	1,500	1,920	2,880,000	
アサツー ディ・ケイ	3,400	2,307	7,843,800	
富士ソフト	2,300	2,039	4,689,700	
応用地質	1,800	1,555	2,799,000	
船井総合研究所	2,000	789	1,578,000	
NSD	3,900	1,323	5,159,700	
進学会	2,700	399	1,077,300	
コナミ	8,200	2,584	21,188,800	
ベネッセホールディングス	6,500	3,855	25,057,500	
イオンディライト	1,900	2,071	3,934,900	
ナック	1,000	1,615	1,615,000	
ニチイ学館	4,200	909	3,817,800	
ダイセキ	2,900	1,786	5,179,400	
ステップ	1,400	788	1,103,200	
日鉄住金物産	12,000	405	4,860,000	
元気寿司	700	1,617	1,131,900	
トラスコ中山	2,100	2,437	5,117,700	
ヤマダ電機	72,100	339	24,441,900	
オートバックスセブン	6,400	1,595	10,208,000	
アークランドサカモト	1,200	1,780	2,136,000	
ニトリホールディングス	7,200	4,800	34,560,000	
愛眼	4,100	274	1,123,400	
吉野家ホールディングス	4,900	1,458	7,144,200	
加藤産業	2,600	1,930	5,018,000	
イノテック	2,400	459	1,101,600	
イエローハット	1,600	1,978	3,164,800	

富士エレクトロニクス	900	1,347	1,212,300	
松屋フーズ	900	1,843	1,658,700	
J B C Cホールディングス	1,500	748	1,122,000	
J Kホールディングス	1,900	554	1,052,600	
サガミチェーン	2,000	950	1,900,000	
日 伝	800	2,352	1,881,600	
関西スーパーマーケット	1,400	816	1,142,400	
北沢産業	6,000	184	1,104,000	
杉本商事	1,100	956	1,051,600	
因幡電機産業	2,500	3,225	8,062,500	
王将フードサービス	900	3,320	2,988,000	
ブレナス	2,000	2,324	4,648,000	
ミニストップ	1,300	1,645	2,138,500	
アークス	3,100	1,980	6,138,000	
バ ロ ー	3,900	1,307	5,097,300	
ミスミグループ本社	7,300	2,977	21,732,100	
江守商事	600	1,787	1,072,200	
ベ ル ク	900	1,881	1,692,900	
大 庄	900	1,274	1,146,600	
タキヒヨー	3,000	413	1,239,000	
ファーストリテイリング	4,300	35,755	153,746,500	
ソフトバンク	89,600	7,802	699,059,200	
スズケン	7,600	3,910	29,716,000	
サンドラッグ	3,900	4,210	16,419,000	
東京デリカ	900	1,364	1,227,600	
ジェコス	1,300	890	1,157,000	
や ま や	500	2,118	1,059,000	
ベルーナ	4,500	507	2,281,500	
合計	29,670,945		32,103,450,210	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成26年2月21日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,174,897,458
国債証券	23,992,514,430
未収利息	84,008,301
前払費用	13,901,560
流動資産合計	29,265,321,749
資産合計	29,265,321,749
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,025,630,416
流動負債合計	5,025,630,416
負債合計	5,025,630,416
純資産の部	
元本等	

元本	19,350,145,636
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,889,545,697
純資産合計	24,239,691,333
負債純資産合計	29,265,321,749

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26年2月21日現在）
1. 計算日における受益権総口数	19,350,145,636口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2527円 (12,527円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年2月22日 至 平成26年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	17,800,350
合計	17,800,350

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

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計算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26年2月21日現在)
同計算期間の期首元本額	12,507,141,338円
同計算期間中の追加設定元本額	13,531,644,734円
同計算期間中の一部解約元本額	6,688,640,436円
同計算期間末日の元本の内訳	

ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）	1,889,654,219円
D Cニッセイ国内債券インデックス	5,079,950,176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）	90,122,303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）	10,688,802円
D Cニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	538,779,748円
D Cニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	2,694,447,990円
D Cニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	769,886,727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）	475,316,950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）	1,445,643,404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）	638,665,914円
ニッセイ厚生年金型バランス運用（現物型）D B（適格機関投資家限定）	5,716,989,403円
計	19,350,145,636円

附属明細表（平成26年2月21日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
国債証券	第329回 利付国債（2年）	1,218,000,000	1,219,973,160	
	第92回 利付国債（5年）	463,000,000	464,629,760	
	第97回 利付国債（5年）	106,000,000	106,770,620	
	第99回 利付国債（5年）	936,000,000	943,422,480	
	第102回 利付国債（5年）	867,000,000	871,985,250	
	第103回 利付国債（5年）	1,802,000,000	1,812,721,900	
	第106回 利付国債（5年）	274,000,000	274,728,840	
	第4回 利付国債（40年）	291,000,000	330,468,330	
	第271回 利付国債（10年）	1,526,000,000	1,548,539,020	
	第279回 利付国債（10年）	71,000,000	73,815,150	

第280回 利付国債(10年)	364,000,000	379,262,520	
第281回 利付国債(10年)	43,000,000	44,902,320	
第282回 利付国債(10年)	34,000,000	35,406,240	
第285回 利付国債(10年)	1,085,000,000	1,138,002,250	
第287回 利付国債(10年)	808,000,000	855,768,960	
第292回 利付国債(10年)	92,000,000	97,797,840	
第306回 利付国債(10年)	245,000,000	262,218,600	
第309回 利付国債(10年)	474,000,000	499,046,160	
第310回 利付国債(10年)	938,000,000	981,541,960	
第312回 利付国債(10年)	1,440,000,000	1,526,054,400	
第313回 利付国債(10年)	354,000,000	377,438,340	
第320回 利付国債(10年)	642,000,000	670,177,380	
第321回 利付国債(10年)	802,000,000	836,967,200	
第26回 利付国債(30年)	1,514,000,000	1,751,985,660	
第28回 利付国債(30年)	421,000,000	496,754,740	
第54回 利付国債(20年)	626,000,000	711,405,180	
第69回 利付国債(20年)	362,000,000	414,511,720	
第72回 利付国債(20年)	996,000,000	1,143,318,360	
第92回 利付国債(20年)	1,556,000,000	1,798,455,920	
第99回 利付国債(20年)	135,000,000	155,864,250	
第117回 利付国債(20年)	934,000,000	1,066,590,640	
第123回 利付国債(20年)	16,000,000	18,154,560	
第125回 利付国債(20年)	944,000,000	1,083,834,720	
国債証券 合計	22,379,000,000	23,992,514,430	
合計	22,379,000,000	23,992,514,430	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ外国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26年2月21日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	87,817,894
コール・ローン	272,491,303
株式	28,977,223,491
投資証券	586,496,596
派生商品評価勘定	15,193,390
未収入金	246,441
未収配当金	43,502,857
差入委託証拠金	569,726,723
流動資産合計	30,552,698,695
資産合計	30,552,698,695
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	497,219
未払金	2,225,098
未払解約金	4,307,563
流動負債合計	7,029,880
負債合計	7,029,880
純資産の部	
元本等	
元本	26,676,145,239

剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,869,523,576
純資産合計	30,545,668,815
負債純資産合計	30,552,698,695

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</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。</p> <p>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。</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>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。</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、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
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>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成26年2月21日現在）
1. 計算日における受益権総口数	26,676,145,239口
2. 1口当たり純資産額	1.1451円
（1万口当たり純資産額）	(11,451円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成25年2月22日 至 平成26年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月21日現在
	当期間の損益に含まれた 評価差額（円）
株式	718,494,937
投資証券	20,320,432
合計	738,815,369

（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26年2月21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	847,932,770	-	862,628,941	14,696,171
合計	847,932,770	-	862,628,941	14,696,171

（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。
4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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計算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26年2月21日現在）
同計算期間の期首元本額	14,705,080,003円
同計算期間中の追加設定元本額	14,347,089,353円
同計算期間中の一部解約元本額	2,376,024,117円

同計算期間末日の元本の内訳	
ファンド名	
D Cニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	292,210,900円
D Cニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,967,589,427円
D Cニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	1,686,777,272円
ニッセイ外国株式インデックスファンドI I（適格機関投資家限定）	11,533,877,599円
ニッセイ厚生年金型バランス運用D B（適格機関投資家限定）	9,782,896,794円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	1,412,793,247円
計	26,676,145,239円

附属明細表（平成26年2月21日現在）

第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	5,974	131.56	785,939.44	
	ABBOTT LABORATORIES	15,059	38.95	586,548.05	
	ABBVIE INC	15,653	51.86	811,764.58	
	ACCENTURE PLC	6,431	83.38	536,216.78	
	ACE LTD	3,204	96.78	310,083.12	
	ACTAVIS PLC	1,698	220.37	374,188.26	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	5,133	19.63	100,760.79	
	ADOBE SYSTEMS INC	4,822	68.48	330,210.56	
	ADT CORP/THE	2,542	30.86	78,446.12	
	ADVANCE AUTO PARTS	888	127.56	113,273.28	
	AES CORP	7,988	14.52	115,985.76	
	AETNA INC	3,718	69.89	259,851.02	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	757	189.30	143,300.10	
	AFLAC INC	4,521	62.92	284,461.32	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,652	57.29	209,223.08	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,152	117.71	253,311.92	
	AIRGAS INC	956	105.42	100,781.52	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,094	61.55	128,885.70	

ALCOA INC	16,013	11.78	188,633.14	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,971	179.06	352,927.26	
ALLERGAN INC	3,081	127.25	392,057.25	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	628	284.23	178,496.44	
ALLIANT ENERGY CORP	1,765	53.70	94,780.50	
ALLSTATE CORP	4,462	53.47	238,583.14	
ALTERA CORP	3,804	35.65	135,612.60	
ALTRIA GROUP INC	18,988	35.53	674,643.64	
AMAZON.COM INC	3,592	349.80	1,256,481.60	
AMEREN CORPORATION	2,944	38.81	114,256.64	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	4,669	50.34	235,037.46	
AMERICAN EXPRESS CO	9,287	89.01	826,635.87	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	13,539	49.22	666,389.58	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,338	44.06	103,012.28	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,205	106.20	234,171.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,409	68.39	164,751.51	
AMETEK INC	3,022	52.26	157,929.72	
AMGEN INC	7,293	123.49	900,612.57	
AMPHENOL CORP-CL A	1,801	88.95	160,198.95	
ANADARKO PETROLEUM CORP	5,042	83.21	419,544.82	
ANALOG DEVICES INC	3,592	51.40	184,628.80	
ANSYS INC	1,218	83.11	101,227.98	
AON PLC	2,773	85.41	236,841.93	
APACHE CORP	3,972	84.36	335,077.92	
APPLE INC	8,959	531.15	4,758,572.85	
APPLIED MATERIALS INC	12,575	18.99	238,799.25	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,631	55.69	90,830.39	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,763	40.12	271,331.56	
ASHLAND INC	999	94.89	94,795.11	
AT&T INC	51,938	33.18	1,723,302.84	
AUTODESK INC	2,676	54.90	146,912.40	
AUTOLIV INC	1,265	95.73	121,098.45	

AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	4,797	76.51	367,018.47	
AUTOZONE INC	395	538.59	212,743.05	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	2,766	59.00	163,194.00	
AVON PRODUCTS INC	5,452	15.04	81,998.08	
BAKER HUGHES INC	4,798	61.23	293,781.54	
BALL CORP	2,205	54.75	120,723.75	
BANK OF AMERICA CORP	105,490	16.30	1,719,487.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	11,542	31.18	359,879.56	
BARD (C.R.) INC	904	140.30	126,831.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,438	69.35	377,125.30	
BB&T CORPORATION	7,057	37.18	262,379.26	
BE AEROSPACE INC	1,316	82.85	109,030.60	
BEAM INC	1,844	83.21	153,439.24	
BECTON DICKINSON & CO	2,111	115.52	243,862.72	
BED BATH & BEYOND INC	2,260	65.13	147,193.80	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	10,225	113.10	1,156,447.50	
BEST BUY CO INC	2,831	24.84	70,322.04	
BIOGEN IDEC INC	2,325	335.11	779,130.75	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,506	80.13	120,675.78	
BLACKROCK INC	1,315	300.52	395,183.80	
BOEING CO	6,841	129.56	886,319.96	
BORGWARNER INC	2,627	60.42	158,723.34	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	14,055	13.23	185,947.65	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	15,913	53.85	856,915.05	
BROADCOM CORP	5,937	30.95	183,750.15	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	1,518	81.54	123,777.72	
BUNGE LIMITED	1,817	79.14	143,797.38	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,920	54.16	103,987.20	
CA Inc	3,857	32.67	126,008.19	
CABOT OIL & GAS CORP	4,422	39.28	173,696.16	
CALPINE CORP	4,524	20.04	90,660.96	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	2,887	62.14	179,398.18	

CAMPBELL SOUP CO	2,615	43.69	114,249.35	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,751	70.84	407,400.84	
CARDINAL HEALTH INC	3,448	71.51	246,566.48	
CAREFUSION CORP	2,801	41.63	116,605.63	
CARMAX INC	2,722	47.33	128,832.26	
CARNIVAL CORP	4,199	39.11	164,222.89	
CATERPILLAR INC	6,512	96.92	631,143.04	
CBRE GROUP INC	4,358	27.35	119,191.30	
CBS CORP-CL B	5,889	65.91	388,143.99	
CELANESE CORP-SERIES A	2,008	52.92	106,263.36	
CELGENE CORP	4,009	163.58	655,792.22	
CENTERPOINT ENERGY INC	4,774	24.28	115,912.72	
CENTURYLINK INC	6,578	31.12	204,707.36	
CERNER CORP	3,239	60.68	196,542.52	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	642	240.86	154,632.12	
CHARLES SCHWAB CORP	11,793	26.12	308,033.16	
CHARTER COMMUNICATION-A	714	131.84	94,133.76	
CHENIERE ENERGY INC	2,284	48.60	111,002.40	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,807	26.65	154,756.55	
CHEVRON CORP	18,650	114.60	2,137,290.00	
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	1,310	79.86	104,616.60	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	317	550.28	174,438.76	
CHUBB CORP	2,386	86.49	206,365.14	
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,704	66.27	112,924.08	
CIGNA CORP	2,850	77.10	219,735.00	
CIMAREX ENERGY CO	1,000	113.92	113,920.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,886	46.79	88,245.94	
CISCO SYSTEMS INC	52,767	22.30	1,176,704.10	
CIT GROUP INC	2,486	47.77	118,756.22	
CITIGROUP INC	29,981	48.13	1,442,985.53	
CITRIX SYSTEMS INC	2,192	60.59	132,813.28	
CLOROX CO	1,550	86.95	134,772.50	
CME GROUP INC	3,119	73.76	230,057.44	

CMS ENERGY CORP	3,710	28.61	106,143.10	
COACH INC	3,056	47.64	145,587.84	
COCA-COLA CO	37,952	37.30	1,415,609.60	
COCA-COLA ENTERPRISES	3,292	46.88	154,328.96	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	3,141	100.66	316,173.06	
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,713	61.86	538,986.18	
COMCAST CORP	21,045	51.76	1,089,289.20	
COMCAST CORP	4,407	50.11	220,834.77	
COMERICA INC	2,422	46.71	113,131.62	
COMPUTER SCIENCES CORP	1,786	62.35	111,357.10	
CONAGRA FOODS INC	5,070	28.56	144,799.20	
CONCHO RESOURCES INC	1,234	116.27	143,477.18	
CONOCOPHILLIPS	10,833	64.92	703,278.36	
CONSOL ENERGY INC	2,793	39.92	111,496.56	
CONSOLIDATED EDISON INC	2,729	55.30	150,913.70	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,728	80.60	139,276.80	
CORE LABORATORIES N.V.	567	189.28	107,321.76	
CORNING INC	14,875	19.00	282,625.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,158	115.06	478,419.48	
COVIDIEN PLC	4,625	71.28	329,670.00	
CROWN HOLDINGS INC	2,513	44.20	111,074.60	
CSX CORP	10,758	27.35	294,231.30	
CUMMINS INC	1,876	141.75	265,923.00	
CVS CAREMARK CORP	11,724	71.31	836,038.44	
DANAHER CORP	5,560	76.11	423,171.60	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,752	50.50	88,476.00	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	2,120	65.78	139,453.60	
DEERE & CO	3,672	85.12	312,560.64	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	2,909	65.71	191,150.39	
DENBURY RESOURCES INC	5,691	15.95	90,771.45	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,337	45.47	106,263.39	
DEVON ENERGY CORPORATION	4,056	64.56	261,855.36	
DIRECTV	5,392	75.08	404,831.36	

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,849	57.07	276,732.43	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	2,504	82.43	206,404.72	
DISH NETWORK CORP	2,360	57.07	134,685.20	
DOLLAR GENERAL CORP	3,235	57.10	184,718.50	
DOLLAR TREE INC	2,431	51.52	125,245.12	
DOMINION RESOURCES INC/VA	5,154	71.50	368,511.00	
DOVER CORP	1,873	88.58	165,910.34	
DOW CHEMICAL CO	12,100	47.14	570,394.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	2,661	51.47	136,961.67	
DTE ENERGY COMPANY	1,844	72.33	133,376.52	
DUKE ENERGY CORP	6,320	71.74	453,396.80	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,796	82.81	148,726.76	
EATON CORP PLC	4,785	72.97	349,161.45	
EATON VANCE CORP	2,227	36.81	81,975.87	
EBAY INC	11,620	54.96	638,635.20	
ECOLAB INC	2,553	101.87	260,074.11	
EDISON INTERNATIONAL	3,087	51.22	158,116.14	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,333	68.10	90,777.30	
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	8,907	65.35	582,072.45	
ELECTRONIC ARTS INC	3,648	27.79	101,377.92	
ELI LILLY & CO	9,760	58.05	566,568.00	
EMC CORP/MASSACHUSETTS	20,565	25.47	523,790.55	
EMERSON ELECTRIC CO	6,729	63.56	427,695.24	
ENERGIZER HOLDINGS INC	810	96.43	78,108.30	
ENSCO PLC	2,954	51.94	153,430.76	
ENTERGY CORP	1,913	65.05	124,440.65	
EOG RESOURCES INC	2,640	180.03	475,279.20	
EQT CORP	1,670	100.03	167,050.10	
EQUIFAX INC	1,670	69.74	116,465.80	
EQUINIX INC	652	187.95	122,543.40	
ESTEE LAUDER COS INC	2,428	67.86	164,764.08	
EXELON CORP	8,361	30.23	252,753.03	

EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	2,728	41.70	113,757.60	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	8,059	77.12	621,510.08	
EXXON MOBIL CORP	42,841	95.37	4,085,746.17	
FACEBOOK INC-A	17,045	69.63	1,186,843.35	
FAMILY DOLLAR STORES	1,241	65.07	80,751.87	
FASTENAL CO	3,039	45.53	138,365.67	
FEDEX CORP	2,941	132.99	391,123.59	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	3,423	54.27	185,766.21	
FIFTH THIRD BANCORP	8,713	21.34	185,935.42	
FIRSTENERGY CORP	4,441	32.26	143,266.66	
FISERV INC	3,117	57.18	178,230.06	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	807	119.32	96,291.24	
FLOWSERVE CORP	1,839	81.55	149,970.45	
FLUOR CORP	1,939	80.01	155,139.39	
FMC CORP	1,690	73.08	123,505.20	
FMC TECHNOLOGIES INC	2,975	50.82	151,189.50	
FORD MOTOR CO	35,659	15.27	544,512.93	
FOREST LABORATORIES INC	2,971	97.30	289,078.30	
FRANKLIN RESOURCES INC	4,320	52.54	226,972.80	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	10,620	33.75	358,425.00	
GAP INC	3,360	42.34	142,262.40	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,842	107.75	306,225.50	
GENERAL ELECTRIC CO	99,146	25.12	2,490,547.52	
GENERAL MILLS INC	6,136	49.78	305,450.08	
GENERAL MOTORS CO	9,323	36.51	340,382.73	
GENUINE PARTS CO	1,881	87.05	163,741.05	
GILEAD SCIENCES INC	14,957	82.81	1,238,589.17	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,200	164.50	690,900.00	
GOOGLE INC-CL A	2,699	1,204.11	3,249,892.89	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	1,339	123.74	165,687.86	
H&R BLOCK INC	3,289	31.53	103,702.17	
HALLIBURTON CO	8,674	55.38	480,366.12	
HARLEY-DAVIDSON INC	2,350	64.31	151,128.50	

HARRIS CORP	1,808	72.64	131,333.12	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	4,953	34.34	170,086.02	
HCA HOLDINGS INC	3,170	50.23	159,229.10	
HELMERICH & PAYNE	1,423	94.66	134,701.18	
HENRY SCHEIN INC	1,160	118.00	136,880.00	
HERSHEY CO/THE	1,530	107.71	164,796.30	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	4,889	27.09	132,443.01	
HESS CORP	3,203	81.61	261,396.83	
HEWLETT-PACKARD CO	19,238	30.19	580,795.22	
HOLLYFRONTIER CORP	2,154	45.66	98,351.64	
HOME DEPOT INC	13,857	77.48	1,073,640.36	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,018	93.56	656,604.08	
HOSPIRA INC	2,148	43.98	94,469.04	
HUMANA INC	1,625	102.24	166,140.00	
IHS INC-CLASS A	761	117.32	89,280.52	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	4,084	80.76	329,823.84	
ILLUMINA INC	1,319	173.70	229,110.30	
INGERSOLL-RAND PLC	3,097	59.72	184,952.84	
INTEL CORP	48,147	24.74	1,191,156.78	
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP INC	1,190	210.25	250,197.50	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	10,215	184.26	1,882,215.90	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,588	49.37	226,509.56	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	6,167	17.02	104,962.34	
INTUIT INC	3,026	73.85	223,470.10	
INTUITIVE SURGICAL INC	420	438.04	183,976.80	
INVESCO LTD	5,151	33.69	173,537.19	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,805	61.04	110,177.20	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,256	71.65	89,992.40	
JM SMUCKER CO	1,228	98.28	120,687.84	
JOHNSON & JOHNSON	27,150	92.38	2,508,117.00	

JOHNSON CONTROLS INC	6,813	49.86	339,696.18	
JPMORGAN CHASE & CO	36,776	57.58	2,117,562.08	
JUNIPER NETWORKS INC	6,506	27.41	178,329.46	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,298	94.23	122,310.54	
KELLOGG CO	2,661	60.24	160,298.64	
KEYCORP	10,480	12.76	133,724.80	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,601	109.97	396,001.97	
KINDER MORGAN INC	6,896	33.23	229,154.08	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	1,362	74.33	101,237.46	
KLA-TENCOR CORP	1,994	64.65	128,912.10	
KOHL'S CORP	2,360	51.87	122,413.20	
KRAFT FOODS GROUP INC	6,066	55.20	334,843.20	
KROGER CO	5,082	39.28	199,620.96	
L BRANDS INC	2,661	53.31	141,857.91	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,139	115.65	131,725.35	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	1,159	92.69	107,427.71	
LAM RESEARCH CORP	2,121	52.35	111,034.35	
LAS VEGAS SANDS CORP	4,123	80.59	332,272.57	
LEUCADIA NATIONAL CORP	4,238	27.80	117,816.40	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,910	87.89	343,649.90	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	5,818	29.31	170,525.58	
LIBERTY MEDIA CORP	1,084	136.48	147,944.32	
LINCOLN NATIONAL CORP	3,124	49.81	155,606.44	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	3,130	46.12	144,355.60	
LINKEDIN CORP - A	1,027	193.39	198,611.53	
LKQ CORP	3,542	29.09	103,036.78	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,464	164.27	404,761.28	
LOEWS CORP	3,537	43.67	154,460.79	
LORILLARD INC	3,883	48.22	187,238.26	
LOWE'S COS INC	10,237	46.66	477,658.42	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,139	85.80	355,126.20	
M&T BANK CORP	1,234	112.43	138,738.62	
MACY'S INC	4,114	53.46	219,934.44	
MANPOWER GROUP	1,170	74.25	86,872.50	

MARATHON OIL CORP	7,447	33.48	249,325.56	
MARATHON PETROLEUM CORP	3,222	87.95	283,374.90	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	3,123	51.79	161,740.17	
MARSH & MCLENNAN COS INC	5,151	48.10	247,763.10	
MASCO CORP	4,524	22.30	100,885.20	
MASTERCARD INC-CLASS A	10,151	75.86	770,054.86	
MATTEL INC	3,803	35.55	135,196.65	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,840	31.30	120,192.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,611	66.13	106,535.43	
MCDONALD'S CORP	9,313	95.75	891,719.75	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	2,605	80.64	210,067.20	
MCKESSON CORP	2,222	177.58	394,582.76	
MDU RESOURCES GROUP INC	2,795	34.83	97,349.85	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	2,128	80.73	171,793.44	
MEADWESTVACO CORP	2,858	35.86	102,487.88	
MEDTRONIC INC	9,467	57.00	539,619.00	
MERCK & CO INC	27,887	55.81	1,556,373.47	
METLIFE INC	9,228	50.71	467,951.88	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	443	245.04	108,552.72	
MGM MIRAGE	5,085	26.83	136,430.55	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	2,038	98.00	199,724.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,671	45.20	120,729.20	
MICRON TECHNOLOGY INC	10,472	25.49	266,931.28	
MICROSOFT CORP	77,769	37.75	2,935,779.75	
MOHAWK INDUSTRIES INC	792	145.94	115,584.48	
MOLSON COORS BREWING CO -B	1,963	56.13	110,183.19	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	16,148	34.48	556,783.04	
MONSANTO CO	5,145	110.70	569,551.50	
MONSTER BEVERAGE CORP	1,542	74.70	115,187.40	
MOODY'S CORP	2,089	78.93	164,884.77	

MORGAN STANLEY	14,848	29.33	435,491.84	
MOSAIC CO/THE	3,215	48.37	155,509.55	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,916	65.22	190,181.52	
MURPHY OIL CORP	2,119	58.11	123,135.09	
MYLAN LABORATORIES	4,108	52.26	214,684.08	
NATIONAL-OILWELL INC	4,459	76.38	340,578.42	
NETAPP INC	3,581	40.18	143,884.58	
NETFLIX INC	533	434.95	231,828.35	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	6,679	15.58	104,058.82	
NEWELL RUBBERMAID INC	3,940	31.81	125,331.40	
NEWMONT MINING CORP	6,957	24.46	170,168.22	
NEXTERA ENERGY INC	3,817	92.45	352,881.65	
NIELSEN HOLDINGS NV	3,120	46.40	144,768.00	
NIKE INC	6,882	75.58	520,141.56	
NISOURCE INC	3,490	35.31	123,231.90	
NOBLE CORP PLC	3,368	31.28	105,351.04	
NOBLE ENERGY INC	3,743	67.12	251,230.16	
NORDSTROM INC	2,216	59.44	131,719.04	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,247	91.02	295,541.94	
NORTHEAST UTILITIES	3,303	44.67	147,545.01	
NORTHERN TRUST CORP	2,735	61.54	168,311.90	
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,060	120.61	248,456.60	
NRG ENERGY INC	3,700	28.72	106,264.00	
NUCOR CORP	3,490	51.09	178,304.10	
NVIDIA CORP	6,984	18.78	131,159.52	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,148	154.26	177,090.48	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	7,847	95.40	748,603.80	
OCEANEERING INTL INC	1,614	70.63	113,996.82	
OGE ENERGY CORP	2,427	36.17	87,784.59	
OMNICOM GROUP	3,216	74.92	240,942.72	
ONEOK INC	2,134	60.98	130,131.32	
ORACLE CORP	34,014	38.27	1,301,715.78	
PACCAR INC	3,848	62.00	238,576.00	
PALL CORP	1,458	85.59	124,790.22	

PARKER HANNIFIN CORP	1,646	117.79	193,882.34	
PAYCHEX INC	3,710	41.27	153,111.70	
PENTAIR LTD-REGISTERED	2,129	78.99	168,169.71	
PEPSICO INC	14,508	78.01	1,131,769.08	
PERRIGO CO PLC	1,453	161.03	233,976.59	
PETSMART INC	1,261	64.78	81,687.58	
PFIZER INC	63,619	31.55	2,007,179.45	
PG&E CORP	4,251	43.66	185,598.66	
PHARMACYCLICS INC	643	142.68	91,743.24	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	15,601	79.71	1,243,555.71	
PHILLIPS 66	5,712	75.29	430,056.48	
PINNACLE WEST CAPITAL	1,648	55.10	90,804.80	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,400	189.60	265,440.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,068	79.98	405,338.64	
POLARIS INDUSTRIES INC	823	129.46	106,545.58	
PPG INDUSTRIES INC	1,418	188.75	267,647.50	
PPL CORPORATION	6,066	31.79	192,838.14	
PRAXAIR INC	2,848	128.07	364,743.36	
PRECISION CASTPARTS CORP	1,394	258.47	360,307.18	
PRICELINE.COM INC	506	1,283.00	649,198.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,405	44.09	150,126.45	
PROCTER & GAMBLE CO	26,341	77.92	2,052,490.72	
PROGRESSIVE CORP	5,757	23.97	137,995.29	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,677	84.49	395,159.73	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	4,865	36.53	177,718.45	
PVH CORP	947	118.09	111,831.23	
QUALCOMM INC	16,890	75.95	1,282,795.50	
QUEST DIAGNOSTICS	1,888	52.97	100,007.36	
RALPH LAUREN CORP	748	157.66	117,929.68	
RANGE RESOURCES CORP	1,880	87.52	164,537.60	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,008	52.11	104,636.88	
RAYTHEON CO	3,047	96.35	293,578.45	

REALOLOGY HOLDINGS CORP	2,227	45.40	101,105.80	
RED HAT INC	2,383	59.30	141,311.90	
REGENERON PHARMACEUTICALS	767	327.62	251,284.54	
REGIONS FINANCIAL CORP	15,600	10.22	159,432.00	
REPUBLIC SERVICES INC	3,545	33.74	119,608.30	
RESMED INC	1,706	46.54	79,397.24	
REYNOLDS AMERICAN INC	3,194	48.51	154,940.94	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,503	118.99	178,841.97	
ROCKWELL COLLINS INC.	1,670	80.98	135,236.60	
ROPER INDUSTRIES INC	1,180	135.54	159,937.20	
ROSS STORES INC	2,298	67.65	155,459.70	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,120	51.37	108,904.40	
SAFEWAY INC	2,783	35.32	98,295.56	
SALESFORCE.COM INC	5,814	63.01	366,340.14	
SANDISK CORP	2,575	75.31	193,923.25	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,621	99.21	160,819.41	
SCANA CORP	2,122	49.08	104,147.76	
SCHLUMBERGER LTD	12,974	91.03	1,181,023.22	
SCRIPPS NETWORKS INTER- CL A	1,251	80.02	100,105.02	
SEAGATE TECHNOLOGY	3,264	50.02	163,265.28	
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,640	34.39	90,789.60	
SEMPRA ENERGY	2,054	92.93	190,878.22	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	870	193.40	168,258.00	
SIGMA-ALDRICH	1,563	94.03	146,968.89	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,823	3.60	125,362.80	
SLM CORP	5,017	23.41	117,447.97	
SOUTHERN CO	7,860	42.40	333,264.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	3,890	42.28	164,469.20	
SPECTRA ENERGY CORP	6,658	37.73	251,206.34	
SPRINT CORP	10,294	8.27	85,131.38	
ST JUDE MEDICAL INC	3,018	67.93	205,012.74	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,724	81.43	140,385.32	
STAPLES INC	7,611	13.10	99,704.10	

STARBUCKS CORP	7,143	73.55	525,367.65	
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	2,297	78.64	180,636.08	
STATE STREET CORP	4,441	67.82	301,188.62	
STERICYCLE INC	1,134	115.99	131,532.66	
STRYKER CORP	3,128	82.65	258,529.20	
SUNTRUST BANKS INC	5,766	37.08	213,803.28	
SYMANTEC CORP	7,625	20.51	156,388.75	
SYSCO CORP	6,485	35.85	232,487.25	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,859	80.10	229,005.90	
TARGET CORP	5,902	56.62	334,171.24	
TE CONNECTIVITY LTD	4,353	57.48	250,210.44	
TERADATA CORP	2,031	44.96	91,313.76	
TESLA MOTORS INC	825	209.97	173,225.25	
TESORO CORP	1,584	50.32	79,706.88	
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,742	44.20	474,796.40	
TEXTRON INC	3,720	38.53	143,331.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,599	124.71	448,831.29	
TIFFANY & CO	1,528	89.44	136,664.32	
TIME WARNER CABLE	2,937	141.66	416,055.42	
TIME WARNER INC	9,006	64.98	585,209.88	
TJX COS INC	6,955	60.02	417,439.10	
TORCHMARK CORP	1,337	76.09	101,732.33	
TOWERS WATSON & CO-CL A	799	110.03	87,913.97	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,583	65.77	104,113.91	
TRANSDIGM GROUP INC	627	177.82	111,493.14	
TRAVELERS COS INC/THE	3,413	83.81	286,043.53	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,241	38.64	125,232.24	
TRIPADVISOR INC	1,213	96.80	117,418.40	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	1,408	82.16	115,681.28	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	5,741	31.80	182,563.80	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	13,370	32.67	436,797.90	
TYCO INTERNATIONAL LTD	5,197	42.25	219,573.25	

TYSON FOODS INC-CL A	3,231	39.17	126,558.27	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	693	86.15	59,701.95	
UNION PACIFIC CORP	4,441	177.87	789,920.67	
UNITED PARCEL SERVICE INC	6,694	95.67	640,414.98	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	8,253	115.05	949,507.65	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,824	73.48	721,867.52	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,235	82.19	101,504.65	
UNUM GROUP	3,534	33.57	118,636.38	
US BANCORP	16,810	40.32	677,779.20	
VALERO ENERGY CORP	5,627	49.59	279,042.93	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,377	84.10	115,805.70	
VERISIGN INC	1,852	55.70	103,156.40	
VERISK ANALYTICS INC- CLASS A	1,824	66.05	120,475.20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	28,030	48.12	1,348,803.60	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,397	84.01	201,371.97	
VF CORP	3,741	58.03	217,090.23	
VIACOM INC-CLASS B	4,239	86.51	366,715.89	
VISA INC-CLASS A SHARES	4,967	223.46	1,109,925.82	
VULCAN MATERIALS CO	1,616	65.30	105,524.80	
WAL-MART STORES INC	15,388	73.52	1,131,325.76	
WALGREEN CO	8,737	66.55	581,447.35	
WALT DISNEY CO	16,474	79.19	1,304,576.06	
WASTE MANAGEMENT INC	4,672	40.98	191,458.56	
WATERS CORP	1,149	114.94	132,066.06	
WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	9,446	15.14	143,012.44	
WELLPOINT INC	3,009	87.71	263,919.39	
WELLS FARGO & CO	48,190	45.63	2,198,909.70	
WESTERN DIGITAL CORP	2,206	86.24	190,245.44	
WESTERN UNION CO	6,449	15.99	103,119.51	
WEYERHAEUSER CO	6,732	30.45	204,989.40	

	WHIRLPOOL CORP	898	138.01	123,932.98	
	WHITING PETROLEUM CORP	1,553	62.60	97,217.80	
	WHOLE FOODS MARKET INC	3,612	52.35	189,088.20	
	WILLIAMS COS INC	7,116	42.00	298,872.00	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	2,199	42.55	93,567.45	
	WISCONSIN ENERGY CORP	2,520	43.89	110,602.80	
	WW GRAINGER INC	613	248.04	152,048.52	
	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	1,720	69.23	119,075.60	
	WYNN RESORTS LTD	905	223.50	202,267.50	
	XCEL ENERGY INC	4,971	29.83	148,284.93	
	XEROX CORP	13,101	10.74	140,704.74	
	XILINX INC	3,091	50.74	156,837.34	
	XL GROUP PLC	4,065	29.30	119,104.50	
	XYLEM INC	2,597	38.71	100,529.87	
	YAHOO! INC	9,696	37.79	366,411.84	
	YUM! BRANDS INC	4,402	72.98	321,257.96	
	ZIMMER HOLDINGS INC	1,917	95.30	182,690.10	
	ZOETIS INC	5,758	29.97	172,567.26	
アメリカ・ドル	小計	2,954,844		166,782,085.55 (17,093,495,949)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	12,544	3.86	48,419.84	
	AGGREKO PLC	3,451	16.27	56,147.77	
	ANGLO AMERICAN PLC	15,052	15.54	233,908.08	
	ARM HOLDINGS PLC	14,579	9.47	138,063.13	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,805	29.67	112,894.35	
	ASTRAZENECA PLC	12,171	39.96	486,353.16	
	AVIVA PLC	32,268	4.68	151,111.04	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	5,494	14.28	78,454.32	
	BAE SYSTEMS PLC	33,320	4.00	133,413.28	
	BARCLAYS PLC	151,999	2.55	387,901.44	
	BG GROUP PLC	33,833	10.96	370,809.68	
	BHP BILLITON PLC	21,515	19.79	425,781.85	
	BP PLC	182,685	4.99	912,511.57	

BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	18,340	31.52	578,076.80	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	12,295	9.17	112,745.15	
BT GROUP PLC	80,592	4.15	334,698.57	
BUNZL PLC	4,869	14.89	72,499.41	
BURBERRY GROUP PLC	5,309	15.26	81,015.34	
CAPITA PLC	8,383	10.82	90,704.06	
CARNIVAL PLC	2,602	24.51	63,775.02	
CENTRICA PLC	49,380	3.20	158,312.28	
COMPASS GROUP PLC	18,892	9.17	173,239.64	
DIAGEO PLC	24,223	19.03	461,084.80	
EXPERIAN PLC	11,247	10.94	123,042.18	
GKN PLC	20,951	4.08	85,542.93	
GLAXOSMITHKLINE PLC	47,464	16.84	799,531.08	
GLENCORE XSTRATA PLC	107,102	3.40	364,575.20	
HSBC HOLDINGS PLC	179,386	6.52	1,169,776.10	
IMI PLC	4,068	15.65	63,664.20	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	9,760	23.60	230,336.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,042	19.75	79,829.50	
INTERTEK GROUP PLC	2,359	30.11	71,029.49	
ITV PLC	48,305	2.07	100,377.79	
JOHNSON MATTHEY PLC	2,615	32.88	85,981.20	
KINGFISHER PLC	27,120	3.97	107,910.48	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	66,158	2.40	158,977.67	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	491,371	0.81	398,501.88	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	18,848	5.03	94,899.68	
MEGGITT PLC	13,750	5.14	70,743.75	
MORRISON WM SUPERMARKETS	30,870	2.42	74,736.27	
NATIONAL GRID PLC	34,414	8.36	287,701.04	
NEXT PLC	1,841	65.40	120,401.40	
OLD MUTUAL PLC	57,814	1.84	106,435.57	
PEARSON PLC	9,756	11.10	108,291.60	
PRUDENTIAL PLC	25,631	13.55	347,300.05	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	6,208	49.75	308,848.00	
REED ELSEVIER PLC	14,323	9.13	130,768.99	
RESOLUTION LTD	20,663	3.71	76,804.37	
REXAM PLC	13,277	5.15	68,376.55	
RIO TINTO PLC	12,874	35.93	462,627.19	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	18,690	10.10	188,769.00	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	23,843	3.55	84,809.55	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	39,004	21.95	856,332.82	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	22,037	23.56	519,301.90	
RSA INSURANCE GROUP PLC	55,192	0.99	54,971.23	
SABMILLER PLC	9,479	27.99	265,364.60	
SAGE GROUP PLC	19,421	4.24	82,345.04	
SEVERN TRENT PLC	3,017	17.98	54,245.66	
SHIRE PLC	5,746	33.31	191,399.26	
SMITH & NEPHEW PLC	11,940	9.58	114,444.90	
SMITHS GROUP PLC	5,934	13.90	82,482.60	
SSE PLC	9,656	14.20	137,115.20	
STANDARD CHARTERED PLC	24,296	13.20	320,707.20	
STANDARD LIFE PLC	28,623	3.88	111,257.60	
TATE & LYLE PLC	7,745	6.51	50,419.95	
TESCO PLC	81,089	3.34	271,242.70	
TRAVIS PERKINS PLC	3,599	19.66	70,756.34	
TULLOW OIL PLC	10,909	7.80	85,090.20	
UNILEVER PLC	12,753	24.38	310,918.14	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,132	7.73	70,590.36	
VODAFONE GROUP PLC	475,595	2.29	1,091,966.12	
WEIR GROUP PLC/THE	2,891	23.28	67,302.48	
WHITBREAD PLC	2,283	41.57	94,904.31	
WOLSELEY PLC	3,226	33.17	107,006.42	
WPP PLC	15,160	13.57	205,721.20	
イギリス・ポンド 小計	2,931,078		17,248,395.52 (2,945,163,535)	

イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	19,960	18.53	369,858.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	27,019	13.05	352,597.95	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	9,191	169.40	1,556,955.40	
イスラエル・シュケル 小計		56,170		2,279,412.15 (66,536,041)	
オーストラリ ア・ドル	AGL ENERGY LTD	8,077	15.92	128,585.84	
	AMCOR LTD	16,254	10.56	171,642.24	
	AMP LTD	38,180	4.92	187,845.60	
	ASCIANO LTD	20,312	5.60	113,747.20	
	ASX LTD	3,930	37.45	147,178.50	
	AURIZON HOLDINGS LTD	31,742	5.04	159,979.68	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	27,585	31.60	871,686.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	9,860	11.74	115,756.40	
	BHP BILLITON LTD	32,590	38.70	1,261,233.00	
	BRAMBLES LTD	20,882	9.19	191,905.58	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	9,649	11.47	110,674.03	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	15,969	74.60	1,191,287.40	
	CROWN RESORTS LTD	7,074	17.23	121,885.02	
	CSL LIMITED	5,019	70.31	352,885.89	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	18,599	5.87	109,176.13	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	26,626	5.52	146,975.52	
	MACQUARIE GROUP LTD	3,524	55.26	194,736.24	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	23,812	35.16	837,229.92	
	ORICA LTD	5,737	24.14	138,491.18	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	13,773	14.55	200,397.15	
QBE INSURANCE GROUP LTD	13,471	11.40	153,569.40		
RIO TINTO LTD	5,103	69.59	355,117.77		
SANTOS LTD	12,414	14.27	177,147.78		
SUNCORP GROUP LTD	16,042	12.70	203,733.40		
SYDNEY AIRPORT	3,043	3.98	12,111.14		

	TATTS GROUP LTD	35,242	2.96	104,316.32	
	TELSTRA CORP LTD	49,901	5.27	262,978.27	
	WESFARMERS LIMITED	10,676	43.05	459,601.80	
	WESTPAC BANKING CORP	31,011	33.10	1,026,464.10	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	7,301	38.60	281,818.60	
	WOOLWORTHS LTD	13,435	36.19	486,212.65	
	オーストラリア・ドル 小計	536,833		10,276,369.75 (947,686,818)	
カナダ・ドル	AGRIUM INC	1,823	98.65	179,838.95	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,636	87.47	143,100.92	
	ARC RESOURCES LTD	4,095	29.80	122,031.00	
	BANK OF MONTREAL	6,098	72.44	441,739.12	
	BANK OF NOVA SCOTIA	11,381	63.95	727,814.95	
	BARRICK GOLD CORP	13,856	23.29	322,706.24	
	BAYTEX ENERGY CORP	2,353	40.76	95,908.28	
	BCE INC	3,452	47.57	164,211.64	
	BOMBARDIER INC	20,252	3.56	72,097.12	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	6,733	44.55	299,955.15	
	CAE INC	7,547	14.85	112,072.95	
	CAMECO CORP	5,705	23.29	132,869.45	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	3,853	90.13	347,270.89	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	8,557	61.85	529,250.45	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	11,542	40.89	471,952.38	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	6,852	20.84	142,795.68	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,894	173.64	328,874.16	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,160	97.98	113,656.80	
	CATAMARAN CORP	2,406	57.41	138,128.46	
	CENOVUS ENERGY INC	8,805	28.40	250,062.00	
	CGI GROUP INC	2,646	37.23	98,510.58	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	4,564	38.82	177,174.48	
	ENBRIDGE INC	8,296	47.61	394,972.56	

ENCANA CORP	8,674	20.66	179,204.84	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,367	21.59	159,053.53	
FORTIS INC	4,390	30.67	134,641.30	
FRANCO-NEVADA CORP	2,517	59.12	148,805.04	
GOLDCORP INC	10,359	30.71	318,124.89	
GREAT-WEST LIFECO INC	3,615	31.00	112,065.00	
HUSKY ENERGY INC	4,414	33.47	147,736.58	
IMPERIAL OIL LTD	3,539	48.62	172,066.18	
INTACT FINANCIAL CORP	1,914	66.85	127,950.90	
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,382	96.09	228,886.38	
MANULIFE FINANCIAL CORP	19,157	21.19	405,936.83	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,676	43.85	161,192.60	
ONEX CORPORATION	1,929	58.99	113,791.71	
PEMBINA PIPELINE CORP	4,060	39.92	162,075.20	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	9,070	37.30	338,311.00	
POWER CORP OF CANADA	5,430	30.11	163,497.30	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	4,247	42.90	182,196.30	
ROYAL BANK OF CANADA	13,670	72.80	995,176.00	
SAPUTO INC	2,270	54.04	122,670.80	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,506	25.36	164,992.16	
SHOPPERS DRUG MART CORP	1,889	59.34	112,093.26	
SILVER WHEATON CORP	6,804	28.79	195,887.16	
SNC-LAVALIN GROUP INC	2,001	47.46	94,967.46	
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,541	39.47	258,173.27	
SUNCOR ENERGY INC	15,259	36.73	560,463.07	
TALISMAN ENERGY INC	12,244	11.74	143,744.56	
TECK RESOURCES LTD-CL B	7,186	25.93	186,332.98	
THOMSON REUTERS CORP	4,712	38.10	179,527.20	
TIM HORTONS INC	2,185	58.98	128,871.30	
TORONTO-DOMINION BANK	17,386	49.84	866,518.24	
TOURMALINE OIL CORP	2,188	50.83	111,216.04	
TRANSCANADA CORP	7,455	48.83	364,027.65	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	3,209	163.73	525,409.57	

	VERMILION ENERGY INC	1,843	63.31	116,680.33	
	YAMANA GOLD INC	13,773	11.69	161,006.37	
カナダ・ドル 小計		369,367		14,350,287.21 (1,322,378,967)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	56,000	2.86	160,160.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	21,000	16.62	349,020.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	110,000	1.40	154,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	54,000	2.86	154,440.00	
	KEPPEL CORP LTD	25,600	10.45	267,520.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	34,000	9.58	325,720.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	18,000	10.18	183,240.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	99,000	3.58	354,420.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	16,000	20.70	331,200.00	
シンガポール・ドル 小計		433,600		2,279,720.00 (184,839,697)	
スイス・フラン	ABB LTD	22,513	22.35	503,165.55	
	ACTELION LTD-REG	1,281	89.30	114,393.30	
	ADECCO SA-REG	1,949	71.60	139,548.40	
	ARYZTA AG	1,481	72.50	107,372.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	5,381	88.10	474,066.10	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	16,137	28.10	453,449.70	
	GEBERIT AG-REG	541	268.90	145,474.90	
	GIVAUDAN-REG	106	1,376.00	145,856.00	
	HOLCIM LTD-REG	2,960	68.60	203,056.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,125	40.91	127,843.75	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	868	122.40	106,243.20	
	NESTLE SA	31,339	65.60	2,055,838.40	
	NOVARTIS AG	22,373	73.05	1,634,347.65	
	ROCHE HOLDING AG	6,854	265.00	1,816,310.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	924	131.70	121,690.80	
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	78	2,190.00	170,820.00		

	SONOVA HOLDING AG-REG	765	124.30	95,089.50	
	SWATCH GROUP AG	423	581.50	245,974.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	576	199.20	114,739.20	
	SWISS RE AG	3,712	83.20	308,838.40	
	SWISSCOM AG	370	516.50	191,105.00	
	SYNGENTA AG	984	326.00	320,784.00	
	TRANSOCEAN LTD	4,304	38.45	165,488.80	
	UBS AG	37,066	18.51	686,091.66	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,561	264.60	413,040.60	
スイス・フラン 小計		167,671		10,860,627.91 (1,251,470,154)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	5,106	169.90	867,509.40	
	ASSA ABLOY AB	3,999	330.80	1,322,869.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	10,714	178.90	1,916,734.60	
	HENNES & MAURITZ AB	9,435	287.60	2,713,506.00	
	HEXAGON AB-B SHS	3,304	223.70	739,104.80	
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	2,801	246.00	689,046.00	
	INVESTOR AB	5,780	220.60	1,275,068.00	
	NORDEA BANK AB	31,195	89.50	2,791,952.50	
	SANDVIK AB	13,654	88.40	1,207,013.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	17,529	87.60	1,535,540.40	
	SKANSKA AB-B SHS	6,989	132.90	928,838.10	
	SKF AB	5,348	173.20	926,273.60	
	SVENSKA CELLULOSA AB	6,380	191.30	1,220,494.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	5,489	326.30	1,791,060.70	
	SWEDBANK AB - A SHARES	9,637	178.00	1,715,386.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	32,619	81.80	2,668,234.20	
TELIASONERA AB	28,373	49.41	1,401,909.93		
VOLVO AB	17,301	93.85	1,623,698.85		
スウェーデン・クローナ 小計		215,653		27,334,239.88 (428,874,223)	

デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	22	64,250.00	1,413,500.00	
	CARLSBERG AS-B	1,391	587.00	816,517.00	
	COLOPLAST-B	1,620	433.10	701,622.00	
	DANSKE BANK A/S	7,742	138.50	1,072,267.00	
	NOVO-NORDISK A/S	19,915	240.00	4,779,600.00	
	NOVOZYMES A/S	2,786	247.80	690,370.80	
	TDC A/S	15,983	52.15	833,513.45	
デンマーク・クローネ 小計		49,459		10,307,390.25 (194,191,232)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	11,350	106.60	1,209,910.00	
	ORKLA ASA	14,325	46.65	668,261.25	
	SEADRILL LTD	4,723	221.30	1,045,199.90	
	STATOIL ASA	11,347	161.10	1,828,001.70	
	TELENOR ASA	8,631	133.40	1,151,375.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,694	246.60	664,340.40	
ノルウェー・クローネ 小計		53,070		6,567,088.65 (110,458,431)	
ユーロ	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	6,420	17.05	109,461.00	
	ACCOR	2,532	36.52	92,481.30	
	ADIDAS AG	2,403	84.80	203,774.40	
	AEGON NV	20,374	6.35	129,537.89	
	AGEAS	3,831	31.85	122,036.50	
	AIR LIQUIDE	3,241	98.58	319,497.78	
	AIRBUS GROUP NV	5,859	52.57	308,007.63	
	AKZO NOBEL NV	2,648	59.49	157,529.52	
	ALCATEL-LUCENT	31,638	3.10	98,299.26	
	ALLIANZ SE	4,599	129.75	596,720.25	
	ALSTOM RGPT	3,060	19.58	59,914.80	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	4,400	31.46	138,424.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	8,151	74.03	603,418.53	
	ARCELORMITTAL	11,965	12.01	143,759.47	
	ARKEMA	897	81.08	72,728.76	
ASML HOLDING NV	3,495	64.66	225,986.70		

ASSICURAZIONI GENERALI SPA	12,891	16.71	215,408.61	
ATLANTIA SPA	5,179	18.04	93,429.16	
AXA	18,828	19.55	368,087.40	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	58,972	8.92	526,089.21	
BANCO DE SABADELL SA	40,716	2.30	93,931.81	
BANCO POPULAR ESPANOL	15,960	5.07	80,965.08	
BANCO SANTANDER SA	113,304	6.50	736,476.00	
BANK OF IRELAND	250,272	0.34	85,092.48	
BASF SE	9,181	82.30	755,596.30	
BAYER AG	8,251	101.20	835,001.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,575	84.39	301,694.25	
BEIERSDORF AG	1,266	73.45	92,987.70	
BNP PARIBAS	10,118	58.52	592,105.36	
BOUYGUES	2,715	28.85	78,341.32	
BRENTAG AG	728	133.90	97,479.20	
BUREAU VERITAS SA	3,317	20.42	67,749.72	
CAIXABANK	21,603	4.60	99,568.22	
CAP GEMINI SA	1,944	56.31	109,466.64	
CARREFOUR SA	6,805	26.42	179,788.10	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,040	82.63	85,935.20	
CHRISTIAN DIOR SA	759	143.45	108,878.55	
CIE DE SAINT-GOBAIN	4,723	41.22	194,705.67	
CNH INDUSTRIAL NV	12,012	8.09	97,237.14	
COMMERZBANK AG	10,945	13.02	142,503.90	
CONTINENTAL AG	1,175	168.30	197,752.50	
CREDIT AGRICOLE SA	12,143	11.17	135,698.02	
CRH PLC	8,236	20.05	165,172.98	
DAIMLER AG	9,573	66.47	636,317.31	
DANONE	5,769	51.70	298,257.30	
DASSAULT SYSTEMES SA	890	83.79	74,573.10	
DEUTSCHE BANK AG	10,622	35.30	374,956.60	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,256	58.23	131,380.41	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	4,508	18.37	82,848.02	

DEUTSCHE POST AG	9,453	26.11	246,817.83	
DEUTSCHE TELEKOM AG	30,354	12.17	369,559.95	
E.ON SE	18,631	14.10	262,697.10	
EDENRD	3,252	22.87	74,373.24	
EDF	2,516	28.35	71,328.60	
ENEL SPA	69,501	3.77	262,435.77	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	37,087	2.95	109,703.34	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	25,633	17.32	443,963.56	
ERSTE GROUP BANK AG	3,506	29.06	101,901.89	
ESSILOR INTERNATIONA	2,247	76.84	172,659.48	
FERROVIAL S.A.	6,768	14.40	97,493.04	
FIAT SPA	11,829	7.61	90,018.69	
FORTUM OYJ	5,366	17.90	96,051.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	2,497	53.20	132,840.40	
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,441	119.40	172,055.40	
GAS NATURAL SDG SA	4,407	18.57	81,837.99	
GDF SUEZ	13,526	17.88	241,912.51	
GEA GROUP AG	2,731	34.29	93,659.64	
GEMALTO	864	79.12	68,359.68	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,668	69.15	115,342.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	1,903	57.30	109,041.90	
HEINEKEN NV	2,423	48.93	118,557.39	
HENKEL AG & CO KGAA	3,235	74.62	241,395.70	
IBERDROLA SA	48,957	4.68	229,216.67	
IMMOFINANZ AG	24,618	3.62	89,117.16	
INDITEX SA	2,181	105.70	230,531.70	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,110	7.67	100,619.25	
ING GROEP NV	39,137	10.52	411,916.92	
INTESA SANPAOLO	127,261	2.23	284,301.07	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	16,454	5.47	90,003.38	
KBC GROUP SA	2,895	44.82	129,753.90	
KERING	880	155.00	136,400.00	
KERRY GROUP PLC-A	1,963	51.60	101,290.80	

KONE OYJ	3,648	31.55	115,094.40	
KONINKLIJKE AHOLD NV	11,042	13.33	147,245.07	
KONINKLIJKE DSM NV	1,714	48.00	82,272.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,835	25.61	251,874.35	
L'OREAL SA	2,364	122.55	289,708.20	
LAFARGE SA	2,372	54.01	128,111.72	
LEGRAND SA	3,320	43.24	143,573.40	
LINDE AG	1,976	148.00	292,448.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	2,273	39.68	90,192.64	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	2,630	137.15	360,704.50	
MERCK KGAA	732	123.05	90,072.60	
MICHELIN (C.G.D.E.)	2,074	87.50	181,475.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	1,872	157.49	294,838.12	
NOKIA OYJ	38,325	5.30	203,122.50	
OMV AG	2,231	34.03	75,920.93	
ORANGE S.A.	21,015	9.38	197,204.76	
PERNOD-RICARD	2,365	85.56	202,349.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	1,675	78.52	131,521.00	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	2,551	34.62	88,328.37	
PUBLICIS GROUPE	2,430	67.83	164,826.90	
RANDSTAD HOLDINGS NV	1,639	43.99	72,107.80	
RED ELECTRICA DE ESPANA	1,520	54.40	82,688.00	
REED ELSEVIER NV	8,393	15.85	133,029.05	
RENAULT SA	2,141	73.36	157,063.76	
REPSOL SA	9,376	17.98	168,627.36	
ROYAL KPN NV	35,155	2.69	94,848.19	
RWE AG	5,423	29.60	160,520.80	
SAFRAN SA	2,967	52.43	155,559.81	
SAMPO OYJ	4,911	36.71	180,282.81	
SANOFI	11,806	73.57	868,567.42	
SAP AG	9,274	57.98	537,706.52	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	5,533	65.39	361,802.87	
SIEMENS AG	7,851	94.84	744,588.84	

	SNAM SPA	25,971	4.09	106,325.27	
	SOCIETE GENERALE	7,448	46.72	347,970.56	
	SODEXO	1,287	76.08	97,914.96	
	SOLVAY SA	925	112.25	103,831.25	
	TECHNIP SA	1,485	69.99	103,935.15	
	TELECOM ITALIA SPA	169,129	0.86	146,465.71	
	TELEFONICA SA	42,553	11.34	482,551.02	
	TENARIS SA	6,332	16.02	101,438.64	
	TERNA SPA	25,941	3.74	97,071.22	
	THYSSENKRUPP AG	4,808	19.85	95,438.80	
	TOTAL SA	20,892	44.89	937,841.88	
	UCB SA	1,764	53.75	94,815.00	
	UNICREDIT SPA	45,141	5.87	264,977.67	
	UNILEVER NV	15,856	28.48	451,578.88	
	UPM-KYMMENE OYJ	7,830	12.76	99,910.80	
	VALEO SA	1,068	87.96	93,941.28	
	VINCI SA	5,227	52.12	272,431.24	
	VIVENDI SA	12,950	20.81	269,489.50	
	VOLKSWAGEN AG	1,657	198.15	328,334.55	
	WARTSILA OYJ	2,567	42.14	108,173.38	
	WOLTERS KLUWER NV	4,990	20.05	100,049.50	
	ユーロ 小計	1,952,337		29,046,973.15 (4,084,585,364)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	121,814	37.35	4,549,752.90	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	49,621	24.15	1,198,347.15	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	17,333	116.10	2,012,361.30	
	CLP HOLDINGS LTD	24,492	59.55	1,458,498.60	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	24,148	71.70	1,731,411.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	39,659	21.55	854,651.45	
	HANG SENG BANK LTD	9,955	122.60	1,220,483.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	75,164	15.90	1,195,107.60	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,621	121.80	1,780,837.80	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	25,331	101.40	2,568,563.40	
	LI & FUNG LTD	77,446	10.18	788,400.28	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,263	62.35	1,138,698.05	
	SANDS CHINA LTD	26,670	57.80	1,541,526.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	20,244	98.15	1,986,948.60	
	SWIRE PACIFIC LTD	12,990	83.75	1,087,912.50	
	WHARF HOLDINGS LTD	21,032	55.90	1,175,688.80	
香港・ドル	小計	578,783		26,289,189.03 (347,543,080)	
合計		10,298,865		28,977,223,491 (28,977,223,491)	

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	5,503.00	121,946.48	
		AMERICAN TOWER REIT INC	4,124.00	348,519.24	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	13,968.00	151,552.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,420.00	183,023.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,852.00	204,942.32	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	3,603.00	274,872.87	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,844.00	225,758.12	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	6,089.00	136,028.26	
		HCP INC	5,330.00	201,687.20	
		HEALTH CARE REIT INC	3,291.00	186,204.78	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	9,517.00	185,105.65	
		KIMCO REALTY CORP	6,410.00	139,097.00	
		MACERICH CO/THE	2,443.00	146,873.16	
		PLUM CREEK TIMBER CO	3,004.00	128,691.36	
		PROLOGIS INC	5,954.00	240,482.06	
		PUBLIC STORAGE	1,508.00	251,398.68	
		REALTY INCOME CORP	3,041.00	130,489.31	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3,148.00	503,428.16			
SL GREEN REALTY CORP	1,420.00	137,456.00			

	VENTAS INC	3,412.00	208,643.80	
	VORNADO REALTY TRUST	2,027.00	192,625.81	
アメリカ・ドル 小計		90,908.00	4,298,826.86	(440,586,765)
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,896.00	96,716.16	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,712.00	116,867.92	
イギリス・ポンド 小計		24,608.00	213,584.08	(36,469,481)
オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	26,533.00	128,685.05	
	STOCKLAND	33,067.00	129,953.31	
	WESTFIELD GROUP	24,665.00	256,022.70	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	48,993.00	152,858.16	
オーストラリア・ドル 小計		133,258.00	667,519.22	(61,558,623)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,178.00	225,056.90	
ユーロ 小計		1,178.00	225,056.90	(31,647,501)
香港・ドル	LINK REIT	33,876.00	1,228,005.00	
香港・ドル 小計		33,876.00	1,228,005.00	(16,234,226)
投資証券 合計			586,496,596	(586,496,596)
合計			586,496,596	(586,496,596)

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合 計金額に対す る比率
アメリカ・ドル	株式 486銘柄	55.96%	-%	59.31%
	投資証券 21銘柄	-%	1.44%	
イギリス・ポンド	株式 75銘柄	9.64%	-%	10.09%
	投資証券 2銘柄	-%	0.12%	
イスラエル・シケル	株式 3銘柄	0.22%	-%	0.23%

オーストラリア・ドル	株式	31銘柄	3.10%	-%	3.41%
	投資証券	4銘柄	-%	0.20%	
カナダ・ドル	株式	58銘柄	4.33%	-%	4.47%
シンガポール・ドル	株式	9銘柄	0.61%	-%	0.63%
スイス・フラン	株式	25銘柄	4.10%	-%	4.23%
スウェーデン・クローナ	株式	18銘柄	1.40%	-%	1.45%
デンマーク・クローネ	株式	7銘柄	0.64%	-%	0.66%
ノルウェー・クローネ	株式	6銘柄	0.36%	-%	0.37%
ユーロ	株式	136銘柄	13.37%	-%	13.92%
	投資証券	1銘柄	-%	0.10%	
香港・ドル	株式	16銘柄	1.14%	-%	1.23%
	投資証券	1銘柄	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

「ニッセイ外国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26年2月21日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	107,321,948
コール・ローン	44,980,402
国債証券	5,336,306,163
派生商品評価勘定	77,423
未収利息	16,012,088
前払費用	37,813,339
流動資産合計	5,542,511,363
資産合計	5,542,511,363
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,588
未払金	122,611,816
未払解約金	301,831
流動負債合計	122,923,235
負債合計	122,923,235
純資産の部	
元本等	
元本	4,485,540,763
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	934,047,365
純資産合計	5,419,588,128
負債純資産合計	5,542,511,363

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。</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。</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、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</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>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>
----------------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成26年2月21日現在）
1. 計算日における受益権総口数	4,485,540,763口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2082円 (12,082円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年2月22日 至 平成26年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成26年2月21日現在）
----	----------------

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年2月21日現在
	当期間の損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	6,006,484
合計	6,006,484

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成26年2月21日 現在）			評価損益 （円）
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	49,684,640	-	49,752,475	67,835
アメリカ・ドル	34,101,088	-	34,174,975	73,887
イギリス・ポンド	2,218,969	-	2,219,550	581
ユーロ	13,364,583	-	13,357,950	6,633
合計	49,684,640	-	49,752,475	67,835

（注） 時価の算定方法

1. 国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、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たレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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計算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26年2月21日現在）
同計算期間の期首元本額	399,963,178円
同計算期間中の追加設定元本額	4,122,059,058円
同計算期間中の一部解約元本額	36,481,473円
同計算期間末日の元本の内訳	
ファンド名	
D C ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	557,671,455円
D C ニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,396,089,173円
D C ニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	532,141,476円
ニッセイ外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	398,245,757円
ニッセイ厚生年金型バランス運用（現物型）D B（適格機関投資家限定）	1,257,933,535円
<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国債券インデックスファンド	343,459,367円
計	4,485,540,763円

附属明細表（平成26年2月21日現在）

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	110,000.00	136,107.40	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	80,000.00	101,000.00	

US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	50,000.00	65,312.50	
US TREASURY N/B 0.875 2019/07/31	310,000.00	295,926.00	
US TREASURY N/B 1 2016/10/31	1,110,000.00	1,121,444.10	
US TREASURY N/B 1.25 2015/10/31	1,290,000.00	1,311,310.80	
US TREASURY N/B 1.25 2019/10/31	340,000.00	329,585.80	
US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	420,000.00	407,530.20	
US TREASURY N/B 1.5 2016/07/31	1,090,000.00	1,116,225.40	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	230,000.00	212,623.50	
US TREASURY N/B 1.75 2015/07/31	1,220,000.00	1,246,925.40	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	200,000.00	188,952.00	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	430,000.00	397,444.70	
US TREASURY N/B 1.875 2017/10/31	640,000.00	658,944.00	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	310,000.00	301,958.60	
US TREASURY N/B 2.375 2017/07/31	690,000.00	723,258.00	
US TREASURY N/B 2.5 2015/04/30	1,010,000.00	1,037,966.90	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	440,000.00	432,951.20	
US TREASURY N/B 2.625 2016/04/30	1,100,000.00	1,152,932.00	
US TREASURY N/B 2.625 2018/04/30	550,000.00	580,547.00	
US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	380,000.00	393,326.60	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	380,000.00	392,350.00	
US TREASURY N/B 2.75 2019/02/15	300,000.00	317,061.00	

US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	210,000.00	173,250.00	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	170,000.00	148,563.00	
US TREASURY N/B 3.125 2017/01/31	630,000.00	674,295.30	
US TREASURY N/B 3.125 2019/05/15	280,000.00	300,759.20	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	290,000.00	307,400.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	50,000.00	44,968.50	
US TREASURY N/B 3.5 2018/02/15	540,000.00	588,600.00	
US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	390,000.00	425,587.50	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	540,000.00	530,631.00	
US TREASURY N/B 3.75 2018/11/15	480,000.00	530,097.60	
US TREASURY N/B 4 2018/08/15	510,000.00	568,609.20	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	140,000.00	154,655.20	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	60,000.00	66,225.00	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	50,000.00	56,304.50	
US TREASURY N/B 4.5 2016/02/15	1,180,000.00	1,277,066.80	
US TREASURY N/B 4.5 2017/05/15	610,000.00	680,912.50	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	70,000.00	80,455.90	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	60,000.00	68,830.80	
WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	230,000.00	258,963.90	
WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	200,000.00	225,062.00	
アメリカ・ドル 小計	19,370,000.00	20,082,921.00 (2,058,298,573)	

イギリス・ボンド	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	120,000.00	130,761.60	
	TSY 4 1/2% 2019 4.5 2019/03/07	160,000.00	180,352.00	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	140,000.00	164,655.40	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	130,000.00	145,407.60	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	60,000.00	68,284.80	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	100,000.00	112,263.00	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	130,000.00	145,580.50	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	100,000.00	116,348.00	
	TSY 4 3/4% 2015 4.75 2015/09/07	10,000.00	10,648.70	
	TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	140,000.00	160,923.00	
	TSY 4% 2016 4 2016/09/07	240,000.00	259,183.20	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	140,000.00	155,213.80	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	40,000.00	44,595.20	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	160,000.00	193,296.00	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	50,000.00	59,852.00	
	TSY 5% 2018 5 2018/03/07	180,000.00	204,699.60	
	UK TREASURY 8.75 2017/08/25	110,000.00	138,054.40	
UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	80,000.00	76,350.40		
UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	30,000.00	29,913.00		
UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	50,000.00	57,515.00		
イギリス・ボンド 小計		2,170,000.00	2,453,897.20 (419,002,947)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2016/06/15	280,000.00	292,216.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	170,000.00	184,312.30	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	220,000.00	247,687.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 6.25 2015/04/15	20,000.00	20,845.60	
	Australia Government Bond 4.75 2027/04/21	130,000.00	134,595.50	
オーストラリア・ドル 小計		820,000.00	879,656.80 (81,121,950)	
カナダ・ドル	CANADA GOVT 5.75 2029/06/01	70,000.00	95,487.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	130,000.00	134,499.30	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	90,000.00	98,055.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	250,000.00	275,490.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2016/06/01	580,000.00	618,628.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	90,000.00	120,065.40	
カナダ・ドル 小計		1,210,000.00	1,342,225.40 (123,686,071)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	200,000.00	203,254.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.75 2016/09/01	30,000.00	32,536.20	
シンガポール・ドル 小計		230,000.00	235,790.20 (19,117,869)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	340,000.00	374,612.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.75 2017/08/12	1,380,000.00	1,501,785.00	
スウェーデン・クローナ 小計		1,720,000.00	1,876,397.00 (29,440,669)	
ノルウェー・クロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	820,000.00	913,357.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 5 2015/05/15	130,000.00	135,590.00	
ノルウェー・クローネ 小計		950,000.00	1,048,947.00 (17,643,289)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	150,000.00	144,112.50	

	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2017/10/25	1,010,000.00	1,067,267.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	160,000.00	171,644.80	
ポーランド・ズロチ	小計	1,320,000.00	1,383,024.30 (46,663,240)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIAN GOVERNMENT 3.741 2015/02/27	270,000.00	271,933.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	630,000.00	631,127.70	
マレーシア・リンギット	小計	900,000.00	903,060.90 (28,049,072)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 6 2015/06/18	640,000.00	659,276.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	1,910,000.00	2,040,453.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2017/12/14	2,970,000.00	3,273,623.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	900,000.00	1,002,708.00	
メキシコ・ペソ	小計	6,420,000.00	6,976,060.90 (53,785,430)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 2.75 2016/03/28	210,000.00	220,779.30	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	160,000.00	182,097.60	
	BELGIUM KINGDOM 4 2018/03/28	170,000.00	191,646.10	
	BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	150,000.00	173,149.50	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	60,000.00	70,490.40	
	BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	80,000.00	103,062.40	
	BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	90,000.00	118,386.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.15 2016/01/31	480,000.00	500,136.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2017/01/31	350,000.00	373,415.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	360,000.00	395,654.40	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2015/01/31	90,000.00	93,289.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	180,000.00	195,730.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	120,000.00	128,846.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	30,000.00	32,921.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	130,000.00	149,838.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	140,000.00	165,898.60	
BTPS 6.5 11/01/27 6.5 2027/11/01	180,000.00	228,004.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	300,000.00	299,469.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	420,000.00	442,688.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	220,000.00	240,979.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2020/01/04	110,000.00	125,250.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	110,000.00	125,255.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2016/01/04	690,000.00	733,670.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2019/07/04	130,000.00	149,037.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.75 2017/01/04	360,000.00	396,648.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2018/01/04	690,000.00	786,317.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	80,000.00	100,221.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	170,000.00	223,912.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	70,000.00	95,328.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2015/08/01	440,000.00	458,726.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2016/08/01	380,000.00	403,047.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	300,000.00	315,867.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2017/02/01	370,000.00	397,065.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	240,000.00	258,619.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	90,000.00	88,175.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/02/01	120,000.00	131,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	130,000.00	142,382.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/02/01	320,000.00	350,876.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	200,000.00	220,618.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	30,000.00	31,215.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	160,000.00	178,113.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	130,000.00	142,500.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	130,000.00	141,035.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	150,000.00	169,815.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	200,000.00	231,810.00	
DEUTSCH REP 6.25 2024/01/04	60,000.00	85,294.80	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	150,000.00	197,505.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	90,000.00	129,153.60	
FRANCE (GOVT OF) 3 2015/10/25	150,000.00	157,005.00	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	200,000.00	217,820.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2016/04/25	530,000.00	564,333.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	30,000.00	29,780.40	

FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	250,000.00	282,367.50	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	200,000.00	219,960.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2017/04/25	370,000.00	408,209.90	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	250,000.00	286,930.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2018/04/25	350,000.00	396,798.50	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	80,000.00	91,456.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	50,000.00	57,265.50	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	40,000.00	45,852.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2019/04/25	280,000.00	325,180.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	240,000.00	284,104.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	80,000.00	98,757.60	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	80,000.00	100,912.00	
FRANCE O.A.T. 5.75 2032/10/25	100,000.00	140,140.00	
FRENCH OAT 5.5 2029/04/25	140,000.00	186,873.40	
ITALY BTP 6 2031/05/01	100,000.00	122,380.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2015/07/15	280,000.00	291,956.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	200,000.00	232,050.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2019/07/15	260,000.00	300,458.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	110,000.00	134,609.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	70,000.00	95,739.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	130,000.00	149,054.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	80,000.00	98,416.80	

	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.3 2017/09/15	130,000.00	147,192.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.35 2019/03/15	160,000.00	186,825.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	60,000.00	76,232.40	
	SPANISH GVOT 5.75 07 5.75 2032/07/30	120,000.00	144,792.00	
	TREASURY 4 1/2% 2018 4.5 2018/10/18	230,000.00	259,633.20	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	60,000.00	70,789.20	
	ユーロ 小計	15,430,000.00	17,319,521.20 (2,435,471,071)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	1,900,000.00	2,163,340.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2017/09/15	410,000.00	414,555.10	
	南アフリカ・ランド 小計	2,310,000.00	2,577,895.10 (24,025,982)	
国債証券 合計			5,336,306,163 (5,336,306,163)	
合計			5,336,306,163 (5,336,306,163)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 種類別合計額及び合計金額欄は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 43銘柄	37.98%	38.57%
イギリス・ポンド	国債証券 20銘柄	7.73%	7.85%
オーストラリア・ドル	国債証券 5銘柄	1.50%	1.52%
カナダ・ドル	国債証券 6銘柄	2.28%	2.32%
シンガポール・ドル	国債証券 2銘柄	0.35%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.54%	0.55%
ノルウェー・クローネ	国債証券 2銘柄	0.33%	0.33%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	0.86%	0.87%
マレーシア・リンギット	国債証券 2銘柄	0.52%	0.53%
メキシコ・ペソ	国債証券 4銘柄	0.99%	1.01%

ユーロ	国債証券	80銘柄	44.94%	45.64%
南アフリカ・ランド	国債証券	2銘柄	0.44%	0.45%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」（平成26年3月31日現在）

資産総額	3,412,863,742円
負債総額	677,616円
純資産総額（ - ）	3,412,186,126円
発行済数量	2,321,210,842口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4700円

「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」（平成26年3月31日現在）

資産総額	11,354,365,007円
負債総額	6,441,086円
純資産総額（ - ）	11,347,923,921円
発行済数量	7,038,951,511口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6122円

「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」（平成26年3月31日現在）

資産総額	6,461,816,230円
負債総額	15,857,611円
純資産総額（ - ）	6,445,958,619円
発行済数量	3,707,657,734口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7386円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（2）受益者に対する特典

ありません。

（3）譲渡制限

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

（4）受益権の譲渡

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

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

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

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

平成26年3月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

（2）委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年3月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	216	25,545
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	21	3,219
単位型公社債投資信託	0	0
合計	237	28,765

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

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第18期事業年度（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。

また、第19期事業年度に係る中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成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 (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)
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		-
その他人件費		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 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)
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

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成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 その他有価証券」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	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）
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）

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

	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)
(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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第19期中間会計期間末
(平成25年9月30日現在)

資産の部

流動資産

現金・預金		1,039,584
有価証券		6,516,182
前払費用		388,146
未収委託者報酬		1,933,274
未収運用受託報酬		1,482,202
未収投資助言報酬		180,423
繰延税金資産		235,931
その他		42,368
流動資産合計		11,818,113

固定資産

有形固定資産	1	222,797
無形固定資産		1,070,936
投資その他の資産		
投資有価証券		29,773,352
関係会社株式		66,222
差入保証金		284,888
繰延税金資産		207,304
その他		17
投資その他の資産合計		30,331,785

固定資産合計 31,625,520

資産合計 43,443,634

負債の部

流動負債

預り金		29,713
未払償還金		143,917
未払手数料		769,667
未払運用委託報酬		583,578
未払投資助言報酬		270,956
その他未払金		135,155
未払費用		87,802
未払法人税等		583,441

前受運用受託報酬	23
前受投資助言報酬	70,261
賞与引当金	426,613
その他	105,966
流動負債合計	3,207,097
固定負債	
退職給付引当金	1,024,873
役員退職慰労引当金	16,300
固定負債合計	1,041,173
負債合計	4,248,270
純資産の部	
株主資本	
資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840
利益剰余金	
利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	19,168,379
利益剰余金合計	19,848,186
株主資本合計	38,130,026
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,065,336
評価・換算差額等合計	1,065,336
純資産合計	39,195,363
負債・純資産合計	43,443,634

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第19期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	6,054,540
運用受託報酬	3,127,116
投資助言報酬	386,556

業務受託料		23,614
営業収益計		9,591,829
営業費用		4,773,795
一般管理費	1	3,333,810
営業利益		1,484,223
営業外収益	2	101,186
営業外費用	3	3,584
経常利益		1,581,825
特別利益	4	103,675
特別損失	5	6,903
税引前中間純利益		1,678,597
法人税、住民税及び事業税		557,717
法人税等調整額		89,547
法人税等合計		647,265
中間純利益		1,031,331

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第19期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
株主資本	
資本金	
当期首残高	10,000,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840
資本剰余金合計	
当期首残高	8,281,840
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	8,281,840

利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	139,807
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
当期首残高	120,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	120,000
研究開発積立金	
当期首残高	70,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	70,000
別途積立金	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	18,272,607
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	1,031,331
当中間期変動額合計	895,771
当中間期末残高	19,168,379
利益剰余金合計	
当期首残高	18,952,414
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	1,031,331
当中間期変動額合計	895,771
当中間期末残高	19,848,186

株主資本合計	
当期首残高	37,234,254
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	1,031,331
当中間期変動額合計	895,771
当中間期末残高	38,130,026
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	846,135
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	219,201
当中間期変動額合計	219,201
当中間期末残高	1,065,336
評価・換算差額等合計	
当期首残高	846,135
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	219,201
当中間期変動額合計	219,201
当中間期末残高	1,065,336
純資産合計	
当期首残高	38,080,390
当中間期変動額	
剰余金の配当	135,560
中間純利益	1,031,331
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	219,201
当中間期変動額合計	1,114,973
当中間期末残高	39,195,363

（重要な会計方針）

項目	第19期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。

	<p>その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額（簡便法により自己都合退職による中間会計期間末要支給額の100%）を計上しております。 なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．リース取引の処理方法	<p>平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>
6．消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。なお、仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。</p>

(注記事項)

[中間貸借対照表関係]

第19期中間会計期間末
(平成25年9月30日現在)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

868,286千円

[中間損益計算書関係]

第19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1. 減価償却の実施額	
有形固定資産	31,169千円
無形固定資産	215,065千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	40,265千円
有価証券利息	38,819千円
為替差益	20,176千円
受取利息	82千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	3,395千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	102,298千円
投資有価証券売却益	1,377千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	6,903千円

[中間株主資本等変動計算書関係]

第19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)				
1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項				
	前事業年度末 株式数(千株)	当中間会計期間増加 株式数(千株)	当中間会計期間減少 株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成25年6月24日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成25年3月31日	平成25年6月24日

[リース取引関係]

第19期中間会計期間
(自 平成25年4月1日
至 平成25年9月30日)

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間会計期間末残高相当額

	取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	中間 会計期間末残高 相当額
有形固定資産 (器具備品)	千円 862	千円 675	千円 186

未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1年内	183千円
1年超	15千円
合計	198千円

当中間会計期間の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料	93千円
減価償却費相当額	86千円
支払利息相当額	4千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

2. オペレーティング・リース取引

該当取引はありません。

[金融商品関係]

第19期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日（中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,039,584	1,039,584	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,016,432	4,023,430	6,997
その他有価証券	2,499,750	2,499,750	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,567,200	22,631,520	64,319
その他有価証券	7,138,652	7,138,652	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

これらの時価は、中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価は、中間決算日の市場価格等によっております。

（注2）非上場株式（中間貸借対照表計上額67,500千円）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ことから、上表の「投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式(中間貸借対照表計上額66,222千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

[有価証券関係]

第19期中間会計期間末(平成25年9月30日現在)

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	23,585,186	23,663,320	78,133
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	23,585,186	23,663,320	78,133
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	2,998,446	2,991,630	6,816
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	2,998,446	2,991,630	6,816
合計		26,583,632	26,654,950	71,317

2. その他有価証券

	種類	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	2,499,429	2,499,750	321
	国債・地方債等	2,499,429	2,499,750	321
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	3,846,150	5,443,586	1,597,436
	小計	6,345,579	7,943,336	1,597,757
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	1,744,700	1,695,065	49,634
	小計	1,744,700	1,695,065	49,634
合計		8,090,279	9,638,402	1,548,123

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 非上場株式(中間貸借対照表計上額67,500千円)については、市場価格がなく、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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式(中間貸借対照表計上額66,222千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載していません。

[デリバティブ取引関係]

第19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位:千円)

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	1,937,710

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第19期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

該当事項はありません。

[1株当たり情報]

	第19期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
1株当たり純資産額	361,420円80銭
1株当たり中間純利益	9,509円92銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益	1,031,331千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,031,331千円
期中平均株式数	108千株

[重要な後発事象]

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成25年9月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

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

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成25年9月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

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

(2) 販売会社

(平成25年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
株式会社八十二銀行	52,243百万円	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,250,000百万円	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

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

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

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。

- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せや、資料のご請求などを委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
コールセンター 0120-762-506
（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）
ホームページ <http://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成25年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

-
- 1．上記は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（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
 - 2．XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年4月16日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成25年2月22日から平成26年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成26年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- 1．上記は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（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
 - 2．X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年4月16日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成25年2月22日から平成26年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成26年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- 1．上記は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（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
 - 2．X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年4月16日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の平成25年2月22日から平成26年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の平成26年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- 1．上記は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（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
 - 2．X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成25年11月22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25年4月1日から平成26年3月31日までの第19期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

1．上記は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（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。