

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成27年5月21日提出

【計算期間】 第12期（自 平成26年2月22日 至 平成27年2月23日）

【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）
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）

【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

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号

【電話番号】 03 - 5533 - 4608

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【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】

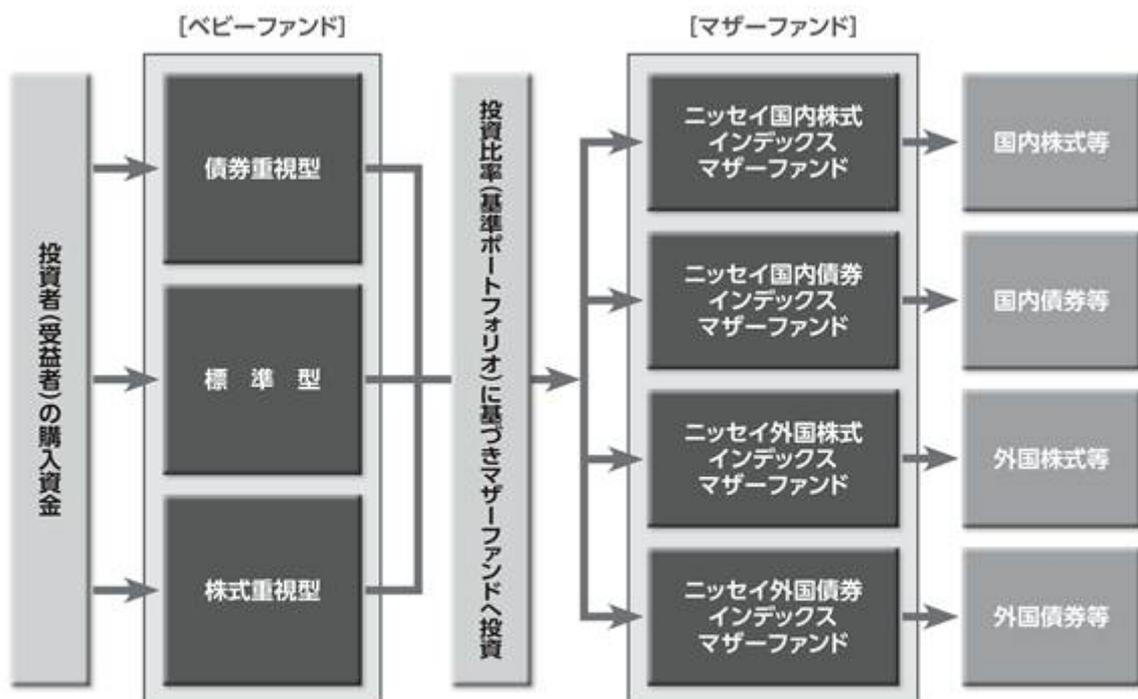
基本方針

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。

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(配当込み)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・インデックス（配当込み、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、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）⁴の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

- 1 TOPIX（東証株価指数）とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株価指数で、東証1部に上場されているすべての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します。TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行うことができます。
- 2 NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。
- 3 MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース）とは、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く世界の主要先進国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。
- 4 シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、Citigroup Index LLC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。シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLC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 追 加 型	国 内 海 外 内 外	株 式 債 券 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)		
	年1回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回 年4回 年6回 (隔月)	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。

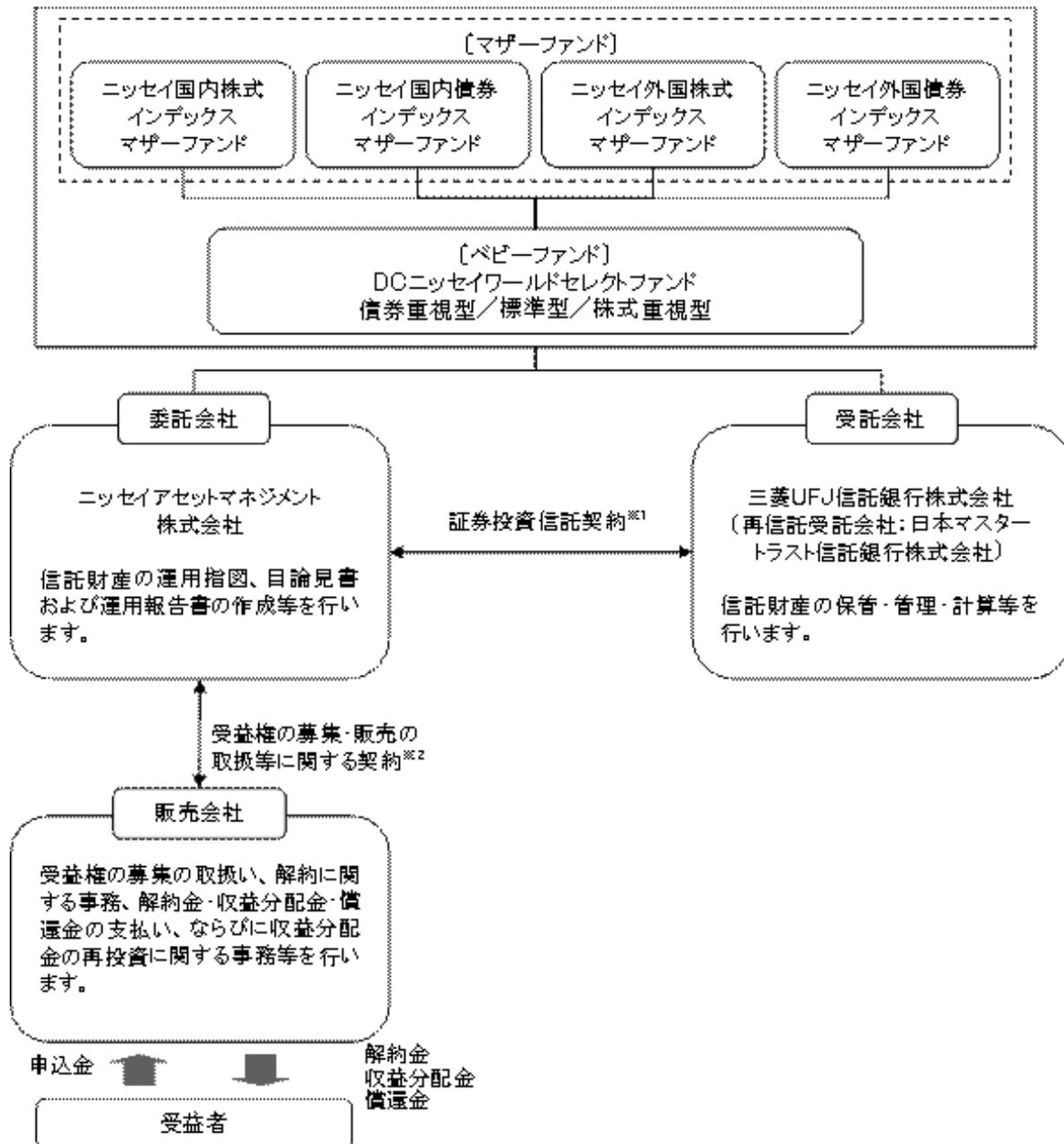
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、
一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

(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対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

委託会社の概況（平成27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・一部解約等にもなう資金フローの影響により、一時的に上記の配分から乖離する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、国内の株式市場の動きをとらえることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所上場株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

国内の証券取引所上場株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)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。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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、

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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・インデックス(配当込み、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・インデックス(配当込み、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。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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、シティ世界国債インデックス(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、シティ世界国債インデックス(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。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

(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.およびニ.に掲げるものに該当するものを除きます)

ニ. 約束手形(イ.に掲げるものを除きます)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券

主にニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」、「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます）のほか、次の1．から22．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます）に投資します。

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます）の新株引受権証券を除きます）
- 6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます）
- 9．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1．から11．の証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます）
- 14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます）
- 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます）
- 16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。有価証券にかかるものに限りません）
- 17．預託証券（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券
- 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

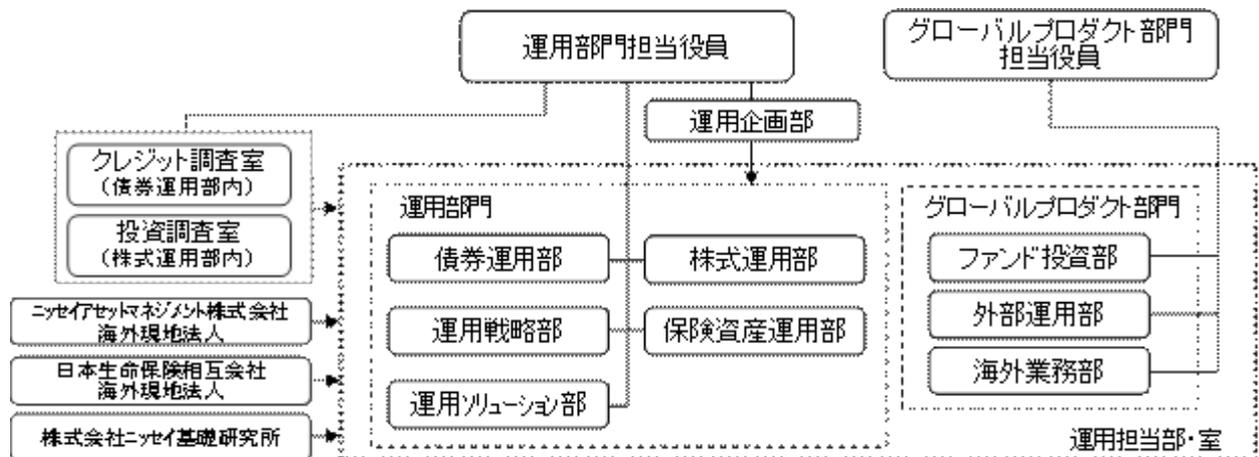
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

- 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。

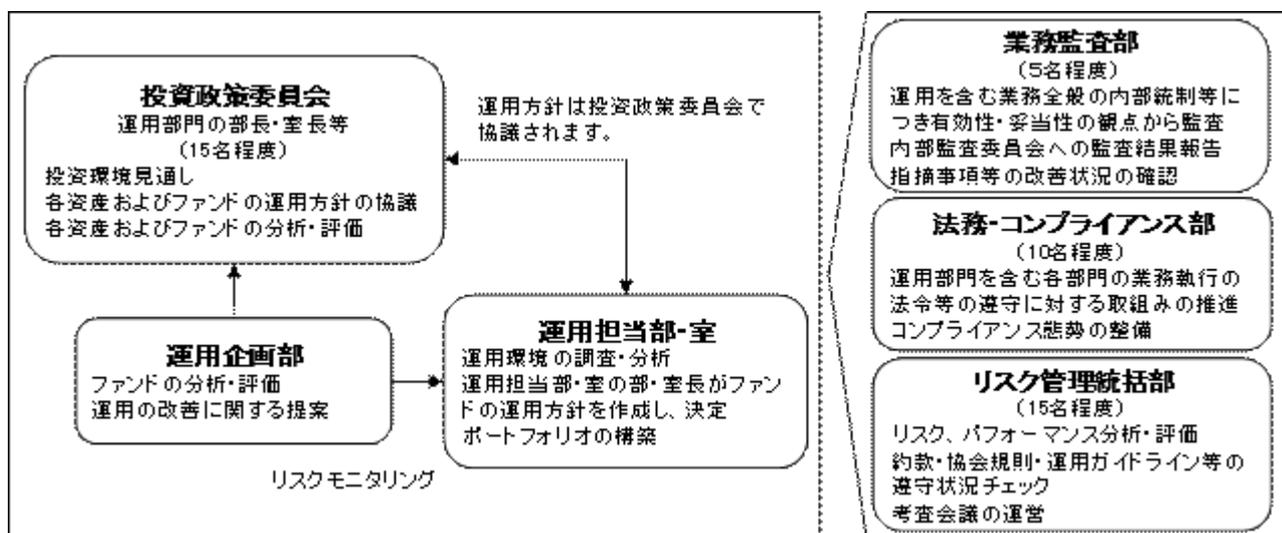
（3）【運用体制】

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。

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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ます。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。

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

信用取引の範囲

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

2. 前記1.の信用取引は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

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な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表

示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます)を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

信用リスク集中回避(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)

信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます)を適正に管理する方法とあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行う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。

・収益分配金に関する留意点

収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

収益分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

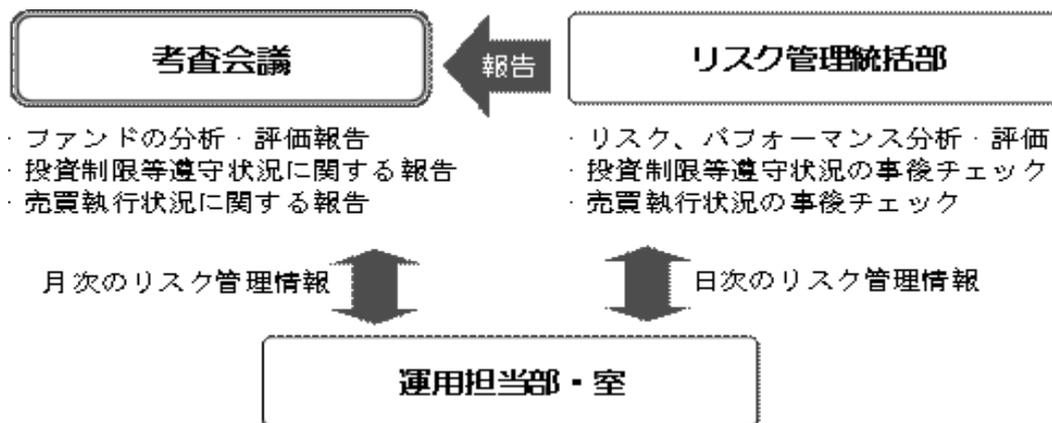
・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は平成27年1月末現在、ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックス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34.6%保有しています。当該保有分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。

(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。

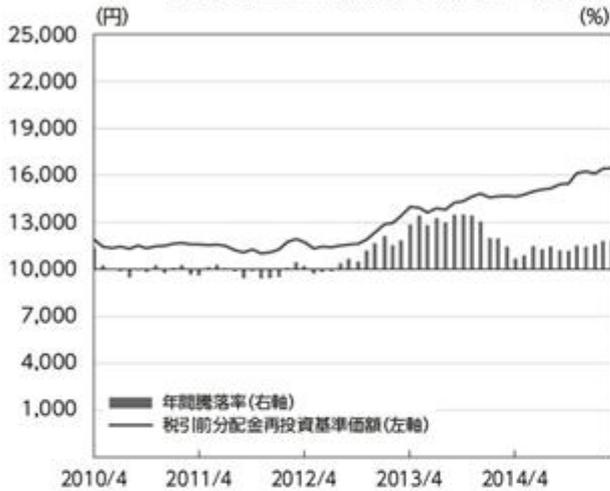
上記投資リスク管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

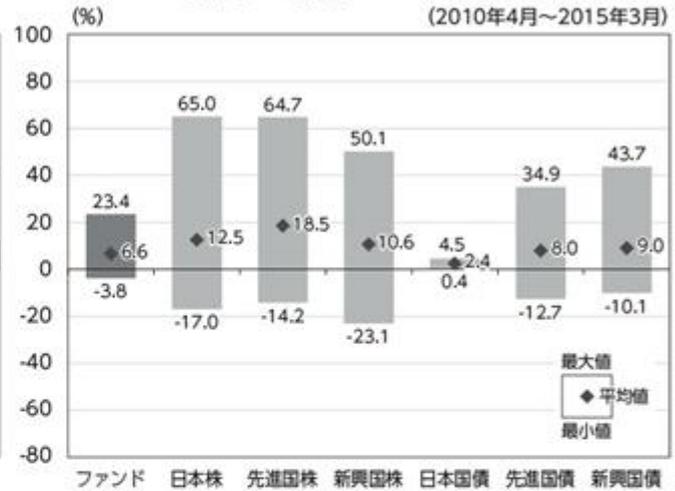
投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

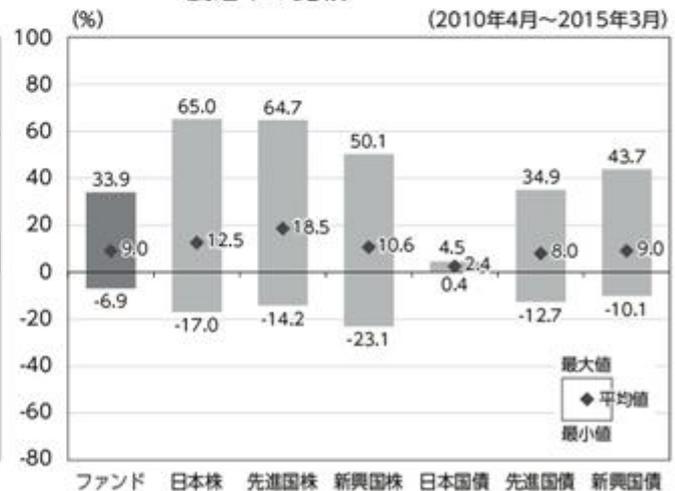


DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

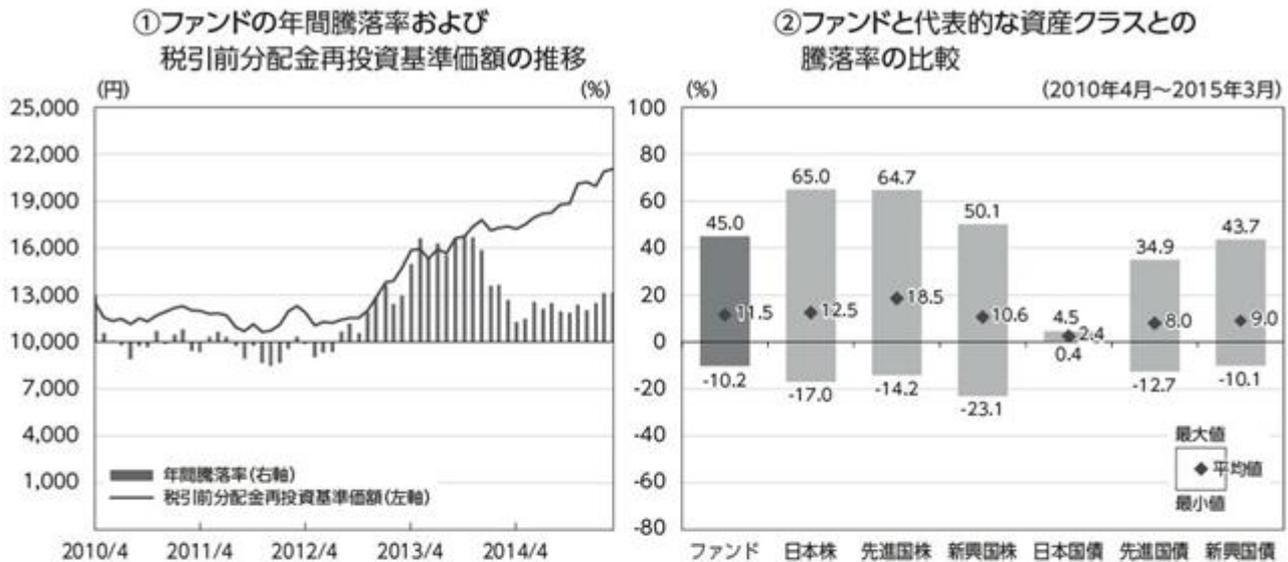
①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)



- ・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります。ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。
- ・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間ににおけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株・・・TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債・・・NOMURA-BPI 国債
- 先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

■ 前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

- ・TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。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。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。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。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、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、一切責任を負いません。
- ・シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

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 0.01080%（税抜0.010%）

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。

<ご参考>

「4 手数料等及び税金」の「(1) 申込手数料」から「(4) その他の手数料等」までに記載の主な手数料において、当該手数料を対価とする役務の内容・收受先等は次の通りです。

申込手数料	投資者のファンドの取得時に、販売会社からの商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売会社における当該取得にかかる事務手続き等の対価として販売会社が收受
-------	--

信託報酬のうち 「委託会社」の報酬	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価として委託会社が収受
信託報酬のうち 「販売会社」の報酬	投資者（受益者）へのファンド購入後の情報提供・運用報告書等各種書類の送付、また口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価として販売会社が収受
信託報酬のうち 「受託会社」の報酬	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価として受託会社が収受
証券取引の手数料	有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
監査費用	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
借入金の利息	受託会社等から一時的に資金を借入れた場合に発生する利息

（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27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	3,811,804,554	95.02
内 日本	3,811,804,554	95.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	199,703,888	4.98
純資産総額	4,011,508,442	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27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	12,945,723,955	95.03
内 日本	12,945,723,955	95.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	677,296,902	4.97
純資産総額	13,623,020,857	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27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	7,505,770,535	95.03
内 日本	7,505,770,535	95.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	392,279,242	4.97
純資産総額	7,898,049,777	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27年3月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	42,803,299,300	98.03
内 日本	42,803,299,300	98.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	861,880,920	1.97
純資産総額	43,665,180,220	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）	864,360,000	1.98
内 日本	864,360,000	1.98

（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27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	33,629,422,509	99.60
内 日本	33,629,422,509	99.60
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	134,714,723	0.40
純資産総額	33,764,137,232	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27年3月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	48,114,115,888	94.21
内 アメリカ	28,630,794,751	56.06
内 イギリス	3,849,765,113	7.54
内 スイス	2,085,553,683	4.08
内 ドイツ	1,978,074,328	3.87
内 カナダ	1,932,596,468	3.78
内 フランス	1,888,893,944	3.70
内 オーストラリア	1,371,600,974	2.69
内 オランダ	1,006,199,456	1.97
内 アイルランド	840,322,601	1.65
内 スペイン	731,705,140	1.43
内 スウェーデン	658,971,500	1.29
内 香港	595,162,168	1.17
内 イタリア	442,413,034	0.87
内 デンマーク	352,063,062	0.69
内 シンガポール	324,141,198	0.63
内 ベルギー	274,610,416	0.54
内 ジャージー	199,433,886	0.39

内	フィンランド	181,959,768	0.36
内	オランダ領キュラソー	174,085,837	0.34
内	ノルウェー	127,869,853	0.25
内	バミューダ	124,044,736	0.24
内	イスラエル	121,118,730	0.24
内	ルクセンブルグ	49,762,332	0.10
内	オーストリア	37,985,340	0.07
内	ポルトガル	30,489,030	0.06
内	ケイマン諸島	30,309,594	0.06
内	ニュージーランド	29,147,331	0.06
内	イギリス領バージン諸島	21,856,964	0.04
内	ガーンジー	13,717,572	0.03
内	マン島	6,214,515	0.01
内	モーリシャス	3,252,564	0.01
投資証券		1,178,757,113	2.31
内	アメリカ	864,798,157	1.69
内	オーストラリア	121,359,209	0.24
内	フランス	71,786,207	0.14
内	イギリス	69,040,753	0.14
内	香港	22,968,024	0.04
内	シンガポール	20,116,747	0.04
内	カナダ	8,688,016	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,779,482,617	3.48
純資産総額		51,072,355,618	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）	1,658,403,995	3.25
内 アメリカ	1,109,887,115	2.17
内 ドイツ	548,516,880	1.07

（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27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	10,368,562,062	98.70

内 アメリカ	4,350,022,765	41.41
内 イタリア	1,023,285,571	9.74
内 フランス	991,610,020	9.44
内 イギリス	859,569,325	8.18
内 ドイツ	825,413,459	7.86
内 スペイン	550,363,757	5.24
内 ベルギー	274,457,279	2.61
内 オランダ	269,698,529	2.57
内 カナダ	229,734,207	2.19
内 オーストラリア	177,958,799	1.69
内 オーストリア	164,929,288	1.57
内 メキシコ	108,653,177	1.03
内 アイルランド	87,039,997	0.83
内 デンマーク	70,070,955	0.67
内 フィンランド	65,746,243	0.63
内 ポーランド	59,790,733	0.57
内 南アフリカ	55,536,972	0.53
内 マレーシア	53,117,137	0.51
内 スウェーデン	50,155,675	0.48
内 シンガポール	39,682,746	0.38
内 スイス	35,528,553	0.34
内 ノルウェー	26,196,875	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	136,542,535	1.30
純資産総額	10,505,104,597	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27年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	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	1,397,095,515	1.2839 1,793,747,115	1.2883 1,799,878,151	- -	44.87%
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	538,850,796	1.4501 781,420,440	1.5006 808,599,504	- -	20.16%

3	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	580,724,575	1.3846	1.3831	-	20.02%
				804,125,493	803,200,159	-	
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	275,664,306	1.4475	1.4515	-	9.97%
				399,032,111	400,126,740	-	

(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	95.02
	小計		95.02
合計(対純資産総額比)			95.02

(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27年3月31日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	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	2,742,297,478	1.4500	1.5006	-	30.21%
				3,976,569,874	4,115,091,595	-	
2	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	3,160,158,238	1.2839	1.2883	-	29.88%
				4,057,360,663	4,071,231,858	-	
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	1,870,818,706	1.4474	1.4515	-	19.93%
				2,707,933,703	2,715,493,351	-	
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	1,477,772,505	1.3846	1.3831	-	15.00%
				2,046,143,244	2,043,907,151	-	

(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	95.03
	小計		95.03
合 計（対純資産総額比）			95.03

（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27年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	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	2,117,890,448	1.4504 3,071,970,669	1.5006 3,178,106,406	- -	40.24%
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	1,625,479,634	1.4473 2,352,683,438	1.4515 2,359,383,688	- -	29.87%
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	915,208,752	1.2838 1,175,034,234	1.2883 1,179,063,435	- -	14.93%
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	570,614,566	1.3844 790,003,925	1.3831 789,217,006	- -	9.99%

（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	95.03
	小計		95.03
合 計（対純資産総額比）			95.03

（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27年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	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	261,800	8,078.00 2,114,820,400	8,383.00 2,194,669,400	- -	5.03%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,502,700	765.50 1,150,316,850	743.70 1,117,557,990	- -	2.56%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	99,000	7,019.00 694,881,000	6,980.00 691,020,000	- -	1.58%
4	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	170,800	3,964.50 677,136,600	3,903.00 666,632,400	- -	1.53%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	141,600	4,672.50 661,626,000	4,601.50 651,572,400	- -	1.49%
6	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,595,300	217.00 563,180,100	211.10 547,867,830	- -	1.25%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	73,300	7,270.00 532,891,000	7,397.00 542,200,100	- -	1.24%
8	ファナック 日本	株式 電気機器	19,800	23,285.00 461,043,000	26,250.00 519,750,000	- -	1.19%
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	190,200	2,715.00 516,393,000	2,720.50 517,439,100	- -	1.19%
10	キヤノン 日本	株式 電気機器	110,000	3,832.50 421,575,000	4,248.00 467,280,000	- -	1.07%
11	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	117,800	3,712.50 437,332,500	3,800.50 447,698,900	- -	1.03%
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	74,500	6,052.00 450,874,000	5,999.00 446,925,500	- -	1.02%

13	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	226,300	1,863.50 421,710,050	1,967.50 445,245,250	- -	1.02%
14	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	78,300	4,557.00 356,813,100	5,053.00 395,649,900	- -	0.91%
15	ソニー 日本	株式 電気機器	124,000	3,201.00 396,924,000	3,190.00 395,560,000	- -	0.91%
16	三菱地所 日本	株式 不動産業	139,000	2,713.00 377,107,000	2,787.00 387,393,000	- -	0.89%
17	日立製作所 日本	株式 電気機器	456,000	831.80 379,300,800	823.20 375,379,200	- -	0.86%
18	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	17,000	22,470.00 381,990,000	21,745.00 369,665,000	- -	0.85%
19	パナソニック 日本	株式 電気機器	231,200	1,458.00 337,089,600	1,577.00 364,602,400	- -	0.83%
20	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	77,100	4,263.00 328,677,300	4,538.50 349,918,350	- -	0.80%
21	三井不動産 日本	株式 不動産業	99,000	3,375.00 334,125,000	3,529.50 349,420,500	- -	0.80%
22	三菱商事 日本	株式 卸売業	143,500	2,347.00 336,794,500	2,420.50 347,341,750	- -	0.80%
23	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	34,800	10,050.00 349,740,000	9,640.00 335,472,000	- -	0.77%
24	村田製作所 日本	株式 電気機器	19,900	13,650.00 271,635,000	16,535.00 329,046,500	- -	0.75%
25	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	266,400	1,206.00 321,278,400	1,224.00 326,073,600	- -	0.75%
26	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	154,300	2,100.50 324,107,150	2,085.50 321,792,650	- -	0.74%
27	花王 日本	株式 化学	53,500	5,150.00 275,525,000	6,000.00 321,000,000	- -	0.74%
28	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	62,300	4,659.00 290,255,700	4,816.00 300,036,800	- -	0.69%
29	キーエンス 日本	株式 電気機器	4,300	60,300.00 259,290,000	65,600.00 282,080,000	- -	0.65%
30	信越化学工業 日本	株式 化学	35,600	8,231.00 293,023,600	7,850.00 279,460,000	- -	0.64%

（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	12.88
		輸送用機器	11.50
		銀行業	8.70
		情報・通信業	6.55
		化学	6.03
		医薬品	4.94
		機械	4.90
		小売業	4.30
		食料品	4.10
		陸運業	4.00
		卸売業	3.93
		サービス業	3.11
		不動産業	2.97
		建設業	2.49
		保険業	2.44
		電気・ガス業	1.95
		その他製品	1.45
		鉄鋼	1.44
		精密機器	1.43
		証券、商品先物取引業	1.32
		その他金融業	1.25
		ゴム製品	0.93
		ガラス・土石製品	0.90
		非鉄金属	0.88
		繊維製品	0.74
		金属製品	0.65
		空運業	0.59
		石油・石炭製品	0.44
		鉱業	0.39
	海運業	0.30	
パルプ・紙	0.22		
倉庫・運輸関連業	0.21		
水産・農林業	0.07		
	小計	98.03	
合 計（対純資産総額比）		98.03	

（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 2706月	買建	56	874,449,240	864,360,000	1.98%

(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27年3月31日現在)

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	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26回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	2,132,000,000	120.84 2,576,340,240	122.67 2,615,345,720	2.400000 2037/3/20	7.75%
2	第113回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	2,528,000,000	100.91 2,551,228,800	100.77 2,547,465,600	0.300000 2018/6/20	7.54%
3	第125回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	2,103,000,000	119.33 2,509,680,220	120.58 2,535,944,610	2.200000 2031/3/20	7.51%
4	第318回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	2,399,000,000	105.80 2,538,321,220	105.44 2,529,625,550	1.000000 2021/9/20	7.49%
5	第117回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	2,126,000,000	118.11 2,511,134,990	118.96 2,529,153,380	2.100000 2030/3/20	7.49%
6	第72回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	2,168,000,000	116.25 2,520,439,150	116.25 2,520,321,680	2.100000 2024/9/20	7.46%
7	第292回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	2,387,000,000	105.06 2,507,821,750	104.88 2,503,557,210	1.700000 2018/3/20	7.41%
8	第325回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	2,138,000,000	104.72 2,239,008,380	104.30 2,229,934,000	0.800000 2022/9/20	6.60%
9	第116回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	1,967,000,000	100.61 1,979,168,330	100.44 1,975,733,480	0.200000 2018/12/20	5.85%
10	第338回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	1,485,000,000	100.09 1,486,407,510	100.09 1,486,407,510	0.100000 2016/3/15	4.40%

11	第291回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	1,290,000,000	103.83 1,339,532,060	103.69 1,337,717,100	1.300000 2018/3/20	3.96%
12	第96回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	1,292,000,000	100.48 1,298,202,459	100.48 1,298,202,459	0.500000 2016/3/20	3.84%
13	第28回 利付国債 (30年) 日本	国債証券	1,021,000,000	123.35 1,259,491,230	125.09 1,277,199,530	2.500000 2038/3/20	3.78%
14	第313回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	1,134,000,000	107.19 1,215,615,870	106.82 1,211,440,860	1.300000 2021/3/20	3.59%
15	第84回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	1,018,000,000	116.58 1,186,799,720	116.26 1,183,567,520	2.000000 2025/12/20	3.51%
16	第303回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	726,000,000	105.90 768,902,560	105.73 767,643,360	1.400000 2019/9/20	2.27%
17	第4回 利付国債(4 0年) 日本	国債証券	460,000,000	118.06 543,110,750	122.05 561,453,000	2.200000 2051/3/20	1.66%
18	第285回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	313,000,000	103.44 323,767,660	103.26 323,228,840	1.700000 2017/3/20	0.96%
19	第320回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	280,000,000	105.73 296,058,880	105.61 295,730,400	1.000000 2021/12/20	0.88%
20	第123回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	230,000,000	118.89 273,460,450	119.06 273,849,500	2.100000 2030/12/20	0.81%
21	第146回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	232,000,000	110.85 257,187,890	111.25 258,120,880	1.700000 2033/9/20	0.76%
22	第69回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	195,000,000	115.67 225,575,020	115.61 225,443,400	2.100000 2024/3/20	0.67%
23	第107回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	221,000,000	100.45 221,994,500	100.40 221,899,470	0.200000 2017/12/20	0.66%
24	第287回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	205,000,000	104.32 213,874,030	104.10 213,419,350	1.900000 2017/6/20	0.63%
25	第321回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	168,000,000	105.79 177,727,650	105.74 177,658,320	1.000000 2022/3/20	0.53%

26	第340回 利付国債 (2年) 日本	国債証券	128,000,000	100.10 128,140,470	100.07 128,099,840	0.100000 2016/5/15	0.38%
27	第312回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	112,000,000	106.32 119,085,690	106.01 118,733,440	1.200000 2020/12/20	0.35%
28	第54回 利付国債 (20年) 日本	国債証券	90,000,000	113.86 102,482,120	113.63 102,270,600	2.200000 2021/12/20	0.30%
29	第330回 利付国債 (10年) 日本	国債証券	67,000,000	104.22 69,827,520	104.25 69,852,860	0.800000 2023/9/20	0.21%
30	第106回 利付国債 (5年) 日本	国債証券	66,000,000	100.42 66,277,560	100.38 66,252,120	0.200000 2017/9/20	0.20%

(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	99.60
	小計		99.60
合 計 (対純資産総額比)			99.60

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各種類及び各業種の評価金額の比率であります。

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27年3月31日現在)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口 数 又は額面 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	78,162	13,864.18 1,083,652,369	15,185.88 1,186,958,979	- -	2.32%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	56,418	11,366.88 641,296,752	10,290.15 580,550,083	- -	1.14%

3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	104,355	5,730.92 598,050,284	4,922.16 513,652,340	- -	1.01%
4	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	37,302	12,964.58 483,605,018	12,203.26 455,206,135	- -	0.89%
5	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	65,665	6,427.32 422,050,059	6,581.71 432,188,046	- -	0.85%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	133,761	3,200.60 428,115,696	3,018.67 403,780,371	- -	0.79%
7	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	42,965	8,958.81 384,915,350	9,239.66 396,982,421	- -	0.78%
8	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	30,655	11,451.06 351,032,472	12,176.45 373,269,197	- -	0.73%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	49,782	7,267.08 361,769,993	7,325.56 364,681,187	- -	0.71%
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	35,957	10,628.69 382,175,955	9,940.46 357,429,206	- -	0.70%
11	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	83,955	3,711.57 311,605,383	4,205.94 353,110,532	- -	0.69%
12	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	55,342	6,028.35 333,621,409	5,902.75 326,670,012	- -	0.64%
13	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	25,174	13,806.87 347,574,190	12,846.17 323,389,559	- -	0.63%
14	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	9,361	35,479.97 332,128,061	32,976.59 308,693,952	- -	0.60%
15	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	21,518	10,987.27 236,424,147	12,752.44 274,407,012	- -	0.54%
16	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	69,178	4,219.06 291,866,361	3,962.00 274,083,574	- -	0.54%
17	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	15,357	17,543.60 269,417,116	17,542.41 269,398,891	- -	0.53%
18	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	26,671	8,923.63 238,002,218	9,997.54 266,644,472	- -	0.52%

19	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	37,996	7,179.78 272,803,108	7,010.71 266,379,233	- -	0.52%
20	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	254,930	1,118.26 285,079,001	1,038.68 264,791,281	- -	0.52%
21	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	139,870	2,029.74 283,900,405	1,865.03 260,862,921	- -	0.51%
22	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	3,876	64,606.88 250,416,290	66,337.44 257,123,937	- -	0.50%
23	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	52,423	5,278.32 276,705,702	4,868.08 255,199,709	- -	0.50%
24	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	3,759	65,789.10 247,301,241	67,431.59 253,475,357	- -	0.50%
25	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	40,313	6,405.45 258,223,057	6,205.57 250,165,498	- -	0.49%
26	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	47,224	4,965.27 234,480,330	5,220.18 246,518,006	- -	0.48%
27	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	12,522	19,351.01 242,313,356	19,548.05 244,780,730	- -	0.48%
28	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	64,432	4,126.56 265,882,664	3,780.54 243,588,281	- -	0.48%
29	GILEAD SCIENCES 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	20,103	12,301.75 247,302,202	12,099.91 243,244,637	- -	0.48%
30	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	17,565	11,840.56 207,979,537	13,775.08 241,959,404	- -	0.47%

(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	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.07
		銀行	9.08
		エネルギー	7.79
		資本財	6.89
		ソフトウェア・サービス	6.88
		食品・飲料・タバコ	5.97

	素材	4.83	
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.44	
	保険	4.14	
	各種金融	3.91	
	ヘルスケア機器・サービス	3.51	
	小売	3.39	
	メディア	3.10	
	公益事業	3.10	
	電気通信サービス	2.93	
	食品・生活必需品小売り	2.17	
	運輸	1.94	
	自動車・自動車部品	1.79	
	半導体・半導体製造装置	1.74	
	家庭用品・パーソナル用品	1.70	
	消費者サービス	1.63	
	耐久消費財・アパレル	1.63	
	商業・専門サービス	0.86	
	不動産	0.70	
	小計	94.21	
投資証券	外国	投資証券	2.31
	小計		2.31
合計(対純資産総額比)			96.52

(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 EMINI FUTURE 201506	買建	89	1,106,806,557	1,109,887,115	2.17%
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 201506	買建	115	543,309,292	548,516,880	1.07%

(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27年3月31日現在）

	銘柄名 地域	種類	株数、口数 又は額面金額	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	278,794,400	101.73 283,631,721	101.43 282,800,675	1.500000 2016/7/31	2.69%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	264,374,000	100.92 266,822,419	100.82 266,563,016	1.000000 2016/10/31	2.54%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	234,331,500	105.33 246,835,475	104.67 245,277,124	3.125000 2017/1/31	2.33%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	217,507,700	109.08 237,274,476	108.13 235,212,826	4.500000 2017/5/15	2.24%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	198,280,500	104.05 206,321,470	103.85 205,932,144	2.375000 2017/7/31	1.96%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	187,465,200	102.79 192,712,222	102.75 192,633,615	1.875000 2017/10/31	1.83%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	149,010,800	103.31 153,946,037	102.49 152,724,149	2.625000 2016/4/30	1.45%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	136,993,800	97.19 133,145,231	98.18 134,510,102	0.875000 2019/7/31	1.28%
9	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	125,107,200	107.71 134,762,608	107.04 133,927,257	3.750000 2017/1/4	1.27%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	122,573,400	107.20 131,408,706	107.38 131,631,574	3.125000 2019/5/15	1.25%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	132,187,000	98.74 130,521,868	99.53 131,577,617	1.250000 2019/10/31	1.25%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	120,170,000	103.31 124,153,563	104.98 126,159,272	2.500000 2023/8/15	1.20%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	126,178,500	98.90 124,790,739	99.92 126,088,913	1.375000 2020/1/31	1.20%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	110,556,400	107.93 119,334,056	111.73 123,529,087	3.125000 2044/8/15	1.18%
15	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	114,681,600	107.30 123,055,885	107.02 122,743,716	4.000000 2017/2/1	1.17%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	112,959,800	107.39 121,308,854	108.61 122,693,545	3.125000 2021/5/15	1.17%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	115,363,200	102.72 118,507,082	104.75 120,851,027	2.500000 2024/5/15	1.15%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	111,758,100	105.47 117,871,352	105.78 118,227,776	2.750000 2019/2/15	1.13%

19	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	108,165,600	108.81 117,697,426	108.12 116,959,463	3.750000 2017/4/25	1.11%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	112,959,800	102.10 115,338,396	103.42 116,833,191	2.250000 2021/7/31	1.11%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	108,153,000	107.72 116,512,133	107.36 116,120,631	3.500000 2018/2/15	1.11%
22	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	97,740,000	117.83 115,168,549	117.42 114,768,262	4.250000 2019/4/25	1.09%
23	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券	96,436,800	116.06 111,928,094	117.23 113,055,753	4.300000 2019/10/31	1.08%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	109,354,700	101.03 110,482,907	101.82 111,353,703	2.000000 2021/11/15	1.06%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	99,741,100	110.13 109,848,080	109.88 109,597,515	4.000000 2018/8/15	1.04%
26	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	84,708,000	122.80 104,022,440	128.46 108,820,979	4.750000 2023/8/1	1.04%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	98,539,400	109.30 107,706,106	109.30 107,707,505	3.750000 2018/11/15	1.03%
28	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券	93,830,400	112.41 105,483,040	111.73 104,843,274	4.000000 2018/1/4	1.00%
29	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	87,314,400	114.43 99,922,351	117.51 102,610,136	3.750000 2021/8/1	0.98%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	84,119,000	114.22 96,089,088	121.84 102,493,113	3.625000 2043/8/15	0.98%

(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	98.70
	小計		98.70
合 計 (対純資産総額比)			98.70

(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27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
第12計算期間末 (平成27年2月23日)	3,980,051,806	3,980,051,806	1.6341	1.6341
平成26年3月末日	3,412,186,126	-	1.4700	-
4月末日	3,379,486,878	-	1.4641	-
5月末日	3,478,801,496	-	1.4766	-
6月末日	3,520,514,074	-	1.4967	-
7月末日	3,576,979,536	-	1.5089	-
8月末日	3,603,040,253	-	1.5152	-
9月末日	3,686,165,886	-	1.5423	-
10月末日	3,722,272,721	-	1.5478	-
11月末日	3,857,432,449	-	1.6135	-
12月末日	3,929,081,042	-	1.6259	-
平成27年1月末日	3,936,226,695	-	1.6116	-
2月末日	3,998,493,912	-	1.6426	-

3月末日	4,011,508,442	-	1.6482	-
------	---------------	---	--------	---

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第12計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第12計算期間	11.4

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額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。

「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27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
第12計算期間末 (平成27年2月23日)	13,482,628,252	13,482,628,252	1.8574	1.8574
平成26年3月末日	11,347,923,921	-	1.6122	-
4月末日	11,275,603,299	-	1.6016	-
5月末日	11,623,544,912	-	1.6221	-
6月末日	11,801,790,187	-	1.6535	-
7月末日	12,035,486,117	-	1.6717	-
8月末日	12,031,862,082	-	1.6776	-
9月末日	12,366,740,250	-	1.7175	-
10月末日	12,499,741,858	-	1.7226	-
11月末日	13,049,988,381	-	1.8172	-
12月末日	13,150,345,158	-	1.8294	-
平成27年1月末日	13,156,141,553	-	1.8092	-
2月末日	13,554,733,764	-	1.8695	-
3月末日	13,623,020,857	-	1.8796	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
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
第12計算期間	0.0000

収益率の推移

	収益率(%)
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
第12計算期間	15.4

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額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。

「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27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
第12計算期間末 (平成27年2月23日)	7,804,670,283	7,804,670,283	2.0739	2.0739
平成26年3月末日	6,445,958,619	-	1.7386	-
4月末日	6,408,969,403	-	1.7226	-
5月末日	6,631,791,568	-	1.7519	-
6月末日	6,802,127,841	-	1.7960	-
7月末日	6,946,985,529	-	1.8207	-
8月末日	6,925,447,964	-	1.8260	-
9月末日	7,131,862,304	-	1.8801	-
10月末日	7,190,267,063	-	1.8841	-
11月末日	7,546,274,856	-	2.0108	-
12月末日	7,565,528,160	-	2.0225	-
平成27年1月末日	7,542,966,262	-	1.9954	-
2月末日	7,825,940,079	-	2.0900	-
3月末日	7,898,049,777	-	2.1057	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
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
第12計算期間	0.0000

収益率の推移

	収益率(%)
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
第12計算期間	19.5

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配落の額)に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額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。

(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
第12計算期間	400,729,347	272,919,476	2,435,551,135

(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
第12計算期間	937,661,500	689,801,801	7,258,743,523

(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
第12計算期間	620,216,297	574,658,447	3,763,295,471

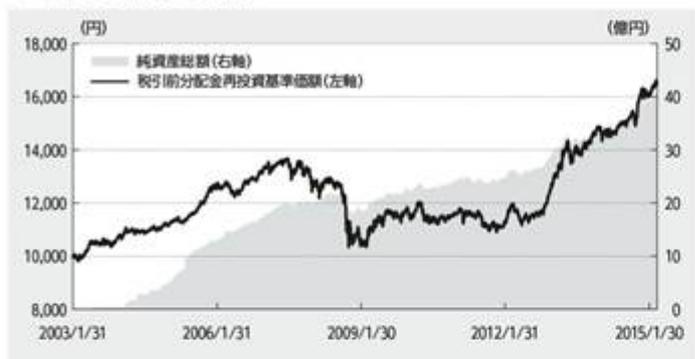
(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2015年3月末現在

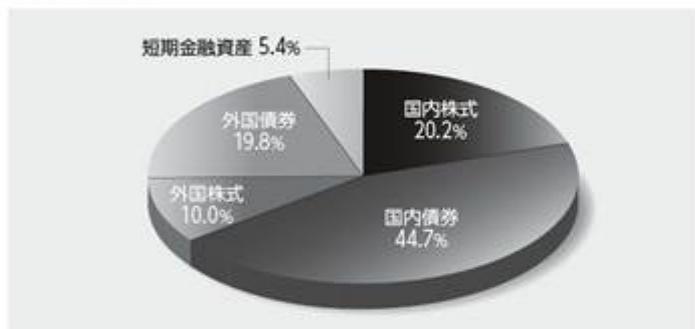
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

● 基準価額・純資産の推移



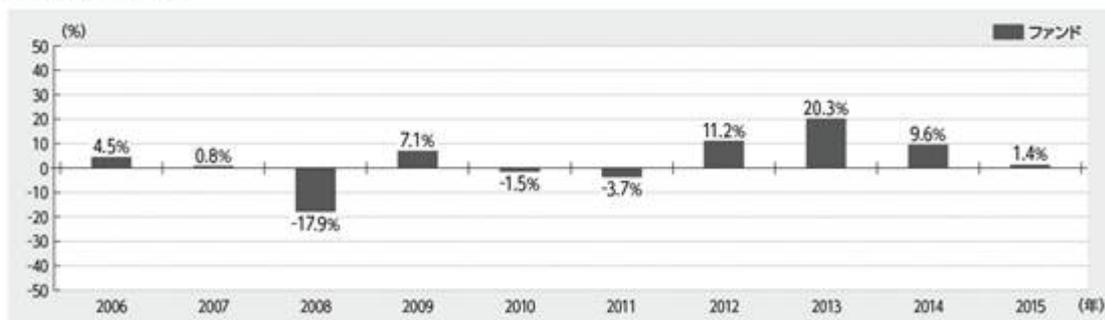
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

● 資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)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して計算しております。
- ・2015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	16,482円
純資産総額	40億円

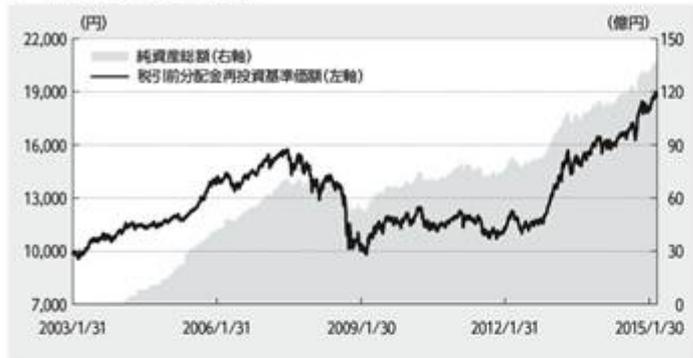
● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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
第12期	2015年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2015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



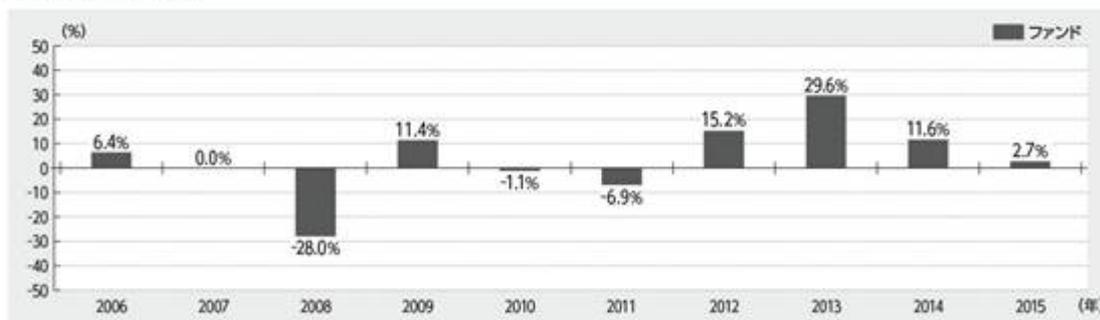
- ・ 基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・ 税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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。
- ・ 2015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	18,796円
純資産総額	136億円

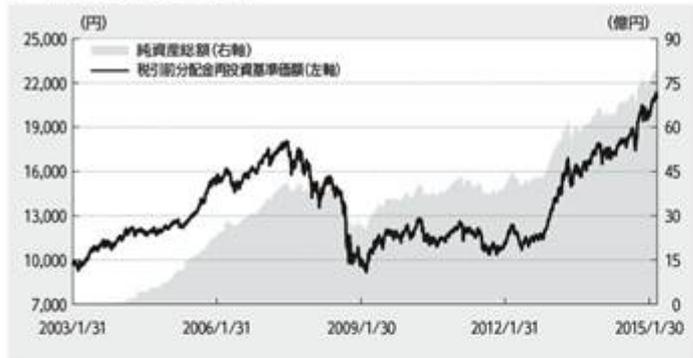
● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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
第12期	2015年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2015年3月末現在

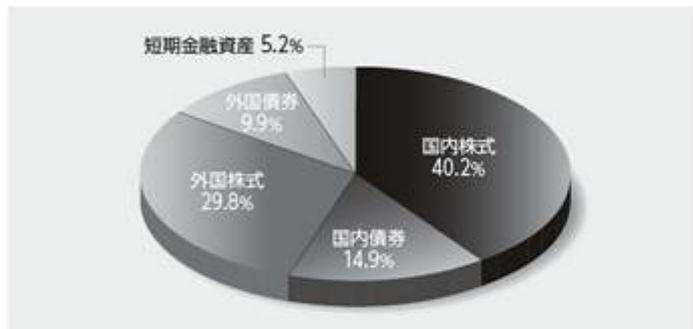
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

●基準価額・純資産の推移



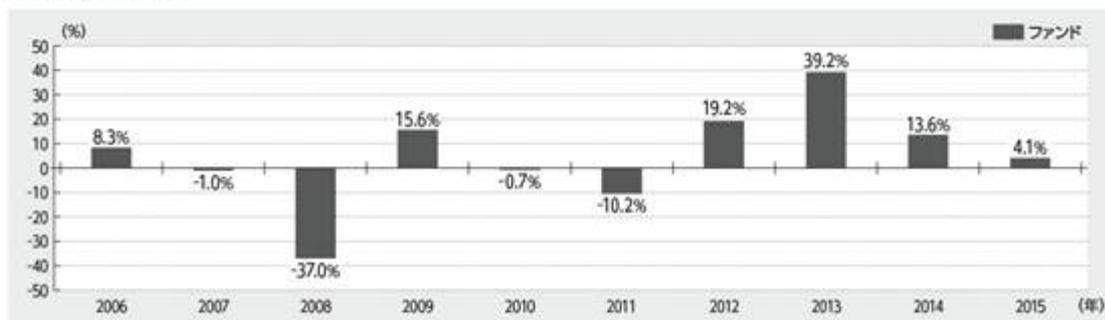
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

●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。
- ・2015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	21,057円
純資産総額	78億円

●分配の推移

1万口当り(税引前)

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
第12期	2015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、申込みの受付けを中止することおよび既に受付けた申込みの受付けを取消すことがあります。

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付けを行います。

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

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

換金単位

1口単位とします。

換金価額

換金請求受付日の翌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ます。

- ・ 交付運用報告書は、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。
 - ・ 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページ(<http://www.nam.co.jp/>)に掲載します。
- ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、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カ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12期計算期間（平成26年2月22日から平成27年2月23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12期計算期間（平成26年2月22日から平成27年2月23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12期計算期間（平成26年2月22日から平成27年2月23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11期 (平成26年2月21日現在)	第12期 (平成27年2月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	144,351,936	201,504,768
投資信託受益証券	843,471,432	-
親投資信託受益証券	1,683,318,742	3,782,585,221
派生商品評価勘定	9,067,080	-
未収入金	674,048,929	4,348,417
前払金	7,120,000	-
差入委託証拠金	29,400,000	-
流動資産合計	3,390,778,119	3,988,438,406
資産合計	3,390,778,119	3,988,438,406
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,305,516	4,302,557
未払受託者報酬	523,592	626,050
未払委託者報酬	1,483,623	3,130,375
その他未払費用	492,047	327,618
流動負債合計	4,804,778	8,386,600
負債合計	4,804,778	8,386,600
純資産の部		
元本等		
元本	2,307,741,264	2,435,551,135
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,078,232,077	1,544,500,671
純資産合計	3,385,973,341	3,980,051,806
負債純資産合計	3,390,778,119	3,988,438,406

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 (自平成25年2月22日 至平成26年2月21日)	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)
営業収益		
受取利息	81,109	89,559
有価証券売買等損益	353,664,053	408,964,579
派生商品取引等損益	9,635,190	2,952,920
営業収益合計	363,380,352	406,101,218
営業費用		
受託者報酬	1,015,988	1,178,417
委託者報酬	2,878,871	5,809,968
その他費用	968,506	632,121
営業費用合計	4,863,365	7,620,506
営業利益又は営業損失()	358,516,987	398,480,712
経常利益又は経常損失()	358,516,987	398,480,712
当期純利益又は当期純損失()	358,516,987	398,480,712
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()	37,405,981	18,048,561
期首剰余金又は期首欠損金()	712,734,810	1,078,232,077
剰余金増加額又は欠損金減少額	176,090,217	214,134,083
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	176,090,217	214,134,083
剰余金減少額又は欠損金増加額	131,703,956	128,297,640
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	131,703,956	128,297,640
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()	1,078,232,077	1,544,500,671

(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>
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>ファンドの計算期間</p> <p>当ファンドは、原則として毎年2月21日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、平成26年2月22日から平成27年2月23日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 (平成26年2月21日現在)	第12期 (平成27年2月23日現在)
1. 受益権総口数	2,307,741,264口	2,435,551,135口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4672円 (14,672円)	1.6341円 (16,341円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期 (自平成25年2月22日 至平成26年2月21日)	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)
1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(85,527円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(380,346,624円)、収益調整金(678,313,430円)及び分配準備積立金(500,997,279円)より分配対象収益は1,559,742,860円(1口当たり0.640407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。</p>

（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11期 (自平成25年2月22日 至平成26年2月21日)	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23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、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、金利変動リスク等の市場リスク、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。	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。 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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 (平成26年2月21日現在)	第12期 (平成27年2月23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ぬ。
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。	(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	第11期 (平成26年2月21日現在)	第12期 (平成27年2月23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	16,530,837	-
親投資信託受益証券	10,478,742	359,157,003
合計	27,009,579	359,157,003

(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11期 (平成26年2月21日現在)				第12期 (平成27年2月23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）

元本額の変動

項目	第11期 (平成26年2月21日現在)	第12期 (平成27年2月23日現在)
期首元本額	2,289,002,662円	2,307,741,264円
期中追加設定元本額	433,711,623円	400,729,347円
期中一部解約元本額	414,973,021円	272,919,476円

（4）【附属明細表】（平成27年2月23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	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	564,710,023	818,603,649	
	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	1,385,652,813	1,779,039,646	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	276,307,624	399,955,285	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	566,736,439	784,986,641	
親投資信託受益証券 合計		2,793,406,899	3,782,585,221	
合計		2,793,406,899	3,782,585,221	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （平成26年2月21日現在）	第12期 （平成27年2月23日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	370,849,777	679,423,216
親投資信託受益証券	7,315,176,587	12,817,562,620
派生商品評価勘定	55,992,290	-
未収入金	3,379,163,060	4,756,504
前払金	24,365,000	-
差入委託証拠金	145,950,000	-
流動資産合計	11,291,496,714	13,501,742,340
資産合計	11,291,496,714	13,501,742,340
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,383,699	4,591,686
未払受託者報酬	1,749,395	2,097,109
未払委託者報酬	4,956,718	11,883,806
その他未払費用	751,722	541,487
流動負債合計	11,841,534	19,114,088
負債合計	11,841,534	19,114,088
純資産の部		
元本等		
元本	7,010,883,824	7,258,743,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,268,771,356	6,223,884,729
純資産合計	11,279,655,180	13,482,628,252
負債純資産合計	11,291,496,714	13,501,742,340

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 (自平成25年2月22日 至平成26年2月21日)	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)
営業収益		
受取利息	266,162	294,967
有価証券売買等損益	1,585,522,112	1,827,654,172
派生商品取引等損益	58,832,840	10,337,710
営業収益合計	1,644,621,114	1,817,611,429
営業費用		
受託者報酬	3,367,767	3,941,071
委託者報酬	9,542,190	21,974,604
その他費用	1,483,511	1,053,006
営業費用合計	14,393,468	26,968,681
営業利益又は営業損失()	1,630,227,646	1,790,642,748
経常利益又は経常損失()	1,630,227,646	1,790,642,748
当期純利益又は当期純損失()	1,630,227,646	1,790,642,748
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()	143,173,664	64,573,739
期首剰余金又は期首欠損金()	2,645,643,119	4,268,771,356
剰余金増加額又は欠損金減少額	528,684,959	650,959,752
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	528,684,959	650,959,752
剰余金減少額又は欠損金増加額	392,610,704	421,915,388
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	392,610,704	421,915,388
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()	4,268,771,356	6,223,884,729

（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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月21日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、平成26年2月22日から平成27年2月23日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第11期 （平成26年2月21日現在）	第12期 （平成27年2月23日現在）
1. 受益権総口数	7,010,883,824口	7,258,743,523口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6089円 (16,089円)	1.8574円 (18,574円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）	第12期 （自平成26年2月22日 至平成27年2月23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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（282,859円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,725,786,150円）、収益調整金（2,674,105,406円）及び分配準備積立金（2,087,684,306円）より分配対象収益は6,487,858,721円（1口当たり0.893799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。

（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11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）	第12期 （自平成26年2月22日 至平成27年2月23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、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、金利変動リスク等の市場リスク、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。	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。 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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 (平成26年2月21日現在)	第12期 (平成27年2月23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	<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>	<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 該当事項はありません。</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	第11期 （平成26年2月21日現在）	第12期 （平成27年2月23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）
親投資信託受益証券	42,716,587	1,647,690,082
合計	42,716,587	1,647,690,082

（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11期 （平成26年2月21日 現在）				第12期 （平成27年2月23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）

元本額の変動

項目	第11期 （平成26年2月21日現在）	第12期 （平成27年2月23日現在）
期首元本額	7,014,605,407円	7,010,883,824円
期中追加設定元本額	1,017,362,567円	937,661,500円
期中一部解約元本額	1,021,084,150円	689,801,801円

（４）【附属明細表】（平成27年2月23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	ニッセイ国内株式インデックス マ ザーファンド	2,854,843,785	4,138,381,550	
	ニッセイ国内債券インデックス マ ザーファンド	3,114,021,918	3,998,092,740	
	ニッセイ外国株式インデックス マ ザーファンド	1,862,734,330	2,696,307,942	
	ニッセイ外国債券インデックス マ ザーファンド	1,432,950,970	1,984,780,388	
親投資信託受益証券 合計		9,264,551,003	12,817,562,620	
合計		9,264,551,003	12,817,562,620	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （平成26年2月21日現在）	第12期 （平成27年2月23日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	562,109,681	392,553,494
親投資信託受益証券	4,193,476,443	7,421,288,282
派生商品評価勘定	24,669,745	-
未収入金	1,589,778,011	4,084,078
前払金	21,290,000	-
差入委託証拠金	83,475,000	-
流動資産合計	6,474,798,880	7,817,925,854
資産合計	6,474,798,880	7,817,925,854
負債の部		
流動負債		
未払解約金	20,305,981	3,978,206
未払受託者報酬	991,512	1,205,401
未払委託者報酬	2,809,400	7,634,493
その他未払費用	621,670	437,471
流動負債合計	24,728,563	13,255,571
負債合計	24,728,563	13,255,571
純資産の部		
元本等		
元本	3,717,737,621	3,763,295,471
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,732,332,696	4,041,374,812
純資産合計	6,450,070,317	7,804,670,283
負債純資産合計	6,474,798,880	7,817,925,854

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（単位：円）

	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）	第12期 （自平成26年2月22日 至平成27年2月23日）
営業収益		
受取利息	156,758	170,849
有価証券売買等損益	1,129,476,825	1,305,672,862
派生商品取引等損益	26,482,185	5,515,255
営業収益合計	1,156,115,768	1,300,328,456
営業費用		
受託者報酬	1,891,814	2,259,834
委託者報酬	5,360,319	14,059,568
その他費用	1,218,189	842,079
営業費用合計	8,470,322	17,161,481
営業利益又は営業損失（ ）	1,147,645,446	1,283,166,975
経常利益又は経常損失（ ）	1,147,645,446	1,283,166,975
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,147,645,446	1,283,166,975
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（ ）	133,467,365	76,931,090
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,594,223,325	2,732,332,696
剰余金増加額又は欠損金減少額	470,138,639	528,190,683
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	470,138,639	528,190,683
剰余金減少額又は欠損金増加額	346,207,349	425,384,452
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	346,207,349	425,384,452
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（ ）	2,732,332,696	4,041,374,812

（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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月21日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、平成26年2月22日から平成27年2月23日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第11期 （平成26年2月21日現在）	第12期 （平成27年2月23日現在）
1. 受益権総口数	3,717,737,621口	3,763,295,471口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7349円 (17,349円)	2.0739円 (20,739円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）	第12期 （自平成26年2月22日 至平成27年2月23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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（161,543円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,206,074,342円）、収益調整金（1,973,182,832円）及び分配準備積立金（1,211,773,171円）より分配対象収益は4,391,191,888円（1口当たり1.166847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。

（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11期 （自平成25年2月22日 至平成26年2月21日）	第12期 （自平成26年2月22日 至平成27年2月23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、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、金利変動リスク等の市場リスク、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。	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。 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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 (平成26年2月21日現在)	第12期 (平成27年2月23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ぬ。	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 (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。	(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	第11期 (平成26年2月21日現在)	第12期 (平成27年2月23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)
親投資信託受益証券	46,516,443	1,172,714,399
合計	46,516,443	1,172,714,399

(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11期 (平成26年2月21日 現在)				第12期 (平成27年2月23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）

元本額の変動

項目	第11期 （平成26年2月21日現在）	第12期 （平成27年2月23日現在）
期首元本額	3,752,789,219円	3,717,737,621円
期中追加設定元本額	756,063,221円	620,216,297円
期中一部解約元本額	791,114,819円	574,658,447円

（4）【附属明細表】（平成27年2月23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	ニッセイ国内株式インデックス マ ザーファンド	2,192,239,458	3,177,870,318	
	ニッセイ国内債券インデックス マ ザーファンド	896,911,957	1,151,545,261	
	ニッセイ外国株式インデックス マ ザーファンド	1,609,399,772	2,329,606,169	
	ニッセイ外国債券インデックス マ ザーファンド	550,333,214	762,266,534	
親投資信託受益証券 合計		5,248,884,401	7,421,288,282	
合計		5,248,884,401	7,421,288,282	

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。

(参考)

開示対象ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型））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開示対象期間末日（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)

開示対象ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型））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開示対象期間末日（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)

開示対象ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（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開示対象期間末日（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)	(平成27年2月23日現在)
--	----------------	----------------

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,064,702,053	666,704,775
株式	32,103,450,210	42,300,900,540
派生商品評価勘定	5,664,090	7,859,340
未収入金	-	11,530,280
未収配当金	35,026,168	48,166,647
前払金	5,320,000	-
差入委託証拠金	19,950,000	18,810,000
流動資産合計	33,234,112,521	43,053,971,582
資産合計	33,234,112,521	43,053,971,582
負債の部		
流動負債		
前受金	-	19,550,000
未払解約金	669,777,694	172,366,196
流動負債合計	669,777,694	191,916,196
負債合計	669,777,694	191,916,196
純資産の部		
元本等		
元本	28,179,989,310	29,567,458,266
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,384,345,517	13,294,597,120
純資産合計	32,564,334,827	42,862,055,386
負債純資産合計	33,234,112,521	43,053,971,582

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）	（平成27年2月23日現在）
1. 受益権総口数	28,179,989,310口	29,567,458,266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)	1.4496円 (14,496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）	（自 平成26年2月22日 至 平成27年2月23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、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、金利変動リスク等の市場リスク、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。	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	<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>	同左
----------------------------	---	----

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)	(平成27年2月23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	<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>	同左

(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	平成27年2月23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)
株式	728,758,930	70,334,610
合計	728,758,930	70,334,610

(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)				(平成27年2月23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	458,470,000	-	464,170,000	5,700,000	428,140,000	-	436,015,000	7,875,000
合計	458,470,000	-	464,170,000	5,700,000	428,140,000	-	436,015,000	7,875,000

(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開示対象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)	(平成27年2月23日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	38,535,873,339円	28,179,989,310円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	10,048,705,621円	14,045,077,774円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	20,404,589,650円	12,657,608,818円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	10,548,302,283円	8,109,707,710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	8,843,614,814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	64,087,291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	9,919,725円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	- 円	564,710,023円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	- 円	2,854,843,785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	2,192,239,458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	147,954,889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	933,928,598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	867,167,683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)	2,059,974,542円	4,978,508,098円
D Cニッセイ国内株式インデックス	- 円	776,192円
計	28,179,989,310円	29,567,458,266円

附属明細表(平成27年2月23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	9,000	293.00	2,637,000	
日本水産	26,600	385.00	10,241,000	
マルハニチロ	4,100	1,772.00	7,265,200	
サカタのタネ	3,500	1,963.00	6,870,500	
ホクト	2,400	2,402.00	5,764,800	
ショーボンドホールディングス	2,100	5,110.00	10,731,000	
ミライト・ホールディングス	6,600	1,296.00	8,553,600	
タマホーム	2,000	565.00	1,130,000	
住石ホールディングス	6,400	117.00	748,800	
日鉄鉱業	6,000	448.00	2,688,000	
三井松島産業	14,000	135.00	1,890,000	
国際石油開発帝石	113,700	1,382.50	157,190,250	
日本海洋掘削	600	4,180.00	2,508,000	
石油資源開発	3,100	3,915.00	12,136,500	
K & Oエナジーグループ	1,500	1,559.00	2,338,500	
ダイセキ環境ソリューション	600	1,880.00	1,128,000	
安藤・間	14,400	712.00	10,252,800	
東急建設	7,700	749.00	5,767,300	
コムシスホールディングス	9,600	1,514.00	14,534,400	
ミサワホーム	2,500	1,049.00	2,622,500	
高松コンストラクショングループ	1,600	2,580.00	4,128,000	
東建コーポレーション	800	5,300.00	4,240,000	
ヤマウラ	3,000	408.00	1,224,000	
大成建設	109,000	720.00	78,480,000	
大林組	65,000	783.00	50,895,000	
清水建設	66,000	859.00	56,694,000	

飛鳥建設	14,000	266.00	3,724,000	
長谷工コーポレーション	27,000	1,118.00	30,186,000	
松井建設	2,000	730.00	1,460,000	
銭高組	3,000	396.00	1,188,000	
鹿島建設	95,000	544.00	51,680,000	
不動テトラ	16,300	260.00	4,238,000	
鉄建建設	13,000	459.00	5,967,000	
日鉄住金テックスエンジ	4,000	555.00	2,220,000	
西松建設	23,000	460.00	10,580,000	
三井住友建設	87,600	175.00	15,330,000	
大豊建設	6,000	638.00	3,828,000	
前田建設工業	14,000	954.00	13,356,000	
佐田建設	8,000	145.00	1,160,000	
ナカノフドー建設	2,900	408.00	1,183,200	
奥村組	20,000	574.00	11,480,000	
東鉄工業	2,600	2,696.00	7,009,600	
イチケン	4,000	338.00	1,352,000	
戸田建設	27,000	464.00	12,528,000	
熊谷組	27,000	392.00	10,584,000	
青木あすなろ建設	1,400	841.00	1,177,400	
北野建設	4,000	369.00	1,476,000	
植木組	4,000	275.00	1,100,000	
三井ホーム	3,000	514.00	1,542,000	
矢作建設工業	2,700	809.00	2,184,300	
東日本ハウス	2,700	562.00	1,517,400	
大東建託	8,200	13,470.00	110,454,000	
新日本建設	2,700	443.00	1,196,100	
N I P P O	5,000	1,746.00	8,730,000	
東亜道路工業	4,000	424.00	1,696,000	
前田道路	7,000	1,854.00	12,978,000	
日本道路	6,000	604.00	3,624,000	
東亜建設工業	16,000	219.00	3,504,000	
若築建設	12,000	200.00	2,400,000	
東洋建設	5,700	572.00	3,260,400	
五洋建設	24,000	439.00	10,536,000	
大林道路	3,000	699.00	2,097,000	
世紀東急工業	3,100	555.00	1,720,500	
福田組	3,000	803.00	2,409,000	
日本ドライケミカル	500	2,271.00	1,135,500	
住友林業	15,900	1,216.00	19,334,400	
日本基礎技術	2,900	435.00	1,261,500	

日成ビルド工業	6,000	297.00	1,782,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	13,000	94.00	1,222,000	
巴コーポレーション	2,900	423.00	1,226,700	
パナホーム	8,000	778.00	6,224,000	
大和ハウス工業	63,200	2,328.00	147,129,600	
ライト工業	3,500	1,059.00	3,706,500	
積水ハウス	66,400	1,610.00	106,904,000	
日特建設	2,900	552.00	1,600,800	
北陸電気工事	2,000	800.00	1,600,000	
ユアテック	3,000	795.00	2,385,000	
西部電気工業	2,000	469.00	938,000	
四電工	3,000	462.00	1,386,000	
中電工	3,100	2,006.00	6,218,600	
関電工	10,000	704.00	7,040,000	
きんでん	14,000	1,462.00	20,468,000	
東京エネシス	2,000	861.00	1,722,000	
トーエネック	3,000	589.00	1,767,000	
住友電設	1,700	1,302.00	2,213,400	
日本電設工業	3,500	1,847.00	6,464,500	
協和エクシオ	9,200	1,165.00	10,718,000	
新日本空調	1,800	978.00	1,760,400	
日本工営	7,000	493.00	3,451,000	
N D S	4,000	305.00	1,220,000	
九電工	4,000	1,428.00	5,712,000	
三機工業	4,400	828.00	3,643,200	
日揮	22,000	2,525.00	55,550,000	
中外炉工業	7,000	289.00	2,023,000	
太平電業	3,000	836.00	2,508,000	
高砂熱学工業	6,000	1,467.00	8,802,000	
三晃金属工業	5,000	260.00	1,300,000	
N E C ネットズエスアイ	2,400	2,371.00	5,690,400	
朝日工業社	3,000	441.00	1,323,000	
明星工業	3,800	677.00	2,572,600	
大気社	3,100	2,684.00	8,320,400	
ダイダン	3,000	728.00	2,184,000	
日比谷総合設備	2,800	1,694.00	4,743,200	
東芝プラントシステム	3,500	1,799.00	6,296,500	
日本製粉	13,000	583.00	7,579,000	
日清製粉グループ本社	23,700	1,426.00	33,796,200	
昭和産業	9,000	506.00	4,554,000	
鳥越製粉	1,800	706.00	1,270,800	

中部飼料	2,100	691.00	1,451,100	
フィード・ワンホールディングス	13,000	119.00	1,547,000	
東洋精糖	12,000	104.00	1,248,000	
日本甜菜製糖	11,000	209.00	2,299,000	
三井製糖	8,000	430.00	3,440,000	
塩水港精糖	4,500	274.00	1,233,000	
ネクスト	2,400	935.00	2,244,000	
日本M & Aセンター	3,100	3,855.00	11,950,500	
ノバレーゼ	1,400	864.00	1,209,600	
アコーディア・ゴルフ	7,600	1,205.00	9,158,000	
タケエイ	2,000	973.00	1,946,000	
パソナグループ	1,700	702.00	1,193,400	
リンクアンドモチベーション	7,800	157.00	1,224,600	
G C Aサヴィアン	1,600	1,377.00	2,203,200	
エス・エム・エス	2,300	1,322.00	3,040,600	
テンプホールディングス	4,000	3,885.00	15,540,000	
リニカル	1,300	967.00	1,257,100	
クックパッド	1,300	4,845.00	6,298,500	
森永製菓	19,000	368.00	6,992,000	
中村屋	5,000	511.00	2,555,000	
江崎グリコ	5,000	5,080.00	25,400,000	
名糖産業	1,000	1,159.00	1,159,000	
不二家	12,000	198.00	2,376,000	
山崎製パン	16,000	1,990.00	31,840,000	
モロゾフ	3,000	376.00	1,128,000	
亀田製菓	1,200	4,595.00	5,514,000	
寿スピリッツ	500	2,602.00	1,301,000	
カルビー	8,000	4,450.00	35,600,000	
森永乳業	19,000	469.00	8,911,000	
六甲バター	100	1,169.00	116,900	
ヤクルト本社	11,600	7,190.00	83,404,000	
明治ホールディングス	6,400	13,470.00	86,208,000	
雪印メグミルク	5,100	1,599.00	8,154,900	
プリマハム	12,000	281.00	3,372,000	
日本ハム	16,000	2,766.00	44,256,000	
伊藤ハム	12,000	650.00	7,800,000	
丸大食品	11,000	412.00	4,532,000	
米久	700	1,909.00	1,336,300	
S Foods	1,400	2,123.00	2,972,200	
スタジオアリス	900	2,081.00	1,872,900	
シミックホールディングス	800	1,954.00	1,563,200	

システナ	1,900	877.00	1,666,300
新日鉄住金ソリューションズ	1,600	3,405.00	5,448,000
総合警備保障	6,700	3,505.00	23,483,500
日本駐車場開発	20,700	131.00	2,711,700
コア	1,300	934.00	1,214,200
カカクコム	13,400	1,825.00	24,455,000
ルネサンス	1,000	1,234.00	1,234,000
ディップ	400	5,320.00	2,128,000
SBSホールディングス	1,500	900.00	1,350,000
オプト	2,000	664.00	1,328,000
新日本科学	1,900	950.00	1,805,000
ツクイ	2,400	964.00	2,313,600
総合臨床ホールディングス	2,500	482.00	1,205,000
キャリアデザインセンター	1,300	950.00	1,235,000
エムスリー	17,400	2,628.00	45,727,200
ツカダ・グローバルホールディング	1,600	809.00	1,294,400
アウトソーシング	800	1,889.00	1,511,200
ウェルネット	500	2,265.00	1,132,500
ディー・エヌ・エー	9,900	1,373.00	13,592,700
博報堂DYホールディングス	27,900	1,310.00	36,549,000
ぐるなび	2,300	1,841.00	4,234,300
エスアールジータカミヤ	1,600	877.00	1,403,200
一休	1,600	1,729.00	2,766,400
ジャパンベストレスキューシステム	4,700	253.00	1,189,100
ファンコミュニケーションズ	3,500	1,171.00	4,098,500
ジェイコムホールディングス	1,500	816.00	1,224,000
PGMホールディングス	2,800	1,341.00	3,754,800
ティア	2,100	596.00	1,251,600
バリューコマース	2,300	526.00	1,209,800
サッポロホールディングス	35,000	470.00	16,450,000
アサヒグループホールディングス	43,400	3,725.00	161,665,000
麒麟ホールディングス	92,400	1,558.50	144,005,400
宝ホールディングス	16,900	800.00	13,520,000
オエノンホールディングス	6,000	221.00	1,326,000
養命酒製造	1,000	949.00	949,000
コカ・コーラウエスト	7,300	1,807.00	13,191,100
コカ・コーライーストジャパン	6,600	2,059.00	13,589,400
サントリー食品インターナショナル	12,900	4,315.00	55,663,500
ダイドードリンコ	1,100	4,860.00	5,346,000
伊藤園	6,400	2,466.00	15,782,400
キーコーヒー	1,900	1,798.00	3,416,200

ユニカフェ	1,400	881.00	1,233,400
ジャパンフーズ	1,100	1,143.00	1,257,300
日清オイリオグループ	10,000	434.00	4,340,000
不二製油	5,800	1,675.00	9,715,000
かどや製油	400	2,725.00	1,090,000
J - オイルミルズ	9,000	419.00	3,771,000
ローソン	7,200	8,070.00	58,104,000
サンエー	1,400	4,180.00	5,852,000
カワチ薬品	1,500	2,017.00	3,025,500
エービーシー・マート	2,700	6,270.00	16,929,000
高千穂交易	1,100	1,093.00	1,202,300
アスクル	2,000	2,231.00	4,462,000
ゲオホールディングス	3,600	1,290.00	4,644,000
アダストリアホールディングス	1,600	2,990.00	4,784,000
伊藤忠食品	500	4,070.00	2,035,000
くらコーポレーション	1,100	3,905.00	4,295,500
キャンドウ	900	1,592.00	1,432,800
エレマテック	900	2,778.00	2,500,200
バル	1,100	3,130.00	3,443,000
J A L U X	600	2,073.00	1,243,800
エディオン	8,700	926.00	8,056,200
あらた	4,000	332.00	1,328,000
サーラコーポレーション	2,100	596.00	1,251,600
ワッツ	1,400	880.00	1,232,000
トーマンデバイス	700	1,862.00	1,303,400
J Pホールディングス	5,000	362.00	1,810,000
あみやき亭	300	4,095.00	1,228,500
東京エレクトロン デバイス	800	1,585.00	1,268,000
ひらまつ	2,600	646.00	1,679,600
双日	127,300	179.00	22,786,700
ゲンキー	200	9,890.00	1,978,000
アルフレッサ ホールディングス	22,500	1,648.00	37,080,000
大黒天物産	500	4,045.00	2,022,500
ハニーズ	1,700	982.00	1,669,400
キッコーマン	18,000	3,385.00	60,930,000
味の素	50,000	2,246.50	112,325,000
キューピー	11,000	2,819.00	31,009,000
ハウス食品グループ本社	8,000	2,470.00	19,760,000
カゴメ	8,300	1,811.00	15,031,300
焼津水産化学工業	1,200	1,029.00	1,234,800
アリアケジャパン	2,000	3,140.00	6,280,000

ニチレイ	23,000	617.00	14,191,000
横浜冷凍	4,700	839.00	3,943,300
東洋水産	11,300	4,295.00	48,533,500
日清食品ホールディングス	9,100	5,870.00	53,417,000
永谷園	2,000	1,168.00	2,336,000
フジッコ	2,000	1,871.00	3,742,000
ロック・フィールド	1,100	2,242.00	2,466,200
日本たばこ産業	119,600	3,669.00	438,812,400
わらべや日洋	1,300	2,011.00	2,614,300
なとり	1,000	1,583.00	1,583,000
ユーグレナ	4,700	2,016.00	9,475,200
片倉工業	2,500	1,190.00	2,975,000
グンゼ	16,000	321.00	5,136,000
ヒューリック	32,100	1,309.00	42,018,900
山下医科器械	700	1,697.00	1,187,900
ラサ商事	2,100	599.00	1,257,900
アルペン	1,700	1,856.00	3,155,200
クオール	1,900	945.00	1,795,500
アルコニックス	1,100	1,837.00	2,020,700
神戸物産	600	4,300.00	2,580,000
ジェイアイエヌ	1,300	3,475.00	4,517,500
ビックカメラ	8,200	1,365.00	11,193,000
DCMホールディングス	9,200	876.00	8,059,200
MonotaRO	3,700	3,830.00	14,171,000
あいホールディングス	3,000	2,210.00	6,630,000
アークランドサービス	300	4,500.00	1,350,000
J・フロントリテイリング	24,100	1,629.00	39,258,900
ドトール・日レスホールディングス	3,300	1,799.00	5,936,700
マツモトキヨシホールディングス	4,200	4,010.00	16,842,000
ブロンコビリー	300	3,880.00	1,164,000
スタートトゥデイ	5,900	2,850.00	16,815,000
物語コーポレーション	500	3,525.00	1,762,500
ココカラファイン	2,000	3,365.00	6,730,000
三越伊勢丹ホールディングス	37,800	1,785.00	67,473,000
東洋紡	80,000	166.00	13,280,000
ユニチカ	59,000	53.00	3,127,000
富士紡ホールディングス	10,000	309.00	3,090,000
日清紡ホールディングス	13,000	1,224.00	15,912,000
倉敷紡績	21,000	206.00	4,326,000
ダイワボウホールディングス	17,000	200.00	3,400,000
シキボウ	12,000	122.00	1,464,000

日東紡績	15,000	490.00	7,350,000	
トヨタ紡織	6,700	1,521.00	10,190,700	
ウエルシアホールディングス	1,700	4,555.00	7,743,500	
クリエイトSDホールディングス	900	4,140.00	3,726,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,600	966.00	3,477,600	
UKCホールディングス	1,200	1,985.00	2,382,000	
OCHIホールディングス	800	1,466.00	1,172,800	
TOKAIホールディングス	9,300	562.00	5,226,600	
エー・ピーカンパニー	600	2,003.00	1,201,800	
三洋貿易	1,100	1,402.00	1,542,200	
チムニー	500	2,353.00	1,176,500	
ジョイフル本田	1,000	4,135.00	4,135,000	
すかいらーく	7,000	1,360.00	9,520,000	
日本毛織	6,000	797.00	4,782,000	
ダイドーリミテッド	2,300	558.00	1,283,400	
野村不動産ホールディングス	11,400	2,102.00	23,962,800	
プレサンスコーポレーション	600	3,770.00	2,262,000	
常和ホールディングス	800	3,885.00	3,108,000	
日本管理センター	1,000	1,341.00	1,341,000	
フージャースホールディングス	2,800	525.00	1,470,000	
オープンハウス	1,200	2,733.00	3,279,600	
東急不動産ホールディングス	49,800	837.00	41,682,600	
飯田グループホールディングス	12,300	1,668.00	20,516,400	
帝国繊維	2,100	1,808.00	3,796,800	
ブックオフコーポレーション	1,400	911.00	1,275,400	
日本コークス工業	18,100	118.00	2,135,800	
あさひ	1,300	1,163.00	1,511,900	
コスモス薬品	1,000	18,750.00	18,750,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,500	2,648.00	9,268,000	
トーエル	1,600	714.00	1,142,400	
セブン&アイ・ホールディングス	79,500	4,556.00	362,202,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1,300	1,572.00	2,043,600	
ツルハホールディングス	4,100	7,910.00	32,431,000	
サンマルクホールディングス	700	7,770.00	5,439,000	
フェリシモ	1,200	1,020.00	1,224,000	
トリドール	2,000	1,658.00	3,316,000	
クスリのアオキ	700	7,580.00	5,306,000	
帝人	82,000	389.00	31,898,000	
東レ	156,000	997.00	155,532,000	

クラレ	34,400	1,511.00	51,978,400
旭化成	126,000	1,230.00	154,980,000
サカイオーベックス	2,000	187.00	374,000
稲葉製作所	1,000	1,326.00	1,326,000
トーカロ	1,300	2,287.00	2,973,100
アルファ	1,000	1,284.00	1,284,000
SUMCO	13,900	2,314.00	32,164,600
川田テクノロジーズ	400	4,130.00	1,652,000
住江織物	5,000	307.00	1,535,000
日本フェルト	2,200	561.00	1,234,200
日本バイリーン	3,000	601.00	1,803,000
芦森工業	7,000	164.00	1,148,000
アツギ	17,000	116.00	1,972,000
ダイニック	7,000	181.00	1,267,000
共和レザー	1,600	780.00	1,248,000
セーレン	5,000	1,085.00	5,425,000
東海染工	9,000	130.00	1,170,000
小松精練	3,400	558.00	1,897,200
ワコールホールディングス	12,000	1,277.00	15,324,000
ホギメディカル	1,300	6,090.00	7,917,000
T S Iホールディングス	9,000	745.00	6,705,000
I Tホールディングス	6,300	2,091.00	13,173,300
グリー	11,500	673.00	7,739,500
コーエーテクモホールディングス	4,300	1,679.00	7,219,700
三菱総合研究所	700	2,740.00	1,918,000
電算	500	2,297.00	1,148,500
A G S	1,100	996.00	1,095,600
ファインデックス	300	5,290.00	1,587,000
K L a b	2,000	1,055.00	2,110,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,500	794.00	1,191,000
ネクソン	18,100	1,123.00	20,326,300
エムアップ	1,600	763.00	1,220,800
エイチーム	200	5,060.00	1,012,000
e n i s h	900	1,410.00	1,269,000
コロブラ	3,300	2,726.00	8,995,800
ブロードリーフ	1,600	1,819.00	2,910,400
ハーツユナイテッドグループ	700	1,766.00	1,236,200
特種東海製紙	12,000	271.00	3,252,000
ティーガイア	1,900	1,472.00	2,796,800
GMOペイメントゲートウェイ	1,700	2,437.00	4,142,900

ザッパラス	1,800	672.00	1,209,600	
インターネットイニシアティブ	3,100	2,311.00	7,164,100	
ビットアイル	2,400	535.00	1,284,000	
S R Aホールディングス	1,000	1,580.00	1,580,000	
パイブドピッツ	600	1,968.00	1,180,800	
王子ホールディングス	83,000	494.00	41,002,000	
日本製紙	9,700	2,015.00	19,545,500	
三菱製紙	31,000	88.00	2,728,000	
北越紀州製紙	12,600	576.00	7,257,600	
中越パルプ工業	8,000	271.00	2,168,000	
大王製紙	9,000	1,010.00	9,090,000	
g u m i	1,400	2,482.00	3,474,800	
レンゴー	18,000	537.00	9,666,000	
トーモク	7,000	291.00	2,037,000	
ザ・バック	1,400	2,411.00	3,375,400	
コープケミカル	8,000	104.00	832,000	
昭和電工	134,000	158.00	21,172,000	
住友化学	149,000	552.00	82,248,000	
日本化成	8,000	149.00	1,192,000	
住友精化	4,000	861.00	3,444,000	
日産化学工業	13,500	2,281.00	30,793,500	
ラサ工業	9,000	140.00	1,260,000	
クレハ	14,000	557.00	7,798,000	
テイカ	3,000	461.00	1,383,000	
石原産業	34,000	119.00	4,046,000	
日本曹達	13,000	722.00	9,386,000	
東ソー	50,000	549.00	27,450,000	
トクヤマ	31,000	264.00	8,184,000	
セントラル硝子	21,000	512.00	10,752,000	
東亜合成	25,000	540.00	13,500,000	
ダイソー	8,000	439.00	3,512,000	
関東電化工業	5,000	814.00	4,070,000	
電気化学工業	42,000	455.00	19,110,000	
イビデン	12,600	1,989.00	25,061,400	
信越化学工業	36,200	8,212.00	297,274,400	
日本カーバイド工業	7,000	236.00	1,652,000	
堺化学工業	8,000	397.00	3,176,000	
エア・ウォーター	18,000	2,053.00	36,954,000	
大陽日酸	26,000	1,756.00	45,656,000	
日本化学工業	7,000	303.00	2,121,000	
日本パーカライジング	4,800	2,858.00	13,718,400	

高圧ガス工業	3,000	615.00	1,845,000
四国化成工業	3,000	1,040.00	3,120,000
戸田工業	4,000	512.00	2,048,000
ステラ ケミファ	1,000	1,408.00	1,408,000
保土谷化学工業	6,000	209.00	1,254,000
日本触媒	16,000	1,623.00	25,968,000
大日精化工業	8,000	662.00	5,296,000
カネカ	27,000	797.00	21,519,000
協和発酵キリン	24,000	1,420.00	34,080,000
三菱瓦斯化学	35,000	602.00	21,070,000
三井化学	92,000	355.00	32,660,000
J S R	19,900	2,175.00	43,282,500
東京応化工業	4,200	4,125.00	17,325,000
大阪有機化学工業	2,500	514.00	1,285,000
三菱ケミカルホールディングス	126,100	645.90	81,447,990
日本合成化学工業	5,000	730.00	3,650,000
ダイセル	28,400	1,590.00	45,156,000
住友ベークライト	19,000	517.00	9,823,000
積水化学工業	47,000	1,472.00	69,184,000
日本ゼオン	17,000	1,162.00	19,754,000
アイカ工業	6,100	2,714.00	16,555,400
宇部興産	102,000	186.00	18,972,000
積水樹脂	3,100	1,663.00	5,155,300
タキロン	4,000	524.00	2,096,000
旭有機材工業	7,000	289.00	2,023,000
日立化成	10,000	2,492.00	24,920,000
ニチバン	3,000	486.00	1,458,000
リケンテクノス	3,300	445.00	1,468,500
大倉工業	5,000	359.00	1,795,000
積水化成品工業	6,000	451.00	2,706,000
群栄化学工業	5,000	345.00	1,725,000
ミライアル	800	1,565.00	1,252,000
ダイキョーニシカワ	500	3,895.00	1,947,500
日本化薬	13,000	1,571.00	20,423,000
カーリットホールディングス	1,800	649.00	1,168,200
E P Sホールディングス	2,500	1,435.00	3,587,500
パナソニック インフォメーションシステムズ	400	3,565.00	1,426,000
プレステージ・インターナショナル	1,500	1,023.00	1,534,500
フェイス	900	1,303.00	1,172,700
アミューズ	600	2,941.00	1,764,600

野村総合研究所	10,800	4,110.00	44,388,000
ドリームインキュベータ	700	2,336.00	1,635,200
サイバネットシステム	2,700	472.00	1,274,400
T A C	5,600	213.00	1,192,800
ケネディクス	28,600	537.00	15,358,200
電通	22,400	5,060.00	113,344,000
インテージホールディングス	1,100	1,974.00	2,171,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,200	1,009.00	1,210,800
東邦システムサイエンス	2,000	638.00	1,276,000
びあ	600	2,356.00	1,413,600
イオンファンタジー	800	1,564.00	1,251,200
日本精化	1,700	850.00	1,445,000
A D E K A	9,300	1,483.00	13,791,900
日油	17,000	851.00	14,467,000
ミヨシ油脂	9,000	141.00	1,269,000
新日本理化	5,500	220.00	1,210,000
ハリマ化成グループ	2,600	480.00	1,248,000
花王	54,300	5,164.00	280,405,200
第一工業製薬	4,000	409.00	1,636,000
三洋化成工業	6,000	947.00	5,682,000
武田薬品工業	75,600	6,082.00	459,799,200
アステラス製薬	229,800	1,871.50	430,070,700
大日本住友製薬	14,300	1,275.00	18,232,500
塩野義製薬	31,500	3,380.00	106,470,000
田辺三菱製薬	23,500	2,010.00	47,235,000
あすか製薬	2,400	1,160.00	2,784,000
日本新薬	5,000	3,910.00	19,550,000
中外製薬	20,100	3,535.00	71,053,500
科研製薬	7,000	3,475.00	24,325,000
エーザイ	26,600	6,214.00	165,292,400
理研ビタミン	600	4,085.00	2,451,000
ロート製薬	9,200	1,530.00	14,076,000
小野薬品工業	9,200	11,640.00	107,088,000
久光製薬	5,700	4,385.00	24,994,500
持田製薬	1,400	7,140.00	9,996,000
参天製薬	7,400	7,720.00	57,128,000
扶桑薬品工業	7,000	318.00	2,226,000
日本ケミファ	3,000	568.00	1,704,000
ツムラ	6,300	3,050.00	19,215,000
日医工	4,700	2,377.00	11,171,900
テルモ	29,500	3,135.00	92,482,500

みらかホールディングス	5,300	5,760.00	30,528,000	
キッセイ薬品工業	3,700	3,410.00	12,617,000	
生化学工業	3,900	2,049.00	7,991,100	
栄研化学	1,700	1,800.00	3,060,000	
日水製薬	700	1,374.00	961,800	
鳥居薬品	1,400	3,295.00	4,613,000	
J C Rファーマ	1,600	2,239.00	3,582,400	
東和薬品	1,000	6,540.00	6,540,000	
富士製薬工業	600	2,286.00	1,371,600	
沢井製薬	3,200	7,760.00	24,832,000	
ゼリア新薬工業	4,100	1,929.00	7,908,900	
第一三共	67,900	1,856.50	126,056,350	
キョーリン製薬ホールディングス	5,400	2,738.00	14,785,200	
大幸薬品	900	1,987.00	1,788,300	
ダイト	800	2,570.00	2,056,000	
大塚ホールディングス	40,000	3,670.50	146,820,000	
大正製薬ホールディングス	4,900	8,040.00	39,396,000	
大日本塗料	12,000	157.00	1,884,000	
日本ペイントホールディングス	17,500	4,280.00	74,900,000	
関西ペイント	24,000	2,105.00	50,520,000	
中国塗料	6,000	990.00	5,940,000	
藤倉化成	2,700	574.00	1,549,800	
太陽ホールディングス	1,600	4,220.00	6,752,000	
D I C	81,000	322.00	26,082,000	
サカタインクス	4,100	1,190.00	4,879,000	
東洋インキ S Cホールディングス	20,000	578.00	11,560,000	
T & K T O K A	700	2,435.00	1,704,500	
アルプス技研	800	1,806.00	1,444,800	
ダイオーズ	1,300	908.00	1,180,400	
日本空調サービス	1,400	864.00	1,209,600	
オリエンタルランド	5,400	30,235.00	163,269,000	
ダスキン	5,700	1,969.00	11,223,300	
パーク 2 4	9,600	2,133.00	20,476,800	
明光ネットワークジャパン	2,000	1,242.00	2,484,000	
ファルコホールディングス	1,000	1,382.00	1,382,000	
クレスコ	700	1,935.00	1,354,500	
フジ・メディア・ホールディングス	19,800	1,614.00	31,957,200	
田谷	1,500	833.00	1,249,500	
ラウンドワン	5,700	691.00	3,938,700	
リゾートトラスト	7,400	2,822.00	20,882,800	
オービック	6,600	4,410.00	29,106,000	

ジャストシステム	2,600	694.00	1,804,400
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,200	1,096.00	1,315,200
ヤフー	136,300	433.00	59,017,900
ビー・エム・エル	1,200	3,325.00	3,990,000
トレンドマイクロ	10,100	3,725.00	37,622,500
もしもしホットライン	3,700	1,355.00	5,013,500
日本オラクル	3,000	5,150.00	15,450,000
アルファシステムズ	700	1,642.00	1,149,400
フューチャ・アーキテクト	2,000	704.00	1,408,000
CAC Holdings	1,300	1,065.00	1,384,500
ソフトバンク・テクノロジー	1,000	1,217.00	1,217,000
トーセ	1,600	757.00	1,211,200
ユー・エス・エス	24,400	2,091.00	51,020,400
オービックビジネスコンサルタント	1,200	4,120.00	4,944,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,200	4,545.00	9,999,000
アイティフォー	2,700	468.00	1,263,600
東計電算	700	1,743.00	1,220,100
サイバーエージェント	3,700	5,790.00	21,423,000
楽天	87,400	1,920.00	167,808,000
大塚商会	5,100	4,690.00	23,919,000
総合メディカル	500	6,680.00	3,340,000
サイボウズ	3,700	334.00	1,235,800
セントラルスポーツ	700	2,153.00	1,507,100
電通国際情報サービス	1,200	1,141.00	1,369,200
イーエムシステムズ	700	1,747.00	1,222,900
ウェザーニューズ	600	3,085.00	1,851,000
C I J	2,600	467.00	1,214,200
東洋ビジネスエンジニアリング	900	1,357.00	1,221,300
日本エンタープライズ	3,200	385.00	1,232,000
WOWOW	500	6,170.00	3,085,000
富士フイルムホールディングス	46,200	4,048.00	187,017,600
コニカミノルタ	45,900	1,263.00	57,971,700
資生堂	35,900	2,015.00	72,338,500
ライオン	23,000	658.00	15,134,000
高砂香料工業	7,000	562.00	3,934,000
マンダム	2,000	3,995.00	7,990,000
ミルボン	1,200	3,415.00	4,098,000
ファンケル	4,700	1,783.00	8,380,100
コーセー	3,300	5,710.00	18,843,000
ドクターシーラボ	1,400	4,135.00	5,789,000
シーボン	400	2,836.00	1,134,400

ポーラ・オルビスホールディングス	2,400	5,540.00	13,296,000	
ノエビアホールディングス	1,300	2,284.00	2,969,200	
エステー	1,400	1,028.00	1,439,200	
アグロ カネショウ	1,300	960.00	1,248,000	
コニシ	1,600	2,032.00	3,251,200	
長谷川香料	2,600	1,742.00	4,529,200	
小林製薬	3,300	7,980.00	26,334,000	
荒川化学工業	1,700	1,339.00	2,276,300	
メック	1,600	833.00	1,332,800	
日本高純度化学	600	2,546.00	1,527,600	
J C U	500	5,480.00	2,740,000	
新田ゼラチン	1,700	777.00	1,320,900	
アース製薬	1,400	3,950.00	5,530,000	
イハラケミカル工業	3,100	1,351.00	4,188,100	
北興化学工業	3,000	415.00	1,245,000	
大成ラミック	600	2,887.00	1,732,200	
クミアイ化学工業	4,000	892.00	3,568,000	
日本農薬	4,600	1,353.00	6,223,800	
昭和シェル石油	18,100	1,125.00	20,362,500	
コスモ石油	56,000	173.00	9,688,000	
ニチレキ	2,000	979.00	1,958,000	
東燃ゼネラル石油	30,000	1,101.00	33,030,000	
ユシロ化学工業	1,200	1,541.00	1,849,200	
ビービー・カストロール	1,000	1,268.00	1,268,000	
富士石油	4,700	383.00	1,800,100	
MORESCO	600	2,125.00	1,275,000	
出光興産	9,600	2,079.00	19,958,400	
J Xホールディングス	223,900	467.00	104,561,300	
横浜ゴム	23,000	1,194.00	27,462,000	
東洋ゴム工業	9,100	2,575.00	23,432,500	
ブリヂストン	63,200	4,696.00	296,787,200	
住友ゴム工業	15,700	2,081.00	32,671,700	
藤倉ゴム工業	1,700	802.00	1,363,400	
オカモト	7,000	466.00	3,262,000	
アキレス	17,000	152.00	2,584,000	
フコク	800	1,194.00	955,200	
ニッタ	2,000	3,065.00	6,130,000	
クリエートメディック	1,200	1,017.00	1,220,400	
住友理工	3,700	1,007.00	3,725,900	
三ツ星ベルト	5,000	955.00	4,775,000	
バンドー化学	7,000	444.00	3,108,000	

鬼怒川ゴム工業	4,000	531.00	2,124,000	
旭硝子	99,000	730.00	72,270,000	
日本板硝子	97,000	117.00	11,349,000	
有沢製作所	3,400	1,016.00	3,454,400	
日本山村硝子	8,000	177.00	1,416,000	
日本電気硝子	39,000	572.00	22,308,000	
住友大阪セメント	37,000	358.00	13,246,000	
太平洋セメント	126,000	377.00	47,502,000	
リゾートソリューション	5,000	260.00	1,300,000	
日本ヒューム	2,100	877.00	1,841,700	
日本コンクリート工業	3,500	473.00	1,655,500	
三谷セキサン	1,000	2,031.00	2,031,000	
ジャパンパイル	2,700	704.00	1,900,800	
東海カーボン	17,000	358.00	6,086,000	
日本カーボン	11,000	287.00	3,157,000	
東洋炭素	1,100	2,218.00	2,439,800	
ノリタケカンパニーリミテド	11,000	288.00	3,168,000	
TOTO	30,000	1,592.00	47,760,000	
日本碍子	25,000	2,364.00	59,100,000	
日本特殊陶業	17,400	3,345.00	58,203,000	
MARUWA	600	2,713.00	1,627,800	
品川リフラクトリーズ	5,000	292.00	1,460,000	
黒崎播磨	5,000	247.00	1,235,000	
ヨータイ	3,000	381.00	1,143,000	
東京窯業	6,000	222.00	1,332,000	
ニッカトー	3,000	417.00	1,251,000	
フジインコーポレーテッド	2,000	1,949.00	3,898,000	
エーアンドエーマテリアル	11,000	120.00	1,320,000	
ニチアス	9,000	693.00	6,237,000	
新日鐵住金	853,000	314.50	268,268,500	
神戸製鋼所	349,000	224.00	78,176,000	
中山製鋼所	15,000	87.00	1,305,000	
合同製鐵	10,000	191.00	1,910,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	51,500	2,929.50	150,869,250	
日新製鋼	8,500	1,579.00	13,421,500	
東京製鐵	10,200	889.00	9,067,800	
共英製鋼	2,100	2,059.00	4,323,900	
大和工業	4,600	3,135.00	14,421,000	
東京鐵鋼	4,000	549.00	2,196,000	
大阪製鐵	1,300	2,119.00	2,754,700	

淀川製鋼所	14,000	473.00	6,622,000	
東洋鋼鈑	5,000	556.00	2,780,000	
丸一鋼管	6,200	2,822.00	17,496,400	
モリ工業	3,000	427.00	1,281,000	
大同特殊鋼	34,000	523.00	17,782,000	
日本冶金工業	15,800	247.00	3,902,600	
山陽特殊製鋼	12,000	474.00	5,688,000	
愛知製鋼	12,000	567.00	6,804,000	
日立金属	21,000	1,912.00	40,152,000	
日本金属	8,000	153.00	1,224,000	
大平洋金属	13,000	354.00	4,602,000	
新日本電工	12,300	311.00	3,825,300	
栗本鐵工所	10,000	232.00	2,320,000	
日本鑄鉄管	5,000	234.00	1,170,000	
日本製鋼所	29,000	483.00	14,007,000	
三菱製鋼	13,000	253.00	3,289,000	
日本精線	2,000	674.00	1,348,000	
日本軽金属ホールディングス	49,000	179.00	8,771,000	
三井金属鉱業	55,000	269.00	14,795,000	
東邦亜鉛	11,000	378.00	4,158,000	
三菱マテリアル	126,000	399.00	50,274,000	
住友金属鉱山	56,000	1,819.50	101,892,000	
DOWAホールディングス	24,000	957.00	22,968,000	
古河機械金属	31,000	207.00	6,417,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	2,461.00	4,922,000	
東邦チタニウム	3,400	775.00	2,635,000	
UACJ	23,000	329.00	7,567,000	
古河電気工業	59,000	211.00	12,449,000	
住友電気工業	76,000	1,544.50	117,382,000	
フジクラ	28,000	500.00	14,000,000	
昭和電線ホールディングス	23,000	100.00	2,300,000	
東京特殊電線	800	1,515.00	1,212,000	
タツタ電線	3,800	498.00	1,892,400	
沖電線	4,000	342.00	1,368,000	
平河ヒューテック	900	1,404.00	1,263,600	
リョービ	11,000	337.00	3,707,000	
アーレスティ	1,900	651.00	1,236,900	
アサヒホールディングス	3,000	2,007.00	6,021,000	
東洋製罐グループホールディングス	14,300	1,601.00	22,894,300	
ホッカフホールディングス	5,000	282.00	1,410,000	
コロナ	1,100	1,155.00	1,270,500	

横河ブリッジホールディングス	3,800	1,302.00	4,947,600	
駒井ハルテック	4,000	279.00	1,116,000	
高田機工	5,000	248.00	1,240,000	
三和ホールディングス	19,400	834.00	16,179,600	
文化シャッター	6,000	978.00	5,868,000	
三協立山	2,600	1,908.00	4,960,800	
東洋シャッター	1,500	842.00	1,263,000	
L I X I Lグループ	30,000	2,759.00	82,770,000	
日本ファイルコン	2,600	483.00	1,255,800	
ノーリツ	3,900	1,978.00	7,714,200	
長府製作所	2,200	3,005.00	6,611,000	
リンナイ	3,700	8,440.00	31,228,000	
ユニプレス	3,700	2,221.00	8,217,700	
日東精工	3,000	365.00	1,095,000	
岡部	4,000	1,057.00	4,228,000	
ジーテクト	1,400	1,081.00	1,513,400	
東プレ	3,900	1,697.00	6,618,300	
高周波熱錬	3,500	895.00	3,132,500	
東京製綱	14,000	208.00	2,912,000	
サンコール	1,000	657.00	657,000	
モリテックスチール	3,800	323.00	1,227,400	
バイオラックス	1,000	5,290.00	5,290,000	
日本発条	17,500	1,229.00	21,507,500	
中央発條	4,000	349.00	1,396,000	
三浦工業	9,000	1,406.00	12,654,000	
タクマ	7,000	965.00	6,755,000	
テクノプロ・ホールディング	2,100	2,634.00	5,531,400	
リブセンス	1,800	669.00	1,204,200	
ジャパンマテリアル	800	1,626.00	1,300,800	
アサンテ	800	1,258.00	1,006,400	
リクルートホールディングス	22,800	3,650.00	83,220,000	
ツガミ	6,000	711.00	4,266,000	
オークマ	13,000	1,122.00	14,586,000	
東芝機械	11,000	459.00	5,049,000	
アマダ	30,100	1,106.00	33,290,600	
アイダエンジニアリング	4,400	1,335.00	5,874,000	
滝澤鉄工所	6,000	222.00	1,332,000	
富士機械製造	6,600	1,324.00	8,738,400	
牧野フライス製作所	10,000	1,006.00	10,060,000	
オーエスジー	9,200	2,327.00	21,408,400	
ダイジェット工業	6,000	227.00	1,362,000	

旭ダイヤモンド工業	5,500	1,284.00	7,062,000
D M G 森精機	12,700	1,737.00	22,059,900
ディスコ	2,300	10,520.00	24,196,000
日東工器	1,200	2,164.00	2,596,800
豊田自動織機	17,500	6,630.00	116,025,000
豊和工業	1,600	746.00	1,193,600
大阪機工	8,000	162.00	1,296,000
石川製作所	12,000	102.00	1,224,000
津田駒工業	8,000	153.00	1,224,000
島精機製作所	2,800	2,055.00	5,754,000
日阪製作所	2,500	987.00	2,467,500
やまびこ	800	5,110.00	4,088,000
ペガサスミシン製造	2,100	617.00	1,295,700
ナブテスコ	12,300	3,145.00	38,683,500
三井海洋開発	2,000	1,983.00	3,966,000
レオン自動機	2,400	506.00	1,214,400
S M C	6,000	33,340.00	200,040,000
ホソカワミクロン	3,000	634.00	1,902,000
ユニオンツール	1,000	3,400.00	3,400,000
オイレス工業	2,500	2,102.00	5,255,000
日精エー・エス・ビー機械	600	2,285.00	1,371,000
サトーホールディングス	2,500	2,445.00	6,112,500
日本エアテック	1,800	669.00	1,204,200
日精樹脂工業	1,500	1,393.00	2,089,500
ワイエイシイ	1,900	664.00	1,261,600
小松製作所	100,000	2,451.50	245,150,000
住友重機械工業	55,000	743.00	40,865,000
日立建機	9,000	2,248.00	20,232,000
日工	3,000	421.00	1,263,000
巴工業	800	1,715.00	1,372,000
井関農機	21,000	248.00	5,208,000
T O W A	1,600	698.00	1,116,800
丸山製作所	5,000	231.00	1,155,000
北川鉄工所	9,000	259.00	2,331,000
シンニッタン	1,000	555.00	555,000
クボタ	97,000	1,903.50	184,639,500
荏原実業	900	1,410.00	1,269,000
東洋エンジニアリング	10,000	359.00	3,590,000
三菱化工機	7,000	452.00	3,164,000
月島機械	3,500	1,311.00	4,588,500
帝国電機製作所	1,300	1,206.00	1,567,800

新東工業	4,700	836.00	3,929,200
澁谷工業	1,700	2,214.00	3,763,800
アイチコーポレーション	2,900	583.00	1,690,700
小森コーポレーション	4,900	1,304.00	6,389,600
鶴見製作所	1,500	1,963.00	2,944,500
住友精密工業	3,000	477.00	1,431,000
酒井重工業	4,000	296.00	1,184,000
荏原製作所	42,000	479.00	20,118,000
西島製作所	2,000	915.00	1,830,000
北越工業	1,500	1,053.00	1,579,500
千代田化工建設	16,000	988.00	15,808,000
ダイキン工業	28,100	7,825.00	219,882,500
オルガノ	4,000	481.00	1,924,000
トーヨーカネツ	12,000	238.00	2,856,000
栗田工業	11,400	2,974.00	33,903,600
椿本チエイン	10,000	980.00	9,800,000
日本コンベヤ	6,000	231.00	1,386,000
日機装	6,200	1,020.00	6,324,000
木村化工機	2,400	499.00	1,197,600
新興プランテック	4,400	942.00	4,144,800
アネスト岩田	3,000	791.00	2,373,000
ダイフク	9,500	1,481.00	14,069,500
加藤製作所	4,000	777.00	3,108,000
油研工業	5,000	253.00	1,265,000
タダノ	9,000	1,435.00	12,915,000
フジテック	5,600	1,200.00	6,720,000
C K D	5,400	1,059.00	5,718,600
キトー	2,100	1,125.00	2,362,500
平和	4,200	2,488.00	10,449,600
理想科学工業	2,300	1,920.00	4,416,000
SANKYO	5,800	4,860.00	28,188,000
日本金銭機械	1,800	1,808.00	3,254,400
マースエンジニアリング	1,100	2,188.00	2,406,800
福島工業	1,100	1,706.00	1,876,600
オーイズミ	1,400	958.00	1,341,200
ダイコク電機	800	1,776.00	1,420,800
アマノ	6,400	1,422.00	9,100,800
JUKI	14,000	425.00	5,950,000
サンデン	12,000	614.00	7,368,000
蛇の目ミシン工業	19,000	151.00	2,869,000
ブラザー工業	24,900	2,021.00	50,322,900

マックス	3,000	1,365.00	4,095,000
モリタホールディングス	3,400	1,264.00	4,297,600
グローリー	6,200	3,160.00	19,592,000
新晃工業	1,300	1,296.00	1,684,800
大和冷機工業	2,800	724.00	2,027,200
セガサミーホールディングス	20,700	1,803.00	37,322,100
日本ピストンリング	8,000	255.00	2,040,000
リケン	8,000	470.00	3,760,000
T P R	2,100	2,973.00	6,243,300
ホシザキ電機	4,200	6,500.00	27,300,000
大豊工業	1,600	1,388.00	2,220,800
日本精工	40,000	1,622.00	64,880,000
N T N	45,000	561.00	25,245,000
ジェイテクト	20,500	1,841.00	37,740,500
不二越	18,000	674.00	12,132,000
ミネベア	29,000	1,840.00	53,360,000
日本トムソン	7,000	604.00	4,228,000
T H K	12,800	2,776.00	35,532,800
ユーシン精機	900	2,180.00	1,962,000
前澤給装工業	900	1,451.00	1,305,900
イーグル工業	2,700	2,449.00	6,612,300
日本ビラー工業	2,100	920.00	1,932,000
キッツ	8,600	614.00	5,280,400
日立製作所	463,000	834.70	386,466,100
東芝	406,000	490.00	198,940,000
三菱電機	193,000	1,367.50	263,927,500
富士電機	54,000	550.00	29,700,000
東洋電機製造	4,000	433.00	1,732,000
安川電機	22,600	1,616.00	36,521,600
シンフォニア テクノロジー	13,000	218.00	2,834,000
明電舎	18,000	382.00	6,876,000
オリジン電気	3,000	534.00	1,602,000
山洋電気	4,000	806.00	3,224,000
デンヨー	1,700	1,951.00	3,316,700
日立工機	5,200	926.00	4,815,200
三櫻工業	2,400	777.00	1,864,800
マキタ	12,600	5,680.00	71,568,000
東芝テック	14,000	738.00	10,332,000
芝浦メカトロニクス	4,000	288.00	1,152,000
マブチモーター	5,900	5,810.00	34,279,000
日本電産	20,800	8,262.00	171,849,600

東光高岳	1,000	1,799.00	1,799,000	
ダイヘン	11,000	587.00	6,457,000	
JVCケンウッド	14,100	405.00	5,710,500	
第一精工	700	2,345.00	1,641,500	
日新電機	5,000	684.00	3,420,000	
大崎電気工業	3,000	805.00	2,415,000	
オムロン	20,800	5,060.00	105,248,000	
日東工業	3,100	2,183.00	6,767,300	
I D E C	2,300	1,022.00	2,350,600	
不二電機工業	800	1,507.00	1,205,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	37,000	533.00	19,721,000	
サクサホールディングス	6,000	221.00	1,326,000	
メルコホールディングス	1,100	1,883.00	2,071,300	
日本電気	249,000	355.00	88,395,000	
富士通	186,000	717.60	133,473,600	
沖電気工業	67,000	258.00	17,286,000	
岩崎通信機	13,000	91.00	1,183,000	
電気興業	5,000	530.00	2,650,000	
サンケン電気	10,000	842.00	8,420,000	
アイホン	1,100	1,835.00	2,018,500	
ルネサスエレクトロニクス	10,000	887.00	8,870,000	
セイコーエプソン	13,100	4,445.00	58,229,500	
ワコム	15,200	620.00	9,424,000	
アルバック	3,200	1,888.00	6,041,600	
アクセル	900	1,691.00	1,521,900	
E I Z O	1,800	2,567.00	4,620,600	
ジャパンディスプレイ	29,700	501.00	14,879,700	
日本信号	5,300	1,207.00	6,397,100	
京三製作所	5,000	379.00	1,895,000	
能美防災	2,500	1,451.00	3,627,500	
ホーチキ	1,000	901.00	901,000	
エレコム	600	2,397.00	1,438,200	
日本無線	4,000	356.00	1,424,000	
パナソニック	234,800	1,442.50	338,699,000	
シャープ	163,000	244.00	39,772,000	
アンリツ	12,100	857.00	10,369,700	
富士通ゼネラル	6,000	1,291.00	7,746,000	
日立国際電気	5,000	1,598.00	7,990,000	
ソニー	124,600	3,205.50	399,405,300	
T D K	11,600	8,110.00	94,076,000	
帝国通信工業	5,000	241.00	1,205,000	

ミツミ電機	6,800	916.00	6,228,800
タムラ製作所	7,000	432.00	3,024,000
アルプス電気	15,200	2,682.00	40,766,400
バイオニア	28,900	247.00	7,138,300
日本電波工業	1,700	959.00	1,630,300
日本トリム	500	3,430.00	1,715,000
ローランド ディー . ジー .	800	3,215.00	2,572,000
フォスター電機	2,000	2,969.00	5,938,000
クラリオン	10,000	392.00	3,920,000
S M K	6,000	498.00	2,988,000
ヨコオ	2,000	651.00	1,302,000
東光	5,000	342.00	1,710,000
ティアック	21,000	60.00	1,260,000
ホシデン	6,100	645.00	3,934,500
ヒロセ電機	3,100	15,470.00	47,957,000
日本航空電子工業	6,000	2,758.00	16,548,000
T O A	2,100	1,192.00	2,503,200
日立マクセル	2,900	2,074.00	6,014,600
古野電気	2,300	1,160.00	2,668,000
ユニデン	5,000	223.00	1,115,000
アルパイン	4,600	1,998.00	9,190,800
スミダコーポレーション	1,900	645.00	1,225,500
アイコム	1,100	2,750.00	3,025,000
船井電機	1,900	1,346.00	2,557,400
横河電機	19,300	1,308.00	25,244,400
新電元工業	7,000	633.00	4,431,000
アズビル	6,300	3,150.00	19,845,000
日本光電工業	4,100	6,210.00	25,461,000
チノー	1,000	1,215.00	1,215,000
共和電業	1,500	482.00	723,000
堀場製作所	3,600	4,420.00	15,912,000
アドバンテスト	13,100	1,540.00	20,174,000
小野測器	1,300	935.00	1,215,500
エスベック	2,100	1,206.00	2,532,600
パナソニック デバイス S U N X	1,700	929.00	1,579,300
キーエンス	4,400	60,020.00	264,088,000
日置電機	1,000	1,895.00	1,895,000
シスメックス	14,900	6,110.00	91,039,000
メガチップス	2,000	1,385.00	2,770,000
O B A R A G R O U P	1,200	6,430.00	7,716,000

イマジカ・ロボット ホールディングス	2,300	694.00	1,596,200
澤藤電機	5,000	240.00	1,200,000
デンソー	47,600	5,589.00	266,036,400
コーセル	2,800	1,321.00	3,698,800
オブテックス	1,300	2,085.00	2,710,500
千代田インテグレ	800	2,244.00	1,795,200
レーザーテック	2,000	1,471.00	2,942,000
スタンレー電気	13,800	2,827.00	39,012,600
岩崎電気	7,000	230.00	1,610,000
ウシオ電機	11,700	1,475.00	17,257,500
ヘリオス テクノ ホールディング	2,900	429.00	1,244,100
日本セラミック	1,100	1,582.00	1,740,200
日本デジタル研究所	1,600	1,585.00	2,536,000
古河電池	1,000	960.00	960,000
双信電機	2,900	418.00	1,212,200
山一電機	2,200	909.00	1,999,800
図研	1,400	1,086.00	1,520,400
日本電子	8,000	574.00	4,592,000
カシオ計算機	19,300	2,010.00	38,793,000
ファナック	20,100	22,630.00	454,863,000
日本シイエムケイ	4,900	318.00	1,558,200
エンプラス	900	4,980.00	4,482,000
ローム	9,500	7,580.00	72,010,000
浜松ホトニクス	8,000	6,790.00	54,320,000
三井ハイテック	2,500	806.00	2,015,000
新光電気工業	7,300	910.00	6,643,000
京セラ	31,600	5,804.00	183,406,400
太陽誘電	10,100	1,404.00	14,180,400
村田製作所	20,200	13,590.00	274,518,000
ユーシン	2,700	727.00	1,962,900
双葉電子工業	3,300	1,925.00	6,352,500
日東電工	15,600	7,489.00	116,828,400
北陸電気工業	8,000	198.00	1,584,000
東海理化電機製作所	5,100	2,514.00	12,821,400
ニチコン	6,100	1,056.00	6,441,600
日本ケミコン	16,000	384.00	6,144,000
K O A	2,700	1,158.00	3,126,600
三井造船	75,000	211.00	15,825,000
日立造船	15,100	692.00	10,449,200
三菱重工業	323,000	654.60	211,435,800

川崎重工業	141,000	562.00	79,242,000
I H I	139,000	558.00	77,562,000
名村造船所	5,400	1,188.00	6,415,200
サノヤスホールディングス	4,200	288.00	1,209,600
日本車輛製造	7,000	367.00	2,569,000
ニチュ三菱フォークリフト	2,200	701.00	1,542,200
近畿車輛	3,000	413.00	1,239,000
F P G	1,600	2,867.00	4,587,200
島根銀行	800	1,473.00	1,178,400
じもとホールディングス	13,600	239.00	3,250,400
全国保証	4,900	3,830.00	18,767,000
足利ホールディングス	12,000	507.00	6,084,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	2,400	3,595.00	8,628,000
日産自動車	270,400	1,224.00	330,969,600
いすゞ自動車	60,900	1,682.50	102,464,250
トヨタ自動車	265,800	8,130.00	2,160,954,000
日野自動車	27,500	1,754.00	48,235,000
三菱自動車工業	70,600	1,083.00	76,459,800
エフテック	1,100	1,223.00	1,345,300
レシップホールディングス	1,400	869.00	1,216,600
武蔵精密工業	2,100	2,497.00	5,243,700
日産車体	8,500	1,546.00	13,141,000
新明和工業	8,000	1,240.00	9,920,000
極東開発工業	3,600	1,336.00	4,809,600
日信工業	3,500	1,851.00	6,478,500
トピー工業	16,000	284.00	4,544,000
ティラド	7,000	257.00	1,799,000
曙ブレーキ工業	8,100	446.00	3,612,600
タチエス	3,100	1,596.00	4,947,600
N O K	9,300	3,290.00	30,597,000
フタバ産業	5,900	582.00	3,433,800
カヤバ工業	22,000	452.00	9,944,000
シロキ工業	4,000	324.00	1,296,000
市光工業	5,000	239.00	1,195,000
大同メタル工業	2,700	1,164.00	3,142,800
プレス工業	10,000	467.00	4,670,000
カルソニックカンセイ	15,000	689.00	10,335,000
太平洋工業	3,900	1,015.00	3,958,500
ケーヒン	4,400	1,929.00	8,487,600
河西工業	2,400	1,016.00	2,438,400
アイシン精機	17,600	4,390.00	77,264,000

マツダ	57,400	2,521.00	144,705,400
ダイハツ工業	23,000	1,750.00	40,250,000
今仙電機製作所	1,600	1,541.00	2,465,600
本田技研工業	173,400	3,928.50	681,201,900
スズキ	40,300	3,789.50	152,716,850
富士重工業	65,600	4,082.00	267,779,200
ヤマハ発動機	29,300	2,788.00	81,688,400
ショーワ	4,500	1,235.00	5,557,500
小糸製作所	11,500	3,760.00	43,240,000
T B K	2,500	652.00	1,630,000
エクセディ	2,600	2,785.00	7,241,000
ミツバ	3,500	2,209.00	7,731,500
豊田合成	6,200	2,624.00	16,268,800
愛三工業	3,000	1,101.00	3,303,000
ヨロズ	1,800	2,342.00	4,215,600
エフ・シー・シー	2,800	1,987.00	5,563,600
新家工業	7,000	191.00	1,337,000
シマノ	8,300	16,860.00	139,938,000
タカタ	3,500	1,332.00	4,662,000
テイ・エス テック	4,100	3,205.00	13,140,500
小野建	1,700	1,069.00	1,817,300
はるやま商事	1,600	751.00	1,201,600
佐鳥電機	1,600	818.00	1,308,800
カッパ・クリエイトホールディングス	3,000	1,141.00	3,423,000
エコートレーディング	1,800	680.00	1,224,000
伯東	1,300	1,357.00	1,764,100
コンドーテック	1,600	797.00	1,275,200
ナガイレーベン	2,700	2,215.00	5,980,500
三菱食品	2,100	2,495.00	5,239,500
良品計画	2,400	14,700.00	35,280,000
三城ホールディングス	2,600	477.00	1,240,200
松田産業	1,400	1,502.00	2,102,800
メディパルホールディングス	19,000	1,492.00	28,348,000
アドヴァン	1,000	1,444.00	1,444,000
アズワン	1,400	3,525.00	4,935,000
尾家産業	1,400	869.00	1,216,600
シモジマ	1,200	1,095.00	1,314,000
ドウシシャ	2,500	2,007.00	5,017,500
小津産業	600	2,104.00	1,262,400
コナカ	2,200	699.00	1,537,800
高速	1,400	879.00	1,230,600

ハウス オブ ローゼ	800	1,443.00	1,154,400
G - 7ホールディングス	1,100	1,075.00	1,182,500
イオン北海道	1,700	700.00	1,190,000
ヒマラヤ	1,200	1,004.00	1,204,800
コーナン商事	2,900	1,413.00	4,097,700
黒田電気	3,200	1,763.00	5,641,600
ネットワンシステムズ	7,700	811.00	6,244,700
ワタミ	2,200	1,150.00	2,530,000
マルシェ	1,300	907.00	1,179,100
ドンキホーテホールディングス	6,100	8,530.00	52,033,000
丸文	1,700	796.00	1,353,200
西松屋チェーン	3,700	944.00	3,492,800
ゼンショーホールディングス	9,800	1,075.00	10,535,000
ハピネット	1,200	1,326.00	1,591,200
幸楽苑	1,200	1,556.00	1,867,200
ハークスレイ	1,200	1,040.00	1,248,000
サイゼリヤ	2,800	2,040.00	5,712,000
エクセル	900	1,397.00	1,257,300
マルカキカイ	600	1,697.00	1,018,200
アルゴグラフィックス	800	1,748.00	1,398,400
ガリバーインターナショナル	5,800	939.00	5,446,200
日本エム・ディ・エム	2,000	610.00	1,220,000
ユナイテッドアローズ	2,500	3,680.00	9,200,000
進和	1,100	1,405.00	1,545,500
エスケイジャパン	5,300	235.00	1,245,500
ダイトエレクトロン	1,800	695.00	1,251,000
ハイデイ日高	1,200	3,795.00	4,554,000
シークス	1,200	2,479.00	2,974,800
京都きもの友禅	1,200	1,010.00	1,212,000
コロワイド	6,300	1,664.00	10,483,200
オーハシテクニカ	1,200	1,614.00	1,936,800
壱番屋	900	5,140.00	4,626,000
マクニカ	1,000	3,780.00	3,780,000
白銅	1,000	1,205.00	1,205,000
トップカルチャー	2,400	500.00	1,200,000
P L A N T	900	1,327.00	1,194,300
スギホールディングス	3,400	5,850.00	19,890,000
島津製作所	23,000	1,254.00	28,842,000
J M S	4,000	295.00	1,180,000
ブイ・テクノロジー	500	2,373.00	1,186,500
スター精密	3,700	1,600.00	5,920,000

東京計器	7,000	270.00	1,890,000
オーバル	3,600	341.00	1,227,600
東京精密	3,500	2,613.00	9,145,500
マニー	500	7,180.00	3,590,000
ニコン	36,000	1,545.00	55,620,000
トプコン	5,800	2,480.00	14,384,000
オリンパス	28,700	4,380.00	125,706,000
理研計器	1,700	1,260.00	2,142,000
S C R E E Nホールディングス	18,000	801.00	14,418,000
キヤノン電子	1,800	2,294.00	4,129,200
タムロン	1,500	2,326.00	3,489,000
H O Y A	45,800	4,843.50	221,832,300
ノーリツ鋼機	1,800	670.00	1,206,000
エー・アンド・デイ	2,600	482.00	1,253,200
キヤノン	111,700	3,843.00	429,263,100
リコー	57,900	1,226.50	71,014,350
シチズンホールディングス	23,700	933.00	22,112,100
リズム時計工業	8,000	159.00	1,272,000
大研医器	1,300	1,170.00	1,521,000
パラマウントベッドホールディングス	2,000	3,130.00	6,260,000
S H O B I	3,000	410.00	1,230,000
前田工織	1,900	1,030.00	1,957,000
永大産業	3,000	446.00	1,338,000
アートネイチャー	1,400	1,090.00	1,526,000
ダンロップスポーツ	1,200	1,291.00	1,549,200
バンダイナムコホールディングス	21,200	2,177.00	46,152,400
共立印刷	4,100	302.00	1,238,200
フランスベッドホールディングス	14,000	184.00	2,576,000
マーベラス	3,200	1,826.00	5,843,200
パイロットコーポレーション	1,700	6,750.00	11,475,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,800	2,010.00	7,638,000
トッパン・フォームズ	3,400	1,251.00	4,253,400
フジシールインターナショナル	2,400	3,555.00	8,532,000
タカラトミー	6,900	689.00	4,754,100
廣済堂	2,500	520.00	1,300,000
レック	900	1,401.00	1,260,900
タカノ	2,000	605.00	1,210,000
プロネクサス	2,000	800.00	1,600,000
ホクシン	9,400	134.00	1,259,600
ウッドワン	4,000	271.00	1,084,000

大建工業	8,000	278.00	2,224,000
きもと	4,300	294.00	1,264,200
凸版印刷	54,000	846.00	45,684,000
大日本印刷	59,000	1,157.00	68,263,000
図書印刷	4,000	331.00	1,324,000
共同印刷	6,000	389.00	2,334,000
日本写真印刷	3,200	2,432.00	7,782,400
光村印刷	4,000	271.00	1,084,000
藤森工業	1,700	3,705.00	6,298,500
前澤化成工業	1,400	1,332.00	1,864,800
アシックス	19,100	2,971.00	56,746,100
ツツミ	1,000	2,673.00	2,673,000
J S P	1,500	2,398.00	3,597,000
ニチハ	2,700	1,319.00	3,561,300
エフピコ	1,800	4,175.00	7,515,000
小松ウオール工業	600	2,581.00	1,548,600
ヤマハ	14,200	2,055.00	29,181,000
河合楽器製作所	700	2,251.00	1,575,700
クリナップ	1,800	918.00	1,652,400
ビジョン	3,600	8,000.00	28,800,000
天馬	1,600	1,786.00	2,857,600
キングジム	1,600	788.00	1,260,800
リンテック	4,600	2,790.00	12,834,000
信越ポリマー	4,000	572.00	2,288,000
東リ	5,000	259.00	1,295,000
イトーキ	4,100	689.00	2,824,900
任天堂	11,900	12,175.00	144,882,500
三菱鉛筆	1,600	4,000.00	6,400,000
松風	900	1,385.00	1,246,500
タカラスタンダード	8,000	995.00	7,960,000
コクヨ	10,000	1,027.00	10,270,000
ニフコ	4,500	4,090.00	18,405,000
グローブライド	9,000	170.00	1,530,000
岡村製作所	7,400	864.00	6,393,600
日本バルカー工業	8,000	316.00	2,528,000
伊藤忠商事	159,100	1,314.00	209,057,400
丸紅	166,300	724.00	120,401,200
スクロール	4,200	289.00	1,213,800
高島	5,000	260.00	1,300,000
ヨンドシーホールディングス	1,400	2,045.00	2,863,000
三陽商会	11,000	305.00	3,355,000

長瀬産業	11,600	1,522.00	17,655,200	
蝶理	1,200	1,912.00	2,294,400	
豊田通商	21,200	3,145.00	66,674,000	
オンワードホールディングス	14,000	826.00	11,564,000	
三共生興	3,200	475.00	1,520,000	
兼松	38,000	179.00	6,802,000	
美津濃	10,000	592.00	5,920,000	
ツカモトコーポレーション	9,000	141.00	1,269,000	
ファミリーマート	6,400	5,480.00	35,072,000	
ルック	6,000	221.00	1,326,000	
三井物産	161,200	1,624.00	261,788,800	
日本紙パルプ商事	10,000	340.00	3,400,000	
東京エレクトロン	16,200	9,054.00	146,674,800	
日立ハイテクノロジーズ	6,600	3,690.00	24,354,000	
カメイ	2,500	848.00	2,120,000	
東都水産	6,000	200.00	1,200,000	
スターゼン	7,000	424.00	2,968,000	
セイコーホールディングス	14,000	644.00	9,016,000	
山善	7,300	884.00	6,453,200	
椿本興業	4,000	302.00	1,208,000	
住友商事	112,200	1,293.50	145,130,700	
日本ユニシス	5,200	1,118.00	5,813,600	
内田洋行	5,000	370.00	1,850,000	
三菱商事	145,700	2,356.00	343,269,200	
第一実業	5,000	600.00	3,000,000	
キヤノンマーケティングジャパン	5,400	2,224.00	12,009,600	
西華産業	6,000	298.00	1,788,000	
佐藤商事	1,700	795.00	1,351,500	
菱洋エレクトロ	2,200	1,279.00	2,813,800	
東京産業	2,500	483.00	1,207,500	
ユアサ商事	1,700	2,441.00	4,149,700	
神鋼商事	5,000	273.00	1,365,000	
小林産業	4,800	257.00	1,233,600	
阪和興業	19,000	467.00	8,873,000	
カナデン	2,000	830.00	1,660,000	
菱電商事	3,000	850.00	2,550,000	
ニプロ	12,300	1,102.00	13,554,600	
フルサト工業	1,000	1,705.00	1,705,000	
岩谷産業	21,000	819.00	17,199,000	
すてきナイスグループ	8,000	197.00	1,576,000	
昭光通商	8,000	151.00	1,208,000	

イワキ	5,000	223.00	1,115,000
兼松エレクトロニクス	1,200	1,783.00	2,139,600
三愛石油	5,000	860.00	4,300,000
稲畑産業	4,600	1,133.00	5,211,800
ゴールドウイン	5,000	817.00	4,085,000
ユニ・チャーム	40,800	3,349.00	136,639,200
デサント	4,600	1,333.00	6,131,800
キング	2,900	434.00	1,258,600
ワキタ	4,000	1,160.00	4,640,000
ヤマトインターナショナル	2,900	427.00	1,238,300
東邦ホールディングス	6,600	1,987.00	13,114,200
サンゲツ	3,400	3,485.00	11,849,000
ミツウロコグループホールディングス	3,100	584.00	1,810,400
シナネン	4,000	487.00	1,948,000
伊藤忠エネクス	4,200	973.00	4,086,600
サンリオ	5,300	3,485.00	18,470,500
サンワテクノス	1,200	1,206.00	1,447,200
リョーサン	3,200	2,694.00	8,620,800
新光商事	2,200	1,147.00	2,523,400
トーヨー	4,000	457.00	1,828,000
三信電気	2,600	951.00	2,472,600
東陽テクニカ	2,800	1,225.00	3,430,000
モスフードサービス	2,500	2,431.00	6,077,500
加賀電子	1,700	1,394.00	2,369,800
三益半導体工業	1,500	1,371.00	2,056,500
ソーダニッカ	2,000	543.00	1,086,000
立花エレテック	1,200	1,835.00	2,202,000
木曽路	2,300	2,130.00	4,899,000
サトレストランシステムズ	1,800	1,091.00	1,963,800
千趣会	3,400	843.00	2,866,200
ケーヨー	3,600	575.00	2,070,000
アデランス	2,200	1,098.00	2,415,600
上新電機	4,000	977.00	3,908,000
日本瓦斯	3,000	3,145.00	9,435,000
ベスト電器	7,800	147.00	1,146,600
マルエツ	5,000	499.00	2,495,000
ロイヤルホールディングス	3,200	1,814.00	5,804,800
東天紅	6,000	195.00	1,170,000
いなげや	2,100	1,450.00	3,045,000
島忠	4,600	3,085.00	14,191,000
チヨダ	2,200	2,734.00	6,014,800

ライフコーポレーション	1,200	1,755.00	2,106,000
カスミ	3,900	979.00	3,818,100
リンガーハット	1,800	2,177.00	3,918,600
MR MAX	4,300	285.00	1,225,500
テンアライド	3,100	388.00	1,202,800
AOKIホールディングス	4,400	1,456.00	6,406,400
オークワ	3,000	971.00	2,913,000
コメリ	3,300	2,811.00	9,276,300
青山商事	4,800	4,030.00	19,344,000
しまむら	2,200	10,890.00	23,958,000
CFSコーポレーション	1,400	882.00	1,234,800
高島屋	28,000	1,085.00	30,380,000
松屋	3,800	1,788.00	6,794,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,000	2,169.00	19,521,000
近鉄百貨店	7,000	351.00	2,457,000
ニッセンホールディングス	4,100	289.00	1,184,900
パルコ	1,800	1,041.00	1,873,800
丸井グループ	22,900	1,365.00	31,258,500
クレディセゾン	15,500	2,240.00	34,720,000
アクシアル リテイリング	1,500	3,100.00	4,650,000
イオン	78,400	1,301.50	102,037,600
ユニーグループ・ホールディングス	18,200	717.00	13,049,400
イズミ	4,200	4,355.00	18,291,000
平和堂	3,900	2,508.00	9,781,200
フジ	2,100	2,193.00	4,605,300
ヤオコー	1,100	7,990.00	8,789,000
ゼビオ	2,600	2,186.00	5,683,600
ケーズホールディングス	4,400	3,425.00	15,070,000
Paltac	3,000	1,676.00	5,028,000
Olympicグループ	1,500	814.00	1,221,000
新生銀行	181,000	225.00	40,725,000
あおぞら銀行	128,000	433.00	55,424,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,525,500	752.70	1,148,243,850
りそなホールディングス	222,400	664.60	147,807,040
三井住友トラスト・ホールディングス	420,000	491.00	206,220,000
三井住友フィナンシャルグループ	143,800	4,602.50	661,839,500
第四銀行	24,000	452.00	10,848,000
北越銀行	21,000	247.00	5,187,000
西日本シティ銀行	67,000	390.00	26,130,000
千葉銀行	74,000	919.00	68,006,000
横浜銀行	131,000	743.60	97,411,600

常陽銀行	69,000	649.00	44,781,000	
群馬銀行	45,000	851.00	38,295,000	
武蔵野銀行	3,000	4,270.00	12,810,000	
千葉興業銀行	3,900	849.00	3,311,100	
筑波銀行	7,900	403.00	3,183,700	
七十七銀行	32,000	727.00	23,264,000	
青森銀行	15,000	381.00	5,715,000	
秋田銀行	13,000	382.00	4,966,000	
山形銀行	11,000	532.00	5,852,000	
岩手銀行	1,300	5,300.00	6,890,000	
東邦銀行	17,000	485.00	8,245,000	
東北銀行	10,000	169.00	1,690,000	
みちのく銀行	9,000	215.00	1,935,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	77,000	663.00	51,051,000	
静岡銀行	56,000	1,229.00	68,824,000	
十六銀行	24,000	461.00	11,064,000	
スルガ銀行	20,100	2,477.00	49,787,700	
八十二銀行	34,000	894.00	30,396,000	
山梨中央銀行	12,000	517.00	6,204,000	
大垣共立銀行	24,000	415.00	9,960,000	
福井銀行	16,000	275.00	4,400,000	
北國銀行	21,000	425.00	8,925,000	
清水銀行	600	3,125.00	1,875,000	
滋賀銀行	19,000	726.00	13,794,000	
南都銀行	18,000	415.00	7,470,000	
百五銀行	18,000	578.00	10,404,000	
京都銀行	36,000	1,178.00	42,408,000	
紀陽銀行	7,500	1,646.00	12,345,000	
三重銀行	8,000	298.00	2,384,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	129,000	281.00	36,249,000	
広島銀行	56,000	650.00	36,400,000	
山陰合同銀行	12,000	1,042.00	12,504,000	
中国銀行	13,700	1,865.00	25,550,500	
鳥取銀行	6,000	266.00	1,596,000	
伊予銀行	20,300	1,512.00	30,693,600	
百十四銀行	21,000	424.00	8,904,000	
四国銀行	15,000	257.00	3,855,000	
阿波銀行	16,000	687.00	10,992,000	
鹿児島銀行	13,000	825.00	10,725,000	
大分銀行	12,000	448.00	5,376,000	
宮崎銀行	13,000	479.00	6,227,000	

肥後銀行	16,000	734.00	11,744,000
佐賀銀行	12,000	306.00	3,672,000
十八銀行	12,000	374.00	4,488,000
沖縄銀行	1,500	5,090.00	7,635,000
琉球銀行	3,900	1,827.00	7,125,300
セブン銀行	64,100	603.00	38,652,300
みずほフィナンシャルグループ	2,632,600	218.70	575,749,620
山口フィナンシャルグループ	19,000	1,376.00	26,144,000
芙蓉総合リース	2,000	4,275.00	8,550,000
興銀リース	3,600	2,480.00	8,928,000
東京センチュリーリース	4,500	3,050.00	13,725,000
SBIホールディングス	22,800	1,413.00	32,216,400
日本証券金融	9,000	643.00	5,787,000
アイフル	31,800	447.00	14,214,600
ポケットカード	900	557.00	501,300
長野銀行	6,000	212.00	1,272,000
名古屋銀行	17,000	466.00	7,922,000
北洋銀行	28,600	470.00	13,442,000
愛知銀行	700	6,030.00	4,221,000
第三銀行	11,000	206.00	2,266,000
中京銀行	8,000	219.00	1,752,000
東日本銀行	8,000	389.00	3,112,000
大光銀行	7,000	242.00	1,694,000
愛媛銀行	11,000	256.00	2,816,000
トマト銀行	8,000	193.00	1,544,000
みなと銀行	17,000	278.00	4,726,000
京葉銀行	16,000	708.00	11,328,000
関西アーバン銀行	2,600	1,303.00	3,387,800
栃木銀行	10,000	621.00	6,210,000
北日本銀行	600	3,050.00	1,830,000
東和銀行	26,000	105.00	2,730,000
福島銀行	23,000	94.00	2,162,000
大東銀行	12,000	157.00	1,884,000
リコーリース	1,500	3,425.00	5,137,500
イオンフィナンシャルサービス	12,500	2,620.00	32,750,000
アコム	38,200	380.00	14,516,000
ジャックス	10,000	574.00	5,740,000
オリエントコーポレーション	43,900	199.00	8,736,100
日立キャピタル	3,700	2,498.00	9,242,600
アプラスフィナンシャル	9,100	137.00	1,246,700
オリックス	134,600	1,593.00	214,417,800

三菱UFJリース	48,200	581.00	28,004,200
ジャフコ	2,600	4,615.00	11,999,000
トモニホールディングス	14,600	553.00	8,073,800
大和証券グループ本社	178,000	932.30	165,949,400
野村ホールディングス	388,700	718.70	279,358,690
岡三証券グループ	16,000	923.00	14,768,000
丸三証券	6,000	875.00	5,250,000
東洋証券	8,000	374.00	2,992,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,800	852.00	18,573,600
光世証券	5,000	235.00	1,175,000
水戸証券	5,900	446.00	2,631,400
いちよし証券	4,000	1,338.00	5,352,000
松井証券	9,700	1,102.00	10,689,400
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	42,300	3,513.00	148,599,900
だいこう証券ビジネス	1,400	813.00	1,138,200
日本取引所グループ	27,900	3,030.00	84,537,000
マネックスグループ	22,400	284.00	6,361,600
カブドットコム証券	8,400	733.00	6,157,200
極東証券	2,500	1,864.00	4,660,000
岩井コスモホールディングス	1,900	1,471.00	2,794,900
フィデアホールディングス	10,900	237.00	2,583,300
池田泉州ホールディングス	15,700	572.00	8,980,400
アニコムホールディングス	800	1,801.00	1,440,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	60,600	3,204.50	194,192,700
マネースクウェアHD	900	1,390.00	1,251,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	18,200	1,788.00	32,541,600
マネーパートナーズグループ	3,100	418.00	1,295,800
第一生命保険	121,800	1,761.00	214,489,800
東京海上ホールディングス	78,200	4,255.00	332,741,000
イー・ギャランティ	700	1,852.00	1,296,400
アサックス	700	1,668.00	1,167,600
NECキャピタルソリューション	800	1,951.00	1,560,800
T&Dホールディングス	69,300	1,521.50	105,439,950
三井不動産	101,000	3,367.00	340,067,000
三菱地所	141,000	2,728.00	384,648,000
平和不動産	3,600	1,698.00	6,112,800
東京建物	41,000	907.00	37,187,000
ダイビル	4,900	1,110.00	5,439,000

京阪神ビルディング	3,100	723.00	2,241,300
住友不動産	46,000	4,175.00	192,050,000
大京	30,000	178.00	5,340,000
テーオーシー	6,500	760.00	4,940,000
東京楽天地	3,000	501.00	1,503,000
レオパレス21	20,800	690.00	14,352,000
スターツコーポレーション	2,200	1,697.00	3,733,400
フジ住宅	2,400	681.00	1,634,400
空港施設	2,300	704.00	1,619,200
明和地所	2,500	496.00	1,240,000
住友不動産販売	1,400	3,195.00	4,473,000
ゴールドクレスト	1,700	2,070.00	3,519,000
リロ・ホールディング	700	9,940.00	6,958,000
日本エスリード	1,000	1,204.00	1,204,000
日神不動産	2,500	492.00	1,230,000
タカラレーベン	8,400	561.00	4,712,400
サンヨーハウジング名古屋	1,100	1,299.00	1,428,900
イオンモール	12,300	2,376.00	29,224,800
トーセイ	2,600	759.00	1,973,400
穴吹興産	5,000	250.00	1,250,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	11,800	1,244.00	14,679,200
サンフロンティア不動産	2,000	1,000.00	2,000,000
エフ・ジェー・ネクスト	2,300	539.00	1,239,700
ランドビジネス	3,100	405.00	1,255,500
グランディハウス	4,100	305.00	1,250,500
東武鉄道	103,000	598.00	61,594,000
相鉄ホールディングス	33,000	584.00	19,272,000
東京急行電鉄	105,000	839.00	88,095,000
京浜急行電鉄	53,000	984.00	52,152,000
小田急電鉄	62,000	1,269.00	78,678,000
京王電鉄	54,000	995.00	53,730,000
京成電鉄	29,000	1,553.00	45,037,000
富士急行	5,000	1,246.00	6,230,000
東日本旅客鉄道	35,300	10,115.00	357,059,500
西日本旅客鉄道	18,500	6,883.00	127,335,500
東海旅客鉄道	17,300	23,110.00	399,803,000
西武ホールディングス	15,300	3,090.00	47,277,000
鴻池運輸	1,200	2,429.00	2,914,800
西日本鉄道	25,000	534.00	13,350,000
ハマキョウレックス	600	4,115.00	2,469,000
サカイ引越センター	300	3,730.00	1,119,000

近畿日本鉄道	194,000	466.00	90,404,000	
阪急阪神ホールディングス	129,000	749.00	96,621,000	
南海電気鉄道	43,000	495.00	21,285,000	
京阪電気鉄道	43,000	728.00	31,304,000	
神戸電鉄	5,000	382.00	1,910,000	
名古屋鉄道	70,000	500.00	35,000,000	
山陽電気鉄道	7,000	487.00	3,409,000	
トランコム	600	5,080.00	3,048,000	
日本通運	76,000	669.00	50,844,000	
ヤマトホールディングス	33,900	2,826.00	95,801,400	
山九	23,000	507.00	11,661,000	
日新	7,000	313.00	2,191,000	
丸全昭和運輸	6,000	408.00	2,448,000	
センコー	8,000	704.00	5,632,000	
トナミホールディングス	4,000	471.00	1,884,000	
日本梱包運輸倉庫	6,300	1,898.00	11,957,400	
日本石油輸送	5,000	241.00	1,205,000	
福山通運	12,000	651.00	7,812,000	
セイノーホールディングス	15,000	1,327.00	19,905,000	
神奈川中央交通	2,000	601.00	1,202,000	
日立物流	4,000	1,729.00	6,916,000	
日本郵船	163,000	346.00	56,398,000	
商船三井	102,000	428.00	43,656,000	
川崎汽船	85,000	343.00	29,155,000	
N S ユナイテッド海運	9,000	301.00	2,709,000	
飯野海運	10,000	636.00	6,360,000	
日本航空	36,900	3,740.00	138,006,000	
A N A ホールディングス	379,000	324.40	122,947,600	
バスコ	1,000	339.00	339,000	
三菱倉庫	13,000	1,837.00	23,881,000	
三井倉庫ホールディングス	11,000	412.00	4,532,000	
住友倉庫	14,000	696.00	9,744,000	
澁澤倉庫	5,000	357.00	1,785,000	
ヤマタネ	9,000	191.00	1,719,000	
乾汽船	1,300	971.00	1,262,300	
日本トランスシティ	4,000	390.00	1,560,000	
ケイヒン	6,000	201.00	1,206,000	
安田倉庫	1,500	1,027.00	1,540,500	
東洋埠頭	6,000	205.00	1,230,000	
宇徳	1,900	656.00	1,246,400	
上組	23,000	1,180.00	27,140,000	

サンリツ	2,200	564.00	1,240,800
キューソー流通システム	900	1,389.00	1,250,100
郵船ロジスティクス	1,800	1,509.00	2,716,200
近鉄エクスプレス	1,700	4,880.00	8,296,000
エーアイティー	1,000	1,297.00	1,297,000
東京放送ホールディングス	11,400	1,375.00	15,675,000
日本テレビホールディングス	17,400	1,922.00	33,442,800
朝日放送	1,900	958.00	1,820,200
テレビ朝日ホールディングス	5,200	1,773.00	9,219,600
スカパーJ S A Tホールディングス	14,400	735.00	10,584,000
テレビ東京ホールディングス	1,500	2,296.00	3,444,000
コネクシオ	1,300	1,082.00	1,406,600
日本電信電話	74,400	7,336.00	545,798,400
K D D I	64,400	8,260.00	531,944,000
光通信	1,700	7,870.00	13,379,000
N T T ドコモ	156,700	2,128.50	333,535,950
G M O インターネット	6,300	1,154.00	7,270,200
K A D O K A W A ・ D W A N G O	4,700	1,931.00	9,075,700
学研ホールディングス	6,000	260.00	1,560,000
ゼンリン	2,500	1,500.00	3,750,000
昭文社	1,400	964.00	1,349,600
インプレスホールディングス	9,600	131.00	1,257,600
東京電力	163,400	476.00	77,778,400
中部電力	58,900	1,481.50	87,260,350
関西電力	78,600	1,054.00	82,844,400
中国電力	26,600	1,595.00	42,427,000
北陸電力	18,900	1,647.00	31,128,300
東北電力	48,100	1,400.00	67,340,000
四国電力	17,300	1,694.00	29,306,200
九州電力	42,500	1,034.00	43,945,000
北海道電力	18,000	937.00	16,866,000
沖縄電力	1,300	4,090.00	5,317,000
電源開発	13,000	4,190.00	54,470,000
東京瓦斯	234,000	734.00	171,756,000
大阪瓦斯	199,000	492.50	98,007,500
東邦瓦斯	49,000	685.00	33,565,000
北海道瓦斯	4,000	288.00	1,152,000
西部瓦斯	22,000	269.00	5,918,000
静岡瓦斯	5,500	845.00	4,647,500
メタウォーター	900	2,371.00	2,133,900
アイネット	1,300	919.00	1,194,700

松竹	13,000	1,195.00	15,535,000
東宝	13,600	2,925.00	39,780,000
エイチ・アイ・エス	3,300	4,080.00	13,464,000
東映	7,000	701.00	4,907,000
エヌ・ティ・ティ・データ	11,700	4,670.00	54,639,000
共立メンテナンス	1,000	6,670.00	6,670,000
イチネンホールディングス	2,100	1,031.00	2,165,100
建設技術研究所	1,200	1,343.00	1,611,600
スペース	1,100	1,220.00	1,342,000
アインファーマシーズ	2,300	4,340.00	9,982,000
燦ホールディングス	700	1,757.00	1,229,900
東京テアトル	8,000	143.00	1,144,000
よみうりランド	4,000	479.00	1,916,000
東京都競馬	14,000	318.00	4,452,000
常磐興産	8,000	153.00	1,224,000
カナモト	2,700	3,055.00	8,248,500
東京ドーム	14,000	562.00	7,868,000
D T S	2,000	2,188.00	4,376,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,900	2,359.00	16,277,100
シーイーシー	1,200	1,000.00	1,200,000
カプコン	4,900	2,107.00	10,324,300
西尾レントオール	1,600	3,115.00	4,984,000
日本空港ビルデング	6,600	5,710.00	37,686,000
トランス・コスモス	2,600	2,423.00	6,299,800
乃村工藝社	3,900	1,201.00	4,683,900
S C S K	4,500	3,095.00	13,927,500
藤田観光	7,000	516.00	3,612,000
K N T - C Tホールディングス	10,000	161.00	1,610,000
日本管財	1,000	2,666.00	2,666,000
トーカイ	900	3,870.00	3,483,000
白洋舎	5,000	247.00	1,235,000
セコム	19,500	7,330.00	142,935,000
セントラル警備保障	900	1,301.00	1,170,900
アイネス	2,600	851.00	2,212,600
丹青社	2,300	816.00	1,876,800
メイテック	2,700	3,590.00	9,693,000
T K C	1,600	2,239.00	3,582,400
アサツー ディ・ケイ	3,800	3,330.00	12,654,000
富士ソフト	2,600	2,512.00	6,531,200
応用地質	2,100	1,713.00	3,597,300

船井総研ホールディングス	2,200	982.00	2,160,400
NSD	4,000	1,873.00	7,492,000
進学会	2,600	469.00	1,219,400
コナミ	7,700	2,345.00	18,056,500
ベネッセホールディングス	7,400	3,770.00	27,898,000
イオンディライト	1,900	2,799.00	5,318,100
ナック	1,300	1,054.00	1,370,200
福井コンピュータホールディングス	1,400	822.00	1,150,800
ニチイ学館	3,900	1,157.00	4,512,300
ダイセキ	3,200	2,056.00	6,579,200
ステップ	1,500	844.00	1,266,000
日鉄住金物産	12,000	414.00	4,968,000
元気寿司	600	2,774.00	1,664,400
トラスコ中山	2,400	3,325.00	7,980,000
ヤマダ電機	75,200	507.00	38,126,400
オートバックスセブン	7,000	1,876.00	13,132,000
アークランドサカモト	1,400	2,494.00	3,491,600
ニトリホールディングス	8,200	7,660.00	62,812,000
グルメ杵屋	1,000	985.00	985,000
愛眼	4,900	249.00	1,220,100
吉野家ホールディングス	5,400	1,328.00	7,171,200
加藤産業	2,700	2,358.00	6,366,600
イノテック	2,700	457.00	1,233,900
イエローハット	1,800	2,417.00	4,350,600
富士エレクトロニクス	1,000	1,549.00	1,549,000
松屋フーズ	900	2,499.00	2,249,100
JBCホールディングス	1,600	778.00	1,244,800
JKホールディングス	2,100	577.00	1,211,700
サガミチェーン	2,000	1,186.00	2,372,000
日伝	800	2,514.00	2,011,200
関西スーパーマーケット	1,500	800.00	1,200,000
北沢産業	6,700	182.00	1,219,400
杉本商事	1,000	1,296.00	1,296,000
因幡電機産業	2,800	4,050.00	11,340,000
王将フードサービス	1,400	4,515.00	6,321,000
ブレナス	2,100	2,399.00	5,037,900
ミニストップ	1,400	1,648.00	2,307,200
アークス	3,300	2,461.00	8,121,300
パロー	4,100	2,428.00	9,954,800
バイテック	1,200	1,033.00	1,239,600
ミスミグループ本社	7,100	4,485.00	31,843,500

江守グループホールディングス	1,400	868.00	1,215,200	
藤久	700	1,695.00	1,186,500	
ベルク	800	3,275.00	2,620,000	
大 庄	1,000	1,473.00	1,473,000	
タキヒヨー	3,000	444.00	1,332,000	
ファーストリテイリング	3,800	44,355.00	168,549,000	
ソフトバンク	100,500	7,052.00	708,726,000	
スズケン	7,900	3,735.00	29,506,500	
サンドラッグ	4,000	5,780.00	23,120,000	
サックスパー ホールディングス	1,400	1,818.00	2,545,200	
ジェコス	1,300	1,328.00	1,726,400	
ベルーナ	4,700	541.00	2,542,700	
合計	31,843,300		42,300,900,540	

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)	(平成27年2月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,174,897,458	434,098,018
国債証券	23,992,514,430	34,671,814,060
未収利息	84,008,301	138,868,282
前払費用	13,901,560	32,726,929
流動資産合計	29,265,321,749	35,277,507,289
資産合計	29,265,321,749	35,277,507,289
負債の部		
流動負債		
未払金	-	214,748,110
未払解約金	5,025,630,416	27,387,268
流動負債合計	5,025,630,416	242,135,378
負債合計	5,025,630,416	242,135,378
純資産の部		
元本等		
元本	19,350,145,636	27,287,875,419
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,889,545,697	7,747,496,492
純資産合計	24,239,691,333	35,035,371,911
負債純資産合計	29,265,321,749	35,277,507,289

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)	(平成27年2月23日現在)
1. 受益権総口数	19,350,145,636口	27,287,875,419口
2. 1口当たり純資産額	1.2527円	1.2839円
(1万口当たり純資産額)	(12,527円)	(12,839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）	（自 平成26年2月22日 至 平成27年2月23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。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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26年2月21日現在）	（平成27年2月23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26年2月21日現在	平成27年2月23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)
国債証券	17,800,350	28,318,600
合計	17,800,350	28,318,600

(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開示対象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)	(平成27年2月23日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	12,507,141,338円	19,350,145,636円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	13,531,644,734円	13,436,290,863円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	6,688,640,436円	5,498,561,080円
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	1,286,251,124円
DCニッセイ国内債券インデックス	5,079,950,176円	5,876,510,249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	66,792,545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	5,574,538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	1,385,652,813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	3,114,021,918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	896,911,957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	425,133,248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	1,138,024,614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	489,093,987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	12,289,416,267円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	- 円	314,492,159円
計	19,350,145,636円	27,287,875,419円

附属明細表(平成27年2月23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338回 利付国債(2年)	1,540,000,000	1,541,370,600	
	第96回 利付国債(5年)	2,127,000,000	2,137,954,050	
	第105回 利付国債(5年)	460,000,000	461,752,600	
	第106回 利付国債(5年)	688,000,000	690,999,680	
	第107回 利付国債(5年)	2,300,000,000	2,310,672,000	
	第120回 利付国債(5年)	591,000,000	593,819,070	
	第4回 利付国債(40年)	477,000,000	566,408,880	
	第285回 利付国債(10年)	324,000,000	335,155,320	
	第287回 利付国債(10年)	213,000,000	222,214,380	
	第291回 利付国債(10年)	2,128,000,000	2,210,013,120	
	第292回 利付国債(10年)	2,475,000,000	2,600,680,500	
	第303回 利付国債(10年)	753,000,000	797,683,020	
	第312回 利付国債(10年)	115,000,000	122,349,650	
	第313回 利付国債(10年)	1,176,000,000	1,261,036,560	
	第318回 利付国債(10年)	1,297,000,000	1,371,357,010	
	第320回 利付国債(10年)	1,378,000,000	1,458,006,680	
	第321回 利付国債(10年)	1,736,000,000	1,837,833,760	
	第329回 利付国債(10年)	22,000,000	22,948,200	
	第330回 利付国債(10年)	703,000,000	733,271,180	
	第26回 利付国債(30年)	2,209,000,000	2,676,070,960	
第28回 利付国債(30年)	829,000,000	1,024,594,260		
第54回 利付国債(20年)	94,000,000	107,110,180		

第69回 利付国債(20年)	202,000,000	233,873,580	
第72回 利付国債(20年)	2,226,000,000	2,590,195,860	
第84回 利付国債(20年)	594,000,000	691,457,580	
第92回 利付国債(20年)	455,000,000	537,122,950	
第99回 利付国債(20年)	62,000,000	73,329,880	
第117回 利付国債(20年)	2,218,000,000	2,621,454,200	
第125回 利付国債(20年)	2,194,000,000	2,621,873,880	
第145回 利付国債(20年)	199,000,000	219,204,470	
国債証券 合計	31,785,000,000	34,671,814,060	
合計	31,785,000,000	34,671,814,060	

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)	(平成27年2月23日現在)
資産の部		
流動資産		

預金	87,817,894	583,988,849
コール・ローン	272,491,303	554,662,409
株式	28,977,223,491	44,491,337,870
投資証券	586,496,596	1,066,791,659
派生商品評価勘定	15,193,390	99,579,141
未収入金	246,441	452,979
未収配当金	43,502,857	74,939,650
差入委託証拠金	569,726,723	881,662,602
流動資産合計	30,552,698,695	47,753,415,159
資産合計	30,552,698,695	47,753,415,159
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	159,057,357
流動負債合計	7,029,880	159,057,357
負債合計	7,029,880	159,057,357
純資産の部		
元本等		
元本	26,676,145,239	32,880,647,674
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,869,523,576	14,713,710,128
純資産合計	30,545,668,815	47,594,357,802
負債純資産合計	30,552,698,695	47,753,415,159

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>

<p>3. 収益及び費用の計上基準</p> <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>	<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> <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> <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）	（平成27年2月23日現在）
1. 受益権総口数	26,676,145,239口	32,880,647,674口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1451円 (11,451円)	1.4475円 (14,475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）	（自平成26年2月22日 至平成27年2月23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、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、金利変動リスク等の市場リスク、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。	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。 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。	同左

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）	（平成27年2月23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 （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。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成26年2月21日現在	平成27年2月23日現在
種類	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）

株式	718,494,937	1,888,023,768
投資証券	20,320,432	75,759,486
合計	738,815,369	1,963,783,254

(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)				(平成27年2月23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	847,932,770	-	862,628,941	14,696,171	1,823,055,430	-	1,922,634,570	99,579,140
合計	847,932,770	-	862,628,941	14,696,171	1,823,055,430	-	1,922,634,570	99,579,140

(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開示対象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)	(平成27年2月23日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	14,705,080,003円	26,676,145,239円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	14,347,089,353円	12,495,940,903円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	2,376,024,117円	6,291,438,468円
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	276,307,624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	1,862,734,330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	1,609,399,772円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	11,533,877,599円	11,291,269,523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	12,246,157,188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	5,594,779,237円
計	26,676,145,239円	32,880,647,674円

附属明細表（平成27年2月23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	7,402	168.12	1,244,424.24	
	ABBOTT LABORATORIES	18,341	47.48	870,830.68	
	ABBVIE INC	19,550	61.30	1,198,415.00	
	ACCENTURE PLC	7,679	90.49	694,872.71	
	ACE LTD	4,021	114.50	460,404.50	
	ACTAVIS PLC	3,228	295.77	954,745.56	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	6,038	23.31	140,745.78	
	ADOBE SYSTEMS INC	5,733	78.55	450,327.15	
	ADT CORP/THE	2,203	39.38	86,754.14	
	ADVANCE AUTO PARTS	931	155.06	144,360.86	
	AES CORP	8,950	11.89	106,415.50	
	AETNA INC	4,375	97.92	428,400.00	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	750	218.31	163,732.50	
	AFLAC INC	5,555	62.13	345,132.15	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,315	41.95	181,014.25	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,598	157.66	409,600.68	
	AIRGAS INC	934	117.47	109,716.98	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,225	71.62	159,354.50	
	ALBEMARLE CORP	1,120	55.47	62,126.40	
	ALCOA INC	14,444	15.79	228,070.76	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,433	186.02	452,586.66		
ALLEGHANY CORP	248	480.86	119,253.28		
ALLERGAN INC	3,647	234.00	853,398.00		

ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	696	282.40	196,550.40	
ALLIANT ENERGY CORP	1,577	64.61	101,889.97	
ALLSTATE CORP	5,184	71.60	371,174.40	
ALLY FINANCIAL INC	4,553	21.82	99,346.46	
ALTERA CORP	4,047	36.14	146,258.58	
ALTRIA GROUP INC	23,990	55.61	1,334,083.90	
AMAZON.COM INC	4,814	383.66	1,846,939.24	
AMEREN CORPORATION	3,212	42.97	138,019.64	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,263	51.02	115,458.26	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	5,851	58.72	343,570.72	
AMERICAN EXPRESS CO	11,464	79.83	915,171.12	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,185	55.22	948,955.70	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,286	53.94	123,306.84	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,329	136.20	317,209.80	
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,752	101.98	280,648.96	
AMERITRADE HOLDING CORP	3,382	36.07	121,988.74	
AMETEK INC	3,351	51.62	172,978.62	
AMGEN INC	9,290	157.66	1,464,661.40	
AMPHENOL CORP-CL A	3,952	56.92	224,947.84	
ANADARKO PETROLEUM CORP	6,226	85.45	532,011.70	
ANALOG DEVICES INC	4,029	59.13	238,234.77	
ANSYS INC	1,218	87.25	106,270.50	
ANTHEM INC	3,346	144.59	483,798.14	
AON PLC	3,374	100.34	338,547.16	
APACHE CORP	4,801	66.22	317,922.22	
APPLE INC	73,540	129.49	9,523,062.30	
APPLIED MATERIALS INC	15,020	25.13	377,452.60	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,905	60.04	114,376.20	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7,923	48.15	381,492.45	
ARROW ELECTRONICS INC	1,359	62.78	85,318.02	
ASHLAND INC	961	127.26	122,296.86	
AT&T INC	63,318	34.08	2,157,877.44	
AUTODESK INC	2,789	62.37	173,949.93	
AUTOLIV INC	1,245	113.41	141,195.45	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	5,791	88.68	513,574.83	

AUTOZONE INC	418	623.31	260,543.58	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	3,083	112.06	345,480.98	
AVERY DENNISON CORP	1,331	54.08	71,980.48	
AVNET INC	1,881	45.91	86,356.71	
BAKER HUGHES INC	5,457	63.49	346,464.93	
BALL CORP	1,600	73.19	117,104.00	
BANK OF AMERICA CORP	128,126	16.38	2,098,703.88	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	13,786	39.44	543,719.84	
BARD (C.R.) INC	970	177.02	171,709.40	
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,677	67.90	453,368.30	
BB&T CORPORATION	8,839	38.19	337,561.41	
BE AEROSPACE INC	1,280	64.54	82,611.20	
BECTON DICKINSON & CO	2,385	145.51	347,041.35	
BED BATH & BEYOND INC	2,576	76.88	198,055.76	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	13,855	148.72	2,060,515.60	
BEST BUY CO INC	3,669	39.28	144,118.32	
BIOGEN IDEC INC	2,892	408.05	1,180,080.60	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,849	107.16	198,138.84	
BLACKROCK INC	1,630	376.64	613,923.20	
BOEING CO	8,318	158.31	1,316,822.58	
BORGWARNER INC	2,995	61.30	183,593.50	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	16,736	16.47	275,641.92	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	20,319	60.52	1,229,705.88	
BROADCOM CORP	6,649	44.68	297,077.32	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	1,536	92.21	141,634.56	
BUNGE LIMITED	1,893	82.72	156,588.96	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,824	72.50	132,240.00	
CA Inc	4,278	32.83	140,446.74	
CABOT OIL & GAS CORP	5,287	28.06	148,353.22	
CALPINE CORP	4,198	22.05	92,565.90	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	2,518	47.09	118,572.62	
CAMPBELL SOUP CO	2,669	46.64	124,482.16	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,874	80.39	552,600.86	
CARDINAL HEALTH INC	4,118	87.06	358,513.08	
CAREFUSION CORP	2,360	59.96	141,505.60	

CARMAX INC	2,839	68.13	193,421.07	
CARNIVAL CORP	4,896	43.27	211,849.92	
CATERPILLAR INC	7,259	84.44	612,949.96	
CBRE GROUP INC	3,821	34.76	132,817.96	
CBS CORP-CL B	6,191	59.50	368,364.50	
CELANESE CORP-SERIES A	2,023	57.55	116,423.65	
CELGENE CORP	9,785	123.43	1,207,762.55	
CENTERPOINT ENERGY INC	5,189	21.73	112,756.97	
CENTURYLINK INC	7,122	37.02	263,656.44	
CERNER CORP	3,828	72.07	275,903.10	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	623	308.39	192,126.97	
CHARLES SCHWAB CORP	14,396	29.65	426,841.40	
CHARTER COMMUNICATION-A	963	175.89	169,382.07	
CHENIERE ENERGY INC	2,785	74.00	206,090.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	6,721	20.30	136,436.30	
CHEVRON CORP	23,114	108.60	2,510,180.40	
CHICAGO BRIDGE & IRON- NY SHR	1,321	41.35	54,623.35	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	379	674.00	255,446.00	
CHUBB CORP	2,959	100.16	296,373.44	
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,853	85.37	158,190.61	
CIGNA CORP	3,263	118.54	386,796.02	
CIMAREX ENERGY CO	1,090	115.90	126,331.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,220	52.58	116,727.60	
CINTAS CORP	1,158	82.47	95,500.26	
CISCO SYSTEMS INC	62,459	29.61	1,849,410.99	
CIT GROUP INC	2,435	46.50	113,227.50	
CITIGROUP INC	36,939	51.78	1,912,701.42	
CITRIX SYSTEMS INC	1,975	64.92	128,217.00	
CLOROX CO	1,650	108.94	179,751.00	
CME GROUP INC	3,861	94.24	363,879.94	
CMS ENERGY CORP	3,551	35.58	126,344.58	
COACH INC	3,459	41.54	143,686.86	
COCA-COLA CO	47,928	41.97	2,011,538.16	
COCA-COLA ENTERPRISES	3,091	44.71	138,198.61	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	7,491	63.05	472,307.55	
COLGATE-PALMOLIVE CO	11,063	70.24	777,065.12	

COMCAST CORP	26,684	58.50	1,561,014.00	
COMCAST CORP	4,801	58.12	279,034.12	
COMERICA INC	2,206	45.83	101,100.98	
COMPUTER SCIENCES CORP	1,803	66.93	120,674.79	
CONAGRA FOODS INC	5,384	34.52	185,855.68	
CONCHO RESOURCES INC	1,410	117.22	165,280.20	
CONOCOPHILLIPS	14,970	67.38	1,008,678.60	
CONSOL ENERGY INC	2,784	33.83	94,182.72	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,576	63.75	227,970.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,110	115.75	244,232.50	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,205	47.35	57,056.75	
COOPER COS INC/THE	596	165.81	98,822.76	
CORE LABORATORIES N.V.	568	114.93	65,280.24	
CORNING INC	16,006	24.96	399,509.76	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,292	147.53	780,755.22	
CROWN HOLDINGS INC	1,817	51.72	93,975.24	
CSX CORP	12,363	35.55	439,504.65	
CUMMINS INC	2,210	142.55	315,035.50	
CVS HEALTH CORP	14,018	102.70	1,439,648.60	
D&B CORP	496	135.44	67,178.24	
DANAHER CORP	7,602	87.68	666,543.36	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,753	62.21	109,054.13	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	2,207	73.76	162,788.32	
DEERE & CO	4,206	92.43	388,760.58	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	3,716	79.27	294,567.32	
DELTA AIR LINES INC	2,658	47.44	126,095.52	
DENBURY RESOURCES INC	6,121	8.91	54,538.11	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	1,901	52.53	99,859.53	
DEVON ENERGY CORPORATION	4,927	63.82	314,441.14	
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,292	54.88	70,904.96	
DIRECTV	5,784	87.26	504,711.84	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,694	60.54	344,714.76	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	1,490	30.93	46,085.70	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3,825	29.50	112,856.62	

DISH NETWORK CORP	2,735	78.31	214,177.85	
DOLLAR GENERAL CORP	3,777	71.69	270,773.13	
DOLLAR TREE INC	2,589	77.69	201,139.41	
DOMINION RESOURCES INC/VA	6,994	73.99	517,486.06	
DOVER CORP	2,201	74.50	163,974.50	
DOW CHEMICAL CO	14,554	49.53	720,859.62	
DR HORTON INC	3,964	27.32	108,296.48	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	2,461	78.82	193,976.02	
DTE ENERGY COMPANY	2,197	83.20	182,790.40	
DUKE ENERGY CORP	8,394	78.71	660,691.74	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,890	75.47	142,638.30	
EATON CORP PLC	5,987	72.51	434,117.37	
EATON VANCE CORP	1,741	43.68	76,046.88	
EBAY INC	13,772	58.02	799,051.44	
ECOLAB INC	3,282	112.53	369,323.46	
EDISON INTERNATIONAL	3,805	64.09	243,862.45	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,318	134.46	177,218.28	
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	11,087	76.67	850,040.29	
ELECTRONIC ARTS INC	3,842	57.67	221,568.14	
ELI LILLY & CO	12,296	71.88	883,836.48	
EMC CORP/MASSACHUSETTS	24,663	29.04	716,213.52	
EMERSON ELECTRIC CO	8,560	58.67	502,215.20	
ENDO INTERNATIONAL PLC	1,774	86.32	153,131.68	
ENERGEN CORP	1,005	67.71	68,048.55	
ENERGIZER HOLDINGS INC	791	134.30	106,231.30	
ENSCO PLC	3,098	29.76	92,196.48	
ENTERGY CORP	2,196	79.32	174,186.72	
EOG RESOURCES INC	6,730	91.08	612,968.40	
EQT CORP	1,968	81.13	159,663.84	
EQUIFAX INC	1,570	93.62	146,983.40	
ESTEE LAUDER COS INC	2,876	81.80	235,256.80	
EVEREST RE GROUP LTD	612	178.95	109,517.40	
EVERSOURCE ENERGY	3,988	52.54	209,529.52	
EXELON CORP	10,396	33.39	347,122.44	
EXPEDIA INC	1,231	92.30	113,621.30	

EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	2,673	45.50	121,634.86	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	9,122	86.08	785,221.76	
EXXON MOBIL CORP	52,196	89.92	4,693,464.32	
F5 NETWORKS INC	923	119.36	110,169.28	
FACEBOOK INC-A	24,187	79.89	1,932,420.36	
FAMILY DOLLAR STORES	1,356	78.27	106,134.12	
FASTENAL CO	3,701	42.76	158,273.26	
FEDEX CORP	3,304	178.50	589,764.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	3,574	68.68	245,462.32	
FIFTH THIRD BANCORP	10,465	19.39	202,916.35	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,695	56.63	95,987.85	
FIRSTENERGY CORP	5,332	35.85	191,152.20	
FISERV INC	3,056	79.05	241,576.80	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	926	156.45	144,872.70	
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	7,335	12.23	89,707.05	
FLOWSERVE CORP	1,742	62.55	108,962.10	
FLUOR CORP	2,106	59.33	124,948.98	
FMC CORP	1,859	64.01	118,994.59	
FMC TECHNOLOGIES INC	2,943	40.97	120,574.71	
FOOT LOCKER INC	1,709	55.56	94,952.04	
FORD MOTOR CO	44,568	16.40	730,915.20	
FOSSIL GROUP INC	612	85.14	52,105.68	
FRANKLIN RESOURCES INC	5,147	54.16	278,761.52	
FREEPORT-MCMORAN INC	13,052	21.28	277,746.56	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	12,521	8.30	103,924.30	
GAP INC	3,002	41.00	123,082.00	
GARMIN LTD	1,367	49.42	67,557.14	
GENERAL DYNAMICS CORP	3,437	142.24	488,878.88	
GENERAL ELECTRIC CO	122,563	25.21	3,089,813.23	
GENERAL MILLS INC	7,497	53.47	400,864.59	
GENERAL MOTORS CO	15,773	37.65	593,853.45	
GENUINE PARTS CO	2,008	96.28	193,330.24	
GENWORTH FINANCIAL INC- CL A	6,603	7.99	52,757.97	
GILEAD SCIENCES INC	18,485	102.61	1,896,745.85	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,834	191.51	925,759.34	

GOOGLE INC-CL A	3,399	541.80	1,841,578.20	
GOOGLE INC-CL C	3,610	538.95	1,945,609.50	
H&R BLOCK INC	3,500	34.74	121,590.00	
HALLIBURTON CO	10,431	43.36	452,288.16	
HANESBRANDS INC	1,145	121.85	139,518.25	
HARLEY-DAVIDSON INC	2,821	63.48	179,077.08	
HARRIS CORP	1,576	78.34	123,463.84	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	5,648	41.47	234,222.56	
HASBRO INC	1,324	61.83	81,862.92	
HCA HOLDINGS INC	3,712	69.79	259,060.48	
HELMERICH & PAYNE	1,331	69.73	92,810.63	
HENRY SCHEIN INC	1,151	142.55	164,075.05	
HERSHEY CO/THE	1,936	107.24	207,616.64	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	5,661	23.20	131,335.20	
HESS CORP	3,416	76.30	260,640.80	
HEWLETT-PACKARD CO	22,825	38.39	876,251.75	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,929	28.35	139,737.15	
HOLLYFRONTIER CORP	2,243	41.11	92,209.73	
HOLOGIC INC	2,786	31.73	88,413.71	
HOME DEPOT INC	16,439	112.24	1,845,113.36	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,970	105.36	945,079.20	
HORMEL FOODS CORP	1,799	57.92	104,198.08	
HOSPIRA INC	2,137	87.54	187,072.98	
HUDSON CITY BANCORP INC	6,979	9.67	67,486.93	
HUMANA INC	1,904	156.12	297,252.48	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	10,285	10.72	110,255.20	
IHS INC-CLASS A	920	120.23	110,611.60	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	4,613	99.49	458,947.37	
ILLUMINA INC	1,707	203.13	346,751.44	
INCYTE CORP	1,829	82.49	150,874.21	
INGERSOLL-RAND PLC	3,428	68.81	235,880.68	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	991	77.18	76,485.38	
INTEL CORP	60,389	34.41	2,077,985.49	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,396	235.02	328,087.92	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	11,598	163.65	1,898,012.70	

INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	1,119	121.40	135,846.60	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,977	57.59	286,625.43	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,705	22.43	127,963.15	
INTUIT INC	3,257	96.72	315,017.04	
INTUITIVE SURGICAL INC	445	513.31	228,422.95	
INVESCO LTD	5,476	40.03	219,204.28	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,843	44.44	81,902.92	
JARDEN CORP	2,340	53.08	124,207.20	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	722	172.42	124,487.24	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,271	85.15	108,225.65	
JM SMUCKER CO	1,347	113.44	152,803.68	
JOHNSON & JOHNSON	34,503	100.26	3,459,270.78	
JOHNSON CONTROLS INC	8,256	50.58	417,588.48	
JOY GLOBAL INC	1,376	44.80	61,644.80	
JPMORGAN CHASE & CO	45,778	59.80	2,737,524.40	
JUNIPER NETWORKS INC	5,294	24.20	128,114.80	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,431	116.61	166,868.91	
KELLOGG CO	3,430	64.09	219,828.70	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	1,490	122.87	183,076.30	
KEYCORP	11,236	14.02	157,528.72	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,523	110.96	501,872.08	
KINDER MORGAN INC	12,194	41.87	510,562.78	
KLA-TENCOR CORP	2,020	64.97	131,239.40	
KOHL'S CORP	2,641	69.50	183,549.50	
KRAFT FOODS GROUP INC	7,334	64.42	472,456.28	
KROGER CO	5,695	72.79	414,539.05	
L BRANDS INC	3,101	90.34	280,144.34	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,081	132.87	143,632.47	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	1,152	121.08	139,484.16	
LAM RESEARCH CORP	2,014	83.84	168,853.76	
LAS VEGAS SANDS CORP	5,070	60.35	305,974.50	
LEGG MASON INC	1,318	58.92	77,656.56	
LEGGETT & PLATT INC	1,812	44.78	81,141.36	
LENNAR CORP-CL A	2,098	50.32	105,571.36	
LEUCADIA NATIONAL CORP	4,571	24.11	110,206.81	

LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	3,599	54.08	194,633.92	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,441	53.25	129,983.25	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	8,478	51.65	437,888.70	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	5,981	29.23	174,824.63	
LIBERTY MEDIA CORP - C	3,902	38.49	150,187.98	
LINCOLN NATIONAL CORP	3,340	58.51	195,423.40	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	3,189	48.25	153,869.25	
LINKEDIN CORP - A	1,326	267.63	354,877.38	
LKQ CORP	3,893	27.38	106,590.34	
LOCKHEED MARTIN CORP	3,226	203.99	658,071.74	
LOEWS CORP	4,710	42.35	199,468.50	
LORILLARD INC	4,086	68.70	280,708.20	
LOWE'S COS INC	12,111	73.56	890,885.16	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,344	67.37	90,545.28	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	5,293	90.47	478,857.71	
M&T BANK CORP	1,497	121.34	181,645.98	
MACY'S INC	4,395	63.70	279,961.50	
MALLINCKRODT PLC	1,388	117.58	163,201.04	
MANPOWER GROUP	1,127	79.50	89,596.50	
MARATHON OIL CORP	8,620	28.47	245,411.40	
MARATHON PETROLEUM CORP	3,474	105.57	366,750.18	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	2,886	83.00	239,538.00	
MARSH & MCLENNAN COS INC	6,508	57.13	371,802.04	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	676	143.24	96,830.24	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	4,817	16.29	78,468.93	
MASCO CORP	4,596	26.75	122,943.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	12,235	90.79	1,110,815.65	
MATTEL INC	4,292	25.77	110,604.84	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,710	34.60	128,366.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,613	75.84	122,329.92	
MCDONALD'S CORP	11,893	94.19	1,120,201.67	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	3,333	104.63	348,731.79	
MCKESSON CORP	2,806	229.16	643,022.96	

MDU RESOURCES GROUP INC	2,708	23.02	62,338.16	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	2,499	105.01	262,419.99	
MEADWESTVACO CORP	2,087	54.92	114,618.04	
MEDIVATION INC	874	110.00	96,140.00	
MEDTRONIC PLC	17,011	78.79	1,340,296.69	
MERCK & CO INC	35,316	58.35	2,060,688.60	
METLIFE INC	11,659	51.59	601,487.81	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	396	313.63	124,197.48	
MGM MIRAGE	4,846	22.63	109,664.98	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	2,544	68.98	175,485.12	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,608	50.92	132,812.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	13,041	32.03	417,703.23	
MICROSOFT CORP	95,865	43.85	4,204,159.57	
MOHAWK INDUSTRIES INC	779	184.26	143,538.54	
MOLSON COORS BREWING CO -B	1,922	76.63	147,282.86	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	20,545	36.97	759,548.65	
MONSANTO CO	6,324	124.91	789,930.84	
MONSTER BEVERAGE CORP	1,755	121.26	212,811.30	
MOODY'S CORP	2,355	97.14	228,764.70	
MORGAN STANLEY	18,041	36.74	662,826.34	
MOSAIC CO/THE	4,114	53.08	218,371.12	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,940	69.83	205,300.20	
MURPHY OIL CORP	2,308	50.27	116,023.16	
MYLAN LABORATORIES	4,668	57.87	270,137.16	
NABORS INDUSTRIES LTD	3,566	13.52	48,212.32	
NASDAQ OMX GROUP/THE	1,453	50.94	74,015.82	
NATIONAL-OILWELL INC	5,333	54.47	290,488.51	
NAVIENT CORP	5,383	21.72	116,918.76	
NETAPP INC	3,934	38.20	150,278.80	
NETFLIX INC	699	478.20	334,261.80	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	6,170	16.52	101,928.40	
NEWELL RUBBERMAID INC	3,355	40.12	134,602.60	
NEWMONT MINING CORP	6,903	25.58	176,578.74	
NEWS CORP - CLASS A	5,172	17.14	88,648.08	
NEXTERA ENERGY INC	5,187	105.60	547,747.20	

NIELSEN NV	3,901	45.28	176,637.28	
NIKE INC	8,303	94.93	788,203.79	
NISOURCE INC	3,904	43.62	170,292.48	
NOBLE CORP PLC	3,704	19.05	70,561.20	
NOBLE ENERGY INC	4,643	49.08	227,878.44	
NORDSTROM INC	1,835	81.74	149,992.90	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,818	111.73	426,585.14	
NORTHERN TRUST CORP	2,827	70.08	198,116.16	
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,416	172.20	416,035.20	
NRG ENERGY INC	4,210	25.39	106,891.90	
NUCOR CORP	4,022	48.48	194,986.56	
NVIDIA CORP	6,734	22.33	150,403.89	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,291	205.84	265,739.44	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,506	80.10	761,430.60	
OCEANEERING INTL INC	1,416	52.63	74,524.08	
OGE ENERGY CORP	2,557	34.05	87,065.85	
OMNICARE INC	1,228	77.18	94,777.04	
OMNICOM GROUP	3,344	77.94	260,631.36	
ONEOK INC	2,550	47.67	121,558.50	
ORACLE CORP	43,576	43.77	1,907,321.52	
PACCAR INC	4,498	64.59	290,525.82	
PALL CORP	1,527	105.02	160,365.54	
PALO ALTO NETWORKS INC	820	141.61	116,120.20	
PARKER HANNIFIN CORP	1,895	123.69	234,392.55	
PAYCHEX INC	4,010	49.55	198,715.55	
PENTAIR PLC	2,562	68.03	174,292.86	
PEPCO HOLDINGS INC	3,247	27.24	88,448.28	
PEPSICO INC	18,204	99.06	1,803,288.24	
PERRIGO CO PLC	1,682	151.37	254,604.34	
PETSMART INC	1,149	82.91	95,263.59	
PFIZER INC	77,632	34.56	2,682,961.92	
PG&E CORP	5,698	54.98	313,276.04	
PHARMACYCLICS INC	779	177.56	138,319.24	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	19,093	83.04	1,585,482.72	
PHILLIPS 66	6,842	77.34	529,160.28	
PINNACLE WEST CAPITAL	1,521	65.77	100,036.17	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,786	158.76	283,545.36	

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6,478	92.27	597,725.06	
POLARIS INDUSTRIES INC	766	155.57	119,166.62	
PPG INDUSTRIES INC	1,704	236.64	403,234.56	
PPL CORPORATION	8,052	34.98	281,658.96	
PRAXAIR INC	3,572	129.31	461,895.32	
PRECISION CASTPARTS CORP	1,783	219.61	391,564.63	
PRICELINE GROUP INC/THE	640	1,216.23	778,387.20	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,394	52.11	228,971.34	
PROCTER & GAMBLE CO	32,919	84.87	2,793,835.53	
PROGRESSIVE CORP	7,221	26.61	192,150.81	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,653	80.81	456,818.93	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,110	41.63	254,359.30	
PULTE GROUP INC	4,202	22.75	95,595.50	
PVH CORP	1,028	110.00	113,080.00	
QUALCOMM INC	20,376	71.52	1,457,291.52	
QUANTA SERVICES INC	2,819	29.51	83,188.69	
QUEST DIAGNOSTICS	1,883	71.77	135,142.91	
RACKSPACE HOSTING INC	1,496	49.38	73,872.48	
RALPH LAUREN CORP	743	139.30	103,499.90	
RANGE RESOURCES CORP	2,134	51.84	110,626.56	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,720	56.60	97,352.00	
RAYTHEON CO	3,790	108.88	412,655.20	
REALOGY HOLDINGS CORP	1,919	47.48	91,114.12	
RED HAT INC	2,402	70.46	169,244.92	
REGENERON PHARMACEUTICALS	974	423.78	412,761.72	
REGIONS FINANCIAL CORP	17,653	9.66	170,527.98	
REPUBLIC SERVICES INC	3,644	40.65	148,128.60	
RESMED INC	1,849	65.78	121,627.22	
REYNOLDS AMERICAN INC	3,894	73.90	287,766.60	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,752	61.31	107,415.12	
ROCK TENN COMPANY -CL A	1,871	71.10	133,028.10	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,814	118.20	214,414.80	
ROCKWELL COLLINS INC.	1,573	90.86	142,922.78	
ROPER INDUSTRIES INC	1,295	168.30	217,948.50	
ROSS STORES INC	2,646	97.92	259,096.32	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,132	76.17	162,394.44
SALESFORCE.COM INC	7,236	63.74	461,222.64
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	728	157.85	114,914.80
SANDISK CORP	2,744	82.63	226,736.72
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,602	121.25	194,242.50
SCANA CORP	1,875	58.30	109,312.50
SCHLUMBERGER LTD	15,833	85.88	1,359,738.04
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,068	73.57	78,572.76
SEAGATE TECHNOLOGY	4,028	62.18	250,461.04
SEALED AIR CORP	2,420	48.18	116,595.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,836	43.37	79,627.32
SEMPRA ENERGY	2,765	109.94	303,984.10
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,133	53.39	113,880.87
SERVICENOW INC	1,609	79.06	127,207.54
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,015	289.75	294,096.25
SIGMA-ALDRICH	1,509	138.75	209,373.75
SIGNET JEWELERS LTD	929	120.08	111,554.32
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,089	3.86	131,583.54
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,316	84.30	195,238.80
SNAP-ON INC	784	146.06	114,511.04
SOUTHERN CO	10,629	46.14	490,422.06
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,047	44.78	91,664.66
SOUTHWESTERN ENERGY CO	4,531	27.55	124,829.05
SPECTRA ENERGY CORP	8,289	36.25	300,476.25
ST JUDE MEDICAL INC	3,621	68.28	247,241.88
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,894	98.94	187,392.36
STAPLES INC	8,295	16.79	139,273.05
STARBUCKS CORP	9,147	93.51	855,335.97
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	2,454	80.26	196,958.04
STATE STREET CORP	5,238	77.63	406,625.94
STERICYCLE INC	1,125	134.61	151,436.25
STRYKER CORP	4,235	95.25	403,383.75
SUNTRUST BANKS INC	6,614	41.08	271,703.12
SYMANTEC CORP	8,527	25.68	219,015.99
SYNOPSIS INC	2,044	46.95	95,965.80
SYSCO CORP	7,308	39.66	289,835.28

T ROWE PRICE GROUP INC	3,302	83.53	275,816.06	
T-MOBILE US INC	2,945	31.95	94,092.75	
TARGET CORP	7,441	76.87	571,989.67	
TE CONNECTIVITY LTD	5,083	71.43	363,078.69	
TERADATA CORP	1,942	45.29	87,953.18	
TESLA MOTORS INC	1,057	217.11	229,485.27	
TESORO CORP	1,547	90.58	140,127.26	
TEXAS INSTRUMENTS INC	13,052	58.52	763,803.04	
TEXTRON INC	3,664	44.99	164,843.36	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,911	131.17	644,175.87	
TIFFANY & CO	1,669	90.20	150,543.80	
TIME WARNER CABLE	3,471	148.58	515,721.18	
TIME WARNER INC	10,519	84.53	889,171.07	
TJX COS INC	8,537	68.73	586,748.01	
TOLL BROTHERS INC	2,221	37.65	83,620.65	
TORCHMARK CORP	1,808	54.18	97,957.44	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	2,178	38.03	82,829.34	
TOWERS WATSON & CO-CL A	914	131.13	119,852.82	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,723	88.12	151,830.76	
TRANSDIGM GROUP INC	632	213.73	135,077.36	
TRAVELERS COS INC/THE	4,057	107.82	437,425.74	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,222	26.53	85,479.66	
TRIPADVISOR INC	1,354	88.78	120,208.12	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	1,369	104.45	142,992.05	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	6,436	34.27	220,593.90	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	16,122	35.30	569,106.60	
TWITTER INC	4,564	49.11	224,138.04	
TYCO INTERNATIONAL PLC	5,516	42.70	235,533.20	
TYSON FOODS INC-CL A	3,781	41.67	157,554.27	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	713	138.00	98,394.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	1,944	75.03	145,858.32	
UNION PACIFIC CORP	10,905	123.66	1,348,512.30	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,173	68.01	79,775.73	
UNITED PARCEL SERVICE INC	8,554	101.96	872,165.84	

UNITED RENTALS INC	1,178	95.98	113,064.44	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	10,553	124.11	1,309,732.83	
UNITEDHEALTH GROUP INC	11,828	112.62	1,332,069.36	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,126	107.87	121,461.62	
UNUM GROUP	3,516	33.99	119,508.84	
US BANCORP	21,613	44.62	964,372.06	
VALERO ENERGY CORP	6,507	60.72	395,105.04	
VANTIV INC - CL A	1,807	38.32	69,244.24	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,402	92.90	130,245.80	
VERISIGN INC	1,520	63.87	97,082.40	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	1,984	67.80	134,515.20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	50,651	48.97	2,480,379.47	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,934	118.61	348,001.74	
VF CORP	4,118	75.80	312,144.40	
VIACOM INC-CLASS B	4,746	69.71	330,843.66	
VISA INC-CLASS A SHARES	6,029	273.00	1,645,917.00	
VMWARE INC-CLASS A	947	85.16	80,646.52	
VOYA FINANCIAL INC	2,603	43.96	114,427.88	
VULCAN MATERIALS CO	1,690	80.98	136,856.20	
WABTEC CORP	1,258	95.03	119,547.74	
WAL-MART STORES INC	19,587	84.30	1,651,184.10	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	11,154	77.13	860,308.02	
WALT DISNEY CO	19,914	104.55	2,082,008.70	
WASTE MANAGEMENT INC	5,424	54.51	295,662.24	
WATERS CORP	1,104	121.04	133,628.16	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	9,639	12.35	119,041.65	
WELLS FARGO & CO	60,321	54.83	3,307,400.43	
WESTERN DIGITAL CORP	2,701	111.31	300,648.31	
WESTERN UNION CO	6,728	19.45	130,859.60	
WEYERHAEUSER CO	6,680	35.49	237,073.20	
WHIRLPOOL CORP	985	213.27	210,070.95	
WHITING PETROLEUM CORP	1,510	38.15	57,606.50	
WHOLE FOODS MARKET INC	4,583	56.71	259,924.84	
WILLIAMS COS INC	8,632	48.97	422,709.04	

	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	2,437	47.75	116,366.75	
	WINDSTREAM HOLDINGS INC	7,678	8.63	66,261.14	
	WISCONSIN ENERGY CORP	2,897	51.93	150,441.21	
	WORKDAY INC-CLASS A	1,103	92.74	102,292.22	
	WR BERKLEY CORP	1,490	50.48	75,215.20	
	WW GRAINGER INC	803	238.14	191,226.42	
	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	1,691	91.77	155,183.07	
	WYNN RESORTS LTD	1,021	158.47	161,797.87	
	XCEL ENERGY INC	6,332	35.92	227,445.44	
	XEROX CORP	13,579	14.00	190,106.00	
	XILINX INC	3,476	41.67	144,862.30	
	XL GROUP PLC	3,556	35.35	125,704.60	
	XYLEM INC	2,329	36.03	83,913.87	
	YAHOO! INC	11,586	44.11	511,058.46	
	YUM! BRANDS INC	5,479	77.53	424,786.87	
	ZIMMER HOLDINGS INC	2,124	121.59	258,257.16	
	ZOETIS INC	6,325	45.60	288,420.00	
	アメリカ・ドル 小計	3,781,056		235,617,234.00 (28,057,300,225)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	13,266	4.82	63,968.65	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	11,380	4.67	53,190.12	
	AGGREKO PLC	3,281	16.87	55,350.47	
	AMEC FOSTER WHEELER PLC	5,073	8.79	44,617.03	
	ANGLO AMERICAN PLC	17,553	12.46	218,798.14	
	ARM HOLDINGS PLC	17,700	11.16	197,532.00	
	ASHTREAD GROUP PLC	5,938	11.30	67,099.40	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,436	30.36	134,676.96	
	ASTRAZENECA PLC	15,469	44.13	682,724.31	
	AVIVA PLC	36,336	5.46	198,576.24	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	3,462	10.12	35,035.44	
	BAE SYSTEMS PLC	39,020	5.30	206,806.00	
	BARCLAYS PLC	202,327	2.61	529,085.10	
	BG GROUP PLC	42,019	9.71	408,172.56	
	BHP BILLITON PLC	26,190	15.81	414,063.90	
	BP PLC	224,782	4.46	1,004,101.19	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	22,803	36.56	833,677.68	
	BT GROUP PLC	100,523	4.41	443,507.47	

BUNZL PLC	4,432	19.28	85,448.96	
BURBERRY GROUP PLC	5,457	19.08	104,119.56	
CAPITA PLC	8,316	11.71	97,380.36	
CARNIVAL PLC	2,416	28.75	69,460.00	
CENTRICA PLC	62,526	2.52	157,628.04	
COBHAM PLC	16,216	3.41	55,345.20	
COCA-COLA HBC AG-CDI	2,816	11.32	31,877.12	
COMPASS GROUP PLC	20,968	11.34	237,777.12	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,820	28.10	51,142.00	
DIAGEO PLC	30,858	18.86	581,981.88	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	17,750	3.27	58,131.25	
DIXONS CARPHONE PLC	11,590	4.41	51,111.90	
EXPERIAN PLC	13,062	11.90	155,437.80	
FRIENDS LIFE GROUP LTD	18,555	4.17	77,392.90	
G4S PLC	19,374	2.83	55,002.78	
GKN PLC	22,239	3.83	85,175.37	
GLAXOSMITHKLINE PLC	59,577	15.30	911,528.10	
GLENCORE PLC	131,254	2.92	383,392.93	
HSBC HOLDINGS PLC	232,407	6.05	1,406,527.16	
IMI PLC	3,958	14.45	57,193.10	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	11,773	31.00	364,963.00	
INMARSAT PLC	5,840	8.90	52,005.20	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,005	25.33	76,116.65	
INTERTEK GROUP PLC	2,251	25.47	57,332.97	
INVESTEC PLC	7,491	5.75	43,073.25	
ITV PLC	49,566	2.33	115,538.34	
JOHNSON MATTHEY PLC	2,742	34.81	95,449.02	
KINGFISHER PLC	31,445	3.41	107,321.78	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	73,277	2.73	200,266.04	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	694,945	0.77	541,362.15	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	2,895	24.61	71,245.95	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	21,717	4.97	108,085.50	
MEGGITT PLC	10,933	5.73	62,646.09	
MORRISON WM SUPERMARKETS	28,608	1.89	54,212.16	
NATIONAL GRID PLC	45,095	8.99	405,404.05	

NEXT PLC	1,934	73.25	141,665.50	
OLD MUTUAL PLC	65,218	2.18	142,370.89	
PEARSON PLC	10,615	13.91	147,654.65	
PERSIMMON PLC	3,656	16.94	61,932.64	
PETROFAC LTD	3,431	8.21	28,185.66	
PRUDENTIAL PLC	31,397	16.04	503,607.88	
RANGOLD RESOURCES LTD	1,198	50.15	60,079.70	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,891	56.85	448,603.35	
REED ELSEVIER PLC	14,722	11.82	174,014.04	
REXAM PLC	9,829	5.60	55,091.54	
RIO TINTO PLC	15,690	32.37	507,963.75	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	23,555	9.56	225,185.80	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	31,271	3.97	124,302.22	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	48,689	21.27	1,035,615.03	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	29,148	22.06	643,004.88	
RSA INSURANCE GROUP PLC	12,418	4.52	56,129.36	
SABMILLER PLC	11,856	35.99	426,756.72	
SAGE GROUP PLC	14,548	4.71	68,608.36	
SAINSBURY (J) PLC	16,994	2.71	46,155.70	
SCHRODERS PLC	1,751	30.21	52,897.71	
SEVERN TRENT PLC	2,989	20.49	61,244.61	
SHIRE PLC	7,232	50.65	366,300.80	
SKY PLC	13,485	9.57	129,118.87	
SMITH & NEPHEW PLC	11,293	11.75	132,692.75	
SMITHS GROUP PLC	5,339	11.92	63,640.88	
SSE PLC	11,978	15.27	182,904.06	
STANDARD CHARTERED PLC	30,703	9.73	298,893.70	
STANDARD LIFE PLC	30,771	4.19	129,115.11	
TESCO PLC	103,997	2.40	250,216.78	
TRAVIS PERKINS PLC	3,212	20.16	64,753.92	
TULLOW OIL PLC	12,174	4.07	49,584.70	
UNILEVER PLC	15,756	28.00	441,168.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,732	9.46	82,604.72	
VODAFONE GROUP PLC	326,353	2.32	758,444.37	
WEIR GROUP PLC/THE	2,750	19.11	52,552.50	
WHITBREAD PLC	2,360	50.10	118,236.00	

	WILLIAM HILL PLC	11,376	3.96	45,094.46	
	WOLSELEY PLC	3,500	39.99	139,965.00	
	WPP PLC	16,857	15.18	255,889.26	
イギリス・ポンド	小計	3,445,400		21,231,304.21 (3,887,664,114)	
イスラエル・シケル	BANK HAPOLIM BM	38,947	17.86	695,593.42	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	11,323	218.00	2,468,414.00	
イスラエル・シケル	小計	50,270		3,164,007.42 (97,672,910)	
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	10,498	15.40	161,669.20	
	AMCOR LTD	16,673	14.32	238,757.36	
	AMP LTD	40,691	6.63	269,781.33	
	ASCIANO LTD	17,010	6.39	108,693.90	
	ASX LTD	3,849	41.99	161,619.51	
	AURIZON HOLDINGS LTD	34,135	4.92	167,944.20	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	34,492	34.81	1,200,666.52	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	6,443	13.97	90,008.71	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	7,832	13.33	104,400.56	
	BHP BILLITON LTD	40,390	32.30	1,304,597.00	
	BRAMBLES LTD	22,422	10.72	240,363.84	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	9,384	10.20	95,716.80	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	20,036	90.21	1,807,447.56	
	COMPUTERSHARE LIMITED	7,507	12.25	91,960.75	
	CROWN RESORTS LTD	6,464	15.26	98,640.64	
	CSL LIMITED	5,966	89.70	535,150.20	
	INCITEC PIVOT LTD	28,700	3.93	112,791.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	33,984	5.95	202,204.80	
	MACQUARIE GROUP LTD	3,965	71.20	282,308.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	29,720	37.48	1,113,905.60	
	NEWCREST MINING LIMITED	10,815	13.93	150,652.95	
	ORICA LTD	5,397	19.75	106,590.75	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	15,066	12.38	186,517.08	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	17,634	11.57	204,025.38	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	1,958	63.17	123,686.86	

	RIO TINTO LTD	5,879	63.75	374,786.25	
	SANTOS LTD	13,384	8.03	107,473.52	
	SEEK LTD	4,565	17.36	79,248.40	
	SONIC HEALTHCARE LTD	6,007	19.36	116,295.52	
	SUNCORP GROUP LTD	17,900	13.77	246,483.00	
	TATTS GROUP LTD	26,590	4.01	106,625.90	
	TELSTRA CORP LTD	58,062	6.61	383,789.82	
	WESFARMERS LIMITED	14,456	46.39	670,613.84	
	WESTPAC BANKING CORP	38,759	37.63	1,458,501.17	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	9,818	35.72	350,698.96	
	WOOLWORTHS LTD	16,361	33.26	544,166.86	
	オーストラリア・ドル 小計	642,812		13,598,783.74 (1,268,630,535)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,849	38.11	108,575.39	
	AGRIUM INC	1,880	136.14	255,943.20	
	ALIMENTATION COUCHE- TARD -B	5,243	48.06	251,978.58	
	ALTAGAS LTD	1,843	45.34	83,561.62	
	ARC RESOURCES LTD	4,172	24.31	101,421.32	
	BANK OF MONTREAL	7,785	77.89	606,373.65	
	BANK OF NOVA SCOTIA	14,660	66.26	971,371.60	
	BARRICK GOLD CORP	15,838	16.17	256,100.46	
	BAYTEX ENERGY CORP	2,748	22.24	61,115.52	
	BCE INC	3,712	55.95	207,686.40	
	BLACKBERRY LTD	5,900	12.87	75,933.00	
	BOMBARDIER INC	18,989	2.40	45,573.60	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	7,063	68.15	481,343.45	
	CAMECO CORP	5,098	19.68	100,328.64	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	4,757	92.04	437,834.28	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	10,102	87.70	885,945.40	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	13,713	36.68	502,992.84	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	7,316	11.03	80,695.48	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,135	238.16	508,471.60	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	961	119.76	115,089.36	
	CANADIAN UTILITIES LTD- A	1,986	41.25	81,922.50	
	CATAMARAN CORP	2,682	66.12	177,333.84	

GENOVUS ENERGY INC	9,951	22.22	221,111.22	
CGI GROUP INC	2,844	52.24	148,570.56	
CI FINANCIAL CORP	3,264	35.18	114,827.52	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	226	403.00	91,078.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	5,569	31.00	172,639.00	
DOLLARAMA INC	1,662	62.65	104,124.30	
ELDORADO GOLD CORP	10,336	6.48	66,977.28	
ENBRIDGE INC	10,520	61.82	650,346.40	
ENCANA CORP	9,625	16.81	161,796.25	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	277	659.10	182,570.70	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,545	13.99	105,554.55	
FORTIS INC	3,837	39.71	152,367.27	
FRANCO-NEVADA CORP	2,103	63.39	133,309.17	
GEORGE WESTON LTD	776	104.73	81,270.48	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,469	74.62	109,616.78	
GOLDCORP INC	10,944	26.90	294,393.60	
GREAT-WEST LIFECO INC	4,123	35.76	147,438.48	
HUSKY ENERGY INC	4,782	28.61	136,813.02	
IGM FINANCIAL INC	1,815	43.85	79,587.75	
IMPERIAL OIL LTD	3,886	48.63	188,976.18	
INTACT FINANCIAL CORP	1,824	90.00	164,160.00	
INTER PIPELINE LTD	4,089	33.91	138,657.99	
KEYERA CORP	1,067	80.70	86,106.90	
LOBLAW COS LTD	2,919	64.87	189,355.53	
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,664	130.41	347,412.24	
MANULIFE FINANCIAL CORP	23,157	22.19	513,853.83	
METHANEX CORP	1,251	65.19	81,552.69	
METRO INC	3,468	35.15	121,900.20	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,144	47.60	197,254.40	
ONEX CORPORATION	1,455	72.49	105,472.95	
OPEN TEXT CORP	1,458	74.87	109,160.46	
PEMBINA PIPELINE CORP	4,091	39.39	161,144.49	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	2,153	35.85	77,185.05	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	10,372	46.38	481,053.36	
POWER CORP OF CANADA	5,619	33.61	188,854.59	
POWER FINANCIAL CORP	3,794	37.32	141,592.08	

	ROGERS COMMUNICATIONS INC	4,870	45.99	223,971.30	
	ROYAL BANK OF CANADA	17,339	76.01	1,317,937.39	
	SAPUTO INC	3,517	36.22	127,385.74	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,856	29.63	173,513.28	
	SILVER WHEATON CORP	5,426	26.86	145,742.36	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	2,061	39.28	80,956.08	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	7,821	39.81	311,354.01	
	SUNCOR ENERGY INC	18,190	38.36	697,768.40	
	TALISMAN ENERGY INC	15,245	9.70	147,876.50	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	7,547	19.29	145,581.63	
	THOMSON REUTERS CORP	4,928	49.30	242,950.40	
	TORONTO-DOMINION BANK	22,177	53.96	1,196,670.92	
	TOURMALINE OIL CORP	2,296	41.60	95,513.60	
	TRANSCANADA CORP	8,784	55.56	488,039.04	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	3,950	217.41	858,769.50	
	VERMILION ENERGY INC	1,496	56.23	84,120.08	
カナダ・ドル 小計		442,014		19,183,827.23 (1,821,120,719)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	55,300	3.68	203,504.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	25,000	19.45	486,250.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	125,000	1.05	131,250.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	63,700	2.51	159,887.00	
	KEPPEL CORP LTD	27,600	8.77	242,052.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	41,700	10.51	438,267.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	17,700	12.26	217,002.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	40,700	4.12	167,684.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	117,900	4.28	504,612.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	19,800	22.97	454,806.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	42,800	3.29	140,812.00	
シンガポール・ドル 小計		577,200		3,146,126.00 (275,663,560)	
スイス・フラン	ABB LTD	27,660	20.26	560,391.60	
	ACTELION LTD-REG	1,303	109.60	142,808.80	
	ADECCO SA-REG	2,498	76.20	190,347.60	

	ARYZTA AG	1,237	72.50	89,682.50	
	BALOISE HOLDING AG	793	121.80	96,587.40	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	9	5,105.00	45,945.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	59,840.00	119,680.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	6,536	84.25	550,658.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	19,539	23.53	459,752.67	
	GEBERIT AG-REG	525	331.80	174,195.00	
	GIVAUDAN-REG	121	1,817.00	219,857.00	
	HOLCIM LTD-REG	3,060	72.35	221,391.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,068	44.28	135,851.04	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG- REG	925	134.20	124,135.00	
	LONZA GROUP AG	717	113.50	81,379.50	
	NESTLE SA	39,418	71.90	2,834,154.20	
	NOVARTIS AG	28,164	96.30	2,712,193.20	
	ROCHE HOLDING AG	8,616	257.80	2,221,204.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	914	151.80	138,745.20	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	81	1,907.00	154,467.00	
	SIKA AG-BEARER	30	3,295.00	98,850.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	715	129.30	92,449.50	
	SWATCH GROUP AG	508	426.80	216,814.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG- REG	478	227.90	108,936.20	
	SWISS RE AG	4,436	85.50	379,278.00	
	SWISSCOM AG	322	534.50	172,109.00	
	SYNGENTA AG	1,207	332.20	400,965.40	
	TRANSOCEAN LTD	5,102	16.27	83,009.54	
	UBS GROUP AG	45,798	16.51	756,124.98	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,845	304.80	562,356.00	
スイス・フラン	小計	205,627		14,144,319.53 (1,789,397,864)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	4,537	162.50	737,262.50	
	ASSA ABLOY AB	4,333	489.70	2,121,870.10	
	ATLAS COPCO AB	5,071	250.50	1,270,285.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	8,149	271.50	2,212,453.50	
	BOLIDEN AB	3,960	165.00	653,400.00	

	ELECTROLUX AB	2,947	274.60	809,246.20	
	GETINGE AB-B SHS	2,728	217.80	594,158.40	
	HENNES & MAURITZ AB	11,732	358.20	4,202,402.40	
	HEXAGON AB-B SHS	3,401	301.90	1,026,761.90	
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	2,898	282.70	819,264.60	
	INVESTOR AB	5,931	320.00	1,897,920.00	
	NORDEA BANK AB	37,706	110.90	4,181,595.40	
	SANDVIK AB	14,550	95.35	1,387,342.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	19,315	101.20	1,954,678.00	
	SKANSKA AB-B SHS	5,743	205.70	1,181,335.10	
	SKF AB	5,796	209.00	1,211,364.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB	7,991	198.40	1,585,414.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	6,309	400.60	2,527,385.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	11,416	209.50	2,391,652.00	
	SWEDISH MATCH AB	2,755	253.50	698,392.50	
	TELE2 AB	4,740	96.75	458,595.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	38,156	108.30	4,132,294.80	
	TELIASONERA AB	31,893	52.30	1,668,003.90	
	VOLVO AB	20,325	99.00	2,012,175.00	
スウェーデン・クローナ 小計		262,382		41,735,253.10 (591,805,888)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	79	14,190.00	1,121,010.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	63	13,710.00	863,730.00	
	CARLSBERG AS-B	1,497	540.50	809,128.50	
	COLOPLAST-B	1,443	513.50	740,980.50	
	DANSKE BANK A/S	8,466	173.70	1,470,544.20	
	DSV A/S	2,969	211.00	626,459.00	
	NOVO-NORDISK A/S	24,748	310.40	7,681,779.20	
	NOVOZYMES A/S	3,079	320.50	986,819.50	
	PANDORA A/S	1,334	576.00	768,384.00	
	TDC A/S	11,858	50.10	594,085.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,661	275.20	732,307.20	
デンマーク・クローネ 小計		58,197		16,395,227.90 (297,409,434)	
ニュージーランド・ドル	SPARK NEW ZEALAND LTD	35,143	3.16	111,051.88	
ニュージーランド・ドル 小計		35,143		111,051.88 (9,938,032)	

ノルウェー・クローネ	DNB ASA	12,664	123.10	1,558,938.40	
	NORSK HYDRO ASA	18,809	44.60	838,881.40	
	ORKLA ASA	11,678	59.40	693,673.20	
	SEADRILL LTD	5,445	93.85	511,013.25	
	STATOIL ASA	14,036	142.00	1,993,112.00	
	TELENOR ASA	9,982	154.60	1,543,217.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,411	430.70	1,038,417.70	
ノルウェー・クローネ 小計		75,025		8,177,253.15 (128,955,283)	
ユーロ	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	6,568	17.30	113,626.40	
	ACCOR	2,547	46.90	119,467.03	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,538	33.86	85,949.37	
	ADIDAS AG	2,719	69.05	187,746.95	
	AEGON NV	24,105	6.72	161,985.60	
	AGEAS	3,391	31.65	107,325.15	
	AIR LIQUIDE	4,353	115.85	504,295.05	
	AIRBUS GROUP NV	7,351	52.46	385,633.46	
	AKZO NOBEL NV	3,202	65.88	210,947.76	
	ALCATEL-LUCENT	35,703	3.41	121,997.15	
	ALLIANZ SE	5,612	147.32	826,776.67	
	ALSTOM RGPT	2,720	28.53	77,615.20	
	ALTICE SA	1,039	83.47	86,725.33	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	5,429	35.94	195,118.26	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	9,908	107.95	1,069,568.60	
	ARCELORMITTAL	13,083	9.63	126,067.78	
	ASML HOLDING NV	4,416	91.58	404,417.28	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	15,825	18.08	286,116.00	
	ATLANTIA SPA	6,309	23.00	145,107.00	
	ATOS	1,184	65.37	77,398.08	
	AXA	22,859	21.15	483,467.85	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	72,087	8.78	633,140.12	
	BANCO DE SABADELL SA	44,156	2.42	107,210.76	
	BANCO POPOLARE SC	5,047	13.85	69,900.95	
BANCO POPULAR ESPANOL	21,787	4.01	87,431.23		
BANCO SANTANDER SA	149,694	6.40	959,239.15		
BANK OF IRELAND	342,614	0.32	109,979.09		

BANKIA SA	53,518	1.24	66,415.83	
BANKINTER SA	8,326	6.87	57,274.55	
BASF SE	11,356	84.01	954,017.56	
BAYER AG	10,181	125.51	1,277,837.67	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,319	112.66	486,600.13	
BEIERSDORF AG	1,433	74.51	106,774.26	
BELGACOM SA	1,950	35.13	68,513.25	
BNP PARIBAS	13,176	51.29	675,797.04	
BOSKALIS WESTMINSTER	1,214	40.33	48,960.62	
BOUYGUES	2,337	35.33	82,566.21	
BRENTAG AG	2,307	52.24	120,517.68	
BUREAU VERITAS SA	3,345	20.12	67,318.12	
CAIXABANK	27,545	3.92	108,141.67	
CAP GEMINI SA	1,868	68.04	127,098.72	
CARREFOUR SA	8,232	29.55	243,255.60	
CASINO GUICHARD PERRACHON	874	81.00	70,794.00	
CHRISTIAN DIOR SA	753	170.55	128,424.15	
CIE DE SAINT-GOBAIN	6,018	41.50	249,777.09	
CNH INDUSTRIAL NV	14,298	7.62	109,022.25	
COMMERZBANK AG	12,251	12.08	148,004.33	
CONTINENTAL AG	1,389	216.40	300,582.37	
CREDIT AGRICOLE SA	13,377	12.89	172,496.41	
CRH PLC	9,990	24.83	248,051.70	
DAIMLER AG	11,888	85.24	1,013,333.12	
DANONE	7,271	60.00	436,260.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	1,617	60.30	97,505.10	
DELHAIZE GROUP	1,384	78.89	109,183.76	
DELTA LLOYD NV	2,991	17.20	51,460.15	
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	3,484	33.70	117,410.80	
DEUTSCHE BANK AG	17,396	29.39	511,425.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,598	71.24	185,089.31	
DEUTSCHE POST AG	12,406	29.67	368,110.83	
DEUTSCHE TELEKOM AG	39,526	15.95	630,439.70	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	4,160	23.99	99,823.36	
E.ON SE	24,985	13.36	333,999.48	
EDENRED	3,019	23.79	71,822.01	
EDF	3,009	23.72	71,373.48	
ENAGAS SA	2,640	27.00	71,280.00	

ENEL SPA	84,341	3.95	333,484.31	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	33,364	3.32	110,935.30	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	32,131	16.37	525,984.47	
ERSTE GROUP BANK AG	3,759	23.89	89,821.30	
ESSILOR INTERNATIONA	2,637	99.31	261,880.47	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,547	30.88	78,664.09	
FERROVIAL S.A.	6,362	18.47	117,506.14	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	11,310	13.44	152,006.40	
FORTUM OYJ	5,919	19.50	115,420.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	2,781	64.24	178,654.22	
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,816	47.71	229,780.99	
GALP ENERGIA SGPS SA	6,265	10.51	65,845.15	
GAS NATURAL SDG SA	4,150	20.62	85,593.75	
GDF SUEZ	18,086	18.59	336,218.74	
GEA GROUP AG	2,511	42.95	107,852.47	
GEMALTO	1,029	69.93	71,957.97	
GRIFOLS SA	1,930	36.21	69,894.95	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,344	76.67	103,044.48	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	6,790	11.95	81,174.45	
HANNOVER RUECK SE	928	83.47	77,462.01	
HEIDELBERGCEMENT AG	1,873	70.71	132,443.57	
HEINEKEN HOLDING NV	1,426	59.21	84,433.46	
HEINEKEN NV	2,933	67.22	197,156.26	
HENKEL AG & CO KGAA	1,788	89.62	160,244.13	
HENKEL KGAA-VORZUG	2,002	100.16	200,524.32	
HERMES INTERNATIONAL	195	286.35	55,838.25	
HUGO BOSS AG	552	115.80	63,922.70	
IBERDROLA SA	60,944	5.90	359,935.26	
ILIAD SA	336	234.75	78,876.00	
INDITEX SA	13,674	27.30	373,300.20	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	15,146	10.25	155,322.23	
ING GROEP NV	47,614	12.61	600,412.54	
INTESA SANPAOLO	156,572	2.90	454,685.08	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	15,399	7.46	114,907.33	
K+S AG	2,205	28.79	63,492.97	

KBC GROUP SA	3,224	53.54	172,612.96	
KERING	984	179.60	176,726.40	
KERRY GROUP PLC-A	2,271	62.05	140,915.55	
KONE OYJ	4,340	40.38	175,249.20	
KONINKLIJKE AHOLD NV	11,902	16.80	199,953.60	
KONINKLIJKE DSM NV	2,219	48.16	106,867.04	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,085	25.72	310,826.20	
L'OREAL SA	3,129	157.60	493,130.40	
LAFARGE SA	2,491	65.76	163,808.16	
LEGRAND SA	3,735	48.40	180,774.00	
LINDE AG	2,324	177.90	413,439.60	
LUXOTTICA GROUP SPA	2,354	53.45	125,821.30	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	3,473	161.00	559,153.00	
MEDIOBANCA SPA	9,211	8.20	75,576.25	
MERCK KGAA	1,645	87.71	144,286.24	
METRO AG	2,306	31.00	71,486.00	
MICHELIN (C.G.D.E.)	2,505	85.57	214,352.85	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	2,158	179.52	387,408.47	
NATIXIS	12,150	6.34	77,067.45	
NOKIA OYJ	46,663	7.11	332,007.24	
OMV AG	2,667	24.34	64,914.78	
ORANGE S.A.	23,368	15.69	366,760.76	
PERNOD-RICARD	2,764	103.20	285,244.80	
PEUGEOT SA	5,028	14.23	71,548.44	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	2,071	82.20	170,240.34	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	2,974	41.60	123,724.34	
PUBLICIS GROUPE	2,649	71.28	188,820.72	
QIAGEN NV	3,310	21.46	71,049.15	
RANDSTAD HOLDINGS NV	1,771	52.30	92,623.30	
RED ELECTRICA DE ESPANA	1,383	73.00	100,959.00	
REED ELSEVIER NV	9,429	22.44	211,586.76	
RENAULT SA	2,511	85.15	213,811.65	
REPSOL SA	13,022	16.87	219,681.14	
REXEL SA	4,437	16.62	73,742.94	
ROYAL KPN NV	40,360	3.00	121,362.52	
RWE AG	6,240	23.48	146,546.40	
SAFRAN SA	3,567	61.63	219,834.21	

SAMPO OYJ	6,084	43.94	267,330.96	
SANOFI	14,674	87.39	1,282,360.86	
SAP SE	11,350	61.08	693,269.35	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,674	71.38	476,390.12	
SIEMENS AG	9,771	97.90	956,580.90	
SNAM SPA	29,319	4.37	128,241.30	
SOCIETE GENERALE	9,166	40.45	370,810.53	
SODEXO	1,378	87.65	120,781.70	
SOLVAY SA	840	125.85	105,714.00	
STMICROELECTRONICS NV	8,967	7.82	70,121.94	
STORA ENSO OYJ	8,953	8.61	77,130.09	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	4,361	16.28	70,997.08	
SYMRISE AG	1,536	55.00	84,483.07	
TECHNIP SA	1,393	58.76	81,852.68	
TELECOM ITALIA SPA	189,331	1.01	191,792.30	
TELEFONICA SA	52,352	13.36	699,422.72	
TENARIS SA	6,555	12.70	83,248.50	
TERNA SPA	25,505	3.94	100,540.71	
THALES SA	1,452	51.80	75,213.60	
THYSSENKRUPP AG	5,984	23.26	139,205.79	
TOTAL SA	26,322	46.03	1,211,733.27	
UCB SA	1,630	67.39	109,845.70	
UMICORE	1,705	36.78	62,718.42	
UNICREDIT SPA	56,178	5.84	328,360.41	
UNILEVER NV	20,018	37.42	749,073.56	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	11,991	6.90	82,737.90	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,714	40.01	68,590.85	
UPM-KYMMENE OYJ	7,369	16.80	123,799.20	
VALEO SA	1,020	134.10	136,782.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	5,823	16.59	96,603.57	
VINCI SA	6,354	52.72	334,982.88	
VIVENDI SA	15,476	21.15	327,317.40	
VOESTALPINE AG	1,770	35.01	61,976.55	
VOLKSWAGEN AG	581	220.23	127,957.69	
VOLKSWAGEN AG	1,816	226.25	410,871.81	
WARTSILA OYJ	2,284	41.30	94,329.20	
WOLTERS KLUWER NV	4,733	28.20	133,494.26	
ZODIAC SA	2,760	31.56	87,119.40	

ユーロ 小計		2,544,245		42,007,382.47 (5,689,479,882)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	150,475	44.50	6,696,137.50	
	BANK OF EAST ASIA	22,600	31.85	719,810.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	52,039	27.20	1,415,460.80	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	19,407	152.00	2,949,864.00	
	CLP HOLDINGS LTD	27,143	68.15	1,849,795.45	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	29,810	43.45	1,295,244.50	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	34,157	22.25	759,993.25	
	HANG SENG BANK LTD	11,512	144.70	1,665,786.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	16,755	55.15	924,038.25	
	HONG KONG & CHINA GAS	87,816	17.50	1,536,780.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,111	177.10	2,499,058.10	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	28,512	104.70	2,985,206.40	
	LI & FUNG LTD	77,278	7.79	601,995.62	
	MTR CORP	28,255	34.85	984,686.75	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	78,669	9.27	729,261.63	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	19,587	78.35	1,534,641.45	
	SANDS CHINA LTD	31,780	39.75	1,263,255.00	
	SINO LAND CO	52,000	12.68	659,360.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	22,023	123.40	2,717,638.20	
	SWIRE PACIFIC LTD	10,366	105.80	1,096,722.80	
WHARF HOLDINGS LTD	22,733	59.80	1,359,433.40		
WHEELLOCK & CO LTD	18,000	42.80	770,400.00		
WYNN MACAU LTD	22,103	23.95	529,366.85		
香港・ドル 小計		877,131		37,543,936.35 (576,299,424)	
合計		12,996,502		44,491,337,870 (44,491,337,870)	

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	4,293.00	94,188.42	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	11,296.00	106,634.24	

	AMERICAN TOWER REIT INC	4,805.00	463,826.65	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	12,105.00	129,765.60	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,613.00	275,823.00	
	BOSTON PROPERTIES INC	1,938.00	270,099.06	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,112.00	84,145.04	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	4,110.00	364,598.10	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,659.00	111,849.78	
	DUKE REALTY CORP	4,863.00	104,359.98	
	EQUINIX INC	712.00	167,590.56	
	EQUITY RESIDENTIAL	4,218.00	331,745.70	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	822.00	186,232.32	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	926.00	133,566.24	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	6,620.00	195,554.80	
	HCP INC	5,747.00	249,764.62	
	HEALTH CARE REIT INC	3,911.00	305,253.55	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	9,596.00	208,904.92	
	IRON MOUNTAIN INC	2,009.00	73,750.39	
	KIMCO REALTY CORP	5,616.00	151,070.40	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,222.00	85,880.30	
	MACERICH CO/THE	1,911.00	160,027.14	
	PLUM CREEK TIMBER CO	2,612.00	112,655.56	
	PROLOGIS INC	6,402.00	275,414.04	
	PUBLIC STORAGE	1,765.00	353,317.70	
	REALTY INCOME CORP	2,925.00	152,012.25	
	REGENCY CENTERS CORP	1,316.00	86,987.60	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,723.00	714,108.63	
	SL GREEN REALTY CORP	1,270.00	163,372.80	
	UDR INC	3,425.00	110,250.75	
	VENTAS INC	3,632.00	281,225.76	
	VORNADO REALTY TRUST	2,124.00	238,928.76	
	アメリカ・ドル 小計	121,298.00	6,742,904.66 (802,945,086)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	12,682.00	103,675.35	
	HAMMERSON PLC	10,776.00	71,660.40	
	INTU PROPERTIES PLC	13,112.00	47,517.88	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,294.00	126,616.20	
イギリス・ポンド	小計	46,864.00	349,469.83 (63,991,421)	
オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	15,278.00	117,487.82	
	GOODMAN GROUP	27,767.00	171,600.06	
	GPT GROUP	29,158.00	135,876.28	
	MIRVAC GROUP	64,091.00	132,027.46	
	NOVION PROPERTY GROUP	42,348.00	103,752.60	
	SCENTRE GROUP	74,171.00	277,399.54	
	STOCKLAND	35,985.00	168,049.95	
オーストラリア・ドル	小計	317,966.00	1,397,873.71 (130,407,639)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,285.00	328,767.25	
ユーロ	小計	1,285.00	328,767.25 (44,528,236)	
香港・ドル	LINK REIT	32,371.00	1,623,405.65	
香港・ドル	小計	32,371.00	1,623,405.65 (24,919,277)	
投資証券	合計		1,066,791,659 (1,066,791,659)	
合計			1,066,791,659 (1,066,791,659)	

(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 564銘柄	58.95%	-%	63.35%
	投資証券 32銘柄	-%	1.69%	
イギリス・ポンド	株式 92銘柄	8.17%	-%	8.67%
	投資証券 4銘柄	-%	0.13%	
イスラエル・シケル	株式 2銘柄	0.21%	-%	0.21%
オーストラリア・ドル	株式 36銘柄	2.67%	-%	3.07%
	投資証券 8銘柄	-%	0.27%	
カナダ・ドル	株式 74銘柄	3.83%	-%	4.00%
シンガポール・ドル	株式 11銘柄	0.58%	-%	0.61%

スイス・フラン	株式	30銘柄	3.76%	-%	3.93%
スウェーデン・クローナ	株式	24銘柄	1.24%	-%	1.30%
デンマーク・クローネ	株式	11銘柄	0.62%	-%	0.65%
ニュージーランド・ドル	株式	1銘柄	0.02%	-%	0.02%
ノルウェー・クローネ	株式	7銘柄	0.27%	-%	0.28%
ユーロ	株式	175銘柄	11.95%	-%	12.59%
	投資証券	1銘柄	-%	0.09%	
香港・ドル	株式	23銘柄	1.21%	-%	1.32%
	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)	(平成27年2月23日現在)
資産の部		
流動資産		

預金	107,321,948	14,987,772
コール・ローン	44,980,402	158,376,605
国債証券	5,336,306,163	9,974,919,871
派生商品評価勘定	77,423	37,288
未収利息	16,012,088	75,004,646
前払費用	37,813,339	24,845,588
流動資産合計	5,542,511,363	10,248,171,770
資産合計	5,542,511,363	10,248,171,770
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,588	48,724
未払金	122,611,816	76,630,521
未払解約金	301,831	52,655,428
流動負債合計	122,923,235	129,334,673
負債合計	122,923,235	129,334,673
純資産の部		
元本等		
元本	4,485,540,763	7,305,510,346
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	934,047,365	2,813,326,751
純資産合計	5,419,588,128	10,118,837,097
負債純資産合計	5,542,511,363	10,248,171,770

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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）	（平成27年2月23日現在）
1. 受益権総口数	4,485,540,763口	7,305,510,346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)	1,3851円 (13,851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)	(自 平成26年2月22日 至 平成27年2月23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、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、金利変動リスク等の市場リスク、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。	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。 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。	同左

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）	（平成27年2月23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 （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。	同左

（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	平成27年2月23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）
国債証券	6,006,484	160,359,008
合計	6,006,484	160,359,008

（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）			（平成27年2月23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）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	49,684,640	-	49,752,475	67,835	99,614,591	-	99,603,155	11,436
アメリカ・ドル	34,101,088	-	34,174,975	73,887	52,620,425	-	52,615,932	4,493

イギリス・ポンド	2,218,969	-	2,219,550	581	8,971,386	-	8,942,230	29,156
カナダ・ドル	-	-	-	-	3,213,720	-	3,199,261	14,459
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	3,010,661	-	3,019,605	8,944
ユーロ	13,364,583	-	13,357,950	6,633	31,798,399	-	31,826,127	27,728
合計	49,684,640	-	49,752,475	67,835	99,614,591	-	99,603,155	11,436

(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開示対象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)	(平成27年2月23日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	399,963,178円	4,485,540,763円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	4,122,059,058円	4,537,837,870円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	36,481,473円	1,717,868,287円
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	566,736,439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	1,432,950,970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	550,333,214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	796,460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	3,257,572,341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	1,497,120,922円
計	4,485,540,763円	7,305,510,346円

附属明細表(平成27年2月23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	140,000.00	186,746.00	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	120,000.00	165,974.40	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	120,000.00	164,484.00	
		US TREASURY N/B 0.875 2019/07/31	1,140,000.00	1,107,931.80	
		US TREASURY N/B 1 2016/10/31	2,200,000.00	2,214,762.00	
		US TREASURY N/B 1.25 2019/10/31	1,070,000.00	1,054,527.80	
		US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	500,000.00	494,410.00	
		US TREASURY N/B 1.5 2016/07/31	1,930,000.00	1,958,042.90	
		US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	350,000.00	340,837.00	
		US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	250,000.00	246,640.00	
		US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	490,000.00	478,779.00	
		US TREASURY N/B 1.875 2017/10/31	1,560,000.00	1,596,192.00	
		US TREASURY N/B 2 2021/11/15	710,000.00	714,153.50	
		US TREASURY N/B 2.25 2021/07/31	640,000.00	653,849.60	
		US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	140,000.00	141,344.00	
		US TREASURY N/B 2.375 2017/07/31	1,650,000.00	1,709,152.50	
		US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	1,000,000.00	1,034,680.00	
		US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	960,000.00	990,969.60	
		US TREASURY N/B 2.625 2016/04/30	1,830,000.00	1,878,458.40	
		US TREASURY N/B 2.625 2018/04/30	800,000.00	836,312.00	
US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	620,000.00	649,158.60			

US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	590,000.00	617,051.50	
US TREASURY N/B 2.75 2019/02/15	930,000.00	978,313.50	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	490,000.00	490,955.50	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	250,000.00	263,357.50	
US TREASURY N/B 3.125 2017/01/31	1,910,000.00	1,999,961.00	
US TREASURY N/B 3.125 2019/05/15	1,020,000.00	1,088,125.80	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	840,000.00	902,605.20	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	50,000.00	54,027.00	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	920,000.00	992,661.60	
US TREASURY N/B 3.5 2018/02/15	900,000.00	963,279.00	
US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	710,000.00	775,227.70	
US TREASURY N/B 3.625 2021/02/15	580,000.00	639,537.00	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	620,000.00	731,017.20	
US TREASURY N/B 3.75 2018/11/15	760,000.00	827,032.00	
US TREASURY N/B 4 2018/08/15	810,000.00	885,994.20	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	210,000.00	269,159.10	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	60,000.00	77,507.40	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	60,000.00	78,388.80	
US TREASURY N/B 4.5 2017/05/15	1,810,000.00	1,957,623.60	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	80,000.00	106,180.80	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	110,000.00	145,620.20	
WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	340,000.00	445,264.00	
WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	290,000.00	383,478.60	
アメリカ・ドル 小計	32,560,000.00	34,289,773.30 (4,083,226,205)	

イギリス・ポンド	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	210,000.00	240,744.00	
	TSY 4 1/2% 2019 4.5 2019/03/07	360,000.00	409,492.80	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	200,000.00	282,958.00	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	230,000.00	301,654.20	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	180,000.00	250,988.40	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	140,000.00	176,104.60	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	220,000.00	283,885.80	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	120,000.00	176,397.60	
	TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	310,000.00	363,351.00	
	TSY 4% 2016 4 2016/09/07	40,000.00	42,192.80	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	220,000.00	257,485.80	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	80,000.00	113,971.20	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	260,000.00	370,988.80	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	100,000.00	129,783.00	
	TSY 5% 2018 5 2018/03/07	290,000.00	326,647.30	
	UK TREASURY 8.75 2017/08/25	220,000.00	264,994.40	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	140,000.00	146,419.00	
	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	140,000.00	152,009.20	
UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	70,000.00	91,632.10		
UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	120,000.00	170,662.80		
イギリス・ポンド 小計		3,650,000.00	4,552,362.80 (833,583,152)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2016/06/15	210,000.00	217,765.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	480,000.00	542,318.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	470,000.00	578,870.80	
	Australia Government Bond 4.75 2027/04/21	370,000.00	448,121.80	
オーストラリア・ドル 小計		1,530,000.00	1,787,076.80 (166,716,395)	

カナダ・ドル	CANADA GOVT 5.75 2029/06/01	120,000.00	181,226.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	420,000.00	470,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	170,000.00	225,624.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	480,000.00	543,067.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2016/06/01	680,000.00	710,824.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	180,000.00	277,533.00	
カナダ・ドル 小計		2,050,000.00	2,408,675.00 (228,655,518)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	420,000.00	424,767.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	10,000.00	10,821.30	
シンガポール・ドル 小計		430,000.00	435,588.30 (38,166,247)	
スイス・フラン	Switzerland Government Bond 2.25 2020/07/06	250,000.00	286,810.00	
スイス・フラン 小計		250,000.00	286,810.00 (36,284,333)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	610,000.00	903,739.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.75 2017/08/12	2,330,000.00	2,565,726.10	
スウェーデン・クローナ 小計		2,940,000.00	3,469,465.50 (49,197,021)	
デンマーク・クロー ネ	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	1,910,000.00	2,302,810.60	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2017/11/15	420,000.00	472,978.80	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	670,000.00	1,216,230.90	
デンマーク・クローネ 小計		3,000,000.00	3,992,020.30 (72,415,248)	
ノルウェー・クロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	490,000.00	560,863.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	1,040,000.00	1,201,054.40	
ノルウェー・クローネ 小計		1,530,000.00	1,761,918.20 (27,785,450)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	380,000.00	431,961.20	

	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2017/10/25	780,000.00	850,629.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	430,000.00	497,948.60	
ポーランド・ズロチ	小計	1,590,000.00	1,780,538.80 (57,814,095)	
マレーシア・リングット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	270,000.00	259,332.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	840,000.00	858,345.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.262 2016/09/15	390,000.00	395,218.20	
マレーシア・リングット	小計	1,500,000.00	1,512,896.10 (49,396,058)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	3,310,000.00	3,763,205.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2017/12/14	6,050,000.00	6,584,638.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	2,210,000.00	2,825,043.00	
メキシコ・ペソ	小計	11,570,000.00	13,172,886.70 (104,197,534)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 2.75 2016/03/28	150,000.00	154,695.00	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	210,000.00	253,073.10	
	BELGIUM KINGDOM 4 2018/03/28	300,000.00	337,755.00	
	BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	340,000.00	430,423.00	
	BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	110,000.00	180,558.40	
	BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	170,000.00	286,021.60	
	BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	200,000.00	315,382.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.15 2016/01/31	160,000.00	164,534.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2017/01/31	640,000.00	683,654.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	310,000.00	372,709.90	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	720,000.00	840,398.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.5 2018/01/31	310,000.00	346,893.10	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	200,000.00	258,622.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	220,000.00	323,378.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	40,000.00	61,312.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	260,000.00	340,477.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	250,000.00	329,117.50	
BTPS 6.5 11/01/27 6.5 2027/11/01	250,000.00	379,085.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	430,000.00	476,126.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	420,000.00	475,498.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	260,000.00	294,920.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	100,000.00	114,879.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	70,000.00	97,195.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2020/01/04	340,000.00	396,120.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	150,000.00	231,564.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2019/07/04	630,000.00	731,007.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.75 2017/01/04	950,000.00	1,020,233.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2018/01/04	700,000.00	784,854.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	130,000.00	209,521.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	170,000.00	291,618.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	110,000.00	186,901.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2016/08/01	210,000.00	220,577.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	620,000.00	722,262.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2017/02/01	880,000.00	943,131.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	390,000.00	455,722.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	140,000.00	176,457.40	

BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/02/01	300,000.00	343,722.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	330,000.00	382,569.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/02/01	640,000.00	716,608.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	600,000.00	758,796.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	120,000.00	173,654.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	300,000.00	394,530.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	210,000.00	296,883.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	210,000.00	305,610.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	200,000.00	280,984.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	340,000.00	442,601.80	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	210,000.00	322,669.20	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	150,000.00	257,491.50	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	100,000.00	125,561.00	
FINNISH GOVERNMENT 3.375 2020/04/15	290,000.00	340,283.10	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	340,000.00	391,914.60	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	340,000.00	405,375.20	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2016/04/25	280,000.00	291,020.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	90,000.00	128,799.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	410,000.00	482,094.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	480,000.00	620,299.20	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2017/04/25	780,000.00	845,192.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	420,000.00	512,416.80	
FRANCE (GOVT OF) 4 2018/04/25	630,000.00	711,377.10	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	140,000.00	215,070.80	

	FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	80,000.00	138,522.40	
	FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	60,000.00	106,250.40	
	FRANCE (GOVT OF) 4.25 2019/04/25	720,000.00	847,648.80	
	FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	400,000.00	528,748.00	
	FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	130,000.00	218,838.10	
	FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	110,000.00	178,828.10	
	FRANCE O.A.T. 5.75 2032/10/25	150,000.00	261,309.00	
	FRENCH OAT 5.5 2029/04/25	260,000.00	416,278.20	
	ITALY BTP 6 2031/05/01	230,000.00	351,088.10	
	NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	420,000.00	533,244.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2019/07/15	390,000.00	459,228.90	
	NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	200,000.00	321,012.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT 4.5 2017/07/15	350,000.00	388,720.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	160,000.00	255,217.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	240,000.00	299,023.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	160,000.00	259,780.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.3 2017/09/15	120,000.00	133,612.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.35 2019/03/15	250,000.00	295,077.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	140,000.00	204,862.00	
	SPANISH GVOT 5.75 07 5.75 2032/07/30	230,000.00	350,283.10	
	TREASURY 4 1/2% 2018 4.5 2018/10/18	320,000.00	370,598.40	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	180,000.00	253,137.60	
ユーロ 小計		24,750,000.00	30,803,517.10 (4,172,028,356)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	4,170,000.00	5,114,505.00	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2017/09/15	290,000.00	300,950.40	
	南アフリカ・ランド 小計	4,460,000.00	5,415,455.40 (55,454,263)	
国債証券 合計			9,974,919,871 (9,974,919,871)	
合計			9,974,919,871 (9,974,919,871)	

(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	組入債券 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	国債証券 44銘柄	40.35%	40.93%
イギリス・ポンド	国債証券 20銘柄	8.24%	8.36%
オーストラリア・ドル	国債証券 4銘柄	1.65%	1.67%
カナダ・ドル	国債証券 6銘柄	2.26%	2.29%
シンガポール・ドル	国債証券 2銘柄	0.38%	0.38%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.36%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.49%	0.49%
デンマーク・クローネ	国債証券 3銘柄	0.72%	0.73%
ノルウェー・クローネ	国債証券 2銘柄	0.27%	0.28%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	0.57%	0.58%
マレーシア・リングギット	国債証券 3銘柄	0.49%	0.50%
メキシコ・ペソ	国債証券 3銘柄	1.03%	1.04%
ユーロ	国債証券 82銘柄	41.23%	41.83%
南アフリカ・ランド	国債証券 2銘柄	0.55%	0.56%

(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27年3月31日現在)

資産総額	4,020,475,899円
負債総額	8,967,457円
純資産総額(-)	4,011,508,442円
発行済数量	2,433,936,740口
1口当たり純資産額(/)	1.6482円

「DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)」 (平成27年3月31日現在)

資産総額	13,639,629,231円
負債総額	16,608,374円
純資産総額(-)	13,623,020,857円
発行済数量	7,247,673,832口
1口当たり純資産額(/)	1.8796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27年3月31日現在)

資産総額	7,906,429,258円
負債総額	8,379,481円
純資産総額(-)	7,898,049,777円
発行済数量	3,750,881,471口
1口当たり純資産額(/)	2.1057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。

第二部【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27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27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	267	36,189
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	30	4,422
単位型公社債投資信託	0	0
合計	297	40,611

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19期事業年度（自平成25年4月1日 至平成26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20期事業年度に係る中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,199,671		1,509,845
有価証券		6,810,580		7,325,806
前払費用	1	420,669	1	207,351
未収委託者報酬		1,578,598		1,897,225
未収運用受託報酬	1	957,692	1	1,419,102
未収投資助言報酬	1	158,845	1	190,027
繰延税金資産		360,157		406,503
その他		50,805		26,376
流動資産合計		11,537,020		12,982,239
固定資産				
有形固定資産				
建物	2	123,366	2	102,335
車両	2	1,731	2	1,009
器具備品	2	125,394	2	105,718

有形固定資産合計		250,493		209,063
無形固定資産				
ソフトウェア		1,068,747		949,954
ソフトウェア仮勘定		51,802		28,053
その他		8,139		8,107
無形固定資産合計		1,128,689		986,115
投資その他の資産				
投資有価証券		28,546,974		31,159,584
関係会社株式		66,222		66,222
差入保証金	1	285,266	1	284,888
繰延税金資産		172,442		160,839
その他		17		17
投資その他の資産合計		29,070,923		31,671,552
固定資産合計		30,450,106		32,866,731
資産合計		41,987,127		45,848,971

負債の部

流動負債				
預り金		29,275		29,930
未払償還金		144,737		137,842
未払手数料	1	587,015	1	711,826
未払運用委託報酬		488,571		508,934
未払投資助言報酬		163,129		310,490
その他未払金	1	219,369	1	248,117
未払費用	1	80,370	1	79,355
未払法人税等		437,800		1,283,286
前受運用受託報酬		58		-
賞与引当金		745,159		769,569
その他		68,729		168,940
流動負債合計		2,964,217		4,248,293

固定負債

退職給付引当金		929,869		1,106,561
役員退職慰労引当金		12,650		19,950

固定負債合計	942,519	1,126,511
負債合計	3,906,737	5,374,805
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	18,272,607	20,276,469
利益剰余金合計	18,952,414	20,956,276
株主資本合計	37,234,254	39,238,116
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,135	1,236,049
評価・換算差額等合計	846,135	1,236,049
純資産合計	38,080,390	40,474,166
負債・純資産合計	41,987,127	45,848,971

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	9,738,507	12,436,743
運用受託報酬	5,029,976	6,674,387
投資助言報酬	681,350	791,350
業務受託料	47,100	47,100
営業収益計	15,496,935	19,949,580

営業費用

支払手数料	4,096,763	5,367,041
広告宣伝費	4,527	13,397
公告費	-	161
調査費	3,009,996	3,767,832
支払運用委託報酬	1,372,587	1,587,647
支払投資助言報酬	751,264	1,228,668
委託調査費	44,108	66,025
調査費	842,036	885,490
委託計算費	104,631	128,890
営業雑経費	447,523	538,997
通信費	56,472	55,199
印刷費	142,821	147,275
協会費	19,986	20,172
その他営業雑経費	228,242	316,349
営業費用計	7,663,442	9,816,320

一般管理費

役員報酬	1	57,777	1	63,866
給料・手当		2,915,416		2,906,149
賞与引当金繰入額		726,623		766,843
賞与		224,092		248,914
福利厚生費		559,429		569,577
退職給付費用		208,549		241,558
役員退職慰労引当金繰入額		7,100		7,300
その他人件費		121,504		97,103
不動産賃借料		619,902		574,467
その他不動産経費		26,829		26,330
交際費		11,456		14,005
旅費交通費		74,226		79,754
固定資産減価償却費		583,306		511,498
租税公課		80,741		93,822
業務委託費		163,637		208,262
器具備品費		134,449		143,717
保守料		88,640		83,044
保険料		60,440		59,043
諸経費		41,887		48,305
一般管理費計		6,706,012		6,743,562

営業利益

1,127,480	3,389,697
-----------	-----------

営業外収益			
受取利息		172	166
有価証券利息		86,415	76,250
受取配当金		79,789	81,042
為替差益		-	20,176
補助金収入		9,500	-
その他営業外収益		10,147	13,559
営業外収益計		186,025	191,194
営業外費用			
為替差損		15,251	-
控除対象外消費税		5,693	4,451
その他営業外費用		646	1,182
営業外費用計		21,591	5,634
経常利益		1,291,913	3,575,257
特別利益			
投資有価証券売却益		125,271	1,377
投資有価証券償還益		1,755	102,298
特別利益計		127,026	103,675
特別損失			
投資有価証券売却損		400,864	-
投資有価証券償還損		4,005	6,903
固定資産除却損	3	8,268	3
事故損失賠償金	2	58	2
寄付金		-	142,550
特別損失計		413,196	160,764
税引前当期純利益		1,005,743	3,518,168
法人税、住民税及び事業税		557,322	1,474,066
法人税等調整額		125,815	95,320
法人税等合計		431,507	1,378,745
当期純利益		574,236	2,139,422

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備 金	資本剰余 金合計	利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余 金合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	17,833,930	18,513,737	36,795,577
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	574,236	574,236	574,236
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	438,676	438,676	438,676
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	18,272,607	18,952,414	37,234,254

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証 券評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	280,116	280,116	37,075,694
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	574,236
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	566,019	566,019	566,019
当期変動額合計	566,019	566,019	1,004,695
当期末残高	846,135	846,135	38,080,390

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備 金	資本剰余 金合計	利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余 金合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		

当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	18,272,607	18,952,414	37,234,254
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	2,139,422	2,139,422	2,139,422
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,003,862	2,003,862	2,003,862
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	846,135	846,135	38,080,390
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	2,139,422
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	389,913	389,913	389,913
当期変動額合計	389,913	389,913	2,393,775
当期末残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166

注記事項

(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、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期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、当期末における退職給付債務に基づき、当期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。

(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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
前払費用	54,152千円	46,554千円
未収運用受託報酬	493,954	738,331
未収投資助言報酬	133,324	151,082
差入保証金	280,262	280,263
未払手数料	112,306	145,292
その他未払金	35,771	61,527
未払費用	12,606	7,311

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
建物	232,440千円	254,648千円
車両	5,282	6,004
器具備品	599,393	520,399
計	837,116	781,053

(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. 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24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
器具備品	3,568千円	8,924千円
その他	4,700	-
計	8,268	8,924

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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25年6月24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25年3月31日

効力発生日 平成25年6月24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26年6月26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26年3月31日

効力発生日 平成26年6月26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

(単位：千円)

	当事業年度（平成26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	762	100

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1年内	186	107

1年超	108	0
合計	295	107

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24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
支払リース料	186	186
減価償却費相当額	172	172
支払利息相当額	12	6

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	-

当事業年度(平成26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	1,509,845	1,509,845	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,626,076	4,632,360	6,283
その他有価証券	2,699,730	2,699,730	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,227,190	23,229,720	72,529
その他有価証券	7,864,894	7,864,894	-

(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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	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	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(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。

当事業年度(平成26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	1,509,845	-	-	-
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	4,600,000	23,200,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	4,888,361	3,035,620	1,624,417	3,044
合計	10,998,206	26,235,620	1,624,417	3,044

(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

当事業年度(平成26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	26,554,298	26,634,680	80,381
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,554,298	26,634,680	80,381
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	1,298,967	1,297,400	1,567
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,298,967	1,297,400	1,567
合計		27,853,266	27,932,080	78,813

2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度（平成26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	1,799,820	1,799,764	55
	国債・地方債等	1,799,820	1,799,764	55
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	7,295,640	5,502,350	1,793,290
	小計	9,095,460	7,302,114	1,793,345
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	899,910	899,912	2
	国債・地方債等	899,910	899,912	2
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	569,254	583,000	13,745
	小計	1,469,164	1,482,912	13,748
合計		10,564,624	8,785,027	1,779,597

（注1）投資信託受益証券等でありませぬ。

（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ぬ。

区分	前事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）	当事業年度 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）
非上場株式	67,500千円	67,500千円
関係会社株式	66,222千円	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

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26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	256,377	1,377	-
合計	256,377	1,377	-

（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）

前事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

(1)退職給付債務	929,869千円
(2)退職給付引当金	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

(1)勤務費用	186,034千円
(2)退職給付負担金	22,515千円

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。

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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。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。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	929,869 千円
退職給付費用	212,344
退職給付の支払額	35,652
退職給付引当金の期末残高	1,106,561

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	212,344 千円
----------------	------------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,191千円であります。

(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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	283,235 千円	274,274 千円
未払事業税	38,976	98,319
その他	38,054	33,928
繰延税金資産合計	360,265	406,523
繰延税金負債		
有価証券評価差額	107	19
繰延税金負債合計	107	19
繰延税金資産の純額	360,157	406,503
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	333,409	394,378
役員退職慰労引当金	2,339	3,835

税務上の繰延資産償却超過額	4,508	7,110
投資有価証券評価損	492,770	486,598
投資有価証券評価差額	31,716	4,898
その他	3,505	2,461
小計	868,247	899,283
評価性引当額	95,324	97,929
繰延税金資産合計	772,923	801,354
繰延税金負債		
特別分配金否認	85,903	92,089
投資有価証券評価差額	514,578	548,424
繰延税金負債合計	600,481	640,514
繰延税金資産の純額	172,442	160,839

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25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)
法定実効税率	38.01 %	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	0.38	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.15
住民税均等割	0.58	住民税均等割	0.17
税率変更に伴う影響	3.66	税率変更に伴う影響	0.98
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.44	その他	0.11
その他	0.71	税効果会計適用後の法人税等の負担率	39.19
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.90		

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について、前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が19,365千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が34,514千円、その他有価証券評価差額金が15,149千円、それぞれ増加しております。

〔セグメント情報等〕

〔セグメント情報〕

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

〔関連情報〕

前事業年度（自平成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

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26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	3,851,374

〔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	-	-

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26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	3,139,318	未収運用受託報酬	738,331
								投資助言報酬の受取	664,956	未収投資助言報酬	151,082
								業務受託料の受取	47,100	-	-

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	当事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	351,139円62銭	373,212円65銭
1株当たり当期純利益金額	5,295円04銭	19,727円63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いません。

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24年4月1日 至平成25年3月31日)	当事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)

当期純利益	574,236千円	2,139,422千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	574,236千円	2,139,422千円
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20期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		1,522,695
有価証券		6,810,810
前払費用		295,938
未収委託者報酬		2,147,820
未収運用受託報酬		1,670,638
未収投資助言報酬		206,291
繰延税金資産		236,575
その他		24,277
流動資産合計		12,915,047
固定資産		
有形固定資産	1	186,661
無形固定資産		933,336
投資その他の資産		
投資有価証券		32,607,421
関係会社株式		66,222
差入保証金		284,888
繰延税金資産		55,058
その他		17
投資その他の資産合計		33,013,609
固定資産合計		34,133,607
資産合計		47,048,655

負債の部

流動負債

預り金		31,366
未払償還金		137,842
未払手数料		794,767
未払運用委託報酬		574,370
未払投資助言報酬		353,064
その他未払金		136,179
未払費用		92,039
未払法人税等		754,602
前受投資助言報酬		72,269
賞与引当金		423,658
その他	2	233,717
流動負債合計		<u>3,603,878</u>

固定負債

退職給付引当金		1,192,922
役員退職慰労引当金		23,600
固定負債合計		<u>1,216,522</u>

負債合計

4,820,400

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		<u>8,281,840</u>

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	21,794,709
利益剰余金合計	22,474,516
株主資本合計	40,756,356
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,471,898
評価・換算差額等合計	1,471,898
純資産合計	42,228,254
負債・純資産合計	47,048,655

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第20期中間会計期間	
(自平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	6,889,577
運用受託報酬	3,667,305
投資助言報酬	422,741
業務受託料	23,614
営業収益計	11,003,238
営業費用	5,336,884
一般管理費	1 3,275,988
営業利益	2,390,365
営業外収益	2 124,617
営業外費用	3 10,149
経常利益	2,504,834
特別利益	4 18,039
特別損失	5 413
税引前中間純利益	2,522,460
法人税、住民税及び事業税	723,566
法人税等調整額	145,094
法人税等合計	868,661
中間純利益	1,653,799

(3) 中間株主資本等変動計算書

第20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備 金	資本剰余 金合計	利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余 金合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	1,653,799	1,653,799	1,653,799
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,518,239	1,518,239	1,518,239
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	21,794,709	22,474,516	40,756,356

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証 券評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	1,653,799
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	235,848	235,848	235,848
当中間期変動額合計	235,848	235,848	1,754,088
当中間期末残高	1,471,898	1,471,898	42,228,254

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第20期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
----	---

<p>1．有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>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。</p>
<p>2．固定資産の減価償却の方法</p>	<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>
<p>3．引当金の計上基準</p>	<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、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
<p>4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<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>
<p>5．リース取引の処理方法</p>	<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>
<p>6．消費税等の会計処理</p>	<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。</p>

（中間貸借対照表関係）

第20期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	806,775千円
2.消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第20期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
1.減価償却の実施額	
有形固定資産	26,053千円
無形固定資産	187,096千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	87,194千円
有価証券利息	35,848千円
為替差益	16千円
受取利息	97千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	3,952千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	12,353千円
投資有価証券売却益	5,686千円
5.特別損失のうち主要なもの	
事故損失賠償金	376千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第20期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)				
1.発行済株式の種類及び総数				
	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26年6月26日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成26年3月31日	平成26年6月26日

(リース取引関係)

第20期中間会計期間
(自 平成26年4月1日
至 平成26年9月30日)

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。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 848	千円 14

未経過リース料中間会計期間末残高相当額等

1年内	15千円
1年超	0千円
合計	15千円

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	1千円
---------	-----

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。

（金融商品関係）

第20期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成26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含まれておりません（注2参照）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,522,695	1,522,695	-
有価証券			
満期保有目的の債券	5,810,910	5,816,850	5,939
その他有価証券	999,900	999,900	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	21,728,395	21,803,240	74,844
その他有価証券	10,811,526	10,811,526	-

（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、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

これらの時価について、中間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

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などができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式(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20期中間会計期間末(平成26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	27,539,306	27,620,090	80,783
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	27,539,306	27,620,090	80,783
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	0	0	0
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	0	0	0
合計		27,539,306	27,620,090	80,783

2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (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 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,501,414	1,502,000	585
	国債・地方債等	1,501,414	1,502,000	585
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	5,983,480	8,133,619	2,150,139
	小計	7,484,894	9,635,619	2,150,724
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	2,002,300	2,001,500	800
	国債・地方債等	2,002,300	2,001,500	800
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	178,170	174,307	3,863
	小計	2,180,470	2,175,807	4,663
合計		9,665,365	11,811,426	2,146,060

(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、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

第20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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	2,371,866

[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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

該当事項はありません。

（ 1株当たり情報）

	第20期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
1株当たり純資産額	389,387円12銭
1株当たり中間純利益金額	15,249円70銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間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株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	1,653,799千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	1,653,799千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第20期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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26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26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26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【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

平成26年3月7日	有価証券届出書の訂正届出書
平成26年5月21日	有価証券報告書
	有価証券届出書
平成26年11月21日	半期報告書
	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成26年6月6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26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27年4月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

佐藤智治

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成26年2月22日から平成27年2月23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27年2月23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27年4月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

佐藤智治

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成26年2月2日から平成27年2月23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27年2月23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27年4月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

佐藤智治

印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の平成26年2月22日から平成27年2月23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27年2月23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26年11月27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26年4月1日から平成27年3月31日までの第20期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26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. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。