

【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28年5月20日提出
【計算期間】	第13期(自 平成27年2月24日 至 平成28年2月22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 赤林 富二
【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】

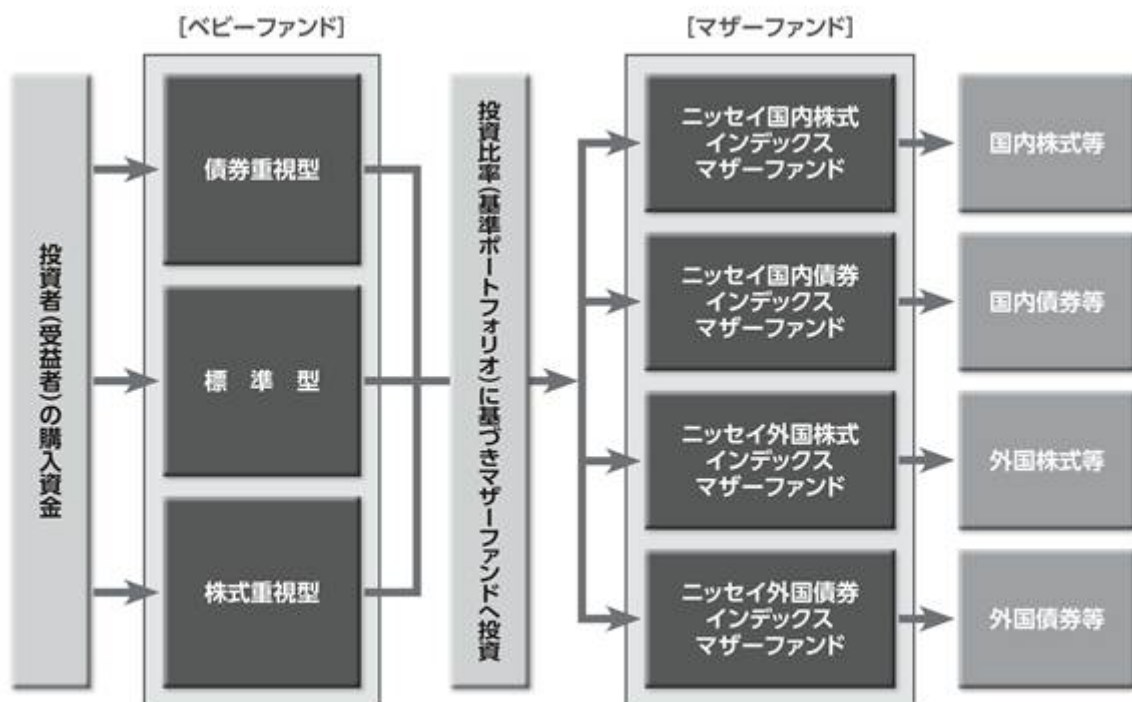
基本方針

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）

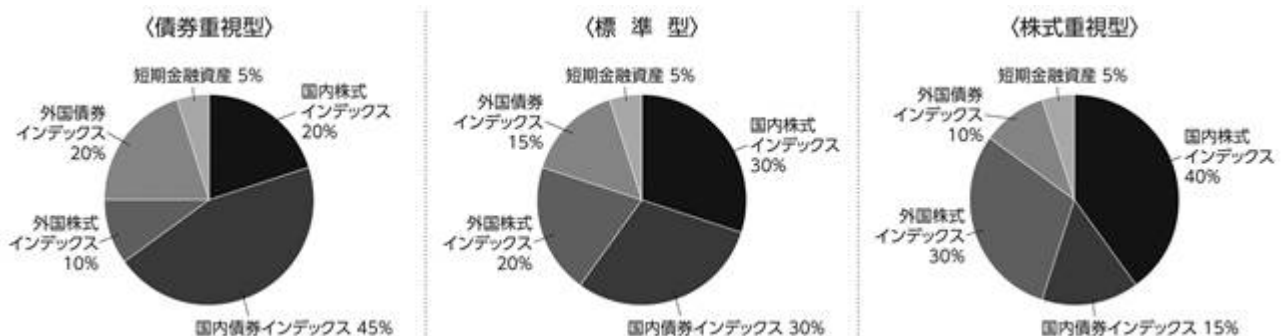
- ・国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数)¹（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

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。

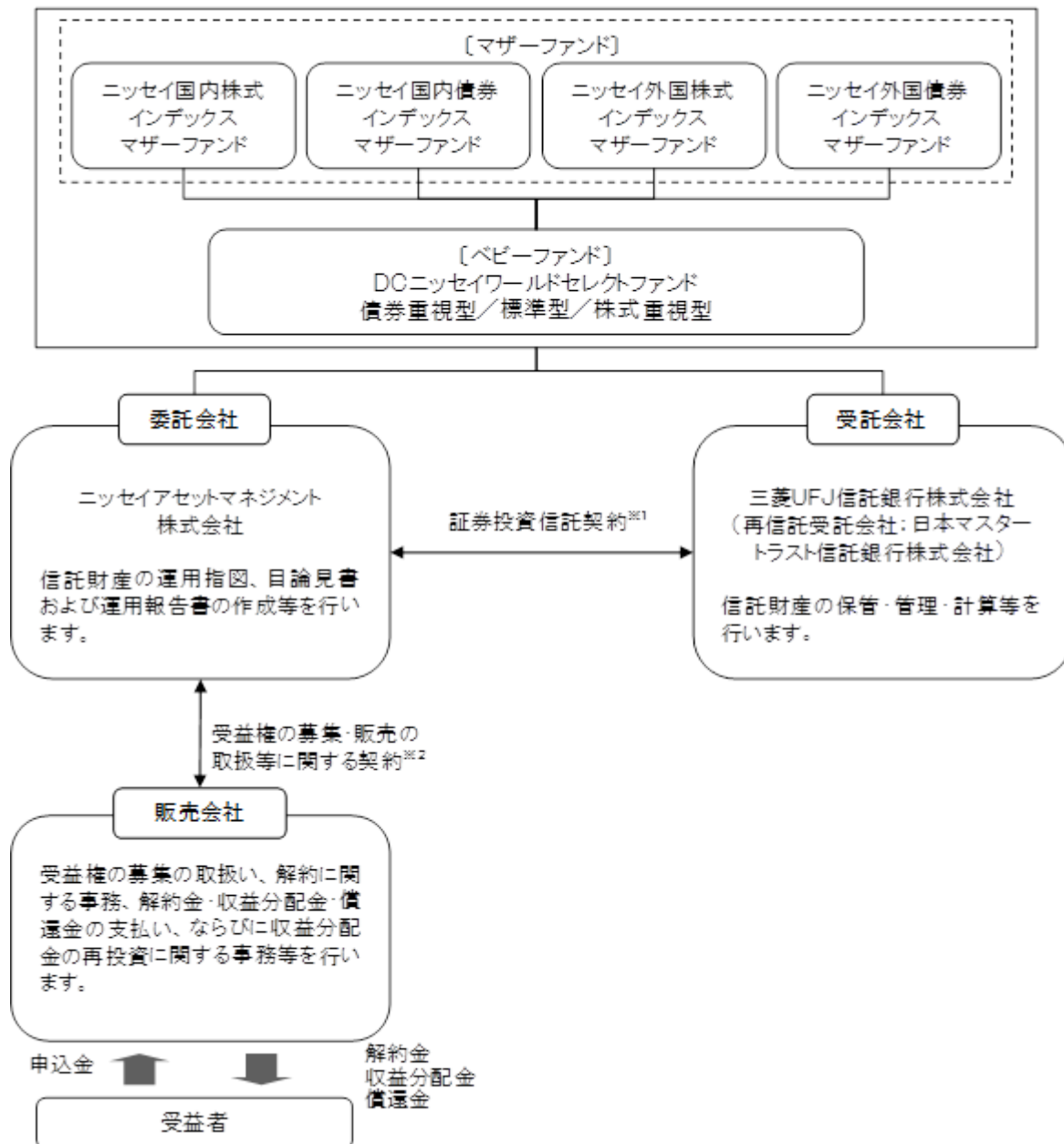
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、
一般社団法人 投資信託協会ホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

（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28年4月1日現在）

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 赤林 富二
 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・ピ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は、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。

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。

(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。

- 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ)

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記「(5)投資制限 b 約款に定めるその他の投資制限 先物取引等、スワップ取引および金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります)

ハ．金銭債権(イ．およびニ．に掲げるものに該当するものを除きます)

ニ．約束手形(イ．に掲げるものを除きます)

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券

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

1．株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます)の新株引受権証券を除きます)

6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます)

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます)

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます)

9．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます)

10．コマーシャル・ペーパー

11．新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ)および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1．から11．の証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます)

14．投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます)

15．外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます)

16．オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります)

17．預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます)

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります)

20．抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます)

21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22．外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの

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

金融商品

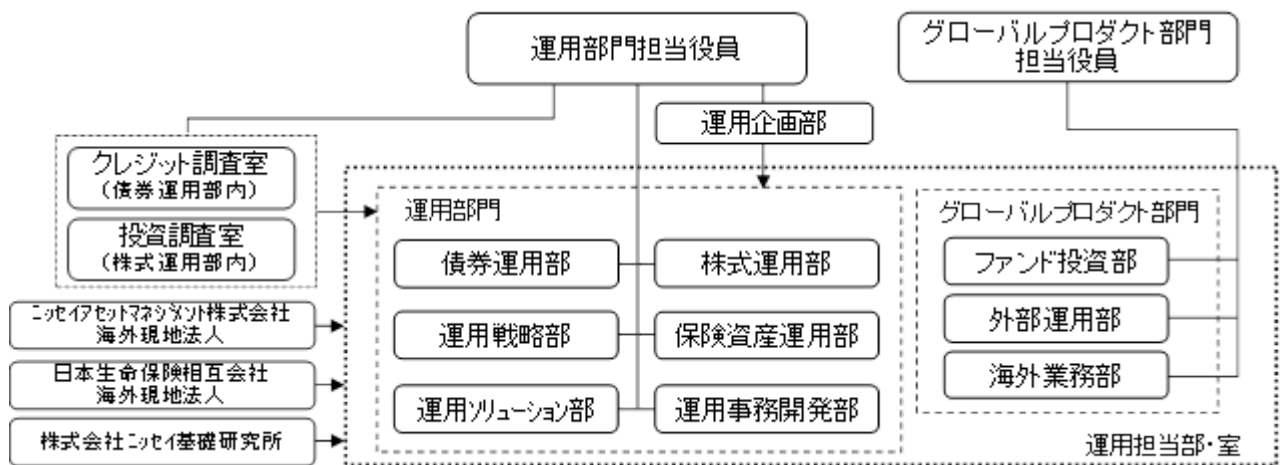
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で5．の権利の性質を有するもの

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。

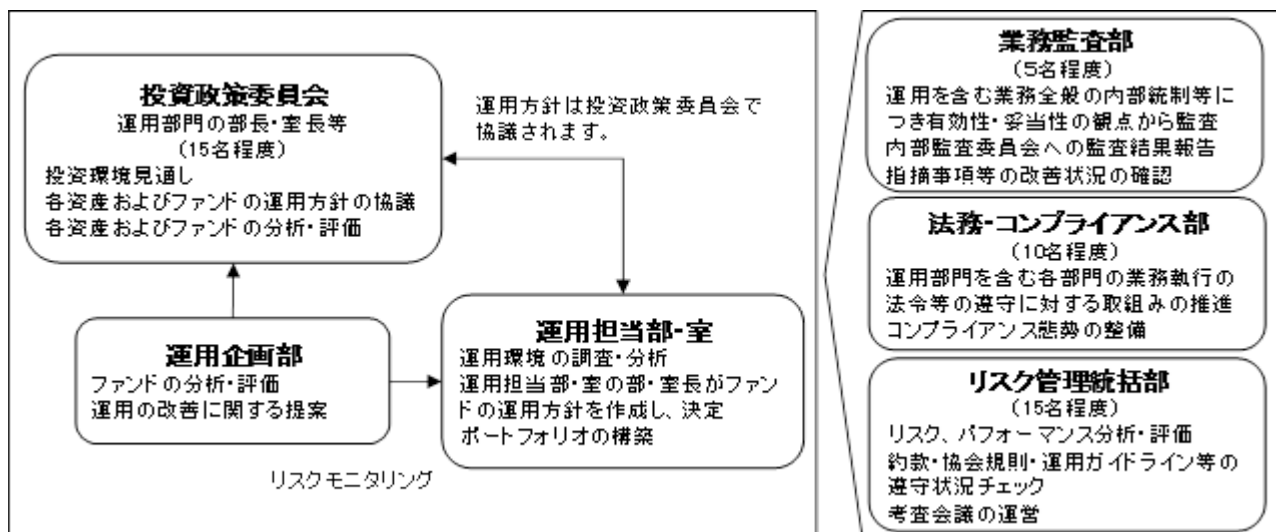
（3）【運用体制】

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しまたは買戻しにより行うことができます。

2. 前記1. の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

有価証券の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとします。

2. 前記1. は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。

4. 前記1. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

外国為替予約等

1. 信託財産を効率的に運用するため、外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

2. 前記1. の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。

3. 前記2. の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。

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

5. 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

資金の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用ならびに安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て(一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます)を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2. 一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4. 借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c 法令に定める投資制限

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

金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、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してあらかじめ委託会社が定めた合理的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。

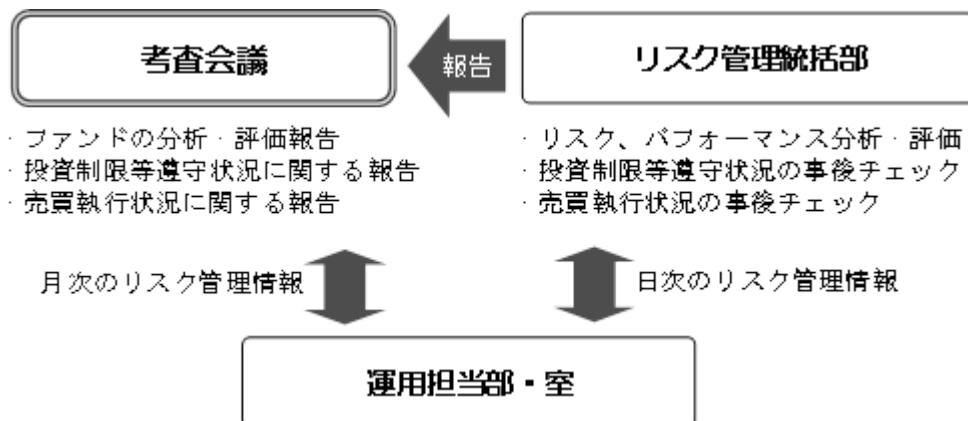
・ファミリーファンド方式に関する留意点

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28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28.5%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、月次の審査会議で報告します。
- ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。

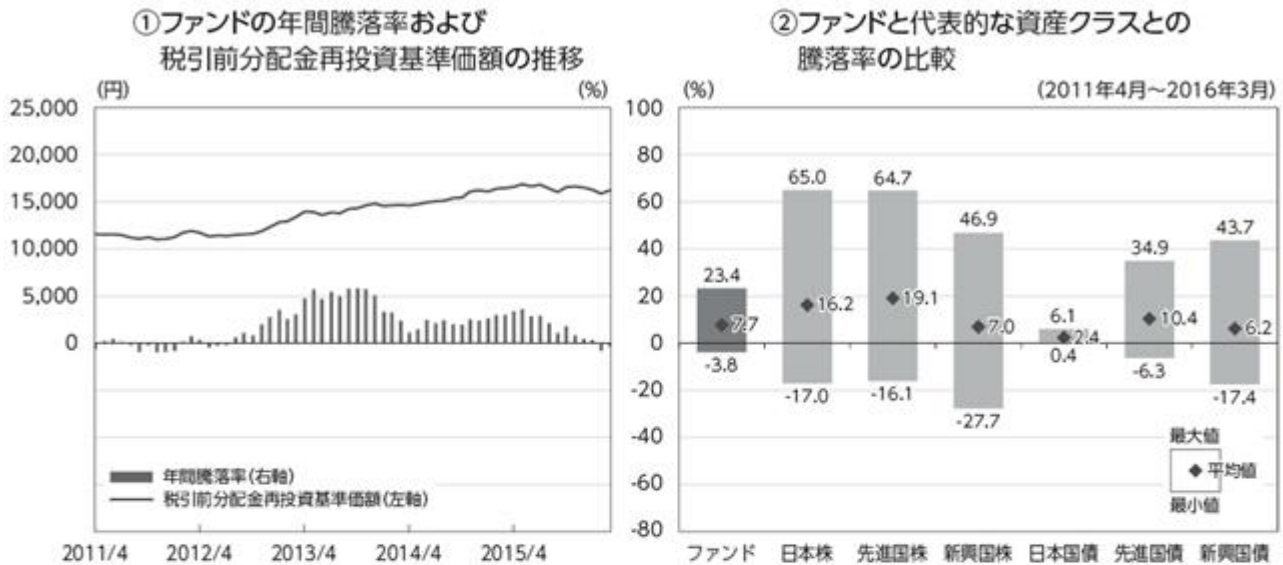
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

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

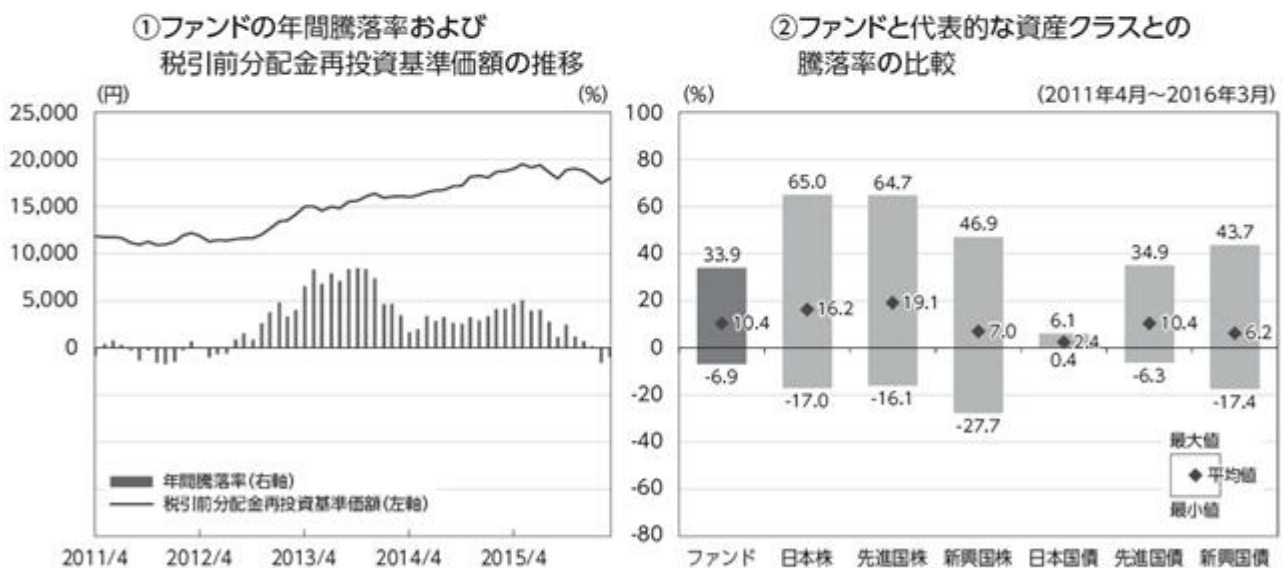
(参考情報)

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。

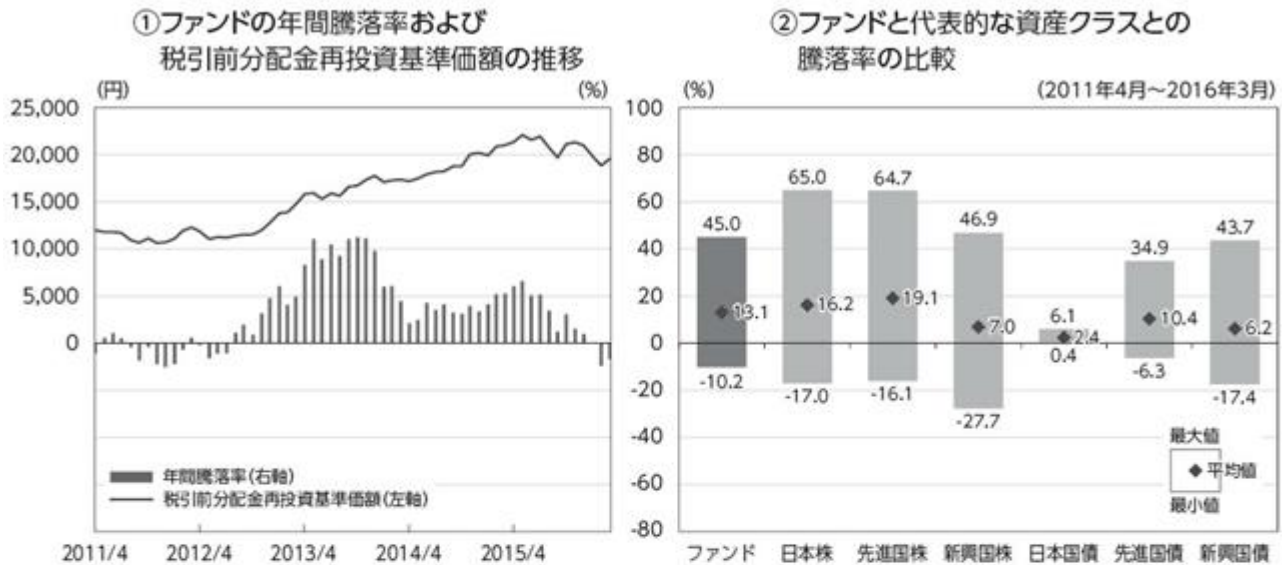
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)



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)



- ・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収受
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28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	3,851,980,433	95.10
内 日本	3,851,980,433	95.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	198,575,035	4.90
純資産総額	4,050,555,468	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28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	12,613,258,885	95.13
内 日本	12,613,258,885	95.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	646,183,805	4.87
純資産総額	13,259,442,690	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28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	7,071,002,370	95.12
内 日本	7,071,002,370	95.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	362,761,772	4.88
純資産総額	7,433,764,142	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28年3月31日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	33,636,656,750	93.85
内 日本	33,636,656,750	93.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,206,064,021	6.15
純資産総額	35,842,720,771	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）	902,825,000	2.52
内 日本	902,825,000	2.52

（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28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	23,929,863,127	90.67
内 日本	23,929,863,127	90.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,461,973,838	9.33
純資産総額	26,391,836,965	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28年3月31日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	47,721,538,128	90.40
内 アメリカ	29,116,969,326	55.15
内 イギリス	3,653,384,994	6.92
内 スイス	1,979,265,583	3.75
内 フランス	1,840,918,937	3.49
内 カナダ	1,822,202,615	3.45
内 ドイツ	1,801,132,602	3.41
内 オーストラリア	1,241,867,356	2.35
内 オランダ	1,015,963,326	1.92
内 アイルランド	855,846,003	1.62
内 スペイン	638,078,126	1.21
内 スウェーデン	611,222,583	1.16
内 香港	553,351,883	1.05
内 デンマーク	400,318,777	0.76
内 イタリア	399,234,050	0.76
内 シンガポール	352,640,276	0.67
内 ベルギー	293,865,008	0.56

内	フィンランド	204,177,648	0.39
内	ジャージー	175,639,914	0.33
内	オランダ領キュラソー	156,446,736	0.30
内	バミューダ	126,528,900	0.24
内	イスラエル	126,466,947	0.24
内	ノルウェー	119,199,769	0.23
内	ケイマン諸島	65,433,057	0.12
内	ニュージーランド	36,839,217	0.07
内	オーストリア	36,767,598	0.07
内	ポルトガル	34,536,107	0.07
内	ルクセンブルグ	23,004,108	0.04
内	イギリス領バージン諸島	17,763,285	0.03
内	パプアニューギニア	12,317,659	0.02
内	マン島	6,399,082	0.01
内	モーリシャス	3,756,656	0.01
投資証券		1,313,982,574	2.49
内	アメリカ	969,405,636	1.84
内	オーストラリア	140,960,480	0.27
内	フランス	81,598,853	0.15
内	イギリス	63,533,324	0.12
内	香港	23,509,749	0.04
内	シンガポール	22,290,922	0.04
内	カナダ	12,683,610	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,756,135,270	7.12
純資産総額		52,791,655,972	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）	1,469,167,210	2.78
内 アメリカ	972,659,394	1.84
内 ドイツ	496,507,816	0.94

（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28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		7,749,006,942	88.92
内 アメリカ		3,265,727,065	37.48
内 フランス		782,110,200	8.98
内 イタリア		776,454,244	8.91
内 イギリス		611,111,953	7.01
内 ドイツ		581,670,211	6.67
内 スペイン		431,806,769	4.96
内 ベルギー		202,957,505	2.33
内 オランダ		195,691,314	2.25
内 カナダ		156,811,464	1.80
内 オーストラリア		143,619,916	1.65
内 オーストリア		120,616,602	1.38
内 メキシコ		76,807,966	0.88
内 アイルランド		65,160,246	0.75
内 デンマーク		52,984,425	0.61
内 フィンランド		49,780,274	0.57
内 ポーランド		47,891,818	0.55
内 スウェーデン		39,436,392	0.45
内 マレーシア		36,763,543	0.42
内 南アフリカ		34,149,275	0.39
内 シンガポール		30,259,509	0.35
内 スイス		23,867,002	0.27
内 ノルウェー		23,329,249	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		965,296,864	11.08
純資産総額		8,714,303,806	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28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	1,328,530,461	1.3395 1,779,664,261	1.3590 1,805,472,896	- -	44.57%
2	ニッセイ外国債券インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	610,890,397	1.3145 803,061,315	1.3358 816,027,392	- -	20.15%

3	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	608,721,066	1.2802	1.3373	-	20.10%
				779,323,329	814,042,681	-	
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	317,672,946	1.2187	1.3109	-	10.28%
				387,149,355	416,437,464	-	

(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	95.10
	小計		95.10
合計(対純資産総額比)			95.10

(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28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	2,976,330,549	1.2799	1.3373	-	30.02%
				3,809,414,820	3,980,246,843	-	
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	2,886,825,493	1.3397	1.3590	-	29.59%
				3,867,626,676	3,923,195,844	-	
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	2,071,003,989	1.2184	1.3109	-	20.48%
				2,523,332,746	2,714,879,129	-	
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	1,493,439,938	1.3144	1.3358	-	15.05%
				1,963,000,336	1,994,937,069	-	

(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	95.13
	小計		95.13
合 計 (対純資産総額比)			95.13

(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28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	2,214,608,465	1.2797 2,834,110,875	1.3373 2,961,595,900	- -	39.84%
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	1,733,737,479	1.2184 2,112,459,812	1.3109 2,272,756,461	- -	30.57%
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	805,380,956	1.3399 1,079,207,466	1.3590 1,094,512,719	- -	14.72%
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	555,575,154	1.3142 730,176,507	1.3358 742,137,290	- -	9.98%

(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 (%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	95.12
	小計		95.12
合 計 (対純資産総額比)			95.12

(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28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	210,100	5,980.00 1,256,398,000	5,952.00 1,250,515,200	- -	3.49%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	1,337,500	477.30 638,388,750	521.50 697,506,250	- -	1.95%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	128,800	4,812.00 619,785,600	4,848.00 624,422,400	- -	1.74%
4	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	111,900	4,542.00 508,249,800	4,690.00 524,811,000	- -	1.46%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	169,300	3,013.00 510,100,900	3,006.00 508,915,800	- -	1.42%
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	94,400	5,095.00 480,968,000	5,366.00 506,550,400	- -	1.41%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	152,000	2,925.00 444,600,000	3,086.00 469,072,000	- -	1.31%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	133,500	3,026.00 403,971,000	3,412.00 455,502,000	- -	1.27%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	2,354,200	166.30 391,503,460	168.10 395,741,020	- -	1.10%
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	70,500	5,417.00 381,898,500	5,136.00 362,088,000	- -	1.01%
11	ソニー 日本	株式 電気機器	119,200	2,488.00 296,569,600	2,893.00 344,845,600	- -	0.96%
12	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	69,700	4,556.00 317,553,200	4,792.00 334,002,400	- -	0.93%

13	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	128,600	2,642.00 339,761,200	2,552.50 328,251,500	- -	0.92%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	90,900	3,311.00 300,969,900	3,355.00 304,969,500	- -	0.85%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	17,300	17,040.00 294,792,000	17,485.00 302,490,500	- -	0.84%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	15,100	20,755.00 313,400,500	19,905.00 300,565,500	- -	0.84%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	30,900	9,953.00 307,547,700	9,713.00 300,131,700	- -	0.84%
18	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	198,100	1,577.00 312,403,700	1,496.50 296,456,650	- -	0.83%
19	花王 日本	株式 化学	47,600	5,848.00 278,364,800	6,003.00 285,742,800	- -	0.80%
20	三菱地所 日本	株式 不動産業	124,000	2,144.50 265,918,000	2,090.50 259,222,000	- -	0.72%
21	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	67,500	3,791.00 255,892,500	3,800.00 256,500,000	- -	0.72%
22	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	59,700	3,991.00 238,262,700	4,205.00 251,038,500	- -	0.70%
23	三井不動産 日本	株式 不動産業	88,000	2,652.00 233,376,000	2,808.00 247,104,000	- -	0.69%
24	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	237,100	979.20 232,168,320	1,041.50 246,939,650	- -	0.69%
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	17,700	13,435.00 237,799,500	13,570.00 240,189,000	- -	0.67%
26	三菱商事 日本	株式 卸売業	125,100	1,872.00 234,187,200	1,906.00 238,440,600	- -	0.67%
27	キーエンス 日本	株式 電気機器	3,800	58,580.00 222,604,000	61,390.00 233,282,000	- -	0.65%
28	日立製作所 日本	株式 電気機器	431,000	476.60 205,414,600	526.60 226,964,600	- -	0.63%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	180,000	1,134.00 204,120,000	1,179.50 212,310,000	- -	0.59%
30	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	53,400	3,693.00 197,206,200	3,975.00 212,265,000	- -	0.59%

（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	10.90

	輸送用機器	9.22
	情報・通信業	7.66
	銀行業	6.95
	化学	5.75
	医薬品	5.30
	小売業	4.77
	食料品	4.75
	機械	4.35
	陸運業	4.34
	卸売業	3.96
	サービス業	3.60
	建設業	2.98
	不動産業	2.69
	保険業	2.18
	電気・ガス業	2.01
	精密機器	1.52
	その他製品	1.48
	その他金融業	1.31
	鉄鋼	1.12
	証券、商品先物取引業	1.03
	ゴム製品	0.94
	ガラス・土石製品	0.82
	非鉄金属	0.77
	繊維製品	0.71
	空運業	0.65
	金属製品	0.61
	石油・石炭製品	0.47
	鉱業	0.28
	パルプ・紙	0.24
	海運業	0.21
	倉庫・運輸関連業	0.20
	水産・農林業	0.10
	小計	93.85
合計（対純資産総額比）		93.85

（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 2806月	買建	67	906,181,180	902,825,000	2.52%

(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28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	1,455,000,000	131.73 1,916,749,230	138.27 2,011,886,700	2.400000 2037/3/20	7.62%
2	第146回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,471,000,000	120.23 1,768,614,860	123.53 1,817,243,980	1.700000 2033/9/20	6.89%
3	第303回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,687,000,000	105.78 1,784,671,800	105.61 1,781,741,920	1.400000 2019/9/20	6.75%
4	第329回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,211,000,000	107.40 1,300,662,820	107.08 1,296,750,910	0.800000 2023/6/20	4.91%
5	第88回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,004,000,000	123.48 1,239,797,860	123.92 1,244,237,120	2.300000 2026/6/20	4.71%
6	第125回 利付国債(20年) 日本	国債証券	947,000,000	127.71 1,209,457,040	129.89 1,230,124,590	2.200000 2031/3/20	4.66%
7	第28回 利付国債(30年) 日本	国債証券	772,000,000	134.19 1,035,986,450	141.53 1,092,634,760	2.500000 2038/3/20	4.14%
8	第117回 利付国債(5年) 日本	国債証券	1,063,000,000	101.29 1,076,714,680	101.28 1,076,617,030	0.200000 2019/3/20	4.08%
9	第83回 利付国債(20年) 日本	国債証券	763,000,000	121.28 925,431,970	121.10 924,000,630	2.100000 2025/12/20	3.50%
10	第328回 利付国債(10年) 日本	国債証券	835,000,000	105.43 880,364,600	105.49 880,891,600	0.600000 2023/3/20	3.34%

11	第116回 利付国債(5年) 日本	国債証券	783,000,000	101.18 792,308,690	101.17 792,184,590	0.200000 2018/12/20	3.00%
12	第120回 利付国債(5年) 日本	国債証券	758,000,000	101.61 770,276,000	101.44 768,968,260	0.200000 2019/9/20	2.91%
13	第306回 利付国債(10年) 日本	国債証券	711,000,000	106.54 757,500,080	106.40 756,546,660	1.400000 2020/3/20	2.87%
14	第103回 利付国債(5年) 日本	国債証券	737,000,000	100.43 740,169,276	100.43 740,169,276	0.300000 2017/3/20	2.80%
15	第327回 利付国債(10年) 日本	国債証券	618,000,000	106.65 659,121,620	106.69 659,368,920	0.800000 2022/12/20	2.50%
16	第310回 利付国債(10年) 日本	国債証券	602,000,000	105.67 636,190,400	105.35 634,243,120	1.000000 2020/9/20	2.40%
17	第117回 利付国債(20年) 日本	国債証券	496,000,000	125.52 622,579,900	127.35 631,695,680	2.100000 2030/3/20	2.39%
18	第4回 利付国債(40年) 日本	国債証券	404,000,000	132.84 536,679,480	150.81 609,280,480	2.200000 2051/3/20	2.31%
19	第348回 利付国債(2年) 日本	国債証券	602,000,000	100.09 602,600,951	100.09 602,600,951	0.100000 2017/1/15	2.28%
20	第318回 利付国債(10年) 日本	国債証券	560,000,000	106.60 596,968,070	106.59 596,948,800	1.000000 2021/9/20	2.26%
21	第292回 利付国債(10年) 日本	国債証券	558,000,000	103.96 580,148,700	103.74 578,902,680	1.700000 2018/3/20	2.19%
22	第325回 利付国債(10年) 日本	国債証券	500,000,000	106.44 532,212,480	106.47 532,385,000	0.800000 2022/9/20	2.02%
23	第133回 利付国債(20年) 日本	国債証券	405,000,000	123.74 501,174,770	124.56 504,480,150	1.800000 2031/12/20	1.91%
24	第115回 利付国債(5年) 日本	国債証券	469,000,000	101.08 474,065,860	101.05 473,933,880	0.200000 2018/9/20	1.80%
25	第72回 利付国債(20年) 日本	国債証券	349,000,000	118.81 414,661,800	118.98 415,240,200	2.100000 2024/9/20	1.57%
26	第291回 利付国債(10年) 日本	国債証券	395,000,000	103.13 407,401,460	102.96 406,692,000	1.300000 2018/3/20	1.54%

27	第94回 利付国債（20年） 日本	国債証券	220,000,000	123.33 271,333,630	123.14 270,925,600	2.100000 2027/3/20	1.03%
28	第361回 利付国債（2年） 日本	国債証券	205,000,000	100.70 206,448,850	100.58 206,191,050	0.100000 2018/2/15	0.78%
29	第313回 利付国債（10年） 日本	国債証券	126,000,000	107.56 135,527,170	107.43 135,364,320	1.300000 2021/3/20	0.51%
30	第299回 利付国債（10年） 日本	国債証券	74,000,000	104.79 77,544,600	104.54 77,361,080	1.300000 2019/3/20	0.29%

（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	90.67
	小計		90.67
合計（対純資産総額比）			90.67

（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28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	82,529	13,166.76 1,086,639,604	12,345.22 1,018,838,727	- -	1.93%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	112,313	6,061.86 680,826,706	6,203.03 696,681,357	- -	1.32%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	61,608	9,027.28 556,152,936	9,523.71 586,736,947	- -	1.11%

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	40,958	11,531.02 472,287,678	12,279.86 502,958,768	- -	0.95%
5	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	139,747	3,398.37 474,912,516	3,586.60 501,217,205	- -	0.95%
6	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	33,600	11,930.31 400,858,576	12,924.39 434,259,705	- -	0.82%
7	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	91,214	3,799.96 346,609,843	4,436.21 404,644,604	- -	0.77%
8	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	47,184	8,833.37 416,793,764	8,434.46 397,971,796	- -	0.75%
9	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	5,898	73,656.20 434,424,326	67,460.38 397,881,375	- -	0.75%
10	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	71,800	6,242.27 448,195,161	5,481.88 393,599,127	- -	0.75%
11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	4,602	82,946.13 381,718,097	84,569.72 389,189,853	- -	0.74%
12	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	40,245	8,612.38 346,605,410	9,316.38 374,937,809	- -	0.71%
13	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	4,313	85,318.36 367,978,087	86,576.55 373,404,665	- -	0.71%
14	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	60,357	5,166.21 311,817,425	6,089.22 367,527,486	- -	0.70%
15	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	54,462	7,537.40 410,501,988	6,728.12 366,427,023	- -	0.69%
16	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	61,137	4,846.27 296,286,708	5,248.63 320,885,761	- -	0.61%
17	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	91,374	3,622.34 330,988,128	3,388.28 309,601,391	- -	0.59%
18	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	27,837	10,175.95 283,267,999	10,732.76 298,768,118	- -	0.57%
19	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	10,407	31,669.29 329,582,366	27,655.70 287,812,932	- -	0.55%

20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	18,766	14,272.79 267,843,277	15,033.76 282,123,645	- -	0.53%
21	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B アメリカ	株式 各種金融	17,541	15,301.43 268,402,398	16,052.39 281,575,022	- -	0.53%
22	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	33,681	10,382.80 349,703,391	8,177.63 275,430,991	- -	0.52%
23	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	23,268	13,155.26 306,096,799	11,145.17 259,326,020	- -	0.49%
24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製 造装置	69,830	3,835.75 267,851,058	3,685.76 257,376,816	- -	0.49%
25	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 食品・飲料・タバ コ	22,941	9,741.37 223,476,829	11,120.38 255,112,848	- -	0.48%
26	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア	36,809	6,975.66 256,767,104	6,850.94 252,176,397	- -	0.48%
27	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバ コ	21,561	11,326.98 244,221,184	11,571.10 249,484,685	- -	0.47%
28	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	28,792	8,962.02 258,034,607	8,651.57 249,096,014	- -	0.47%
29	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	41,348	6,078.52 251,335,055	5,996.82 247,956,910	- -	0.47%
30	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハードウェアおよ び機器	75,196	3,054.85 229,713,116	3,206.87 241,144,007	- -	0.46%

（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	8.71
		ソフトウェア・サービス	8.15
		銀行	7.70
		資本財	6.84
		エネルギー	6.37
		食品・飲料・タバコ	6.14

		素材	4.23
		保険	3.92
		小売	3.72
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.63
		各種金融	3.54
		ヘルスケア機器・サービス	3.41
		公益事業	3.33
		電気通信サービス	3.20
		メディア	2.85
		家庭用品・パーソナル用品	2.18
		食品・生活必需品小売り	2.09
		半導体・半導体製造装置	1.93
		消費者サービス	1.81
		運輸	1.77
		耐久消費財・アパレル	1.77
		自動車・自動車部品	1.53
		商業・専門サービス	0.91
		不動産	0.69
	小計		90.40
投資証券	外国	投資証券	2.49
	小計		2.49
合計（対純資産総額比）			92.88

（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 5 0 0 E M I N I F U T U R E 2 0 1 6 0 6	買建	84	955,267,236	972,659,394	1.84%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 2 0 1 6 0 6	買建	131	499,491,143	496,507,816	0.94%

（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28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	73,242,000	101.84 74,594,120	101.76 74,534,721	1.875000 2017/10/31	0.86%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	67,608,000	100.10 67,675,630	100.40 67,882,488	1.000000 2017/12/15	0.78%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	60,847,200	104.32 63,478,622	106.14 64,588,085	2.625000 2020/11/15	0.74%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	60,847,200	102.59 62,424,967	102.20 62,187,663	2.375000 2017/7/31	0.71%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	57,466,800	104.33 59,959,601	105.10 60,402,778	2.375000 2020/12/31	0.69%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	56,340,000	104.37 58,803,331	106.00 59,724,343	2.625000 2020/8/15	0.69%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	56,340,000	105.36 59,361,839	105.10 59,216,157	3.500000 2018/2/15	0.68%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	58,593,600	99.57 58,347,506	99.85 58,508,639	0.625000 2017/8/31	0.67%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	55,213,200	104.78 57,854,227	105.25 58,115,757	2.750000 2019/2/15	0.67%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	57,466,800	100.12 57,537,209	100.22 57,598,973	0.875000 2017/6/15	0.66%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	55,213,200	99.89 55,153,017	100.07 55,256,266	0.750000 2017/6/30	0.63%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	54,086,400	99.91 54,040,426	101.79 55,057,791	1.625000 2020/6/30	0.63%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	54,086,400	99.14 53,624,211	100.90 54,576,422	1.375000 2020/3/31	0.63%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	54,086,400	99.97 54,075,041	100.20 54,198,358	0.875000 2017/10/15	0.62%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	54,086,400	99.67 53,910,166	99.97 54,075,582	0.750000 2017/12/31	0.62%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	52,959,600	100.48 53,215,913	101.95 53,993,900	1.625000 2019/12/31	0.62%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	48,452,400	108.05 52,355,240	109.34 52,981,245	3.500000 2020/5/15	0.61%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	50,706,000	101.89 51,666,416	103.44 52,450,793	2.000000 2020/9/30	0.60%

19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	50,706,000	99.15 50,277,137	100.69 51,056,378	1.250000 2019/10/31	0.59%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	50,706,000	100.08 50,748,424	100.44 50,929,613	1.000000 2018/3/15	0.58%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	49,579,200	99.23 49,197,935	100.98 50,069,042	1.375000 2020/1/31	0.57%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	46,198,800	107.46 49,649,692	107.58 49,701,593	3.750000 2018/11/15	0.57%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	45,072,000	100.93 45,494,775	102.02 45,985,609	1.625000 2019/3/31	0.53%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	45,072,000	98.22 44,270,484	99.92 45,039,998	1.000000 2019/9/30	0.52%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	41,691,600	106.05 44,214,719	106.75 44,507,033	3.125000 2019/5/15	0.51%
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	43,945,200	100.12 44,001,348	100.69 44,248,861	1.125000 2018/6/15	0.51%
27	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	37,033,000	115.32 42,709,418	114.59 42,436,485	3.750000 2019/10/25	0.49%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	38,311,200	107.80 41,300,246	107.69 41,260,779	4.000000 2018/8/15	0.47%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	39,438,000	103.83 40,950,447	103.82 40,947,686	2.625000 2018/4/30	0.47%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	39,438,000	100.56 39,662,330	101.31 39,958,581	1.375000 2018/9/30	0.46%

（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	88.92
	小計		88.92
合 計（対純資産総額比）			88.92

（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28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
第13計算期間末 (平成28年2月22日)	3,885,525,955	3,885,525,955	1.5825	1.5825
平成27年3月末日	4,011,508,442	-	1.6482	-
4月末日	4,063,541,947	-	1.6625	-
5月末日	4,102,039,121	-	1.6898	-
6月末日	4,049,889,592	-	1.6685	-
7月末日	4,085,988,824	-	1.6855	-
8月末日	3,962,324,280	-	1.6434	-
9月末日	3,897,254,580	-	1.6076	-
10月末日	4,020,788,950	-	1.6594	-
11月末日	4,057,915,218	-	1.6654	-
12月末日	4,090,090,824	-	1.6550	-
平成28年1月末日	3,997,170,985	-	1.6311	-
2月末日	3,919,459,124	-	1.5898	-

3月末日	4,050,555,468	-	1.6257	-
------	---------------	---	--------	---

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第13計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第13計算期間	3.2

(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（第1計算期間については、前計算期間末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。

「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28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
第13計算期間末 (平成28年2月22日)	12,635,415,827	12,635,415,827	1.7401	1.7401
平成27年3月末日	13,623,020,857	-	1.8796	-
4月末日	13,912,119,838	-	1.9029	-
5月末日	14,154,506,278	-	1.9518	-
6月末日	13,892,078,045	-	1.9162	-
7月末日	14,156,034,416	-	1.9423	-
8月末日	13,472,099,526	-	1.8650	-
9月末日	13,001,793,062	-	1.7969	-
10月末日	13,700,516,472	-	1.8915	-
11月末日	13,732,577,272	-	1.9032	-
12月末日	13,680,472,416	-	1.8823	-
平成28年1月末日	13,168,139,230	-	1.8197	-
2月末日	12,717,830,421	-	1.7490	-
3月末日	13,259,442,690	-	1.8038	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
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
第13計算期間	0.0000

収益率の推移

	収益率(%)
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
第13計算期間	6.3

(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(第1計算期間については、前計算期間末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。)

「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28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
第13計算期間末 (平成28年2月22日)	7,049,086,725	7,049,086,725	1.8772	1.8772
平成27年3月末日	7,898,049,777	-	2.1057	-
4月末日	8,077,684,340	-	2.1394	-
5月末日	8,346,045,395	-	2.2142	-
6月末日	8,086,471,189	-	2.1615	-
7月末日	8,256,275,629	-	2.1984	-
8月末日	7,705,205,289	-	2.0782	-
9月末日	7,389,266,030	-	1.9721	-
10月末日	7,943,330,363	-	2.1172	-
11月末日	7,965,425,910	-	2.1358	-
12月末日	7,927,530,558	-	2.1024	-
平成28年1月末日	7,486,974,219	-	1.9923	-
2月末日	7,102,160,828	-	1.8877	-
3月末日	7,433,764,142	-	1.9630	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
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

第13計算期間	0.0000
---------	--------

収益率の推移

	収益率(%)
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
第13計算期間	9.5

(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（第1計算期間については、前計算期間末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。

（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
第13計算期間	470,047,100	450,270,647	2,455,327,588

(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
第13計算期間	943,466,343	940,757,157	7,261,452,709

(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
第13計算期間	684,049,192	692,168,947	3,755,175,716

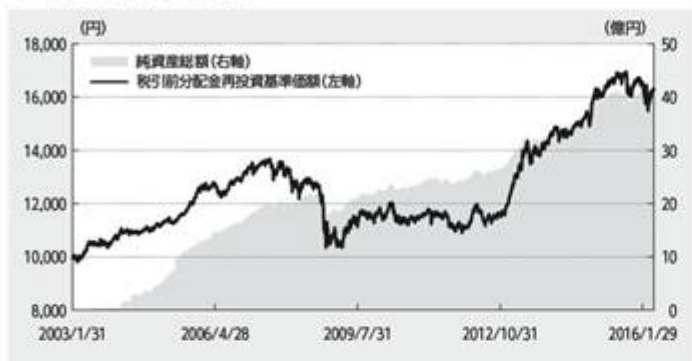
(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2016年3月末現在

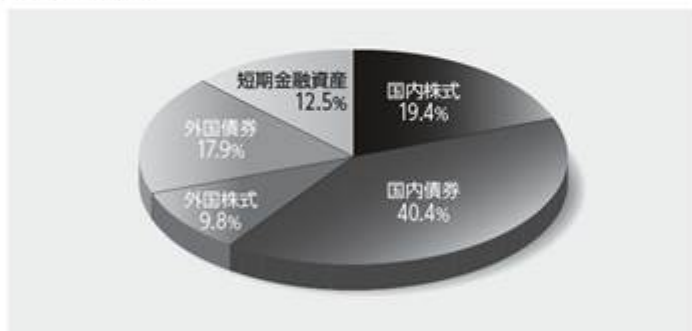
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

● 基準価額・純資産の推移



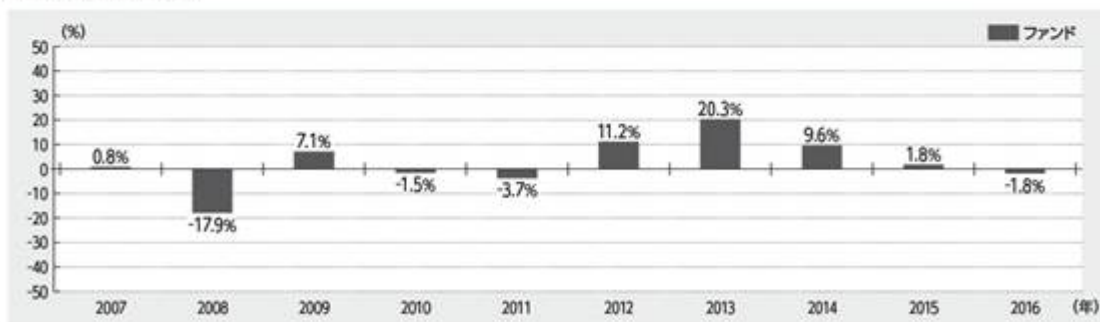
- ・ 基準価額は運用管理費用(信託報酬)控後のものです。
- ・ 税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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。
- ・ 2016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	16,257円
純資産総額	40億円

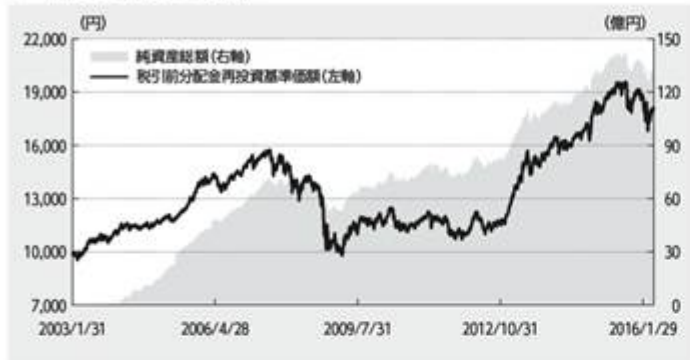
● 分配の推移 1万口当り(税引前)

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
第13期	2016年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2016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



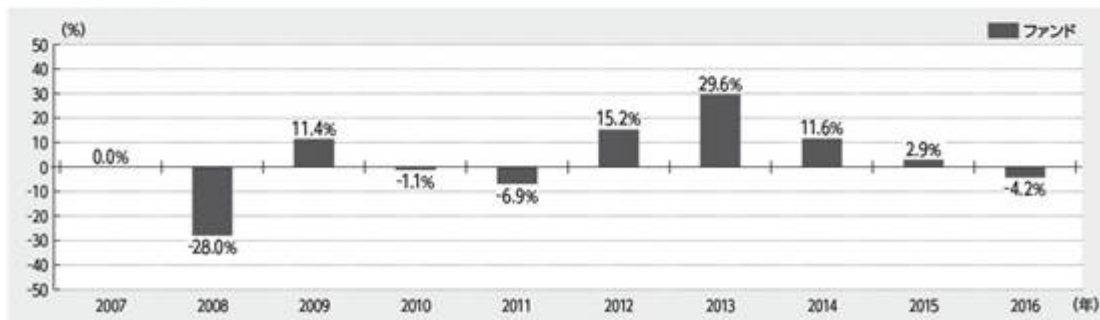
- ・ 基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・ 税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 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。
- ・ 2016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	18,038円
純資産総額	132億円

● 分配の推移

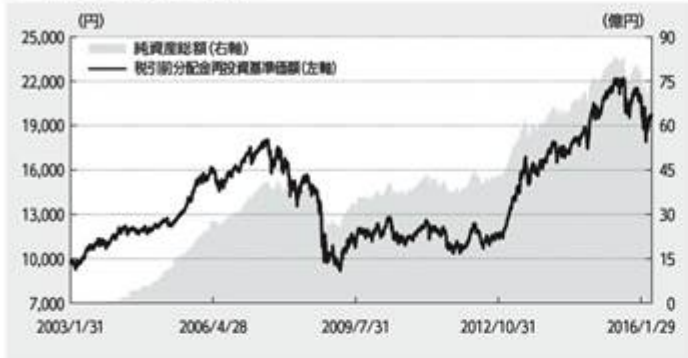
1万口当り(税引前)

期	年月	金額
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
第13期	2016年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

2016年3月末現在

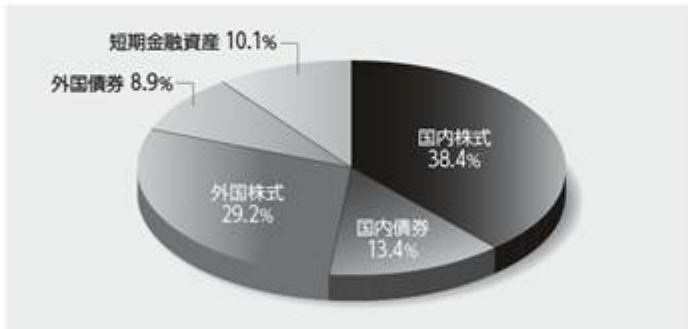
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

●基準価額・純資産の推移



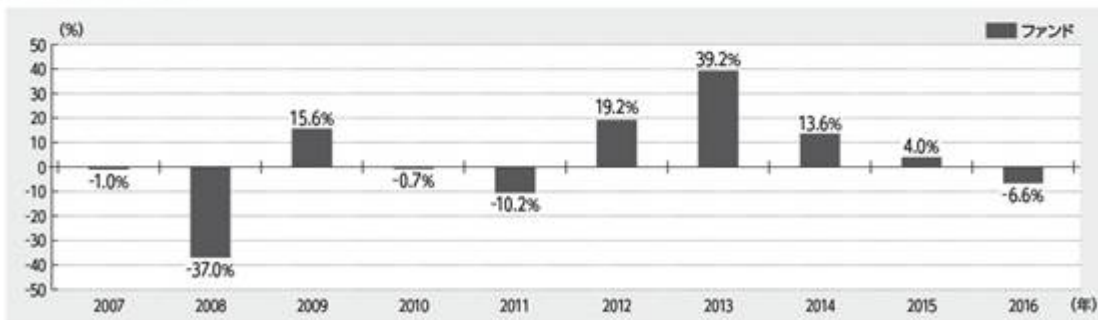
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●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。
- ・2016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	19,630円
純資産総額	74億円

●分配の推移

1万口当り(税引前)

期	年月	金額
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
第13期	2016年2月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受け付けを行います。

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

1円以上1円単位とします。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

2【換金（解約）手続等】

換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受け付けを行います。

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

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

換金単位

1口単位とします。

換金価額

換金請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

換金請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

ファンドおよびマザーファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	証券取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法で評価します。
外国株式	証券取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
外国債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。
国内債券先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限です。

(4) 【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

(5) 【その他】

繰上償還

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

約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することができます。この場合、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、前記1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる

受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記1.から5.の規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

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

公告

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

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

運用報告書の作成

委託会社は、ファンドの計算期間の末日毎および償還時に期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

- ・ 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・販売の取扱いに関する契約」は、契約期間満了の3ヵ月前までに委託会社、販売会社いずれかにより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 反対者の買取請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成27年2月24日から平成28年2月22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13期計算期間（平成27年2月24日から平成28年2月22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13期計算期間（平成27年2月24日から平成28年2月22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12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	179,091,896
コール・ローン	201,504,768	14,967,805
親投資信託受益証券	3,782,585,221	3,695,513,517
未収入金	4,348,417	25,988,571
流動資産合計	3,988,438,406	3,915,561,789
資産合計	3,988,438,406	3,915,561,789
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,302,557	25,945,201
未払受託者報酬	626,050	653,599
未払委託者報酬	3,130,375	3,268,194
その他未払費用	327,618	168,840
流動負債合計	8,386,600	30,035,834
負債合計	8,386,600	30,035,834
純資産の部		
元本等		
元本	2,435,551,135	2,455,327,588
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,544,500,671	1,430,198,367
純資産合計	3,980,051,806	3,885,525,955
負債純資産合計	3,988,438,406	3,915,561,789

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（単位：円）

	第12期 （自平成26年2月22日 至平成27年2月23日）	第13期 （自平成27年2月24日 至平成28年2月22日）
営業収益		
受取利息	89,559	111,596
有価証券売買等損益	408,964,579	119,701,282
派生商品取引等損益	2,952,920	-
営業収益合計	406,101,218	119,589,686
営業費用		
受託者報酬	1,178,417	1,298,852
委託者報酬	5,809,968	6,494,614
その他費用	632,121	335,203
営業費用合計	7,620,506	8,128,669
営業利益又は営業損失（ ）	398,480,712	127,718,355
経常利益又は経常損失（ ）	398,480,712	127,718,355
当期純利益又は当期純損失（ ）	398,480,712	127,718,355
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（ ）	18,048,561	5,833,831
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,078,232,077	1,544,500,671
剰余金増加額又は欠損金減少額	214,134,083	305,667,426
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	214,134,083	305,667,426
剰余金減少額又は欠損金増加額	128,297,640	286,417,544
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	128,297,640	286,417,544
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（ ）	1,544,500,671	1,430,198,367

（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. 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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成27年2月24日から平成28年2月22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12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
1. 受益権総口数	2,435,551,135口	2,455,327,588口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6341円 (16,341円)	1.5825円 (15,825円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(839,805,396円)及び分配準備積立金(732,608,759円)より分配対象収益は1,572,414,155円(1口当たり0.640409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12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。</p> <p>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。</p>	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	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>	<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>

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	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	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22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	359,157,003	137,233,650
合計	359,157,003	137,233,650

(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)

元本額の変動

項目	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
期首元本額	2,307,741,264円	2,435,551,135円
期中追加設定元本額	400,729,347円	470,047,100円
期中一部解約元本額	272,919,476円	450,270,647円

(4)【附属明細表】(平成28年2月22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	639,417,761	817,303,782	
	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	1,287,567,160	1,723,923,670	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	327,907,032	399,292,392	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	574,139,676	754,993,673	
親投資信託受益証券 合計		2,829,031,629	3,695,513,517	
合計		2,829,031,629	3,695,513,517	

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12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	577,181,340
コール・ローン	679,423,216	48,238,576
親投資信託受益証券	12,817,562,620	12,024,823,015
未収入金	4,756,504	13,329,627
流動資産合計	13,501,742,340	12,663,572,558
資産合計	13,501,742,340	12,663,572,558
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,591,686	13,175,908
未払受託者報酬	2,097,109	2,189,897
未払委託者報酬	11,883,806	12,409,642
その他未払費用	541,487	381,284
流動負債合計	19,114,088	28,156,731
負債合計	19,114,088	28,156,731
純資産の部		
元本等		
元本	7,258,743,523	7,261,452,709
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,223,884,729	5,373,963,118
純資産合計	13,482,628,252	12,635,415,827
負債純資産合計	13,501,742,340	12,663,572,558

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)
営業収益		
受取利息	294,967	379,399
有価証券売買等損益	1,827,654,172	824,080,309
派生商品取引等損益	10,337,710	-
営業収益合計	1,817,611,429	823,700,910
営業費用		
受託者報酬	3,941,071	4,402,764
委託者報酬	21,974,604	24,949,400
その他費用	1,053,006	756,463
営業費用合計	26,968,681	30,108,627
営業利益又は営業損失()	1,790,642,748	853,809,537
経常利益又は経常損失()	1,790,642,748	853,809,537
当期純利益又は当期純損失()	1,790,642,748	853,809,537
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()	64,573,739	19,509,085
期首剰余金又は期首欠損金()	4,268,771,356	6,223,884,729
剰余金増加額又は欠損金減少額	650,959,752	832,131,617
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	650,959,752	832,131,617
剰余金減少額又は欠損金増加額	421,915,388	808,734,606
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	421,915,388	808,734,606
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()	6,223,884,729	5,373,963,118

(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. 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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成27年2月24日から平成28年2月22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12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
1. 受益権総口数	7,258,743,523口	7,261,452,709口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8574円 (18,574円)	1.7401円 (17,401円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,140,335,083円)及び分配準備積立金(3,349,959,276円)より分配対象収益は6,490,294,359円(1口当たり0.893801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12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。</p> <p>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。</p>	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	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>	<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>

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	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	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22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	1,647,690,082	886,280,864
合計	1,647,690,082	886,280,864

(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)

元本額の変動

項目	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
期首元本額	7,010,883,824円	7,258,743,523円
期中追加設定元本額	937,661,500円	943,466,343円
期中一部解約元本額	689,801,801円	940,757,157円

(4)【附属明細表】(平成28年2月22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	3,086,722,705	3,945,448,961	
	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	2,757,297,518	3,691,745,646	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	2,109,450,728	2,568,678,151	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	1,383,232,135	1,818,950,257	
親投資信託受益証券 合計		9,336,703,086	12,024,823,015	
合計		9,336,703,086	12,024,823,015	

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12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	319,117,980
コール・ローン	392,553,494	26,670,642
親投資信託受益証券	7,421,288,282	6,712,687,709
未収入金	4,084,078	10,677,342
流動資産合計	7,817,925,854	7,069,153,673
資産合計	7,817,925,854	7,069,153,673
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,978,206	10,582,554
未払受託者報酬	1,205,401	1,255,074
未払委託者報酬	7,634,493	7,949,065
その他未払費用	437,471	280,255
流動負債合計	13,255,571	20,066,948
負債合計	13,255,571	20,066,948
純資産の部		
元本等		
元本	3,763,295,471	3,755,175,716
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,041,374,812	3,293,911,009
純資産合計	7,804,670,283	7,049,086,725
負債純資産合計	7,817,925,854	7,069,153,673

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)
営業収益		
受取利息	170,849	219,534
有価証券売買等損益	1,305,672,862	720,433,996
派生商品取引等損益	5,515,255	-
営業収益合計	1,300,328,456	720,214,462
営業費用		
受託者報酬	2,259,834	2,544,578
委託者報酬	14,059,568	16,116,129
その他費用	842,079	563,941
営業費用合計	17,161,481	19,224,648
営業利益又は営業損失()	1,283,166,975	739,439,110
経常利益又は経常損失()	1,283,166,975	739,439,110
当期純利益又は当期純損失()	1,283,166,975	739,439,110
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()	76,931,090	17,240,998
期首剰余金又は期首欠損金()	2,732,332,696	4,041,374,812
剰余金増加額又は欠損金減少額	528,190,683	755,419,377
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	528,190,683	755,419,377
剰余金減少額又は欠損金増加額	425,384,452	746,203,072
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	425,384,452	746,203,072
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()	4,041,374,812	3,293,911,009

（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. 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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成27年2月24日から平成28年2月22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12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
1. 受益権総口数	3,763,295,471口	3,755,175,716口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0739円 (20,739円)	1.8772円 (18,772円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,371,271,804円)及び分配準備積立金(2,010,456,372円)より分配対象収益は4,381,728,176円(1口当たり1.166850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12期 (自平成26年2月22日 至平成27年2月23日)	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。</p> <p>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。</p>	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	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>	<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>

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	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	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22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	1,172,714,399	756,941,235
合計	1,172,714,399	756,941,235

(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)

元本額の変動

項目	第12期 (平成27年2月23日現在)	第13期 (平成28年2月22日現在)
期首元本額	3,717,737,621円	3,763,295,471円
期中追加設定元本額	620,216,297円	684,049,192円
期中一部解約元本額	574,658,447円	692,168,947円

(4)【附属明細表】(平成28年2月22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	2,271,160,116	2,902,996,860	
	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	759,246,193	1,016,554,727	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	1,745,354,731	2,125,318,455	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	507,846,135	667,817,667	
親投資信託受益証券 合計		5,283,607,175	6,712,687,709	
合計		5,283,607,175	6,712,687,709	

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27年2月23日現在）	（平成28年2月22日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,552,328,027
コール・ローン	666,704,775	129,737,550
株式	42,300,900,540	33,569,060,310
派生商品評価勘定	7,859,340	2,176,240
未収入金	11,530,280	38,804,780
未収配当金	48,166,647	53,632,336
前払金	-	26,650,000
差入委託証拠金	18,810,000	122,130,000
流動資産合計	43,053,971,582	35,494,519,243
資産合計	43,053,971,582	35,494,519,243
負債の部		
流動負債		
前受金	19,550,000	-
未払金	-	1,295,076,600
未払解約金	172,366,196	61,994,903
流動負債合計	191,916,196	1,357,071,503
負債合計	191,916,196	1,357,071,503
純資産の部		
元本等		
元本	29,567,458,266	26,708,202,183
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,294,597,120	7,429,245,557
純資産合計	42,862,055,386	34,137,447,740
負債純資産合計	43,053,971,582	35,494,519,243

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27年2月23日現在）	（平成28年2月22日現在）
1. 受益権総口数	29,567,458,266口	26,708,202,183口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4496円 (14,496円)	1.2782円 (12,782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26年2月22日 至 平成27年2月23日）	（自 平成27年2月24日 至 平成28年2月22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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、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。</p> <p>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。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。</p>	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27年2月23日現在）	（平成28年2月22日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	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27年2月23日現在	平成28年2月22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	70,334,610	5,047,967,953
合計	70,334,610	5,047,967,953

(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27年2月23日 現在)				(平成28年2月22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	428,140,000	-	436,015,000	7,875,000	568,920,000	-	571,120,000	2,200,000
合計	428,140,000	-	436,015,000	7,875,000	568,920,000	-	571,120,000	2,200,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

3. 評価損益は契約額等と時価の差額であります。なお、契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの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27年2月23日現在）	（平成28年2月22日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	28,179,989,310円	29,567,458,266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	14,045,077,774円	11,405,221,135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	12,657,608,818円	14,264,477,218円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	8,109,707,710円	8,316,998,974円
ニッセイ国内株式インデックスSA（適格機関投資家限定）	8,843,614,814円	7,359,394,307円
ニッセイ日本バランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	64,087,291円	28,333,451円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	9,919,725円	8,035,580円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	564,710,023円	639,417,761円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	2,854,843,785円	3,086,722,705円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,192,239,458円	2,271,160,116円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	147,954,889円	106,618,067円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	933,928,598円	634,211,990円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	867,167,683円	524,533,318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）	4,978,508,098円	1,336,991,960円
DCニッセイ国内株式インデックス	776,192円	6,973,595円
ニッセイターゲットデートファンドI（適格機関投資家限定）	- 円	312,638円
ニッセイターゲットデートファンド（適格機関投資家限定）	- 円	298,736円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	- 円	2,224,600,009円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）	- 円	163,598,976円
計	29,567,458,266円	26,708,202,183円

附属明細表（平成28年2月22日現在）

第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	8,000	262.00	2,096,000	
日本水産	22,500	546.00	12,285,000	
マルハニチロ	4,000	2,236.00	8,944,000	
サカタのタネ	2,900	2,755.00	7,989,500	
ホクト	2,000	2,023.00	4,046,000	
ショーボンドホールディングス	2,100	3,840.00	8,064,000	
ミライト・ホールディングス	6,000	795.00	4,770,000	
住石ホールディングス	6,800	93.00	632,400	
日鉄鉱業	5,000	410.00	2,050,000	
三井松島産業	13,000	118.00	1,534,000	
国際石油開発帝石	103,100	824.90	85,047,190	
日本海洋掘削	600	2,029.00	1,217,400	
石油資源開発	3,100	2,544.00	7,886,400	
K & Oエナジーグループ	1,300	1,225.00	1,592,500	
安藤・間	13,100	518.00	6,785,800	
東急建設	6,400	823.00	5,267,200	
コムシスホールディングス	8,400	1,698.00	14,263,200	
ミサワホーム	2,300	660.00	1,518,000	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,147.00	3,220,500	
東建コーポレーション	800	8,570.00	6,856,000	
大成建設	102,000	692.00	70,584,000	
大林組	58,700	989.00	58,054,300	
清水建設	60,000	865.00	51,900,000	
飛鳥建設	14,800	154.00	2,279,200	
長谷工コーポレーション	22,800	946.00	21,568,800	
松井建設	2,200	667.00	1,467,400	
銭高組	3,000	442.00	1,326,000	
鹿島建設	92,000	644.00	59,248,000	
不動テトラ	13,800	114.00	1,573,200	
鉄建建設	12,000	257.00	3,084,000	
西松建設	23,000	429.00	9,867,000	
三井住友建設	75,000	92.00	6,900,000	
大豊建設	8,000	426.00	3,408,000	
前田建設工業	12,000	751.00	9,012,000	
佐田建設	2,400	403.00	967,200	
ナカノフード建設	1,800	526.00	946,800	
奥村組	19,000	556.00	10,564,000	
東鉄工業	2,300	3,030.00	6,969,000	
イチケン	3,000	298.00	894,000	

浅沼組	6,000	227.00	1,362,000
戸田建設	23,000	455.00	10,465,000
熊谷組	29,000	296.00	8,584,000
青木あすなる建設	1,500	664.00	996,000
北野建設	4,000	267.00	1,068,000
植木組	4,000	214.00	856,000
三井ホーム	3,000	506.00	1,518,000
矢作建設工業	2,700	731.00	1,973,700
ピーエス三菱	2,300	419.00	963,700
日本ハウスホールディングス	4,000	399.00	1,596,000
大東建託	7,300	15,190.00	110,887,000
新日本建設	2,300	520.00	1,196,000
N I P P O	5,000	1,689.00	8,445,000
東亜道路工業	4,000	350.00	1,400,000
前田道路	6,000	1,717.00	10,302,000
日本道路	6,000	556.00	3,336,000
東亜建設工業	17,000	243.00	4,131,000
若築建設	11,000	115.00	1,265,000
東洋建設	6,100	417.00	2,543,700
五洋建設	21,700	468.00	10,155,600
大林道路	2,300	731.00	1,681,300
世紀東急工業	3,100	467.00	1,447,700
福田組	3,000	912.00	2,736,000
日本ドライケミカル	500	2,080.00	1,040,000
住友林業	13,500	1,274.00	17,199,000
日本基礎技術	2,200	447.00	983,400
日成ビルド工業	5,000	369.00	1,845,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	15,000	68.00	1,020,000
パナホーム	7,000	823.00	5,761,000
大和ハウス工業	57,800	3,064.00	177,099,200
ライト工業	3,800	1,096.00	4,164,800
積水ハウス	65,400	1,803.50	117,948,900
日特建設	2,400	398.00	955,200
北陸電気工事	1,300	765.00	994,500
ユアテック	3,000	787.00	2,361,000
中電工	2,800	2,341.00	6,554,800
関電工	8,000	839.00	6,712,000
きんでん	11,800	1,449.00	17,098,200
東京エネシス	2,000	873.00	1,746,000
トーエネック	3,000	679.00	2,037,000
住友電設	1,500	1,333.00	1,999,500

日本電設工業	3,200	2,136.00	6,835,200
協和エクシオ	7,700	1,261.00	9,709,700
新日本空調	1,600	961.00	1,537,600
日本工営	6,000	360.00	2,160,000
N D S	3,000	282.00	846,000
九電工	4,000	2,244.00	8,976,000
三機工業	4,300	937.00	4,029,100
日揮	20,000	1,710.00	34,200,000
中外炉工業	6,000	176.00	1,056,000
太平電業	3,000	890.00	2,670,000
高砂熱学工業	5,800	1,528.00	8,862,400
N E C ネットズエスアイ	2,200	1,736.00	3,819,200
朝日工業社	2,000	447.00	894,000
明星工業	3,500	412.00	1,442,000
大気社	2,400	2,538.00	6,091,200
ダイダン	3,000	754.00	2,262,000
日比谷総合設備	2,400	1,631.00	3,914,400
東芝プラントシステム	3,200	1,261.00	4,035,200
日本製粉	13,000	805.00	10,465,000
日清製粉グループ本社	21,400	1,871.00	40,039,400
昭和産業	8,000	452.00	3,616,000
鳥越製粉	1,600	639.00	1,022,400
中部飼料	1,800	793.00	1,427,400
フィード・ワン	11,800	117.00	1,380,600
東洋精糖	10,000	101.00	1,010,000
日本甜菜製糖	10,000	187.00	1,870,000
三井製糖	8,000	480.00	3,840,000
塩水港精糖	4,300	230.00	989,000
日新製糖	300	4,325.00	1,297,500
ネクスト	5,200	1,030.00	5,356,000
日本M & Aセンター	2,800	5,110.00	14,308,000
ノバレーゼ	1,200	826.00	991,200
アコーディア・ゴルフ	7,200	1,098.00	7,905,600
タケエイ	1,600	727.00	1,163,200
トラスト・テック	400	2,388.00	955,200
パソナグループ	1,600	632.00	1,011,200
リンクアンドモチベーション	8,800	117.00	1,029,600
G C A サヴィアン	1,600	877.00	1,403,200
エス・エム・エス	2,300	1,802.00	4,144,600
テンプホールディングス	12,800	1,458.00	18,662,400
リニカル	1,100	1,552.00	1,707,200

クックパッド	4,100	2,016.00	8,265,600
アイ・ケイ・ケイ	1,500	639.00	958,500
森永製菓	18,000	642.00	11,556,000
中村屋	5,000	463.00	2,315,000
江崎グリコ	4,500	6,060.00	27,270,000
名糖産業	900	1,300.00	1,170,000
不二家	11,000	190.00	2,090,000
山崎製パン	14,000	2,155.00	30,170,000
モロゾフ	3,000	421.00	1,263,000
亀田製菓	1,100	4,300.00	4,730,000
寿スピリッツ	500	5,470.00	2,735,000
カルビー	7,200	4,645.00	33,444,000
森永乳業	18,000	536.00	9,648,000
六甲バター	900	1,791.00	1,611,900
ヤクルト本社	10,500	5,560.00	58,380,000
明治ホールディングス	11,600	9,330.00	108,228,000
雪印メグミルク	4,600	2,719.00	12,507,400
プリマハム	12,000	278.00	3,336,000
日本ハム	14,000	2,538.00	35,532,000
伊藤ハム	9,000	706.00	6,354,000
林兼産業	11,000	93.00	1,023,000
丸大食品	10,000	422.00	4,220,000
米久	600	2,566.00	1,539,600
S Foods	1,200	2,149.00	2,578,800
学情	1,000	1,019.00	1,019,000
スタジオアリス	800	2,232.00	1,785,600
シミックホールディングス	800	1,558.00	1,246,400
システナ	1,700	1,515.00	2,575,500
N J S	800	1,154.00	923,200
デジタルアーツ	800	1,936.00	1,548,800
新日鉄住金ソリューションズ	2,900	1,969.00	5,710,100
総合警備保障	6,100	5,790.00	35,319,000
いちごグループホールディングス	14,300	361.00	5,162,300
日本駐車場開発	18,800	119.00	2,237,200
コア	800	1,316.00	1,052,800
カカクコム	13,200	1,978.00	26,109,600
ルネサンス	900	1,205.00	1,084,500
ディップ	2,000	2,179.00	4,358,000
S B Sホールディングス	1,700	646.00	1,098,200
オプトホールディング	1,700	587.00	997,900
新日本科学	2,700	365.00	985,500

ツクイ	2,200	1,337.00	2,941,400
キャリアデザインセンター	1,200	829.00	994,800
エムスリー	15,800	2,699.00	42,644,200
ツカダ・グローバルホールディング	1,500	673.00	1,009,500
アウトソーシング	800	2,905.00	2,324,000
ウェルネット	700	3,145.00	2,201,500
ディー・エヌ・エー	8,200	1,745.00	14,309,000
博報堂D Yホールディングス	25,300	1,261.00	31,903,300
ぐるなび	2,100	2,515.00	5,281,500
エスアールジータカミヤ	3,000	318.00	954,000
ジャパンベストレスキューシステム	4,100	238.00	975,800
ファンコミュニケーションズ	4,200	652.00	2,738,400
WDBホールディングス	1,100	872.00	959,200
ティア	1,600	625.00	1,000,000
バリューコマース	2,900	342.00	991,800
インフォマート	2,600	958.00	2,490,800
サッポロホールディングス	30,000	549.00	16,470,000
アサヒグループホールディングス	36,700	3,497.00	128,339,900
麒麟ホールディングス	79,300	1,499.00	118,870,700
宝ホールディングス	14,200	821.00	11,658,200
オエノンホールディングス	5,000	205.00	1,025,000
養命酒製造	600	1,915.00	1,149,000
コカ・コーラウエスト	6,600	2,598.00	17,146,800
コカ・コーライーストジャパン	6,900	2,052.00	14,158,800
サントリー食品インターナショナル	13,400	4,990.00	66,866,000
ダイトードリンコ	1,000	5,120.00	5,120,000
伊藤園	5,800	3,245.00	18,821,000
キーコーヒー	1,700	1,801.00	3,061,700
ユニカフェ	600	922.00	553,200
日清オイリオグループ	10,000	454.00	4,540,000
不二製油グループ本社	5,200	1,949.00	10,134,800
J・オイルミルズ	8,000	340.00	2,720,000
ローソン	6,500	9,170.00	59,605,000
サンエー	1,200	4,805.00	5,766,000
カワチ薬品	1,300	1,936.00	2,516,800
エービーシー・マート	2,200	6,760.00	14,872,000
ハードオフコーポレーション	800	1,631.00	1,304,800
高千穂交易	1,100	871.00	958,100
アスクル	2,100	3,415.00	7,171,500
ゲオホールディングス	3,300	1,683.00	5,553,900
アダストリア	1,600	5,920.00	9,472,000

シー・ヴィ・エス・ベイエリア	12,000	83.00	996,000	
伊藤忠食品	500	4,185.00	2,092,500	
くらコーポレーション	1,000	5,200.00	5,200,000	
キャンドウ	900	1,460.00	1,314,000	
エレマテック	800	2,149.00	1,719,200	
パル	1,000	2,551.00	2,551,000	
JALUX	600	2,047.00	1,228,200	
エディオン	7,300	856.00	6,248,800	
あらた	800	2,170.00	1,736,000	
ワッツ	1,200	781.00	937,200	
トーメンデバイス	600	1,723.00	1,033,800	
ハローズ	500	2,657.00	1,328,500	
J Pホールディングス	4,500	258.00	1,161,000	
あみやき亭	300	4,325.00	1,297,500	
東京エレクトロン デバイス	600	1,503.00	901,800	
ひらまつ	2,400	653.00	1,567,200	
フィールズ	1,100	1,733.00	1,906,300	
双日	108,600	225.00	24,435,000	
ゲンキー	400	2,802.00	1,120,800	
アルフレッサ ホールディングス	21,700	1,995.00	43,291,500	
大黒天物産	400	4,710.00	1,884,000	
ハニーズ	1,500	1,212.00	1,818,000	
ファーマライズホールディングス	2,000	493.00	986,000	
キッコーマン	15,000	3,810.00	57,150,000	
味の素	42,000	2,880.50	120,981,000	
キューピー	10,000	2,554.00	25,540,000	
ハウス食品グループ本社	6,700	2,205.00	14,773,500	
カゴメ	7,000	2,139.00	14,973,000	
焼津水産化学工業	1,000	1,005.00	1,005,000	
アリアケジャパン	1,600	6,380.00	10,208,000	
エバラ食品工業	500	1,947.00	973,500	
ニチレイ	21,000	887.00	18,627,000	
横浜冷凍	4,300	1,021.00	4,390,300	
東洋水産	9,600	4,165.00	39,984,000	
日清食品ホールディングス	8,300	5,410.00	44,903,000	
永谷園ホールディングス	2,000	1,038.00	2,076,000	
一正蒲鉾	1,100	863.00	949,300	
フジッコ	1,900	2,199.00	4,178,100	
ロック・フィールド	1,000	2,996.00	2,996,000	
日本たばこ産業	115,700	4,542.00	525,509,400	
ケンコーマヨネーズ	600	2,318.00	1,390,800	

わらべや日洋	1,100	2,354.00	2,589,400	
なとり	1,000	1,592.00	1,592,000	
ユーグレナ	6,600	1,521.00	10,038,600	
片倉工業	2,300	1,181.00	2,716,300	
グンゼ	15,000	286.00	4,290,000	
ヒューリック	35,900	989.00	35,505,100	
山下医科器械	600	1,593.00	955,800	
ラサ商事	1,600	600.00	960,000	
アルペン	1,500	1,777.00	2,665,500	
クオール	1,700	1,423.00	2,419,100	
アルコニックス	1,000	1,432.00	1,432,000	
神戸物産	1,100	2,374.00	2,611,400	
ジェイアイエヌ	1,200	4,745.00	5,694,000	
ビックカメラ	8,900	889.00	7,912,100	
D C Mホールディングス	8,500	840.00	7,140,000	
MonotaRO	6,100	2,412.00	14,713,200	
あいホールディングス	3,100	2,793.00	8,658,300	
きちり	100	650.00	65,000	
アークランドサービス	500	2,857.00	1,428,500	
J.フロントリテイリング	21,800	1,337.00	29,146,600	
ドトール・日レスホールディングス	3,000	1,798.00	5,394,000	
マツモトキヨシホールディングス	3,600	5,180.00	18,648,000	
ブロンコビリー	700	2,661.00	1,862,700	
スタートトゥデイ	5,200	3,390.00	17,628,000	
物語コーポレーション	500	5,220.00	2,610,000	
ココカラファイン	1,800	4,385.00	7,893,000	
三越伊勢丹ホールディングス	34,300	1,315.00	45,104,500	
東洋紡	72,000	157.00	11,304,000	
ユニチカ	53,000	51.00	2,703,000	
富士紡ホールディングス	9,000	204.00	1,836,000	
日清紡ホールディングス	9,700	1,110.00	10,767,000	
倉敷紡績	19,000	175.00	3,325,000	
ダイワボウホールディングス	16,000	200.00	3,200,000	
シキボウ	11,000	107.00	1,177,000	
日東紡績	12,000	363.00	4,356,000	
トヨタ紡織	6,100	1,763.00	10,754,300	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,100	1,326.00	4,110,600	
ウエルシアホールディングス	1,500	5,610.00	8,415,000	
クリエイトSDホールディングス	2,500	2,418.00	6,045,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,000	957.00	2,871,000	

U K Cホールディングス	1,100	2,065.00	2,271,500	
O C H Iホールディングス	1,000	1,007.00	1,007,000	
T O K A Iホールディングス	7,600	567.00	4,309,200	
三洋貿易	900	1,290.00	1,161,000	
チムニー	400	2,715.00	1,086,000	
ジョイフル本田	2,800	2,210.00	6,188,000	
キリン堂ホールディングス	1,000	1,007.00	1,007,000	
すかいらーく	5,300	1,500.00	7,950,000	
日本毛織	6,000	741.00	4,446,000	
ダイドーリミテッド	2,100	467.00	980,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,700	946.00	5,392,200	
野村不動産ホールディングス	11,500	1,979.00	22,758,500	
三重交通グループホールディングス	3,100	441.00	1,367,100	
日本商業開発	600	1,747.00	1,048,200	
プレサンスコーポレーション	600	3,545.00	2,127,000	
ユニゾホールディングス	1,100	3,920.00	4,312,000	
日本管理センター	1,200	1,739.00	2,086,800	
サンセイランディック	1,200	848.00	1,017,600	
フージャースホールディングス	2,400	427.00	1,024,800	
オープンハウス	2,500	2,106.00	5,265,000	
東急不動産ホールディングス	41,700	707.00	29,481,900	
飯田グループホールディングス	16,000	2,052.00	32,832,000	
帝国繊維	1,900	1,474.00	2,800,600	
ブックオフコーポレーション	1,100	905.00	995,500	
日本コークス工業	14,800	76.00	1,124,800	
あさひ	1,300	1,301.00	1,691,300	
日本調剤	400	3,605.00	1,442,000	
コスモス薬品	900	16,660.00	14,994,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,500	2,791.00	9,768,500	
一六堂	2,900	332.00	962,800	
セブン&アイ・ホールディングス	72,100	4,556.00	328,487,600	
薬王堂	400	2,582.00	1,032,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,500	2,945.00	4,417,500	
ツルハホールディングス	4,000	9,520.00	38,080,000	
サンマルクホールディングス	1,400	2,896.00	4,054,400	
トリドール	2,100	2,252.00	4,729,200	
クスリのアオキ	1,500	4,890.00	7,335,000	
帝人	75,000	379.00	28,425,000	
東レ	133,000	913.80	121,535,400	

クラレ	28,900	1,239.00	35,807,100
旭化成	114,000	656.10	74,795,400
稲葉製作所	1,000	1,158.00	1,158,000
トーカロ	1,300	1,884.00	2,449,200
SUMCO	14,300	763.00	10,910,900
川田テクノロジーズ	300	3,150.00	945,000
住江織物	5,000	286.00	1,430,000
日本フェルト	2,100	454.00	953,400
芦森工業	7,000	149.00	1,043,000
アツギ	14,000	109.00	1,526,000
共和レザー	1,200	826.00	991,200
セーレン	4,600	1,064.00	4,894,400
東海染工	3,000	117.00	351,000
小松精練	2,800	578.00	1,618,400
ワコールホールディングス	11,000	1,311.00	14,421,000
ホギメディカル	1,200	5,540.00	6,648,000
レナウン	9,500	102.00	969,000
T S Iホールディングス	8,200	729.00	5,977,800
I Tホールディングス	5,700	2,511.00	14,312,700
電算システム	700	1,528.00	1,069,600
グリー	10,500	541.00	5,680,500
コーエーテクモホールディングス	4,100	1,679.00	6,883,900
三菱総合研究所	700	3,480.00	2,436,000
電算	400	2,395.00	958,000
A G S	1,200	815.00	978,000
ファインデックス	1,100	1,014.00	1,115,400
ヒト・コミュニケーションズ	600	1,732.00	1,039,200
K L a b	2,700	494.00	1,333,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,100	970.00	1,067,000
ネクソン	16,500	1,661.00	27,406,500
アイスタイル	2,600	778.00	2,022,800
エムアップ	2,100	476.00	999,600
エイチーム	700	1,431.00	1,001,700
コロブラ	4,800	1,979.00	9,499,200
ブロードリーフ	1,800	1,280.00	2,304,000
ハーツユナイテッドグループ	500	1,915.00	957,500
バイキューブ	800	1,287.00	1,029,600
特種東海製紙	11,000	368.00	4,048,000
ティーガイア	1,700	1,204.00	2,046,800
テクマトリックス	700	1,486.00	1,040,200

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,100	284.00	8,548,400	
GMOペイメントゲートウェイ	1,500	6,110.00	9,165,000	
ザッパラス	2,500	392.00	980,000	
インターネットイニシアティブ	2,800	2,168.00	6,070,400	
さくらインターネット	800	1,784.00	1,427,200	
SRAホールディングス	1,000	2,256.00	2,256,000	
王子ホールディングス	75,000	430.00	32,250,000	
日本製紙	9,500	1,825.00	17,337,500	
三菱製紙	28,000	80.00	2,240,000	
北越紀州製紙	11,400	617.00	7,033,800	
中越バルブ工業	8,000	159.00	1,272,000	
大王製紙	8,100	872.00	7,063,200	
gumi	1,800	640.00	1,152,000	
パイブドHD	900	1,076.00	968,400	
レンゴー	16,000	539.00	8,624,000	
トーモク	6,000	250.00	1,500,000	
ザ・バック	1,300	2,642.00	3,434,600	
昭和電工	122,000	113.00	13,786,000	
住友化学	135,000	502.00	67,770,000	
日本化成	9,000	114.00	1,026,000	
住友精化	4,000	587.00	2,348,000	
日産化学工業	11,000	2,563.00	28,193,000	
ラサ工業	10,000	101.00	1,010,000	
クレハ	14,000	361.00	5,054,000	
テイカ	3,000	526.00	1,578,000	
石原産業	33,000	73.00	2,409,000	
日本曹達	12,000	505.00	6,060,000	
東ソー	49,000	428.00	20,972,000	
トクヤマ	30,000	140.00	4,200,000	
セントラル硝子	20,000	543.00	10,860,000	
東亜合成	11,400	880.00	10,032,000	
大阪ソーダ	8,000	414.00	3,312,000	
関東電化工業	4,000	877.00	3,508,000	
デンカ	38,000	401.00	15,238,000	
イビデン	10,700	1,353.00	14,477,100	
信越化学工業	32,800	5,675.00	186,140,000	
日本カーバイド工業	8,000	119.00	952,000	
堺化学工業	7,000	297.00	2,079,000	
エア・ウォーター	15,000	1,583.00	23,745,000	
大陽日酸	14,100	1,006.00	14,184,600	

日本化学工業	7,000	193.00	1,351,000
日本パーカラライジング	9,300	972.00	9,039,600
高圧ガス工業	3,000	586.00	1,758,000
四国化成工業	3,000	869.00	2,607,000
戸田工業	4,000	317.00	1,268,000
ステラ ケミファ	900	2,301.00	2,070,900
保土谷化学工業	6,000	174.00	1,044,000
日本触媒	2,700	6,790.00	18,333,000
大日精化工業	7,000	442.00	3,094,000
カネカ	25,000	864.00	21,600,000
協和発酵キリン	21,900	1,616.00	35,390,400
三菱瓦斯化学	31,000	571.00	17,701,000
三井化学	78,000	396.00	30,888,000
J S R	17,200	1,577.00	27,124,400
東京応化工業	3,700	2,964.00	10,966,800
三菱ケミカルホールディングス	122,500	610.00	74,725,000
日本合成化学工業	4,000	662.00	2,648,000
ダイセル	25,700	1,515.00	38,935,500
住友ベークライト	17,000	483.00	8,211,000
積水化学工業	41,500	1,279.00	53,078,500
日本ゼオン	16,000	696.00	11,136,000
アイカ工業	5,500	2,186.00	12,023,000
宇部興産	98,000	192.00	18,816,000
積水樹脂	2,800	1,344.00	3,763,200
タキロン	4,000	543.00	2,172,000
旭有機材工業	6,000	202.00	1,212,000
日立化成	9,000	1,869.00	16,821,000
ニチバン	2,000	624.00	1,248,000
リケンテクノス	3,000	359.00	1,077,000
大倉工業	4,000	272.00	1,088,000
積水化成品工業	5,000	347.00	1,735,000
群栄化学工業	5,000	267.00	1,335,000
ミライアル	1,200	859.00	1,030,800
ダイキョーニシカワ	2,400	1,534.00	3,681,600
日本化薬	12,000	1,141.00	13,692,000
カーリットホールディングス	2,000	488.00	976,000
E P Sホールディングス	2,000	1,357.00	2,714,000
プレステージ・インターナショナル	1,500	1,207.00	1,810,500
フェイス	800	1,193.00	954,400
アミューズ	500	4,110.00	2,055,000
野村総合研究所	12,100	3,845.00	46,524,500

ドリームインキュベータ	600	2,166.00	1,299,600	
サイバネットシステム	1,400	912.00	1,276,800	
T A C	5,400	179.00	966,600	
ケネディクス	24,500	464.00	11,368,000	
電通	20,300	5,540.00	112,462,000	
インテージホールディングス	900	1,426.00	1,283,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	2,100	461.00	968,100	
東邦システムサイエンス	1,700	580.00	986,000	
びあ	500	2,163.00	1,081,500	
イオンファンタジー	600	2,126.00	1,275,600	
メディカルシステムネットワーク	2,300	425.00	977,500	
日本精化	1,500	721.00	1,081,500	
扶桑化学工業	1,200	1,359.00	1,630,800	
A D E K A	9,000	1,495.00	13,455,000	
日油	14,000	792.00	11,088,000	
ミヨシ油脂	8,000	121.00	968,000	
新日本理化	6,800	144.00	979,200	
ハリマ化成グループ	1,900	506.00	961,400	
花王	49,200	5,848.00	287,721,600	
第一工業製薬	4,000	312.00	1,248,000	
三洋化成工業	6,000	766.00	4,596,000	
武田薬品工業	72,800	5,417.00	394,357,600	
アステラス製薬	204,800	1,577.00	322,969,600	
大日本住友製薬	12,900	1,236.00	15,944,400	
塩野義製薬	26,700	4,764.00	127,198,800	
田辺三菱製薬	21,300	2,031.00	43,260,300	
わかもと製薬	4,000	268.00	1,072,000	
あすか製薬	2,300	1,176.00	2,704,800	
日本新薬	4,200	3,880.00	16,296,000	
ビオフェルミン製薬	300	3,510.00	1,053,000	
中外製薬	18,200	3,370.00	61,334,000	
科研製薬	3,200	7,200.00	23,040,000	
エーザイ	22,500	7,000.00	157,500,000	
理研ビタミン	600	3,740.00	2,244,000	
ロート製薬	9,000	2,061.00	18,549,000	
小野薬品工業	8,300	19,715.00	163,634,500	
久光製薬	5,700	5,020.00	28,614,000	
持田製薬	1,300	8,540.00	11,102,000	
参天製薬	33,700	1,742.00	58,705,400	
扶桑薬品工業	6,000	252.00	1,512,000	
日本ケミファ	3,000	480.00	1,440,000	

ツムラ	5,800	2,793.00	16,199,400
日医工	4,300	2,731.00	11,743,300
テルモ	26,800	3,885.00	104,118,000
みらかホールディングス	4,700	4,760.00	22,372,000
キッセイ薬品工業	3,200	2,647.00	8,470,400
生化学工業	3,500	1,336.00	4,676,000
栄研化学	1,500	2,138.00	3,207,000
鳥居薬品	1,200	2,341.00	2,809,200
J C Rファーマ	1,400	2,008.00	2,811,200
東和薬品	800	5,220.00	4,176,000
富士製薬工業	500	2,024.00	1,012,000
沢井製薬	3,100	7,620.00	23,622,000
ゼリア新薬工業	3,700	1,389.00	5,139,300
第一三共	61,500	2,259.00	138,928,500
キョーリン製薬ホールディングス	4,900	2,127.00	10,422,300
大幸薬品	900	1,345.00	1,210,500
ダイト	800	2,705.00	2,164,000
大塚ホールディングス	39,300	4,152.00	163,173,600
大正製薬ホールディングス	4,400	8,910.00	39,204,000
ペプチドリーム	2,200	4,255.00	9,361,000
大日本塗料	10,000	198.00	1,980,000
日本ペイントホールディングス	14,100	2,372.00	33,445,200
関西ペイント	20,700	1,689.00	34,962,300
中国塗料	5,000	713.00	3,565,000
日本特殊塗料	1,300	991.00	1,288,300
藤倉化成	2,500	516.00	1,290,000
太陽ホールディングス	1,300	3,685.00	4,790,500
D I C	73,000	242.00	17,666,000
サカタインクス	3,700	1,137.00	4,206,900
東洋インキS Cホールディングス	18,000	447.00	8,046,000
T & K T O K A	1,300	909.00	1,181,700
アルプス技研	700	2,191.00	1,533,700
ダイオーズ	1,000	1,005.00	1,005,000
日本空調サービス	900	1,111.00	999,900
オリエンタルランド	19,700	8,010.00	157,797,000
ダスキン	5,200	2,160.00	11,232,000
パーク24	8,700	2,943.00	25,604,100
明光ネットワークジャパン	2,100	1,132.00	2,377,200
ファルコホールディングス	800	1,267.00	1,013,600
クレスコ	600	1,757.00	1,054,200
フジ・メディア・ホールディングス	17,900	1,314.00	23,520,600

秀英予備校	1,800	524.00	943,200
ラウンドワン	5,700	691.00	3,938,700
リゾートトラスト	7,600	2,513.00	19,098,800
オービック	5,900	5,570.00	32,863,000
ジャストシステム	3,100	851.00	2,638,100
TDCソフトウェアエンジニアリング	900	1,043.00	938,700
ヤフー	123,500	433.00	53,475,500
ビー・エム・エル	1,100	4,095.00	4,504,500
トレンドマイクロ	8,400	3,860.00	32,424,000
りらいあコミュニケーションズ	3,000	982.00	2,946,000
インフォメーション・ディベロプメント	1,100	880.00	968,000
リソー教育	3,400	308.00	1,047,200
日本オラクル	2,800	5,380.00	15,064,000
アルファシステムズ	600	1,733.00	1,039,800
フューチャーアーキテクト	2,100	802.00	1,684,200
CAC Holdings	1,400	723.00	1,012,200
ソフトバンク・テクノロジー	800	1,300.00	1,040,000
トーセ	1,400	696.00	974,400
ユー・エス・エス	22,100	1,719.00	37,989,900
オービックビジネスコンサルタント	900	4,510.00	4,059,000
伊藤忠テクノソリューションズ	3,900	2,276.00	8,876,400
アイティフォー	2,200	455.00	1,001,000
東計電算	500	1,924.00	962,000
サイバーエージェント	4,500	5,130.00	23,085,000
楽天	85,300	999.60	85,265,880
大塚商会	4,600	5,470.00	25,162,000
総合メディカル	800	3,445.00	2,756,000
サイボウズ	3,300	303.00	999,900
セントラルスポーツ	600	2,272.00	1,363,200
バラカ	800	1,331.00	1,064,800
電通国際情報サービス	1,100	2,103.00	2,313,300
イーエムシステムズ	400	2,568.00	1,027,200
ウェザーニューズ	600	3,545.00	2,127,000
C I J	2,300	437.00	1,005,100
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,313.00	919,100
日本エンタープライズ	3,900	229.00	893,100
WOWOW	800	2,564.00	2,051,200
フルキャストホールディングス	1,700	667.00	1,133,900
富士フイルムホールディングス	41,800	4,269.00	178,444,200
コニカミノルタ	43,600	922.00	40,199,200

資生堂	34,700	2,426.00	84,182,200
ライオン	21,000	1,224.00	25,704,000
高砂香料工業	1,200	2,271.00	2,725,200
マンダム	1,700	4,640.00	7,888,000
ミルボン	1,100	4,390.00	4,829,000
ファンケル	4,200	1,391.00	5,842,200
コーセー	3,000	9,560.00	28,680,000
シーズ・ホールディングス	2,300	1,841.00	4,234,300
シーボン	400	2,400.00	960,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,900	8,600.00	16,340,000
ノエビアホールディングス	1,200	3,020.00	3,624,000
アジュバンコスメジャパン	1,000	998.00	998,000
エステー	1,200	1,095.00	1,314,000
アグロ カネショウ	900	882.00	793,800
コニシ	1,400	2,617.00	3,663,800
長谷川香料	2,300	1,449.00	3,332,700
星光PMC	1,100	914.00	1,005,400
小林製薬	2,800	9,690.00	27,132,000
荒川化学工業	1,600	927.00	1,483,200
メック	1,400	841.00	1,177,400
日本高純度化学	500	2,024.00	1,012,000
JCU	500	3,290.00	1,645,000
デクセリアルズ	4,100	1,027.00	4,210,700
アース製薬	1,300	4,050.00	5,265,000
イハラケミカル工業	2,800	1,236.00	3,460,800
北興化学工業	3,000	292.00	876,000
大成ラミック	500	3,015.00	1,507,500
クミアイ化学工業	3,800	1,148.00	4,362,400
日本農薬	4,200	589.00	2,473,800
昭和シェル石油	18,400	936.00	17,222,400
ニチレキ	2,200	745.00	1,639,000
東燃ゼネラル石油	28,000	900.00	25,200,000
ユシロ化学工業	1,000	1,232.00	1,232,000
ビーピー・カストロール	800	1,227.00	981,600
富士石油	4,200	276.00	1,159,200
MORESCO	300	1,472.00	441,600
出光興産	9,500	1,796.00	17,062,000
JXホールディングス	216,500	445.20	96,385,800
コスモエネルギーホールディングス	5,500	1,188.00	6,534,000
横浜ゴム	11,000	1,903.00	20,933,000
東洋ゴム工業	8,300	1,711.00	14,201,300

ブリヂストン	61,700	3,991.00	246,244,700	
住友ゴム工業	17,100	1,657.00	28,334,700	
藤倉ゴム工業	2,200	453.00	996,600	
オカモト	6,000	938.00	5,628,000	
アキレス	15,000	146.00	2,190,000	
フコク	300	851.00	255,300	
ニッタ	2,000	2,912.00	5,824,000	
クリエートメディック	1,200	804.00	964,800	
住友理工	3,900	994.00	3,876,600	
三ツ星ベルト	4,000	873.00	3,492,000	
バンドー化学	7,000	431.00	3,017,000	
鬼怒川ゴム工業	4,000	524.00	2,096,000	
旭硝子	97,000	545.00	52,865,000	
日本板硝子	89,000	72.00	6,408,000	
有沢製作所	2,700	560.00	1,512,000	
日本山村硝子	7,000	164.00	1,148,000	
日本電気硝子	38,000	532.00	20,216,000	
住友大阪セメント	36,000	412.00	14,832,000	
太平洋セメント	114,000	228.00	25,992,000	
日本ヒューム	1,800	547.00	984,600	
日本コンクリート工業	4,000	250.00	1,000,000	
三谷セキサン	900	1,372.00	1,234,800	
アジアパイルホールディングス	2,700	358.00	966,600	
東海カーボン	16,000	273.00	4,368,000	
日本カーボン	9,000	214.00	1,926,000	
東洋炭素	1,000	1,453.00	1,453,000	
ノリタケカンパニーリミテド	10,000	243.00	2,430,000	
TOTO	13,400	3,235.00	43,349,000	
日本碍子	23,000	2,055.00	47,265,000	
日本特殊陶業	15,800	2,165.00	34,207,000	
MARUWA	700	2,489.00	1,742,300	
品川リフラクトリーズ	5,000	203.00	1,015,000	
黒崎播磨	4,000	234.00	936,000	
東京窯業	6,000	167.00	1,002,000	
ニッカトー	2,600	373.00	969,800	
フジインコーポレーテッド	1,600	1,165.00	1,864,000	
エーアンドエーマテリアル	14,000	71.00	994,000	
ニチアス	9,000	628.00	5,652,000	
新日鐵住金	82,400	1,874.00	154,417,600	
神戸製鋼所	336,000	86.00	28,896,000	
中山製鋼所	21,000	65.00	1,365,000	

合同製鐵	10,000	192.00	1,920,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	50,000	1,292.50	64,625,000	
日新製鋼	8,300	1,166.00	9,677,800	
東京製鐵	10,100	724.00	7,312,400	
共英製鋼	1,900	1,701.00	3,231,900	
大和工業	4,000	2,307.00	9,228,000	
東京鐵鋼	4,000	389.00	1,556,000	
大阪製鐵	1,100	1,727.00	1,899,700	
淀川製鋼所	2,700	2,451.00	6,617,700	
東洋鋼鈹	4,400	301.00	1,324,400	
丸一鋼管	6,100	3,125.00	19,062,500	
大同特殊鋼	31,000	409.00	12,679,000	
日本冶金工業	13,400	113.00	1,514,200	
山陽特殊製鋼	11,000	479.00	5,269,000	
愛知製鋼	11,000	423.00	4,653,000	
日立金属	20,900	1,192.00	24,912,800	
日本金属	10,000	107.00	1,070,000	
大平洋金属	13,000	312.00	4,056,000	
新日本電工	10,300	165.00	1,699,500	
栗本鐵工所	9,000	156.00	1,404,000	
日本鑄鉄管	7,000	134.00	938,000	
日本製鋼所	30,000	380.00	11,400,000	
三菱製鋼	13,000	175.00	2,275,000	
日亜鋼業	3,700	262.00	969,400	
日本精線	2,000	477.00	954,000	
大紀アルミニウム工業所	4,000	257.00	1,028,000	
日本輕金属ホールディングス	41,400	168.00	6,955,200	
三井金属鈹業	47,000	160.00	7,520,000	
東邦亜鉛	10,000	281.00	2,810,000	
三菱マテリアル	114,000	311.00	35,454,000	
住友金属鈹山	50,000	1,160.50	58,025,000	
DOWAホールディングス	24,000	602.00	14,448,000	
古河機械金属	29,000	160.00	4,640,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	1,632.00	2,937,600	
東邦チタニウム	3,100	865.00	2,681,500	
UACJ	26,000	214.00	5,564,000	
古河電気工業	57,000	231.00	13,167,000	
住友電気工業	73,200	1,340.50	98,124,600	
フジクラ	25,000	466.00	11,650,000	
昭和電線ホールディングス	22,000	55.00	1,210,000	

東京特殊電線	1,200	857.00	1,028,400
タツタ電線	3,800	329.00	1,250,200
カナレ電気	600	1,693.00	1,015,800
リョービ	11,000	407.00	4,477,000
アーレスティ	2,100	655.00	1,375,500
アサヒホールディングス	2,800	1,440.00	4,032,000
東洋製罐グループホールディングス	13,000	1,971.00	25,623,000
ホッカホホールディングス	5,000	289.00	1,445,000
コロナ	1,000	1,000.00	1,000,000
横河ブリッジホールディングス	3,500	1,058.00	3,703,000
OSJBホールディングス	3,600	219.00	788,400
駒井ハルテック	4,000	224.00	896,000
高田機工	5,000	186.00	930,000
三和ホールディングス	18,500	719.00	13,301,500
文化シャッター	5,100	905.00	4,615,500
三協立山	2,400	1,299.00	3,117,600
アルインコ	1,000	987.00	987,000
LIXILグループ	25,500	2,393.00	61,021,500
日本ファイルコン	2,300	416.00	956,800
ノーリツ	3,600	1,894.00	6,818,400
長府製作所	2,000	2,490.00	4,980,000
リンナイ	3,400	9,740.00	33,116,000
ユニプレス	3,600	1,783.00	6,418,800
ダイニチ工業	900	609.00	548,100
日東精工	3,000	302.00	906,000
岡部	3,800	678.00	2,576,400
ジーテクト	1,900	1,172.00	2,226,800
東プレ	3,500	2,055.00	7,192,500
高周波熱錬	3,400	817.00	2,777,800
東京製綱	12,000	139.00	1,668,000
サンコール	2,100	473.00	993,300
モリテックスチール	4,000	248.00	992,000
バイオラックス	900	5,230.00	4,707,000
日本発条	17,200	1,020.00	17,544,000
中央発條	4,000	263.00	1,052,000
三浦工業	8,200	1,810.00	14,842,000
タクマ	7,000	870.00	6,090,000
テクノプロ・ホールディングス	3,000	3,070.00	9,210,000
リブセンス	700	389.00	272,300
ジャパンマテリアル	800	2,216.00	1,772,800
ベクトル	600	2,588.00	1,552,800

アサンテ	700	1,496.00	1,047,200	
アビスト	500	1,981.00	990,500	
ウィルグループ	1,100	896.00	985,600	
リクルートホールディングス	36,800	3,380.00	124,384,000	
ツガミ	5,000	399.00	1,995,000	
オークマ	12,000	862.00	10,344,000	
東芝機械	10,000	370.00	3,700,000	
アマダホールディングス	26,600	1,089.00	28,967,400	
アイダエンジニアリング	4,800	864.00	4,147,200	
滝澤鉄工所	8,000	124.00	992,000	
富士機械製造	6,000	1,077.00	6,462,000	
牧野フライス製作所	9,000	722.00	6,498,000	
オーエスジー	8,300	1,912.00	15,869,600	
ダイジェット工業	8,000	130.00	1,040,000	
旭ダイヤモンド工業	5,000	976.00	4,880,000	
D M G 森精機	10,100	973.00	9,827,300	
ソディック	3,500	738.00	2,583,000	
ディスコ	2,300	10,780.00	24,794,000	
日東工器	1,100	2,071.00	2,278,100	
日本郵政	40,200	1,391.00	55,918,200	
ベルシステム24ホールディングス	2,700	958.00	2,586,600	
豊田自動織機	15,900	4,780.00	76,002,000	
豊和工業	1,800	540.00	972,000	
OKK	9,000	112.00	1,008,000	
石川製作所	14,000	68.00	952,000	
津田駒工業	10,000	98.00	980,000	
島精機製作所	2,600	1,716.00	4,461,600	
日阪製作所	2,300	805.00	1,851,500	
やまびこ	3,300	750.00	2,475,000	
ペガサスミシン製造	2,000	490.00	980,000	
ナブテスコ	9,500	2,219.00	21,080,500	
三井海洋開発	2,100	1,475.00	3,097,500	
レオン自動機	1,600	605.00	968,000	
S M C	5,500	27,365.00	150,507,500	
新川	2,400	398.00	955,200	
ホソカワミクロン	3,000	528.00	1,584,000	
ユニオンツール	800	2,430.00	1,944,000	
オイレス工業	2,400	1,777.00	4,264,800	
日精エー・エス・ビー機械	700	1,806.00	1,264,200	
サトーホールディングス	2,500	2,492.00	6,230,000	
日本エアーテック	1,400	691.00	967,400	

日精樹脂工業	1,500	680.00	1,020,000	
小松製作所	89,600	1,741.50	156,038,400	
住友重機械工業	53,000	464.00	24,592,000	
日立建機	8,200	1,637.00	13,423,400	
日工	3,000	325.00	975,000	
巴工業	700	1,423.00	996,100	
井関農機	19,000	180.00	3,420,000	
TOWA	1,800	692.00	1,245,600	
丸山製作所	6,000	165.00	990,000	
北川鉄工所	8,000	206.00	1,648,000	
シンニッタン	600	588.00	352,800	
クボタ	87,700	1,449.00	127,077,300	
荏原実業	800	1,210.00	968,000	
東洋エンジニアリング	10,000	263.00	2,630,000	
三菱化工機	6,000	223.00	1,338,000	
月島機械	3,500	1,007.00	3,524,500	
帝国電機製作所	1,400	662.00	926,800	
新東工業	4,100	909.00	3,726,900	
澁谷工業	1,500	1,332.00	1,998,000	
アイチコーポレーション	2,600	772.00	2,007,200	
小森コーポレーション	4,400	1,202.00	5,288,800	
鶴見製作所	1,400	1,758.00	2,461,200	
住友精密工業	3,000	344.00	1,032,000	
荏原製作所	40,000	426.00	17,040,000	
石井鐵工所	7,000	146.00	1,022,000	
西島製作所	1,900	969.00	1,841,100	
北越工業	2,000	642.00	1,284,000	
千代田化工建設	14,000	847.00	11,858,000	
ダイキン工業	25,400	7,809.00	198,348,600	
オルガノ	3,000	413.00	1,239,000	
トーヨーカネツ	10,000	240.00	2,400,000	
栗田工業	11,000	2,546.00	28,006,000	
椿本チエイン	10,000	627.00	6,270,000	
日機装	6,500	834.00	5,421,000	
新興プランテック	4,000	880.00	3,520,000	
アネスト岩田	2,900	863.00	2,502,700	
ダイフク	9,400	1,754.00	16,487,600	
加藤製作所	4,000	374.00	1,496,000	
タダノ	8,000	974.00	7,792,000	
フジテック	5,100	1,173.00	5,982,300	
C K D	4,900	781.00	3,826,900	

キトー	2,200	743.00	1,634,600
平和	5,500	2,360.00	12,980,000
理想科学工業	1,900	1,786.00	3,393,400
SANKYO	4,900	4,250.00	20,825,000
日本金銭機械	1,600	989.00	1,582,400
マースエンジニアリング	1,000	1,947.00	1,947,000
福島工業	1,100	2,264.00	2,490,400
オーイズミ	2,100	475.00	997,500
ダイコク電機	800	1,218.00	974,400
竹内製作所	2,600	1,437.00	3,736,200
アマノ	5,400	1,583.00	8,548,200
JUKI	2,600	862.00	2,241,200
サンデンホールディングス	11,000	291.00	3,201,000
蛇の目マシン工業	1,800	537.00	966,600
ブラザー工業	22,600	1,198.00	27,074,800
マックス	3,000	1,190.00	3,570,000
モリタホールディングス	3,100	1,244.00	3,856,400
グローリー	6,000	3,790.00	22,740,000
新晃工業	1,200	1,696.00	2,035,200
大和冷機工業	2,800	920.00	2,576,000
セガサミーホールディングス	18,800	1,196.00	22,484,800
日本ピストンリング	700	1,503.00	1,052,100
リケン	8,000	355.00	2,840,000
T P R	2,100	2,652.00	5,569,200
ツバキ・ナカシマ	1,600	1,563.00	2,500,800
ホシザキ電機	3,800	8,590.00	32,642,000
大豊工業	1,400	1,087.00	1,521,800
日本精工	35,900	1,048.00	37,623,200
NTN	43,000	362.00	15,566,000
ジェイテクト	18,600	1,550.00	28,830,000
不二越	16,000	378.00	6,048,000
ミネベア	28,000	792.00	22,176,000
日本トムソン	6,000	379.00	2,274,000
THK	11,600	1,969.00	22,840,400
ユーシン精機	700	1,724.00	1,206,800
前澤給装工業	700	1,369.00	958,300
イーグル工業	2,200	1,402.00	3,084,400
日本ビラー工業	1,800	912.00	1,641,600
キッツ	8,500	470.00	3,995,000
日立製作所	445,000	476.60	212,087,000
東芝	368,000	183.50	67,528,000

三菱電機	186,000	1,134.00	210,924,000
富士電機	53,000	382.00	20,246,000
東洋電機製造	3,000	319.00	957,000
安川電機	21,700	1,281.00	27,797,700
シンフォニアテクノロジー	11,000	144.00	1,584,000
明電舎	16,000	464.00	7,424,000
オリジン電気	4,000	255.00	1,020,000
山洋電気	5,000	500.00	2,500,000
デンヨー	1,600	1,171.00	1,873,600
日立工機	4,700	740.00	3,478,000
三櫻工業	2,200	564.00	1,240,800
マキタ	11,400	6,760.00	77,064,000
東芝テック	12,000	352.00	4,224,000
芝浦メカトロニクス	5,000	191.00	955,000
マブチモーター	5,000	4,620.00	23,100,000
日本電産	21,000	7,372.00	154,812,000
東光高岳	1,000	1,337.00	1,337,000
ダブル・スコープ	500	4,025.00	2,012,500
ダイヘン	10,000	454.00	4,540,000
田淵電機	2,200	437.00	961,400
JVCケンウッド	12,800	294.00	3,763,200
ミマキエンジニアリング	1,000	429.00	429,000
第一精工	700	1,285.00	899,500
日新電機	4,100	917.00	3,759,700
大崎電気工業	3,000	717.00	2,151,000
オムロン	20,000	3,070.00	61,400,000
日東工業	2,800	1,799.00	5,037,200
I D E C	2,300	1,023.00	2,352,900
ジーエス・ユアサコーポレーション	34,000	448.00	15,232,000
サクサホールディングス	5,000	191.00	955,000
メルコホールディングス	1,000	2,237.00	2,237,000
テクノメディカ	400	2,235.00	894,000
日本電気	240,000	273.00	65,520,000
富士通	168,000	414.20	69,585,600
沖電気工業	76,000	152.00	11,552,000
岩崎通信機	14,000	72.00	1,008,000
電気興業	5,000	551.00	2,755,000
サンケン電気	10,000	303.00	3,030,000
アイホン	1,000	1,933.00	1,933,000
ルネサスエレクトロニクス	9,000	659.00	5,931,000
セイコーエプソン	26,000	1,799.00	46,774,000

ワコム	13,700	484.00	6,630,800
アルバック	3,200	3,280.00	10,496,000
アクセル	1,200	860.00	1,032,000
E I Z O	1,700	2,990.00	5,083,000
ジャパンディスプレイ	32,600	211.00	6,878,600
日本信号	4,800	799.00	3,835,200
京三製作所	4,000	321.00	1,284,000
能美防災	2,000	1,353.00	2,706,000
ホーチキ	1,300	1,134.00	1,474,200
エレコム	1,500	1,618.00	2,427,000
日本無線	4,000	267.00	1,068,000
パナソニック	199,500	845.10	168,597,450
シャープ	148,000	173.00	25,604,000
アンリツ	10,500	638.00	6,699,000
富士通ゼネラル	5,000	1,488.00	7,440,000
日立国際電気	4,000	1,266.00	5,064,000
ソニー	123,200	2,488.00	306,521,600
T D K	10,500	5,740.00	60,270,000
ミツミ電機	6,600	487.00	3,214,200
タムラ製作所	7,000	271.00	1,897,000
アルプス電気	14,800	1,804.00	26,699,200
パイオニア	28,300	244.00	6,905,200
日本電波工業	1,600	675.00	1,080,000
日本トリム	500	4,335.00	2,167,500
ローランド ディー . ジー .	900	2,334.00	2,100,600
フォスター電機	2,200	2,138.00	4,703,600
クラリオン	9,000	351.00	3,159,000
S M K	5,000	529.00	2,645,000
東光	4,000	358.00	1,432,000
ティアック	23,000	42.00	966,000
ホシデン	5,300	661.00	3,503,300
ヒロセ電機	2,800	12,610.00	35,308,000
日本航空電子工業	5,000	1,151.00	5,755,000
T O A	2,100	1,012.00	2,125,200
日立マクセル	2,900	1,627.00	4,718,300
古野電気	2,100	698.00	1,465,800
ユニデンホールディングス	9,000	113.00	1,017,000
アルパイン	4,200	1,270.00	5,334,000
スミダコーポレーション	1,400	708.00	991,200
アイコム	1,000	2,196.00	2,196,000
リオン	700	1,560.00	1,092,000

船井電機	1,800	963.00	1,733,400	
横河電機	17,500	1,124.00	19,670,000	
新電元工業	6,000	361.00	2,166,000	
アズビル	5,700	2,777.00	15,828,900	
日本光電工業	7,300	2,826.00	20,629,800	
チノー	1,000	1,005.00	1,005,000	
日本電子材料	2,500	384.00	960,000	
堀場製作所	3,200	3,655.00	11,696,000	
アドバンテスト	11,900	1,025.00	12,197,500	
エスベック	1,800	1,343.00	2,417,400	
パナソニック デバイスSUNX	1,800	544.00	979,200	
キーエンス	4,000	58,580.00	234,320,000	
日置電機	900	2,239.00	2,015,100	
シスメックス	13,500	6,660.00	89,910,000	
日本マイクロニクス	2,300	959.00	2,205,700	
メガチップス	1,800	1,063.00	1,913,400	
OBARA GROUP	1,100	4,150.00	4,565,000	
イマジカ・ロボット ホールディングス	2,600	389.00	1,011,400	
澤藤電機	5,000	179.00	895,000	
デンソー	43,100	4,200.00	181,020,000	
コーセル	2,400	998.00	2,395,200	
オブテックス	1,300	2,770.00	3,601,000	
千代田インテグレ	900	2,538.00	2,284,200	
レーザーテック	2,000	1,419.00	2,838,000	
スタンレー電気	12,500	2,534.00	31,675,000	
岩崎電気	6,000	174.00	1,044,000	
ウシオ電機	10,600	1,578.00	16,726,800	
岡谷電機産業	2,600	370.00	962,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	2,600	382.00	993,200	
日本セラミック	1,000	1,820.00	1,820,000	
日本デジタル研究所	1,500	1,569.00	2,353,500	
双信電機	3,800	259.00	984,200	
山一電機	1,700	572.00	972,400	
図研	1,300	1,163.00	1,511,900	
日本電子	7,000	524.00	3,668,000	
カシオ計算機	17,500	2,102.00	36,785,000	
ファナック	17,900	17,040.00	305,016,000	
日本シイエムケイ	3,800	390.00	1,482,000	
エンブラス	900	3,815.00	3,433,500	
ローム	8,600	4,685.00	40,291,000	

浜松ホトニクス	13,600	2,805.00	38,148,000
三井ハイテック	2,500	528.00	1,320,000
新光電気工業	6,600	648.00	4,276,800
京セラ	28,700	4,927.00	141,404,900
協栄産業	8,000	125.00	1,000,000
太陽誘電	8,500	1,111.00	9,443,500
村田製作所	18,300	13,435.00	245,860,500
ユーシン	2,300	659.00	1,515,700
双葉電子工業	3,000	1,504.00	4,512,000
日東電工	14,100	5,982.00	84,346,200
北陸電気工業	8,000	124.00	992,000
東海理化電機製作所	5,100	2,357.00	12,020,700
ニチコン	5,500	733.00	4,031,500
日本ケミコン	14,000	142.00	1,988,000
K O A	2,400	864.00	2,073,600
三井造船	68,000	147.00	9,996,000
日立造船	13,800	514.00	7,093,200
三菱重工業	311,000	409.90	127,478,900
川崎重工業	136,000	303.00	41,208,000
I H I	134,000	190.00	25,460,000
名村造船所	5,200	675.00	3,510,000
サノヤスホールディングス	4,800	204.00	979,200
日本車輛製造	7,000	243.00	1,701,000
ニチュ三菱フォークリフト	2,200	431.00	948,200
近畿車輛	3,000	298.00	894,000
F P G	5,100	957.00	4,880,700
島根銀行	800	1,156.00	924,800
じもとホールディングス	12,400	145.00	1,798,000
全国保証	4,500	3,310.00	14,895,000
足利ホールディングス	12,600	316.00	3,981,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	2,400	2,597.00	6,232,800
九州フィナンシャルグループ	26,400	659.00	17,397,600
かんば生命保険	5,300	2,377.00	12,598,100
ゆうちょ銀行	33,100	1,191.00	39,422,100
日産自動車	245,100	979.20	240,001,920
いすゞ自動車	50,600	1,137.50	57,557,500
トヨタ自動車	217,200	5,980.00	1,298,856,000
日野自動車	24,900	1,182.00	29,431,800
三菱自動車工業	69,300	809.00	56,063,700
レシップホールディングス	1,300	762.00	990,600
G M B	1,200	826.00	991,200

ファルテック	700	1,324.00	926,800	
武蔵精密工業	1,900	2,105.00	3,999,500	
日産車体	8,500	1,133.00	9,630,500	
新明和工業	8,000	767.00	6,136,000	
極東開発工業	3,500	1,032.00	3,612,000	
日信工業	3,900	1,442.00	5,623,800	
トピー工業	14,000	214.00	2,996,000	
ティラド	7,000	168.00	1,176,000	
曙ブレーキ工業	8,800	240.00	2,112,000	
タチエス	2,800	1,495.00	4,186,000	
N O K	8,400	1,850.00	15,540,000	
フタバ産業	5,300	463.00	2,453,900	
K Y B	20,000	294.00	5,880,000	
シロキ工業	4,000	331.00	1,324,000	
市光工業	5,000	184.00	920,000	
大同メタル工業	2,400	779.00	1,869,600	
プレス工業	9,300	391.00	3,636,300	
カルソニックカンセイ	13,000	814.00	10,582,000	
太平洋工業	3,900	1,001.00	3,903,900	
ケーヒン	4,100	1,585.00	6,498,500	
河西工業	2,100	1,235.00	2,593,500	
アイシン精機	17,600	4,480.00	78,848,000	
マツダ	55,300	1,614.50	89,281,850	
ダイハツ工業	20,800	1,586.00	32,988,800	
今仙電機製作所	1,600	1,016.00	1,625,600	
本田技研工業	157,100	2,925.00	459,517,500	
スズキ	36,500	2,809.50	102,546,750	
富士重工業	55,200	3,693.00	203,853,600	
ヤマハ発動機	24,700	1,783.00	44,040,100	
ショーワ	4,500	926.00	4,167,000	
小糸製作所	10,500	4,930.00	51,765,000	
T B K	2,700	369.00	996,300	
エクセディ	2,400	2,272.00	5,452,800	
ミツバ	3,000	1,497.00	4,491,000	
豊田合成	6,300	2,235.00	14,080,500	
愛三工業	3,100	887.00	2,749,700	
ヨロズ	1,600	2,172.00	3,475,200	
エフ・シー・シー	2,900	1,860.00	5,394,000	
新家工業	7,000	132.00	924,000	
シマノ	7,000	18,470.00	129,290,000	
タカタ	3,200	507.00	1,622,400	

テイ・エス テック	4,100	2,553.00	10,467,300
ジャムコ	800	2,489.00	1,991,200
小野建	1,500	961.00	1,441,500
はるやま商事	1,300	754.00	980,200
佐鳥電機	1,400	689.00	964,600
カッパ・クリエイト	2,400	1,126.00	2,702,400
エコートレーディング	1,600	605.00	968,000
伯東	1,300	931.00	1,210,300
コンドーテック	1,400	765.00	1,071,000
ライトオン	1,300	1,458.00	1,895,400
ナガイレーベン	2,500	1,993.00	4,982,500
三菱食品	1,900	2,968.00	5,639,200
良品計画	2,000	23,850.00	47,700,000
三城ホールディングス	2,200	445.00	979,000
松田産業	1,300	1,220.00	1,586,000
第一興商	3,000	4,650.00	13,950,000
メディパルホールディングス	17,200	1,739.00	29,910,800
アドヴァン	1,800	1,048.00	1,886,400
アズワン	1,300	3,925.00	5,102,500
尾家産業	1,200	846.00	1,015,200
シモジマ	1,200	1,081.00	1,297,200
ドウシシャ	2,000	2,142.00	4,284,000
小津産業	500	2,158.00	1,079,000
コナカ	2,000	533.00	1,066,000
高速	1,100	856.00	941,600
ハウス オブ ローゼ	700	1,460.00	1,022,000
イオン北海道	1,900	518.00	984,200
コジマ	4,300	228.00	980,400
ヒマラヤ	1,000	1,006.00	1,006,000
コーナン商事	2,400	1,547.00	3,712,800
黒田電気	3,200	1,623.00	5,193,600
ネットワンシステムズ	7,500	588.00	4,410,000
エコス	800	1,180.00	944,000
ワタミ	2,000	1,076.00	2,152,000
マルシェ	1,200	836.00	1,003,200
ドンキホーテホールディングス	11,100	3,705.00	41,125,500
丸文	1,500	705.00	1,057,500
西松屋チェーン	3,400	972.00	3,304,800
ゼンショーホールディングス	8,900	1,393.00	12,397,700
ハピネット	1,600	931.00	1,489,600
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,563.00	1,719,300

橋本総業	600	1,515.00	909,000
サイゼリヤ	2,800	2,299.00	6,437,200
エクセル	800	1,294.00	1,035,200
V Tホールディングス	5,800	569.00	3,300,200
マルカキカイ	700	1,386.00	970,200
アルゴグラフィックス	800	1,686.00	1,348,800
ガリバーインターナショナル	4,600	1,116.00	5,133,600
ユナイテッドアローズ	2,500	5,080.00	12,700,000
進和	1,000	1,408.00	1,408,000
エスケイジャパン	2,200	451.00	992,200
ハイデイ日高	1,300	3,495.00	4,543,500
シークス	1,100	2,833.00	3,116,300
京都きもの友禅	1,200	842.00	1,010,400
コロワイド	5,700	1,730.00	9,861,000
ピーシーデポコーポレーション	1,400	1,028.00	1,439,200
田中商事	1,600	620.00	992,000
オーハシテクニカ	1,000	1,258.00	1,258,000
壱番屋	800	5,920.00	4,736,000
白銅	1,000	1,012.00	1,012,000
トップカルチャー	2,100	457.00	959,700
P L A N T	800	1,163.00	930,400
スギホールディングス	3,100	5,430.00	16,833,000
島津製作所	22,000	1,787.00	39,314,000
モリテックス	3,300	289.00	953,700
長野計器	1,600	598.00	956,800
ブイ・テクノロジー	400	3,675.00	1,470,000
スター精密	3,300	1,273.00	4,200,900
東京計器	6,000	154.00	924,000
オーバル	4,600	215.00	989,000
東京精密	3,400	2,141.00	7,279,400
マニー	1,600	1,662.00	2,659,200
ニコン	32,600	1,692.00	55,159,200
トプコン	5,900	1,185.00	6,991,500
オリンパス	26,000	4,100.00	106,600,000
理研計器	1,400	1,044.00	1,461,600
S C R E E Nホールディングス	18,000	812.00	14,616,000
キヤノン電子	1,600	1,643.00	2,628,800
タムロン	1,400	1,718.00	2,405,200
H O Y A	40,600	4,150.00	168,490,000
ノーリツ鋼機	1,200	418.00	501,600
エー・アンド・デイ	2,500	378.00	945,000

キヤノン	94,000	3,311.00	311,234,000
リコー	56,500	1,134.00	64,071,000
シチズンホールディングス	21,500	626.00	13,459,000
リズム時計工業	8,000	142.00	1,136,000
大研医器	1,400	900.00	1,260,000
メニコン	900	3,060.00	2,754,000
スノーピーク	300	3,455.00	1,036,500
パラマウントベッドホールディングス	1,800	3,745.00	6,741,000
S H O B I	2,600	395.00	1,027,000
ニホンフラッシュ	1,000	980.00	980,000
前田工織	1,900	982.00	1,865,800
アートネイチャー	1,400	960.00	1,344,000
ダンロップスポーツ	1,100	934.00	1,027,400
バンダイナムコホールディングス	18,100	2,345.00	42,444,500
共立印刷	3,400	282.00	958,800
S H O E I	800	1,820.00	1,456,000
フランスベッドホールディングス	2,400	964.00	2,313,600
マーベラス	2,900	821.00	2,380,900
パイロットコーポレーション	3,000	3,965.00	11,895,000
萩原工業	500	1,976.00	988,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,200	1,302.00	4,166,400
トッパン・フォームズ	3,100	1,325.00	4,107,500
フジシールインターナショナル	2,100	3,650.00	7,665,000
タカラトミー	5,700	843.00	4,805,100
廣済堂	3,100	308.00	954,800
レック	800	1,258.00	1,006,400
プロネクサス	1,600	1,112.00	1,779,200
ホクシン	9,000	108.00	972,000
ウッドワン	4,000	242.00	968,000
大建工業	7,000	239.00	1,673,000
きもと	5,800	167.00	968,600
凸版印刷	49,000	972.00	47,628,000
大日本印刷	52,000	990.00	51,480,000
図書印刷	3,000	461.00	1,383,000
共同印刷	6,000	338.00	2,028,000
日本写真印刷	2,900	1,736.00	5,034,400
光村印刷	5,000	205.00	1,025,000
藤森工業	1,600	2,443.00	3,908,800
宝印刷	800	1,259.00	1,007,200
前澤化成工業	1,300	975.00	1,267,500

アシックス	16,300	2,032.00	33,121,600	
ツツミ	900	2,449.00	2,204,100	
J S P	1,200	2,239.00	2,686,800	
ニチハ	2,400	1,529.00	3,669,600	
エフピコ	1,600	4,400.00	7,040,000	
小松ウオール工業	600	1,667.00	1,000,200	
ヤマハ	12,800	3,180.00	40,704,000	
河合楽器製作所	600	1,897.00	1,138,200	
クリナップ	2,000	723.00	1,446,000	
ビジョン	9,900	2,637.00	26,106,300	
天馬	1,400	1,907.00	2,669,800	
キングジム	1,500	736.00	1,104,000	
リンテック	4,200	2,125.00	8,925,000	
信越ポリマー	3,600	581.00	2,091,600	
東リ	5,000	291.00	1,455,000	
イトーキ	3,700	697.00	2,578,900	
任天堂	10,800	16,495.00	178,146,000	
三菱鉛筆	1,300	4,360.00	5,668,000	
松風	900	1,310.00	1,179,000	
タカラスタンダード	7,000	968.00	6,776,000	
コクヨ	9,100	1,107.00	10,073,700	
ニフコ	3,500	5,060.00	17,710,000	
グローブライド	800	1,423.00	1,138,400	
岡村製作所	6,100	993.00	6,057,300	
日本バルカー工業	7,000	276.00	1,932,000	
伊藤忠商事	135,200	1,378.50	186,373,200	
丸紅	169,600	584.40	99,114,240	
スクロール	2,600	404.00	1,050,400	
ヨンドシーホールディングス	1,300	2,437.00	3,168,100	
三陽商会	10,000	257.00	2,570,000	
長瀬産業	10,400	1,170.00	12,168,000	
蝶理	1,100	1,428.00	1,570,800	
豊田通商	19,200	2,330.00	44,736,000	
オンワードホールディングス	12,000	705.00	8,460,000	
三共生興	2,600	389.00	1,011,400	
兼松	37,000	151.00	5,587,000	
美津濃	9,000	503.00	4,527,000	
ツカモトコーポレーション	9,000	105.00	945,000	
ファミリーマート	5,300	5,560.00	29,468,000	
三井物産	155,800	1,313.00	204,565,400	
日本紙パルプ商事	9,000	316.00	2,844,000	

東京エレクトロン	15,700	7,053.00	110,732,100	
日立ハイテクノロジーズ	6,000	3,030.00	18,180,000	
カメイ	2,200	983.00	2,162,600	
東都水産	6,000	173.00	1,038,000	
スターゼン	600	3,145.00	1,887,000	
セイコーホールディングス	11,000	398.00	4,378,000	
山善	6,600	907.00	5,986,200	
椿本興業	3,000	286.00	858,000	
住友商事	108,500	1,136.50	123,310,250	
日本ユニシス	4,800	1,395.00	6,696,000	
内田洋行	4,000	390.00	1,560,000	
三菱商事	129,300	1,872.00	242,049,600	
第一実業	4,000	456.00	1,824,000	
キヤノンマーケティングジャパン	4,900	1,946.00	9,535,400	
西華産業	6,000	217.00	1,302,000	
佐藤商事	1,500	622.00	933,000	
菱洋エレクトロ	2,000	1,095.00	2,190,000	
東京産業	2,500	393.00	982,500	
ユアサ商事	1,600	2,442.00	3,907,200	
神鋼商事	5,000	198.00	990,000	
小林産業	5,000	193.00	965,000	
阪和興業	17,000	435.00	7,395,000	
カナデン	1,600	811.00	1,297,600	
菱電商事	3,000	624.00	1,872,000	
ニプロ	13,000	1,075.00	13,975,000	
フルサト工業	900	1,563.00	1,406,700	
岩谷産業	20,000	609.00	12,180,000	
すてきナイスグループ	7,000	132.00	924,000	
昭光通商	13,000	75.00	975,000	
イワキ	5,000	185.00	925,000	
兼松エレクトロニクス	1,100	1,834.00	2,017,400	
三愛石油	4,000	869.00	3,476,000	
稲畑産業	4,100	1,194.00	4,895,400	
ゴールドウイン	800	4,570.00	3,656,000	
ユニ・チャーム	37,000	2,415.00	89,355,000	
デサント	4,200	1,713.00	7,194,600	
キング	2,400	383.00	919,200	
ワキタ	3,700	825.00	3,052,500	
ヤマトインターナショナル	2,600	380.00	988,000	
東邦ホールディングス	5,500	2,327.00	12,798,500	
サンゲツ	6,200	1,950.00	12,090,000	

ミツウロコグループホールディングス	2,800	557.00	1,559,600	
シナネンホールディングス	4,000	440.00	1,760,000	
伊藤忠エネクス	4,400	817.00	3,594,800	
サンリオ	5,300	2,100.00	11,130,000	
サンワテクノス	1,500	676.00	1,014,000	
リョーサン	2,700	2,821.00	7,616,700	
新光商事	2,000	1,030.00	2,060,000	
トーヨー	800	2,212.00	1,769,600	
三信電気	2,400	837.00	2,008,800	
東陽テクニカ	2,500	1,086.00	2,715,000	
モスフードサービス	2,300	3,105.00	7,141,500	
加賀電子	1,600	1,291.00	2,065,600	
三益半導体工業	1,300	1,026.00	1,333,800	
ソーダニッカ	2,200	450.00	990,000	
立花エレテック	1,300	1,091.00	1,418,300	
木曽路	2,100	2,229.00	4,680,900	
サトレストランシステムズ	2,000	780.00	1,560,000	
千趣会	3,400	705.00	2,397,000	
ケーヨー	2,900	503.00	1,458,700	
アデランス	3,000	565.00	1,695,000	
上新電機	4,000	853.00	3,412,000	
日本瓦斯	2,000	2,080.00	4,160,000	
ベスト電器	8,300	120.00	996,000	
ロイヤルホールディングス	2,900	2,017.00	5,849,300	
東天紅	7,000	130.00	910,000	
いなげや	1,900	1,230.00	2,337,000	
島忠	4,500	2,469.00	11,110,500	
チヨダ	2,000	2,816.00	5,632,000	
ライフコーポレーション	1,100	2,336.00	2,569,600	
リンガーハット	1,600	2,411.00	3,857,600	
MR MAX	3,500	285.00	997,500	
テンアライド	2,700	363.00	980,100	
AOKIホールディングス	3,900	1,238.00	4,828,200	
オークワ	3,000	1,005.00	3,015,000	
コメリ	2,700	2,173.00	5,867,100	
青山商事	3,300	4,175.00	13,777,500	
しまむら	2,000	12,060.00	24,120,000	
高島屋	25,000	920.00	23,000,000	
松屋	3,500	850.00	2,975,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,800	1,850.00	16,280,000	
近鉄百貨店	7,000	306.00	2,142,000	

ニッセンホールディングス	6,600	146.00	963,600	
バルコ	1,700	866.00	1,472,200	
丸井グループ	21,100	1,500.00	31,650,000	
クレディセゾン	13,100	1,854.00	24,287,400	
アクシアル リテイリング	1,300	3,370.00	4,381,000	
イオン	70,900	1,425.50	101,067,950	
ユニーグループ・ホールディングス	16,500	749.00	12,358,500	
イズミ	3,400	4,325.00	14,705,000	
平和堂	3,500	2,095.00	7,332,500	
フジ	1,900	2,056.00	3,906,400	
ヤオコー	2,000	4,125.00	8,250,000	
ゼビオホールディングス	2,300	1,754.00	4,034,200	
ケーズホールディングス	3,600	3,480.00	12,528,000	
PALTA C	2,800	1,739.00	4,869,200	
三谷産業	3,200	310.00	992,000	
Olympicグループ	1,700	567.00	963,900	
新生銀行	149,000	141.00	21,009,000	
あおぞら銀行	109,000	357.00	38,913,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,382,600	477.30	659,914,980	
りそなホールディングス	201,600	389.60	78,543,360	
三井住友トラスト・ホールディングス	360,000	324.50	116,820,000	
三井住友フィナンシャルグループ	138,000	3,026.00	417,588,000	
第四銀行	22,000	368.00	8,096,000	
北越銀行	19,000	182.00	3,458,000	
西日本シティ銀行	56,000	200.00	11,200,000	
千葉銀行	66,000	538.00	35,508,000	
横浜銀行	116,000	504.20	58,487,200	
常陽銀行	62,000	385.00	23,870,000	
群馬銀行	38,000	487.00	18,506,000	
武蔵野銀行	2,700	2,894.00	7,813,800	
千葉興業銀行	4,700	447.00	2,100,900	
筑波銀行	7,200	279.00	2,008,800	
七十七銀行	27,000	402.00	10,854,000	
青森銀行	13,000	295.00	3,835,000	
秋田銀行	11,000	268.00	2,948,000	
山形銀行	10,000	377.00	3,770,000	
岩手銀行	1,200	3,705.00	4,446,000	
東邦銀行	15,000	323.00	4,845,000	
東北銀行	9,000	140.00	1,260,000	
みちのく銀行	9,000	166.00	1,494,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	75,000	352.00	26,400,000	

静岡銀行	51,000	822.00	41,922,000	
十六銀行	22,000	361.00	7,942,000	
スルガ銀行	16,400	1,820.00	29,848,000	
八十二銀行	31,000	504.00	15,624,000	
山梨中央銀行	11,000	392.00	4,312,000	
大垣共立銀行	23,000	343.00	7,889,000	
福井銀行	15,000	186.00	2,790,000	
北國銀行	19,000	277.00	5,263,000	
清水銀行	600	2,108.00	1,264,800	
富山銀行	300	2,703.00	810,900	
滋賀銀行	16,000	448.00	7,168,000	
南都銀行	17,000	301.00	5,117,000	
百五銀行	15,000	393.00	5,895,000	
京都銀行	33,000	727.00	23,991,000	
紀陽銀行	6,800	1,184.00	8,051,200	
三重銀行	8,000	191.00	1,528,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	117,000	167.00	19,539,000	
広島銀行	51,000	410.00	20,910,000	
山陰合同銀行	10,400	652.00	6,780,800	
中国銀行	12,200	1,176.00	14,347,200	
鳥取銀行	6,000	159.00	954,000	
伊予銀行	18,400	772.00	14,204,800	
百十四銀行	19,000	316.00	6,004,000	
四国銀行	13,000	207.00	2,691,000	
阿波銀行	14,000	502.00	7,028,000	
大分銀行	10,000	339.00	3,390,000	
宮崎銀行	11,000	260.00	2,860,000	
佐賀銀行	10,000	200.00	2,000,000	
十八銀行	11,000	230.00	2,530,000	
沖縄銀行	1,400	3,455.00	4,837,000	
琉球銀行	3,500	1,133.00	3,965,500	
セブン銀行	64,600	483.00	31,201,800	
みずほフィナンシャルグループ	2,427,600	166.30	403,709,880	
山口フィナンシャルグループ	16,000	1,050.00	16,800,000	
芙蓉総合リース	2,000	4,605.00	9,210,000	
興銀リース	3,200	1,885.00	6,032,000	
東京センチュリーリース	4,000	3,740.00	14,960,000	
SBIホールディングス	20,700	1,016.00	21,031,200	
日本証券金融	7,600	479.00	3,640,400	
アイフル	28,800	294.00	8,467,200	
ポケットカード	2,200	440.00	968,000	

長野銀行	6,000	176.00	1,056,000
名古屋銀行	14,000	356.00	4,984,000
北洋銀行	26,000	276.00	7,176,000
愛知銀行	600	4,375.00	2,625,000
第三銀行	10,000	140.00	1,400,000
中京銀行	7,000	192.00	1,344,000
東日本銀行	8,000	271.00	2,168,000
大光銀行	6,000	190.00	1,140,000
愛媛銀行	10,000	208.00	2,080,000
トマト銀行	7,000	146.00	1,022,000
みなと銀行	16,000	152.00	2,432,000
京葉銀行	14,000	420.00	5,880,000
関西アーバン銀行	2,400	1,045.00	2,508,000
栃木銀行	9,000	418.00	3,762,000
北日本銀行	500	2,609.00	1,304,500
東和銀行	24,000	81.00	1,944,000
福島銀行	21,000	71.00	1,491,000
大東銀行	10,000	177.00	1,770,000
リコーリース	1,400	3,170.00	4,438,000
イオンフィナンシャルサービス	11,300	2,500.00	28,250,000
アコム	34,600	468.00	16,192,800
ジャックス	10,000	375.00	3,750,000
オリエントコーポレーション	74,500	191.00	14,229,500
日立キャピタル	4,100	2,371.00	9,721,100
アプラスフィナンシャル	11,000	87.00	957,000
オリックス	122,000	1,429.50	174,399,000
三菱UFJリース	43,700	481.00	21,019,700
ジャフコ	2,900	3,175.00	9,207,500
トモニホールディングス	13,200	331.00	4,369,200
大和証券グループ本社	161,000	671.80	108,159,800
野村ホールディングス	331,600	494.10	163,843,560
岡三証券グループ	15,000	532.00	7,980,000
丸三証券	5,100	1,199.00	6,114,900
東洋証券	7,000	289.00	2,023,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,800	523.00	10,355,400
光世証券	4,000	138.00	552,000
水戸証券	5,300	323.00	1,711,900
いちよし証券	3,900	1,078.00	4,204,200
松井証券	8,800	963.00	8,474,400

損保ジャパン日本興亜ホールディングス	38,300	3,075.00	117,772,500
日本取引所グループ	50,600	1,729.00	87,487,400
マネックスグループ	20,300	283.00	5,744,900
カブドットコム証券	15,300	330.00	5,049,000
極東証券	2,300	1,327.00	3,052,100
岩井コスモホールディングス	1,600	1,055.00	1,688,000
藍澤證券	2,400	564.00	1,353,600
フィデアホールディングス	10,600	172.00	1,823,200
池田泉州ホールディングス	18,300	387.00	7,082,100
アニコムホールディングス	1,100	2,493.00	2,742,300
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	51,500	2,972.00	153,058,000
マネースクウェアHD	1,000	995.00	995,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	16,500	1,552.00	25,608,000
マネーパートナーズグループ	3,200	308.00	985,600
第一生命保険	110,400	1,306.00	144,182,400
東京海上ホールディングス	69,800	3,791.00	264,611,800
イー・ギャランティ	600	2,161.00	1,296,600
NECキャピタルソリューション	700	1,547.00	1,082,900
T & Dホールディングス	62,800	1,116.50	70,116,200
三井不動産	91,000	2,652.00	241,332,000
三菱地所	128,000	2,144.50	274,496,000
平和不動産	3,300	1,184.00	3,907,200
東京建物	18,900	1,327.00	25,080,300
ダイビル	4,400	931.00	4,096,400
京阪神ビルディング	2,900	571.00	1,655,900
住友不動産	41,000	3,085.00	126,485,000
大京	33,000	182.00	6,006,000
テーオーシー	6,700	901.00	6,036,700
東京楽天地	3,000	473.00	1,419,000
レオバレス21	20,300	668.00	13,560,400
スターツコーポレーション	2,000	2,307.00	4,614,000
フジ住宅	2,200	678.00	1,491,600
空港施設	2,100	499.00	1,047,900
明和地所	1,500	644.00	966,000
住友不動産販売	1,300	2,135.00	2,775,500
ゴールドクレスト	1,400	1,616.00	2,262,400
リロ・ホールディング	700	12,850.00	8,995,000
日本エスリード	900	1,037.00	933,300
日神不動産	2,700	359.00	969,300

タカラレーベン	7,600	595.00	4,522,000
サンヨーハウジング名古屋	1,000	1,015.00	1,015,000
イオンモール	11,200	1,589.00	17,796,800
ファースト住建	800	1,285.00	1,028,000
東祥	500	3,945.00	1,972,500
トーセイ	2,600	650.00	1,690,000
穴吹興産	4,000	246.00	984,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,800	1,096.00	11,836,800
サンフロンティア不動産	2,100	1,005.00	2,110,500
エフ・ジェー・ネクスト	2,000	497.00	994,000
ランドビジネス	3,500	286.00	1,001,000
グランディハウス	2,600	364.00	946,400
東武鉄道	93,000	600.00	55,800,000
相鉄ホールディングス	30,000	701.00	21,030,000
東京急行電鉄	102,000	954.00	97,308,000
京浜急行電鉄	48,000	1,015.00	48,720,000
小田急電鉄	56,000	1,369.00	76,664,000
京王電鉄	49,000	1,077.00	52,773,000
京成電鉄	26,000	1,653.00	42,978,000
富士急行	5,000	1,233.00	6,165,000
新京成電鉄	2,000	419.00	838,000
東日本旅客鉄道	31,900	9,953.00	317,500,700
西日本旅客鉄道	16,800	6,814.00	114,475,200
東海旅客鉄道	15,600	20,755.00	323,778,000
西武ホールディングス	13,900	2,355.00	32,734,500
鴻池運輸	2,500	1,274.00	3,185,000
西日本鉄道	23,000	838.00	19,274,000
ハマキョウレックス	1,300	1,828.00	2,376,400
サカイ引越センター	700	2,673.00	1,871,100
近鉄グループホールディングス	176,000	490.00	86,240,000
阪急阪神ホールディングス	117,000	722.00	84,474,000
南海電気鉄道	39,000	672.00	26,208,000
京阪電気鉄道	39,000	789.00	30,771,000
神戸電鉄	4,000	355.00	1,420,000
名古屋鉄道	64,000	554.00	35,456,000
山陽電気鉄道	6,000	455.00	2,730,000
トランコム	500	6,340.00	3,170,000
日本通運	68,000	516.00	35,088,000
ヤマトホールディングス	32,300	2,366.50	76,437,950
山九	23,000	528.00	12,144,000
日新	7,000	275.00	1,925,000

丸全昭和運輸	6,000	399.00	2,394,000
センコー	8,000	711.00	5,688,000
トナミホールディングス	4,000	258.00	1,032,000
ニッコンホールディングス	5,700	1,959.00	11,166,300
日本石油輸送	4,000	240.00	960,000
福山通運	11,000	534.00	5,874,000
セイノーホールディングス	12,400	1,198.00	14,855,200
神奈川中央交通	2,000	685.00	1,370,000
日立物流	3,600	1,731.00	6,231,600
C & F ロジホールディングス	1,700	848.00	1,441,600
日本郵船	157,000	213.00	33,441,000
商船三井	86,000	209.00	17,974,000
川崎汽船	77,000	189.00	14,553,000
N S ユナイテッド海運	8,000	152.00	1,216,000
飯野海運	9,100	430.00	3,913,000
日本航空	33,400	4,192.00	140,012,800
A N A ホールディングス	324,000	325.90	105,591,600
バスコ	2,000	411.00	822,000
三菱倉庫	12,000	1,493.00	17,916,000
三井倉庫ホールディングス	10,000	273.00	2,730,000
住友倉庫	13,000	550.00	7,150,000
澁澤倉庫	5,000	276.00	1,380,000
ヤマタネ	8,000	160.00	1,280,000
乾汽船	1,400	768.00	1,075,200
日本トランスシティ	4,000	353.00	1,412,000
ケイヒン	7,000	145.00	1,015,000
中央倉庫	1,100	912.00	1,003,200
安田倉庫	1,400	697.00	975,800
東洋埠頭	7,000	144.00	1,008,000
宇徳	3,000	313.00	939,000
上組	21,000	1,050.00	22,050,000
キューソー流通システム	500	2,074.00	1,037,000
郵船ロジスティクス	1,600	1,204.00	1,926,400
近鉄エクスプレス	3,100	1,494.00	4,631,400
エーアイティー	1,000	1,014.00	1,014,000
内外トランスライン	700	897.00	627,900
東京放送ホールディングス	10,300	1,762.00	18,148,600
日本テレビホールディングス	15,700	1,976.00	31,023,200
朝日放送	1,700	684.00	1,162,800
テレビ朝日ホールディングス	4,700	2,024.00	9,512,800
スカパー J S A T ホールディングス	13,100	683.00	8,947,300

テレビ東京ホールディングス	1,600	1,847.00	2,955,200
コネクシオ	1,500	1,077.00	1,615,500
日本通信	9,100	171.00	1,556,100
日本電信電話	133,200	4,812.00	640,958,400
KDDI	175,100	3,013.00	527,576,300
光通信	2,100	7,780.00	16,338,000
NTTドコモ	132,900	2,642.00	351,121,800
エムティーアイ	2,200	735.00	1,617,000
GMOインターネット	6,400	1,218.00	7,795,200
カドカワ	5,400	1,812.00	9,784,800
学研ホールディングス	6,000	237.00	1,422,000
ゼンリン	2,300	1,852.00	4,259,600
昭文社	1,600	626.00	1,001,600
インプレスホールディングス	7,800	125.00	975,000
東京電力	148,100	560.00	82,936,000
中部電力	53,400	1,428.50	76,281,900
関西電力	71,200	1,236.00	88,003,200
中国電力	24,100	1,518.00	36,583,800
北陸電力	17,100	1,640.00	28,044,000
東北電力	43,600	1,458.00	63,568,800
四国電力	15,700	1,625.00	25,512,500
九州電力	38,600	1,086.00	41,919,600
北海道電力	16,300	967.00	15,762,100
沖縄電力	1,900	2,781.00	5,283,900
電源開発	14,900	3,450.00	51,405,000
イーレックス	300	1,664.00	499,200
東京瓦斯	195,000	540.90	105,475,500
大阪瓦斯	181,000	441.60	79,929,600
東邦瓦斯	44,000	795.00	34,980,000
北海道瓦斯	4,000	274.00	1,096,000
広島ガス	3,000	405.00	1,215,000
西部瓦斯	20,000	254.00	5,080,000
静岡ガス	5,000	724.00	3,620,000
メタウォーター	1,100	2,384.00	2,622,400
アイネット	1,000	1,090.00	1,090,000
松竹	11,000	1,020.00	11,220,000
東宝	12,300	2,816.00	34,636,800
エイチ・アイ・エス	3,000	3,260.00	9,780,000
東映	6,000	879.00	5,274,000
AOI Pro.	1,000	1,004.00	1,004,000
エヌ・ティ・ティ・データ	10,600	5,620.00	59,572,000

共立メンテナンス	1,400	8,500.00	11,900,000
イチネンホールディングス	1,900	905.00	1,719,500
建設技術研究所	1,100	914.00	1,005,400
スペース	1,000	1,239.00	1,239,000
アインホールディングス	2,100	4,945.00	10,384,500
東京テアトル	8,000	117.00	936,000
ナガワ	300	2,730.00	819,000
よみうりランド	4,000	419.00	1,676,000
東京都競馬	12,000	212.00	2,544,000
常磐興産	7,000	149.00	1,043,000
カナモト	2,500	2,479.00	6,197,500
東京ドーム	15,000	521.00	7,815,000
D T S	1,900	2,089.00	3,969,100
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,300	2,920.00	21,316,000
シーイーシー	1,100	1,093.00	1,202,300
カプコン	4,400	2,404.00	10,577,600
西尾レントオール	1,500	2,598.00	3,897,000
日本空港ビルデング	5,500	4,010.00	22,055,000
トランス・コスモス	2,100	2,419.00	5,079,900
乃村工藝社	3,900	1,433.00	5,588,700
ジャステック	1,100	914.00	1,005,400
S C S K	4,100	4,380.00	17,958,000
藤田観光	7,000	552.00	3,864,000
K N T - C Tホールディングス	9,000	170.00	1,530,000
日本管財	1,600	1,756.00	2,809,600
トーカイ	800	3,070.00	2,456,000
セコム	19,000	8,120.00	154,280,000
セントラル警備保障	800	2,114.00	1,691,200
アイネス	2,400	1,089.00	2,613,600
丹青社	3,400	670.00	2,278,000
メイテック	2,300	3,980.00	9,154,000
T K C	1,600	3,145.00	5,032,000
アサツー ディ・ケイ	3,200	2,859.00	9,148,800
富士ソフト	2,600	2,335.00	6,071,000
応用地質	1,900	1,224.00	2,325,600
船井総研ホールディングス	2,500	1,399.00	3,497,500
N S D	3,700	1,658.00	6,134,600
進学会	1,600	622.00	995,200
コナミホールディングス	7,800	2,844.00	22,183,200
ベネッセホールディングス	6,100	3,535.00	21,563,500

イオンディライト	1,800	3,635.00	6,543,000
ナック	1,200	834.00	1,000,800
福井コンピュータホールディングス	1,000	1,008.00	1,008,000
ニチイ学館	3,200	789.00	2,524,800
ダイセキ	3,400	1,757.00	5,973,800
日鉄住金物産	11,000	336.00	3,696,000
元気寿司	500	2,143.00	1,071,500
トラスコ中山	2,000	3,910.00	7,820,000
ヤマダ電機	52,400	518.00	27,143,200
オートバックスセブン	6,600	1,945.00	12,837,000
アークランドサカモト	2,900	1,035.00	3,001,500
ニトリホールディングス	7,400	8,420.00	62,308,000
グルメ杵屋	1,000	996.00	996,000
愛眼	4,700	209.00	982,300
吉野家ホールディングス	6,400	1,429.00	9,145,600
加藤産業	2,700	2,722.00	7,349,400
イノテック	2,200	440.00	968,000
イエローハット	1,600	1,900.00	3,040,000
松屋フーズ	800	2,812.00	2,249,600
J B C Cホールディングス	1,500	636.00	954,000
J Kホールディングス	2,100	456.00	957,600
サガミチェーン	2,300	1,216.00	2,796,800
日伝	700	2,817.00	1,971,900
関西スーパーマーケット	1,400	773.00	1,082,200
ミロク情報サービス	1,300	917.00	1,192,100
北沢産業	6,100	162.00	988,200
杉本商事	1,000	1,260.00	1,260,000
因幡電機産業	2,400	3,445.00	8,268,000
王将フードサービス	1,300	3,910.00	5,083,000
ブレナス	1,900	1,953.00	3,710,700
ミニストップ	1,300	2,039.00	2,650,700
アークス	3,200	2,299.00	7,356,800
パローホールディングス	3,700	2,417.00	8,942,900
パイテックホールディングス	1,000	950.00	950,000
ミスミグループ本社	19,300	1,545.00	29,818,500
藤久	600	1,713.00	1,027,800
ベルク	800	3,815.00	3,052,000
大 庄	800	1,432.00	1,145,600
タキヒヨー	3,000	460.00	1,380,000
ファーストリテイリング	3,500	31,760.00	111,160,000
ソフトバンクグループ	97,600	5,095.00	497,272,000

スズケン	7,800	3,715.00	28,977,000	
サンドラッグ	3,600	7,560.00	27,216,000	
サックスパー ホールディングス	1,600	1,498.00	2,396,800	
ジェコス	1,200	895.00	1,074,000	
やまや	100	1,870.00	187,000	
ルネサスイーストン	2,400	410.00	984,000	
ペルーナ	4,300	504.00	2,167,200	
合計	28,896,700		33,569,060,310	

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27年2月23日現在)	(平成28年2月22日現在)
資産の部		

流動資産		
金銭信託	-	204,100,084
コール・ローン	434,098,018	17,057,893
国債証券	34,671,814,060	25,067,271,251
未収利息	138,868,282	100,638,043
前払費用	32,726,929	13,638,500
流動資産合計	35,277,507,289	25,402,705,771
資産合計	35,277,507,289	25,402,705,771
負債の部		
流動負債		
未払金	214,748,110	-
未払解約金	27,387,268	82,121,608
流動負債合計	242,135,378	82,121,608
負債合計	242,135,378	82,121,608
純資産の部		
元本等		
元本	27,287,875,419	18,912,024,491
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,747,496,492	6,408,559,672
純資産合計	35,035,371,911	25,320,584,163
負債純資産合計	35,277,507,289	25,402,705,771

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27年2月23日現在）	（平成28年2月22日現在）
1. 受益権総口数	27,287,875,419口	18,912,024,491口
2. 1口当たり純資産額	1.2839円	1.3389円
（1万口当たり純資産額）	（12,839円）	（13,389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26年2月22日 至 平成27年2月23日)	(自 平成27年2月24日 至 平成28年2月22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27年2月23日現在)	(平成28年2月22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27年2月23日現在	平成28年2月22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	28,318,600	750,573,100
合計	28,318,600	750,573,100

（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27年2月23日現在）	（平成28年2月22日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	19,350,145,636円	27,287,875,419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	13,436,290,863円	11,130,629,869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	5,498,561,080円	19,506,480,797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）	1,286,251,124円	1,340,785,796円
DCニッセイ国内債券インデックス	5,876,510,249円	6,601,563,989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）	66,792,545円	27,138,778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）	5,574,538円	4,144,471円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,385,652,813円	1,287,567,160円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,114,021,918円	2,757,297,518円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	896,911,957円	759,246,193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）	425,133,248円	301,966,720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）	1,138,024,614円	761,580,628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）	489,093,987円	291,676,172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）	12,289,416,267円	2,402,078,684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	314,492,159円	2,216,221,801円

ニッセイターゲットデートファンドI(適格機関投資家限定)	- 円	56,775円
ニッセイターゲットデートファンド(適格機関投資家限定)	- 円	56,760円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	- 円	160,643,046円
計	27,287,875,419円	18,912,024,491円

附属明細表(平成28年2月22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348回 利付国債(2年)	915,000,000	916,031,471	
	第103回 利付国債(5年)	1,056,000,000	1,061,575,680	
	第113回 利付国債(5年)	4,000,000	4,048,920	
	第115回 利付国債(5年)	721,000,000	728,822,850	
	第116回 利付国債(5年)	1,188,000,000	1,202,149,080	
	第117回 利付国債(5年)	1,167,000,000	1,182,124,320	
	第4回 利付国債(40年)	399,000,000	527,410,170	
	第285回 利付国債(10年)	4,000,000	4,080,720	
	第291回 利付国債(10年)	432,000,000	445,625,280	
	第292回 利付国債(10年)	847,000,000	880,744,480	
	第303回 利付国債(10年)	1,748,000,000	1,849,209,200	
	第306回 利付国債(10年)	1,080,000,000	1,150,826,400	
	第313回 利付国債(10年)	355,000,000	381,859,300	
	第318回 利付国債(10年)	852,000,000	908,308,680	
	第325回 利付国債(10年)	758,000,000	806,845,520	
	第327回 利付国債(10年)	939,000,000	1,001,490,450	
	第328回 利付国債(10年)	1,270,000,000	1,338,973,700	
	第329回 利付国債(10年)	153,000,000	163,754,370	
	第26回 利付国債(30年)	1,547,000,000	2,035,403,370	
	第28回 利付国債(30年)	821,000,000	1,100,304,200	
	第69回 利付国債(20年)	2,000,000	2,359,680	
	第72回 利付国債(20年)	593,000,000	704,549,230	
	第86回 利付国債(20年)	277,000,000	340,956,530	
第88回 利付国債(20年)	1,524,000,000	1,881,774,240		

	第117回 利付国債(20年)	753,000,000	944,849,340	
	第125回 利付国債(20年)	1,439,000,000	1,837,070,570	
	第146回 利付国債(20年)	1,390,000,000	1,666,123,500	
国債証券 合計		22,234,000,000	25,067,271,251	
合計		22,234,000,000	25,067,271,251	

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27年2月23日現在)	(平成28年2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	583,988,849	1,099,792,433
金銭信託	-	518,887,988
コール・ローン	554,662,409	43,366,643
株式	44,491,337,870	44,075,285,993
投資証券	1,066,791,659	1,155,981,691
派生商品評価勘定	99,579,141	34,132,221

未収入金	452,979	33,823,068
未収配当金	74,939,650	86,271,458
差入委託証拠金	881,662,602	719,888,452
流動資産合計	47,753,415,159	47,767,429,947
資産合計	47,753,415,159	47,767,429,947
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	17,237,978
未払解約金	159,057,357	57,093,478
流動負債合計	159,057,357	74,331,456
負債合計	159,057,357	74,331,456
純資産の部		
元本等		
元本	32,880,647,674	39,165,529,544
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,713,710,128	8,527,568,947
純資産合計	47,594,357,802	47,693,098,491
負債純資産合計	47,753,415,159	47,767,429,947

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>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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>
----------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成27年2月23日現在)	(平成28年2月22日現在)
1. 受益権総口数	32,880,647,674口	39,165,529,544口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4475円 (14,475円)	1.2177円 (12,177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26年2月22日 至平成27年2月23日)	(自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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。</p> <p>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。</p>	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27年2月23日現在）	（平成28年2月22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27年2月23日現在	平成28年2月22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	1,888,023,768	4,198,124,073

投資証券	75,759,486	42,408,248
合計	1,963,783,254	4,240,532,321

（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27年2月23日 現在）				（平成28年2月22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	-	-	-	-	262,815,612	-	262,616,440	199,172
アメリカ・ドル	-	-	-	-	175,293,322	-	175,240,520	52,802
ユーロ	-	-	-	-	87,522,290	-	87,375,920	146,370
合計	-	-	-	-	262,815,612	-	262,616,440	199,172

（注） 1．時価の算定方法

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。

株式関連

種類	（平成27年2月23日 現在）				（平成28年2月22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	1,823,055,430	-	1,922,634,570	99,579,140	2,162,458,998	-	2,179,552,412	17,093,414
合計	1,823,055,430	-	1,922,634,570	99,579,140	2,162,458,998	-	2,179,552,412	17,093,414

（注） 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として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27年2月23日現在）	（平成28年2月22日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	26,676,145,239円	32,880,647,674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	12,495,940,903円	21,097,909,350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	6,291,438,468円	14,813,027,480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）	276,307,624円	327,907,032円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,862,734,330円	2,109,450,728円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	1,609,399,772円	1,745,354,731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）	11,291,269,523円	11,023,720,087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）	12,246,157,188円	6,262,929,248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	5,594,779,237円	17,501,750,595円
DCニッセイ外国株式インデックス	- 円	21,751,286円
ニッセイターゲットデートファンドI（適格機関投資家限定）	- 円	243,270円
ニッセイターゲットデートファンド（適格機関投資家限定）	- 円	200,731円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）	- 円	172,221,836円
計	32,880,647,674円	39,165,529,544円

附属明細表（平成28年2月22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	9,377	156.45	1,467,031.65	
	ABBOTT LABORATORIES	22,315	38.53	859,796.95	
	ABBVIE INC	24,848	54.29	1,348,997.92	
	ACCENTURE PLC	9,383	98.95	928,447.85	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	7,706	30.19	232,644.14	
	ACUITY BRANDS INC	589	191.06	112,534.34	
	ADOBE SYSTEMS INC	7,489	80.87	605,635.43	
	ADT CORP/THE	2,276	40.00	91,040.00	
	ADVANCE AUTO PARTS	1,019	143.63	146,358.97	
	AERCAP HOLDINGS NV	1,191	31.70	37,754.70	
	AES CORP	9,263	9.41	87,164.83	
	AETNA INC	5,223	103.45	540,319.35	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	723	129.54	93,657.42	
	AFLAC INC	6,431	59.32	381,486.92	
	AGCO CORP	934	46.40	43,337.60	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,867	37.44	182,220.48	
	AGL RESOURCES INC	1,623	64.75	105,089.25	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,059	131.53	402,350.27	
	AIRGAS INC	908	141.23	128,236.84	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,401	53.13	127,565.13	
	ALBEMARLE CORP	1,506	54.48	82,046.88	
	ALCOA INC	18,592	7.87	146,319.04	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	3,391	145.89	494,712.99	
	ALKERMES PLC	2,074	33.57	69,624.18	
	ALLEGHANY CORP	216	466.04	100,664.64	
	ALLERGAN PLC	5,907	275.75	1,628,855.25	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	911	204.36	186,171.96	
	ALLIANT ENERGY CORP	1,584	67.12	106,318.08	
	ALLSTATE CORP	5,988	64.00	383,232.00	
	ALLY FINANCIAL INC	5,831	16.90	98,543.90	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,022	63.52	64,917.44	
	ALPHABET INC-CL A	4,353	722.11	3,143,344.83	
	ALPHABET INC-CL C	4,643	700.91	3,254,325.13	
	ALTRIA GROUP INC	29,435	60.56	1,782,583.60	
AMAZON.COM INC	5,967	534.90	3,191,748.30		
AMERCO	119	343.19	40,839.61		
AMEREN CORPORATION	3,449	45.60	157,274.40		

AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,292	39.76	91,129.92	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	7,416	61.91	459,124.56	
AMERICAN EXPRESS CO	13,513	54.71	739,296.23	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	19,385	51.53	998,909.05	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,571	65.77	169,094.67	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,662	82.69	220,120.78	
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,085	86.84	267,901.40	
AMERITRADE HOLDING CORP	3,631	27.89	101,268.59	
AMETEK INC	3,473	46.13	160,209.49	
AMGEN INC	11,374	150.12	1,707,464.88	
AMPHENOL CORP-CL A	4,660	52.10	242,786.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	7,610	35.35	269,013.50	
ANALOG DEVICES INC	4,707	52.10	245,234.70	
ANSYS INC	1,232	87.59	107,910.88	
ANTERO RESOURCES CORP	1,099	23.98	26,354.02	
ANTHEM INC	3,924	127.23	499,250.52	
AON PLC	4,198	93.58	392,848.84	
APACHE CORP	5,660	37.33	211,287.80	
APPLE INC	85,597	96.04	8,220,735.88	
APPLIED MATERIALS INC	17,980	18.38	330,472.40	
ARAMARK	3,074	30.15	92,681.10	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,668	68.63	114,474.84	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	9,111	32.65	297,474.15	
ARROW ELECTRONICS INC	1,265	56.96	72,054.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,317	39.43	91,359.31	
ASHLAND INC	870	92.70	80,649.00	
ASSURANT INC	899	70.33	63,226.67	
AT&T INC	92,488	36.57	3,382,286.16	
AUTODESK INC	3,236	49.91	161,508.76	
AUTOLIV INC	1,229	108.72	133,616.88	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	7,019	85.56	600,545.64	
AUTONATION INC	995	47.94	47,700.30	
AUTOZONE INC	467	759.91	354,877.97	
AVERY DENNISON CORP	1,261	64.59	81,447.99	
AVNET INC	1,805	41.28	74,510.40	

AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,941	24.76	48,059.16	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,363	53.97	73,561.11	
BAKER HUGHES INC	6,015	42.14	253,472.10	
BALL CORP	1,798	66.06	118,775.88	
BANK OF AMERICA CORP	156,651	12.13	1,900,176.63	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	16,587	34.93	579,383.91	
BARD (C.R.) INC	1,091	189.11	206,319.01	
BAXALTA INC -W/I	8,134	39.41	320,560.94	
BAXTER INTERNATIONAL INC	8,152	37.65	306,922.80	
BB&T CORPORATION	11,657	32.38	377,453.66	
BE AEROSPACE INC	1,438	40.94	58,871.72	
BECTON DICKINSON & CO	3,150	144.90	456,435.00	
BED BATH & BEYOND INC	2,263	46.49	105,206.87	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	17,765	131.05	2,328,103.25	
BEST BUY CO INC	4,252	29.95	127,347.40	
BIOGEN INC	3,526	261.40	921,696.40	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,358	77.70	183,216.60	
BLACKROCK INC	1,833	314.29	576,093.57	
BOEING CO	9,688	115.16	1,115,670.08	
BORGWARNER INC	3,029	32.30	97,836.70	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	20,122	17.16	345,293.52	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	25,033	63.80	1,597,105.40	
BROADCOM LTD	4,090	128.67	526,260.30	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	1,657	102.01	169,030.57	
BUNGE LIMITED	1,925	48.81	93,959.25	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,986	70.48	139,973.28	
CA Inc	4,478	30.01	134,384.78	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	2,738	32.44	88,820.72	
CABOT OIL & GAS CORP	5,595	19.91	111,396.45	
CALPINE CORP	4,648	12.21	56,752.08	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	2,720	66.33	180,417.60	
CAMPBELL SOUP CO	2,527	60.94	153,995.38	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	8,120	65.73	533,727.60	
CARDINAL HEALTH INC	4,908	80.83	396,713.64	

CARMAX INC	2,974	45.36	134,900.64
CARNIVAL CORP	6,200	46.39	287,618.00
CATERPILLAR INC	8,569	65.42	560,583.98
CBRE GROUP INC	4,009	25.06	100,465.54
CBS CORP-CL B	6,690	45.09	301,652.10
CDK GLOBAL INC	1,859	43.01	79,955.59
CDW CORP/DE	1,961	38.20	74,910.20
CELANESE CORP-SERIES A	2,065	59.00	121,835.00
CELGENE CORP	11,861	102.61	1,217,057.21
CENTENE CORP	1,516	55.43	84,031.88
CENTERPOINT ENERGY INC	5,627	18.44	103,761.88
CENTURYLINK INC	8,532	29.73	253,656.36
CERNER CORP	4,634	51.46	238,465.64
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,131	33.00	103,323.00
CHARLES SCHWAB CORP	17,718	24.44	433,027.92
CHARTER COMMUNICATION-A	1,277	173.57	221,648.89
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	909	81.61	74,183.49
CHENIERE ENERGY INC	3,021	29.37	88,726.77
CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,013	2.00	16,026.00
CHEVRON CORP	28,191	86.50	2,438,521.50
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	1,274	33.20	42,296.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	466	511.58	238,396.28
CHUBB LTD	6,725	115.67	777,880.75
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,806	89.41	161,474.46
CIGNA CORP	3,857	133.94	516,606.58
CIMAREX ENERGY CO	1,274	85.58	109,028.92
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,092	62.57	130,896.44
CINTAS CORP	1,279	83.38	106,643.02
CISCO SYSTEMS INC	76,355	26.55	2,027,225.25
CIT GROUP INC	2,334	28.23	65,888.82
CITIGROUP INC	45,178	38.99	1,761,490.22
CITIZENS FINANCIAL GROUP	7,481	19.24	143,934.44
CITRIX SYSTEMS INC	2,312	69.28	160,175.36
CLOROX CO	1,948	128.63	250,571.24
CME GROUP INC	4,798	93.32	447,749.36
CMS ENERGY CORP	3,978	39.40	156,733.20

COACH INC	3,705	35.82	132,713.10
COCA-COLA CO	61,980	43.77	2,712,864.60
COCA-COLA ENTERPRISES	2,993	48.93	146,447.49
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	9,161	55.90	512,099.90
COLGATE-PALMOLIVE CO	12,845	67.46	866,523.70
COLUMBIA PIPELINE GROUP -W/I	4,248	17.08	72,555.84
COMCAST CORP	37,176	57.76	2,147,285.76
COMERICA INC	2,372	34.32	81,407.04
CONAGRA FOODS INC	6,498	41.84	271,876.32
CONCHO RESOURCES INC	1,826	92.29	168,521.54
CONOCOPHILLIPS	18,483	32.87	607,536.21
CONSOLIDATED EDISON INC	4,451	70.87	315,442.37
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,580	139.51	359,935.80
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,247	17.46	21,772.62
COOPER COS INC/THE	653	140.84	91,968.52
CORE LABORATORIES N.V.	577	107.29	61,906.33
CORNING INC	18,343	18.55	340,262.65
COSTCO WHOLESALE CORP	6,584	148.70	979,040.80
CROWN HOLDINGS INC	1,923	45.56	87,611.88
CSX CORP	14,903	24.51	365,272.53
CUMMINS INC	2,535	96.59	244,855.65
CVS HEALTH CORP	16,716	97.59	1,631,314.44
D&B CORP	491	92.59	45,461.69
DANAHER CORP	9,227	86.65	799,519.55
DARDEN RESTAURANTS INC	1,539	61.19	94,171.41
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	2,476	63.80	157,968.80
DEERE & CO	4,685	77.00	360,745.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	4,273	65.16	278,428.68
DELTA AIR LINES INC	2,725	46.72	127,312.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	1,876	56.37	105,750.12
DEVON ENERGY CORPORATION	5,560	18.65	103,694.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,251	38.50	48,163.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6,528	46.15	301,267.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	1,969	25.35	49,914.15

DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3,759	24.94	93,749.46	
DISH NETWORK CORP	3,240	44.21	143,240.40	
DOLLAR GENERAL CORP	4,425	72.00	318,600.00	
DOLLAR TREE INC	3,342	79.44	265,488.48	
DOMINION RESOURCES INC/VA	8,970	69.46	623,056.20	
DOVER CORP	2,098	60.62	127,180.76	
DOW CHEMICAL CO	16,870	47.08	794,239.60	
DR HORTON INC	4,454	25.01	111,394.54	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	2,873	90.54	260,121.42	
DTE ENERGY COMPANY	2,747	84.72	232,725.84	
DUKE ENERGY CORP	10,372	74.55	773,232.60	
E*TRADE FINANCIAL	3,889	22.49	87,463.61	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,001	62.40	124,862.40	
EATON CORP PLC	6,982	56.01	391,061.82	
EATON VANCE CORP	1,543	29.11	44,916.73	
EBAY INC	16,417	23.81	390,888.77	
ECOLAB INC	3,995	107.77	430,541.15	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	832	75.12	62,499.84	
EDISON INTERNATIONAL	4,931	62.89	310,110.59	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,231	86.21	278,544.51	
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	13,559	59.97	813,133.23	
ELECTRONIC ARTS INC	4,698	59.57	279,859.86	
ELI LILLY & CO	14,979	72.61	1,087,625.19	
EMC CORP/MASSACHUSETTS	28,872	25.03	722,666.16	
EMERSON ELECTRIC CO	9,842	48.06	473,006.52	
ENDO INTERNATIONAL PLC	3,064	50.26	153,996.64	
ENERGEN CORP	1,061	24.42	25,909.62	
ENSCO PLC	3,121	8.22	25,654.62	
ENTERGY CORP	2,671	72.98	194,929.58	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	2,493	21.03	52,427.79	
EOG RESOURCES INC	8,232	69.71	573,852.72	
EQT CORP	2,045	58.89	120,430.05	
EQUIFAX INC	1,704	100.99	172,086.96	
ESTEE LAUDER COS INC	3,379	91.63	309,617.77	
EVEREST RE GROUP LTD	590	186.55	110,064.50	

EVERSOURCE ENERGY	4,853	54.67	265,313.51	
EXELON CORP	12,954	31.24	404,682.96	
EXPEDIA INC	1,494	108.67	162,352.98	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	2,655	46.69	123,961.95	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	10,140	68.01	689,621.40	
EXXON MOBIL CORP	62,552	82.50	5,160,540.00	
F5 NETWORKS INC	969	92.67	89,797.23	
FACEBOOK INC-A	32,231	104.57	3,370,395.67	
FASTENAL CO	3,820	44.65	170,563.00	
FEDEX CORP	4,070	129.76	528,123.20	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	4,270	59.71	254,961.70	
FIFTH THIRD BANCORP	11,853	15.28	181,113.84	
FIREEYE INC	1,929	13.89	26,793.81	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,937	59.86	115,948.82	
FIRSTENERGY CORP	6,415	32.97	211,502.55	
FISERV INC	3,557	96.65	343,784.05	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,092	127.97	139,743.24	
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	7,639	10.59	80,897.01	
FLIR SYSTEMS INC	1,894	30.83	58,392.02	
FLOWSERVE CORP	1,780	41.39	73,674.20	
FLUOR CORP	1,926	45.38	87,401.88	
FMC CORP	1,781	35.95	64,026.95	
FMC TECHNOLOGIES INC	3,076	25.17	77,422.92	
FNF GROUP	3,422	32.93	112,686.46	
FOOT LOCKER INC	1,869	67.50	126,157.50	
FORD MOTOR CO	55,592	12.10	672,663.20	
FORTINET INC	1,974	26.09	51,501.66	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	2,165	49.58	107,340.70	
FRANKLIN RESOURCES INC	5,758	34.08	196,232.64	
FREEPORT-MCMORAN INC	13,859	6.92	95,904.28	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	15,969	4.44	70,902.36	
GAMESTOP CORP-CLASS A	1,424	28.19	40,142.56	
GAP INC	3,329	26.24	87,352.96	
GARMIN LTD	1,524	39.97	60,914.28	
GARTNER INC	1,157	82.78	95,776.46	

GENERAL DYNAMICS CORP	4,126	135.26	558,082.76	
GENERAL ELECTRIC CO	141,692	29.02	4,111,901.84	
GENERAL MILLS INC	8,988	58.72	527,775.36	
GENERAL MOTORS CO	21,388	28.78	615,546.64	
GENUINE PARTS CO	2,155	92.07	198,410.85	
GILEAD SCIENCES INC	22,021	87.44	1,925,516.24	
GLOBAL PAYMENTS INC	1,762	59.16	104,239.92	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,838	146.91	857,660.58	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	3,630	29.61	107,484.30	
H&R BLOCK INC	3,156	33.96	107,177.76	
HALLIBURTON CO	12,802	31.37	401,598.74	
HANESBRANDS INC	5,757	26.53	152,733.21	
HARLEY-DAVIDSON INC	2,767	42.00	116,214.00	
HARMAN INTERNATIONAL	956	73.20	69,979.20	
HARRIS CORP	1,750	75.18	131,565.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	6,200	41.78	259,036.00	
HASBRO INC	1,519	72.08	109,489.52	
HCA HOLDINGS INC	4,991	67.62	337,491.42	
HELMERICH & PAYNE	1,439	51.58	74,223.62	
HENRY SCHEIN INC	1,222	166.24	203,145.28	
HERSHEY CO/THE	2,211	91.03	201,267.33	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	5,339	8.30	44,313.70	
HESS CORP	3,679	42.31	155,658.49	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	27,270	13.67	372,780.90	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,621	19.88	131,625.48	
HOLLYFRONTIER CORP	2,413	30.76	74,223.88	
HOLOGIC INC	3,241	34.49	111,782.09	
HOME DEPOT INC	19,278	121.69	2,345,939.82	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11,131	107.27	1,194,022.37	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	8,100	5.81	47,061.00	
HORMEL FOODS CORP	4,160	42.75	177,840.00	
HP INC	27,032	10.32	278,970.24	
HUMANA INC	2,137	165.34	353,331.58	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	10,803	8.67	93,662.01	
IHS INC-CLASS A	927	102.60	95,110.20	

ILLINOIS TOOL WORKS INC	4,953	95.86	474,794.58	
ILLUMINA INC	2,171	151.31	328,494.01	
IMS HEALTH HOLDINGS INC	2,212	25.73	56,914.76	
INCYTE CORP	2,382	72.70	173,171.40	
INGERSOLL-RAND PLC	3,885	52.02	202,097.70	
INTEL CORP	71,350	28.71	2,048,458.50	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,658	248.07	411,300.06	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	13,982	133.08	1,860,724.56	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	1,093	105.40	115,202.20	
INTERNATIONAL PAPER CO	5,840	34.01	198,618.40	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,605	21.14	118,489.70	
INTUIT INC	3,959	97.19	384,775.21	
INTUITIVE SURGICAL INC	553	546.34	302,126.02	
INVESCO LTD	6,221	26.30	163,612.30	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,612	37.00	59,644.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,650	37.99	62,683.50	
JARDEN CORP	2,779	52.17	144,980.43	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	825	123.07	101,532.75	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,323	76.76	101,553.48	
JM SMUCKER CO	1,700	127.75	217,175.00	
JOHNSON & JOHNSON	41,559	104.16	4,328,785.44	
JOHNSON CONTROLS INC	9,785	34.88	341,300.80	
JONES LANG LASALLE INC	600	100.54	60,324.00	
JPMORGAN CHASE & CO	55,476	57.82	3,207,622.32	
JUNIPER NETWORKS INC	4,698	24.57	115,429.86	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,506	82.71	124,561.26	
KELLOGG CO	3,997	75.52	301,853.44	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	1,593	91.52	145,791.36	
KEYCORP	11,546	10.70	123,542.20	
KIMBERLY-CLARK CORP	5,465	130.43	712,799.95	
KINDER MORGAN INC	27,924	17.37	485,039.88	
KLA-TENCOR CORP	2,192	65.69	143,992.48	
KOHL'S CORP	2,646	44.38	117,429.48	
KRAFT HEINZ CO/THE	9,097	73.52	668,811.44	
KROGER CO	13,956	37.82	527,815.92	

L BRANDS INC	3,729	83.94	313,012.26	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,083	117.56	127,317.48	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	1,441	108.72	156,665.52	
LAM RESEARCH CORP	2,258	69.77	157,540.66	
LAS VEGAS SANDS CORP	5,958	45.86	273,233.88	
LEAR CORP	1,035	103.32	106,936.20	
LEGG MASON INC	1,307	27.42	35,837.94	
LEGGETT & PLATT INC	1,861	43.70	81,325.70	
LENNAR CORP-CL A	2,349	39.97	93,889.53	
LEUCADIA NATIONAL CORP	4,404	14.76	65,003.04	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	4,590	48.17	221,100.30	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,205	37.10	118,905.50	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	9,499	36.19	343,768.81	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	6,379	24.45	155,966.55	
LIBERTY MEDIA CORP	1,175	33.85	39,773.75	
LIBERTY MEDIA CORP - C	2,854	33.19	94,724.26	
LINCOLN NATIONAL CORP	3,548	35.96	127,586.08	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	3,225	43.17	139,223.25	
LINKEDIN CORP - A	1,721	114.12	196,400.52	
LKQ CORP	4,116	26.31	108,291.96	
LOCKHEED MARTIN CORP	4,198	213.62	896,776.76	
LOEWS CORP	4,003	36.92	147,790.76	
LOWE'S COS INC	13,892	68.52	951,879.84	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,522	60.76	92,476.72	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	5,935	78.14	463,760.90	
M&T BANK CORP	2,163	107.05	231,549.15	
MACY'S INC	4,835	40.23	194,512.05	
MALLINCKRODT PLC	1,576	64.74	102,030.24	
MANPOWER GROUP	1,029	76.99	79,222.71	
MARATHON OIL CORP	9,070	6.73	61,041.10	
MARATHON PETROLEUM CORP	8,043	31.59	254,078.37	
MARKEL CORP	201	861.43	173,147.43	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	3,113	65.71	204,555.23	
MARSH & MCLENNAN COS INC	7,949	57.31	455,557.19	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	773	135.98	105,112.54	

MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	5,523	9.16	50,590.68	
MASCO CORP	4,671	27.62	129,013.02	
MASTERCARD INC-CLASS A	15,014	86.79	1,303,065.06	
MATTEL INC	4,540	31.79	144,326.60	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,836	32.99	126,549.64	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,567	92.02	144,195.34	
MCDONALD'S CORP	14,124	116.53	1,645,869.72	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	4,082	87.95	359,011.90	
MCKESSON CORP	3,481	154.27	537,013.87	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,038	74.79	227,212.02	
MEDIVATION INC	2,190	32.76	71,744.40	
MEDNAX INC	1,257	65.88	82,811.16	
MEDTRONIC PLC	21,228	75.38	1,600,166.64	
MELCO PBL ENTERTAINMENT-ADR	1,257	15.60	19,609.20	
MERCK & CO INC	42,265	50.12	2,118,321.80	
METLIFE INC	14,169	39.11	554,149.59	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	376	322.14	121,124.64	
MGM MIRAGE	6,044	18.06	109,154.64	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	2,592	52.73	136,676.16	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,843	42.37	120,457.91	
MICRON TECHNOLOGY INC	15,836	11.16	176,729.76	
MICROSOFT CORP	114,072	51.82	5,911,211.04	
MOBILEYE NV	1,089	28.89	31,461.21	
MOHAWK INDUSTRIES INC	900	165.68	149,112.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	2,238	85.55	191,460.90	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	24,184	39.81	962,765.04	
MONSANTO CO	7,021	88.52	621,498.92	
MONSTER BEVERAGE CORP	2,156	127.58	275,062.48	
MOODY'S CORP	2,714	85.66	232,481.24	
MORGAN STANLEY	21,977	24.00	527,448.00	
MOSAIC CO/THE	4,275	24.40	104,310.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,249	66.00	148,434.00	
MURPHY OIL CORP	2,185	15.76	34,435.60	

MYLAN NV	6,262	45.34	283,919.08
NASDAQ INC	1,589	62.93	99,995.77
NATIONAL-OILWELL INC	5,452	29.30	159,743.60
NAVIENT CORP	4,988	9.92	49,480.96
NETAPP INC	4,027	24.64	99,225.28
NETFLIX INC	6,070	89.23	541,626.10
NETSUITE INC	548	56.25	30,825.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	6,524	15.46	100,861.04
NEWELL RUBBERMAID INC	3,852	37.46	144,295.92
NEWMONT MINING CORP	7,060	24.84	175,370.40
NEWS CORP - CLASS A	5,180	10.92	56,565.60
NEXTERA ENERGY INC	6,810	114.75	781,447.50
NIELSEN HOLDINGS PLC	5,269	48.09	253,386.21
NIKE INC	20,361	59.31	1,207,610.91
NOBLE ENERGY INC	6,264	29.85	186,980.40
NORDSTROM INC	1,902	49.17	93,521.34
NORFOLK SOUTHERN CORP	4,575	75.00	343,125.00
NORTHERN TRUST CORP	3,233	59.38	191,975.54
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,678	190.68	510,641.04
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,156	42.49	91,608.44
NRG ENERGY INC	4,438	10.01	44,424.38
NUANCE COMMUNICATIONS INC	3,416	18.70	63,879.20
NUCOR CORP	4,569	39.39	179,972.91
NVIDIA CORP	8,098	30.44	246,503.12
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,261	66.47	150,288.67
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,493	257.84	384,955.12
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	11,459	70.26	805,109.34
OCEANEERING INTL INC	1,309	28.11	36,795.99
OGE ENERGY CORP	2,751	26.45	72,763.95
OMNICOM GROUP	3,695	76.52	282,741.40
ONEOK INC	2,814	20.66	58,137.24
ORACLE CORP	52,112	36.78	1,916,679.36
PACCAR INC	5,307	50.90	270,126.30
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,327	45.15	59,914.05
PALO ALTO NETWORKS INC	1,021	127.16	129,830.36
PARKER HANNIFIN CORP	2,019	99.89	201,677.91

PARTNERRE LTD	610	140.15	85,491.50	
PATTERSON COS INC	1,180	44.47	52,474.60	
PAYCHEX INC	4,950	51.25	253,687.50	
PAYPAL HOLDINGS INC	16,473	35.76	589,074.48	
PENTAIR PLC	2,417	48.01	116,040.17	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	4,178	14.67	61,291.26	
PEPCO HOLDINGS INC	3,247	26.42	85,785.74	
PEPSICO INC	22,052	99.58	2,195,938.16	
PERRIGO CO PLC	2,194	129.34	283,771.96	
PFIZER INC	92,547	29.49	2,729,211.03	
PG&E CORP	7,383	55.89	412,635.87	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	23,249	91.94	2,137,513.06	
PHILLIPS 66	8,071	80.09	646,406.39	
PINNACLE WEST CAPITAL	1,540	68.25	105,105.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,235	122.99	274,882.65	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	3,010	7.13	21,461.30	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	7,704	82.82	638,045.28	
POLARIS INDUSTRIES INC	845	85.85	72,543.25	
PPG INDUSTRIES INC	4,062	95.63	388,449.06	
PPL CORPORATION	10,137	36.26	367,567.62	
PRAXAIR INC	4,305	103.31	444,749.55	
PRICELINE GROUP INC/THE	760	1,283.74	975,642.40	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,176	36.81	153,718.56	
PROCTER & GAMBLE CO	40,677	81.79	3,326,971.83	
PROGRESSIVE CORP	8,805	31.91	280,967.55	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,743	65.36	440,722.48	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	7,636	42.97	328,118.92	
PULTE GROUP INC	4,268	16.54	70,592.72	
PVH CORP	1,113	74.99	83,463.87	
QORVO INC	2,008	41.85	84,034.80	
QUALCOMM INC	23,586	49.42	1,165,620.12	
QUANTA SERVICES INC	2,620	18.68	48,941.60	
QUEST DIAGNOSTICS	1,925	66.31	127,646.75	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,264	63.43	80,175.52	
RALPH LAUREN CORP	801	88.28	70,712.28	

RANGE RESOURCES CORP	2,280	23.74	54,127.20	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,725	43.87	75,675.75	
RAYTHEON CO	4,563	123.57	563,849.91	
REALOGY HOLDINGS CORP	1,974	31.06	61,312.44	
RED HAT INC	2,711	65.90	178,654.90	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,145	394.98	452,252.10	
REGIONS FINANCIAL CORP	18,801	7.65	143,827.65	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	625	115.20	72,000.00	
REPUBLIC SERVICES INC	3,401	45.68	155,357.68	
RESMED INC	1,884	58.90	110,967.60	
REYNOLDS AMERICAN INC	12,880	49.51	637,688.80	
RITE AID CORP	13,608	7.93	107,911.44	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,811	38.37	69,488.07	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,965	101.60	199,644.00	
ROCKWELL COLLINS INC.	1,879	86.07	161,725.53	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,519	170.34	258,746.46	
ROSS STORES INC	6,190	54.69	338,531.10	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,574	70.85	182,367.90	
SABRE CORP	2,480	27.55	68,324.00	
SALESFORCE.COM INC	9,362	62.14	581,754.68	
SANDISK CORP	3,061	68.85	210,749.85	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,929	89.64	172,915.56	
SCANA CORP	1,885	65.38	123,241.30	
SCHLUMBERGER LTD	18,985	72.87	1,383,436.95	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,031	55.13	56,839.03	
SEAGATE TECHNOLOGY	4,171	31.34	130,719.14	
SEALED AIR CORP	2,819	43.29	122,034.51	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,898	37.24	70,681.52	
SEMPRA ENERGY	3,560	97.25	346,210.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,306	34.60	79,787.60	
SERVICENOW INC	2,128	54.74	116,486.72	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,190	255.51	304,056.90	
SIGNATURE BANK	681	131.34	89,442.54	
SIGNET JEWELERS LTD	1,016	103.82	105,481.12	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	33,854	3.62	122,551.48	

SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,724	63.03	171,693.72	
SNAP-ON INC	791	145.22	114,869.02	
SOUTHERN CO	13,703	48.57	665,554.71	
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,270	39.31	89,233.70	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	5,131	7.09	36,378.79	
SPECTRA ENERGY CORP	10,045	28.63	287,588.35	
SPLUNK INC	1,695	34.84	59,053.80	
SPRINT CORP	10,840	2.93	31,761.20	
ST JUDE MEDICAL INC	4,208	53.41	224,749.28	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,312	92.00	212,704.00	
STAPLES INC	8,600	9.48	81,528.00	
STARBUCKS CORP	22,265	57.67	1,284,022.55	
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	2,422	66.33	160,651.26	
STATE STREET CORP	6,101	56.19	342,815.19	
STERICYCLE INC	1,141	109.66	125,122.06	
STRYKER CORP	5,081	97.72	496,515.32	
SUNTRUST BANKS INC	7,685	34.15	262,442.75	
SYMANTEC CORP	10,065	19.93	200,595.45	
SYNCHRONY FINANCIAL	12,518	26.77	335,106.86	
SYNOPSIS INC	2,148	44.48	95,543.04	
SYSCO CORP	8,901	44.99	400,455.99	
T ROWE PRICE GROUP INC	3,812	68.86	262,494.32	
T-MOBILE US INC	4,031	34.95	140,883.45	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	697	42.39	29,545.83	
TARGET CORP	8,956	72.32	647,697.92	
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	100	139.07	13,907.00	
TE CONNECTIVITY LTD	6,046	57.61	348,310.06	
TEGNA INC	2,927	23.91	69,984.57	
TERADATA CORP	1,906	25.08	47,802.48	
TESLA MOTORS INC	1,461	166.58	243,373.38	
TESORO CORP	1,760	72.16	127,001.60	
TEXAS INSTRUMENTS INC	15,404	52.76	812,715.04	
TEXTRON INC	3,935	33.28	130,956.80	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,981	130.16	778,486.96	
TIFFANY & CO	1,729	64.51	111,537.79	
TIME WARNER CABLE	4,158	188.84	785,196.72	

TIME WARNER INC	12,265	64.67	793,177.55	
TJX COS INC	10,125	71.59	724,848.75	
TOLL BROTHERS INC	2,261	25.08	56,705.88	
TORCHMARK CORP	1,681	51.88	87,210.28	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	2,288	42.79	97,903.52	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,935	84.62	163,739.70	
TRANSDIGM GROUP INC	799	207.41	165,720.59	
TRAVELERS COS INC/THE	4,663	108.09	504,023.67	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,441	23.54	81,001.14	
TRIPADVISOR INC	1,582	63.42	100,330.44	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	6,452	26.69	172,203.88	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	18,200	26.62	484,484.00	
TWITTER INC	8,197	18.31	150,087.07	
TYCO INTERNATIONAL PLC	6,301	33.57	211,524.57	
TYSON FOODS INC-CL A	4,570	62.97	287,772.90	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	870	150.07	130,560.90	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,703	80.64	217,969.92	
UNION PACIFIC CORP	13,078	79.90	1,044,932.20	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,297	53.82	69,804.54	
UNITED PARCEL SERVICE INC	10,586	97.37	1,030,758.82	
UNITED RENTALS INC	1,280	48.40	61,952.00	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	12,678	88.23	1,118,579.94	
UNITED THERAPEUTICS CORP	612	127.32	77,919.84	
UNITEDHEALTH GROUP INC	14,296	117.68	1,682,353.28	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,267	106.99	135,556.33	
UNUM GROUP	3,293	27.52	90,623.36	
US BANCORP	26,413	39.46	1,042,256.98	
VALERO ENERGY CORP	7,457	57.05	425,421.85	
VANTIV INC - CL A	2,024	50.33	101,867.92	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,323	77.78	102,902.94	
VERISIGN INC	1,398	80.67	112,776.66	
VERISK ANALYTICS INC	2,290	67.95	155,605.50	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	61,168	50.86	3,111,004.48	

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,669	88.08	323,165.52	
VF CORP	5,106	58.55	298,956.30	
VIACOM INC-CLASS B	5,224	35.28	184,302.72	
VISA INC-CLASS A SHARES	29,316	71.53	2,096,973.48	
VMWARE INC-CLASS A	1,077	49.22	53,009.94	
VOYA FINANCIAL INC	3,008	28.93	87,021.44	
VULCAN MATERIALS CO	1,920	94.88	182,169.60	
WABCO HOLDINGS INC	744	91.35	67,964.40	
WABTEC CORP	1,306	67.25	87,828.50	
WAL-MART STORES INC	24,124	64.66	1,559,857.84	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	13,101	77.57	1,016,244.57	
WALT DISNEY CO	24,091	95.01	2,288,885.91	
WASTE MANAGEMENT INC	6,822	55.50	378,621.00	
WATERS CORP	1,153	121.37	139,939.61	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	10,380	6.20	64,356.00	
WEC ENERGY GROUP INC	4,823	56.53	272,644.19	
WELLS FARGO & CO	73,162	48.09	3,518,360.58	
WESTERN DIGITAL CORP	3,280	44.12	144,713.60	
WESTERN UNION CO	6,975	18.19	126,875.25	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	610	42.80	26,108.00	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	3,750	31.56	118,350.00	
WEYERHAEUSER CO	7,489	22.87	171,273.43	
WHIRLPOOL CORP	1,119	142.91	159,916.29	
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	2,367	38.31	90,679.77	
WHITING PETROLEUM CORP	2,730	4.32	11,793.60	
WHOLE FOODS MARKET INC	5,066	31.39	159,021.74	
WILLIAMS COS INC	10,421	15.51	161,629.71	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,911	110.33	210,840.63	
WORKDAY INC-CLASS A	1,497	57.12	85,508.64	
WR BERKLEY CORP	1,345	52.00	69,940.00	
WW GRAINGER INC	847	217.27	184,027.69	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	1,586	69.17	109,703.62	
WYNN RESORTS LTD	1,079	77.18	83,277.22	
XCEL ENERGY INC	7,759	39.33	305,161.47	
XEROX CORP	14,124	9.36	132,200.64	
XILINX INC	3,699	48.43	179,142.57	
XL GROUP PLC	4,144	34.28	142,056.32	

	XYLEM INC	2,448	37.03	90,649.44	
	YAHOO! INC	13,378	30.04	401,875.12	
	YUM! BRANDS INC	6,461	70.52	455,629.72	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	1,360	20.31	27,621.60	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,586	94.79	245,126.94	
	ZOETIS INC	7,130	41.83	298,247.90	
アメリカ・ドル	小計	4,667,553		253,909,348.75 (28,653,670,006)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	12,889	4.20	54,236.91	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	12,078	2.38	28,818.10	
	ADMIRAL GROUP PLC	2,844	17.43	49,570.92	
	AGGREKO PLC	3,385	8.48	28,721.72	
	AMEC FOSTER WHEELER PLC	5,202	3.49	18,191.39	
	ANGLO AMERICAN PLC	18,643	4.36	81,395.33	
	ANTOFAGASTA PLC	5,137	4.80	24,683.28	
	ARM HOLDINGS PLC	21,103	9.37	197,735.11	
	ASHTED GROUP PLC	6,787	8.46	57,451.95	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	5,355	32.55	174,305.25	
	ASTRAZENECA PLC	18,968	40.73	772,566.64	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	10,610	3.86	40,986.43	
	AVIVA PLC	60,338	4.36	263,616.72	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	3,407	9.22	31,429.57	
	BAE SYSTEMS PLC	47,409	5.05	239,652.49	
	BARCLAYS PLC	251,486	1.61	406,652.86	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	13,427	5.84	78,480.81	
	BHP BILLITON PLC	31,536	7.32	230,969.66	
	BP PLC	274,168	3.43	940,944.57	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	27,968	38.30	1,071,174.40	
	BT GROUP PLC	126,278	4.57	578,100.68	
	BUNZL PLC	4,604	19.04	87,660.16	
	BURBERRY GROUP PLC	5,957	12.70	75,653.90	
	CAPITA PLC	9,609	11.11	106,755.99	
	CARNIVAL PLC	2,553	33.13	84,580.89	
	CENTRICA PLC	76,117	2.11	160,987.45	
	COBHAM PLC	15,568	2.49	38,857.72	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	2,693	14.13	38,052.09	
	COMPASS GROUP PLC	24,705	12.29	303,624.45	

CRODA INTERNATIONAL PLC	1,845	28.35	52,305.75
DIAGEO PLC	37,725	18.28	689,801.62
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	18,628	3.74	69,799.11
DIXONS CARPHONE PLC	13,176	4.48	59,081.18
EASYJET PLC	2,241	15.53	34,802.73
EXPERIAN PLC	14,621	11.62	169,896.02
FRESNILLO PLC	2,980	9.53	28,414.30
G4S PLC	21,243	1.99	42,337.29
GKN PLC	22,793	2.79	63,638.05
GLAXOSMITHKLINE PLC	73,070	13.83	1,010,923.45
GLENCORE PLC	182,488	1.18	216,065.79
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,500	12.38	43,330.00
HSBC HOLDINGS PLC	293,278	4.49	1,319,164.44
ICAP PLC	7,385	4.13	30,559.13
IMI PLC	3,644	8.37	30,500.28
IMPERIAL BRANDS PLC	14,365	37.32	536,173.62
INMARSAT PLC	6,317	9.99	63,106.83
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,171	24.46	77,562.66
INTERTEK GROUP PLC	2,178	28.91	62,965.98
INVESTEC PLC	7,445	4.68	34,842.60
ITV PLC	58,060	2.52	146,427.32
JOHNSON MATTHEY PLC	2,591	24.76	64,153.16
KINGFISHER PLC	31,879	3.42	109,058.05
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	88,817	2.22	197,173.74
LLOYDS BANKING GROUP PLC	856,457	0.61	529,290.42
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,472	23.14	103,482.08
MARKS & SPENCER GROUP PLC	23,424	4.32	101,285.37
MEGGITT PLC	10,388	3.77	39,245.86
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	9,581	4.35	41,753.99
MONDI PLC/WI	4,981	13.21	65,799.01
MORRISON WM SUPERMARKETS	29,636	1.84	54,796.96
NATIONAL GRID PLC	56,487	9.64	544,817.11
NEXT PLC	2,195	70.05	153,759.75
OLD MUTUAL PLC	69,886	1.71	119,784.60
PEARSON PLC	11,054	7.94	87,768.76
PERSIMMON PLC	4,140	20.62	85,366.80

PETROFAC LTD	3,480	7.25	25,247.40	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	1,992	32.20	64,142.40	
PRUDENTIAL PLC	38,466	12.29	472,939.47	
RANDGOLD RESOURCES LTD	1,243	63.55	78,992.65	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,598	65.56	629,244.88	
RELX PLC	17,016	12.16	206,914.56	
REXAM PLC	9,671	6.05	58,557.90	
RIO TINTO PLC	18,754	18.91	354,731.91	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	26,790	6.42	171,991.80	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	50,529	2.46	124,301.34	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	58,805	15.63	919,122.15	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	58,798	15.60	917,542.79	
ROYAL MAIL PLC	12,596	4.41	55,586.14	
RSA INSURANCE GROUP PLC	13,647	4.09	55,829.87	
SABMILLER PLC	14,554	41.75	607,702.27	
SAGE GROUP PLC	14,866	5.80	86,222.80	
SAINSBURY (J) PLC	17,933	2.61	46,823.06	
SCHRODERS PLC	1,637	24.60	40,270.20	
SEVERN TRENT PLC	3,331	21.44	71,416.64	
SHIRE PLC	8,882	38.19	339,203.58	
SKY PLC	15,798	10.18	160,823.64	
SMITH & NEPHEW PLC	13,434	11.53	154,894.02	
SMITHS GROUP PLC	5,320	9.73	51,763.60	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	3,629	4.00	14,516.00	
SSE PLC	15,004	13.94	209,155.76	
ST JAMES'S PLACE PLC	7,002	8.92	62,457.84	
STANDARD CHARTERED PLC	48,888	4.14	202,689.64	
STANDARD LIFE PLC	27,180	3.36	91,542.24	
TATE & LYLE PLC	6,302	5.58	35,196.67	
TAYLOR WIMPEY PLC	43,948	1.83	80,732.47	
TESCO PLC	121,808	1.83	223,274.06	
TRAVIS PERKINS PLC	3,364	17.86	60,081.04	
TUI AG-DI	6,747	10.60	71,518.20	
UNILEVER PLC	19,227	30.34	583,347.18	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,500	9.32	88,540.00	
VODAFONE GROUP PLC	399,290	2.12	850,088.41	

	WEIR GROUP PLC/THE	2,843	9.08	25,814.44	
	WHITBREAD PLC	2,592	38.83	100,647.36	
	WILLIAM HILL PLC	11,776	3.84	45,243.39	
	WOLSELEY PLC	3,811	36.03	137,310.33	
	WPP PLC	19,583	14.68	287,478.44	
イギリス・ポンド 小計		4,266,599		22,208,989.79 (3,582,754,233)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	457	139.10	63,568.70	
	BANK HAPOALIM BM	13,986	18.48	258,461.28	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	18,555	12.87	238,802.85	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	27,034	8.59	232,276.12	
	DELEK GROUP LTD	64	644.10	41,222.40	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	6,660	15.45	102,897.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,904	42.73	81,357.92	
	NICE SYSTEMS LTD	779	236.00	183,844.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	12,958	221.70	2,872,788.60	
イスラエル・シュケル 小計		82,397		4,075,218.87 (117,529,312)	
オーストラリ ア・ドル	AGL ENERGY LTD	10,086	18.65	188,103.90	
	ALUMINA LTD	37,258	1.22	45,454.76	
	AMCOR LTD	18,088	13.90	251,423.20	
	AMP LTD	44,985	5.45	245,168.25	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	8,202	9.90	81,199.80	
	ASCIANO LTD	9,804	8.87	86,961.48	
	ASX LTD	3,071	41.75	128,214.25	
	AURIZON HOLDINGS LTD	32,253	3.91	126,109.23	
	AUSNET SERVICES	34,125	1.47	50,334.37	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	43,751	23.40	1,023,773.40	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	5,806	11.20	65,027.20	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	7,036	8.78	61,776.08	
	BHP BILLITON LTD	48,653	16.61	808,126.33	
	BORAL LTD	12,109	5.78	69,990.02	
	BRAMBLES LTD	24,935	11.06	275,781.10	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,896	35.37	137,801.52	
	CHALLENGER LTD	8,809	7.70	67,829.30	
CIMIC GROUP LIMITED	1,757	29.28	51,444.96		

COCA-COLA AMATIL LIMITED	8,760	8.75	76,650.00	
COCHLEAR LTD	875	104.53	91,463.75	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	25,734	73.43	1,889,647.62	
COMPUTERSHARE LIMITED	7,271	9.17	66,675.07	
CROWN RESORTS LTD	5,299	12.10	64,117.90	
CSL LIMITED	7,071	101.80	719,827.80	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	844	40.36	34,063.84	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	22,078	1.99	43,935.22	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	8,984	4.64	41,685.76	
HEALTHSCOPE LTD	27,090	2.29	62,036.10	
ILUKA RESOURCES LIMITED	6,192	6.74	41,734.08	
INCITEC PIVOT LTD	25,270	3.06	77,326.20	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	34,839	5.40	188,130.60	
MACQUARIE GROUP LTD	4,715	63.90	301,288.50	
MEDIBANK PRIVATE LTD	41,268	2.48	102,344.64	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	40,053	25.62	1,026,157.86	
NEWCREST MINING LIMITED	10,651	15.90	169,350.90	
OIL SEARCH LTD	19,037	7.13	135,733.81	
ORICA LTD	5,322	14.00	74,508.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	23,952	4.11	98,442.72	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	4,269	6.35	27,108.15	
QANTAS AIRWAYS LTD	8,896	3.96	35,228.16	
QBE INSURANCE GROUP LTD	20,223	10.19	206,072.37	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	2,109	59.88	126,286.92	
REA GROUP LTD	884	51.00	45,084.00	
RIO TINTO LTD	6,265	42.62	267,014.30	
SANTOS LTD	22,942	3.39	77,773.38	
SEEK LTD	4,853	13.44	65,224.32	
SONIC HEALTHCARE LTD	5,752	18.94	108,942.88	
SOUTH32 LTD	73,404	1.19	87,717.78	
SUNCORP GROUP LTD	19,883	11.48	228,256.84	
TABCORP HOLDINGS LTD	12,832	4.19	53,766.08	
TATTS GROUP LTD	22,396	4.02	90,031.92	
TELSTRA CORP LTD	69,682	5.28	367,920.96	
TPG TELECOM LTD	4,579	10.10	46,247.90	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	10,513	9.42	99,032.46	
	WESFARMERS LIMITED	17,240	43.43	748,733.20	
	WESTPAC BANKING CORP	50,428	29.78	1,501,745.84	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	11,443	28.10	321,548.30	
	WOOLWORTHS LTD	19,329	22.95	443,600.55	
オーストラリア・ドル 小計		1,067,851		14,016,975.83 (1,132,151,138)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,924	47.62	139,240.88	
	AGRIUM INC	1,949	112.95	220,139.55	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	6,303	59.69	376,226.07	
	ALTAGAS LTD	1,963	33.19	65,151.97	
	ARC RESOURCES LTD	4,641	17.99	83,491.59	
	ATCO LTD -CL 'I'	1,124	38.61	43,397.64	
	BANK OF MONTREAL	9,695	74.39	721,211.05	
	BANK OF NOVA SCOTIA	18,207	56.01	1,019,774.07	
	BARRICK GOLD CORP	15,596	17.26	269,186.96	
	BCE INC	2,124	59.06	125,443.44	
	BLACKBERRY LTD	6,713	9.80	65,787.40	
	BOMBARDIER INC	26,013	1.14	29,654.82	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	12,999	41.84	543,878.16	
	CAE INC	3,801	14.67	55,760.67	
	CAMECO CORP	5,356	16.56	88,695.36	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	5,955	90.50	538,927.50	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	12,090	78.48	948,823.20	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	16,418	28.09	461,181.62	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	6,495	9.18	59,624.10	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,322	173.39	402,611.58	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	990	129.83	128,531.70	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,771	35.04	62,055.84	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	383	198.92	76,186.36	
	CENOVUS ENERGY INC	11,574	14.53	168,170.22	
CGI GROUP INC	3,070	57.44	176,340.80		
CI FINANCIAL CORP	3,211	29.01	93,151.11		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	262	515.00	134,930.00		

CRESCENT POINT ENERGY CORP	6,689	15.65	104,682.85	
DOLLARAMA INC	1,657	77.69	128,732.33	
ELDORADO GOLD CORP	9,501	4.02	38,194.02	
ELEMENT FINANCIAL CORP	5,231	14.02	73,338.62	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,316	25.55	59,173.80	
ENBRIDGE INC	12,939	43.14	558,188.46	
ENCANA CORP	11,324	4.32	48,919.68	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	307	774.00	237,618.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	2,311	17.70	40,904.70	
FIRST CAPITAL REALTY INC	1,670	19.68	32,865.60	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,148	4.58	41,897.84	
FORTIS INC	3,901	38.27	149,291.27	
FRANCO-NEVADA CORP	2,115	78.75	166,556.25	
GEORGE WESTON LTD	713	107.45	76,611.85	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,154	33.65	106,132.10	
GOLDCORP INC	11,110	21.26	236,198.60	
GREAT-WEST LIFECO INC	4,063	34.96	142,042.48	
HUSKY ENERGY INC	4,736	13.26	62,799.36	
IGM FINANCIAL INC	1,340	34.43	46,136.20	
IMPERIAL OIL LTD	4,012	42.46	170,349.52	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,366	37.66	51,443.56	
INTACT FINANCIAL CORP	1,820	85.53	155,664.60	
INTER PIPELINE LTD	4,534	23.43	106,231.62	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	1,135	20.00	22,700.00	
KEYERA CORP	2,318	37.36	86,600.48	
KINROSS GOLD CORP	15,283	4.07	62,201.81	
LINAMAR CORP	660	55.44	36,590.40	
LOBLAW COS LTD	3,173	66.40	210,687.20	
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,020	47.11	283,602.20	
MANULIFE FINANCIAL CORP	29,504	17.55	517,795.20	
MEG ENERGY CORP	2,114	4.17	8,815.38	
METHANEX CORP	1,211	40.00	48,440.00	
METRO INC	3,343	41.46	138,600.78	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,412	38.42	169,509.04	
ONEX CORPORATION	1,196	80.87	96,720.52	
OPEN TEXT CORP	1,679	67.99	114,155.21	

	PEMBINA PIPELINE CORP	4,653	33.14	154,200.42	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	2,068	29.42	60,840.56	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	12,226	22.06	269,705.56	
	POWER CORP OF CANADA	5,053	28.85	145,779.05	
	POWER FINANCIAL CORP	3,392	31.46	106,712.32	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,999	19.90	39,780.10	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	2,744	44.98	123,425.12	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	5,446	49.36	268,814.56	
	ROYAL BANK OF CANADA	22,265	71.28	1,587,049.20	
	SAPUTO INC	3,473	38.33	133,120.09	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	2,195	15.89	34,878.55	
	SHAW COMMUNICATIONS INC- B	5,643	23.55	132,892.65	
	SILVER WHEATON CORP	5,394	21.43	115,593.42	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	2,034	40.98	83,353.32	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	9,170	40.45	370,926.50	
	SUNCOR ENERGY INC	21,700	32.86	713,062.00	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	7,463	8.15	60,823.45	
	THOMSON REUTERS CORP	5,293	49.50	262,003.50	
	TORONTO-DOMINION BANK	27,821	52.42	1,458,376.82	
	TOURMALINE OIL CORP	2,540	26.79	68,046.60	
	TRANSCANADA CORP	10,661	49.98	532,836.78	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,580	2.95	40,061.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	4,888	117.00	571,896.00	
	VERESEN INC	3,923	7.49	29,383.27	
	VERMILION ENERGY INC	1,506	35.35	53,237.10	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	935	40.90	38,241.50	
	YAMANA GOLD INC	12,509	3.71	46,408.39	
	カナダ・ドル 小計	562,528		19,229,413.02 (1,574,312,044)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND LTD	34,600	2.87	99,302.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,500	7.14	39,270.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	31,700	2.95	93,515.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	26,300	13.68	359,784.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	80,900	0.72	58,248.00	

	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	42,200	1.71	72,373.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	94,400	0.36	34,456.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	1,600	39.34	62,944.00	
	KEPPEL CORP LTD	19,600	5.34	104,664.00	
	NOBLE GROUP LTD	62,700	0.36	22,885.50	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	45,700	7.98	364,686.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	13,400	2.70	36,180.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	11,300	1.70	19,210.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	7,900	11.48	90,692.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,000	7.30	80,300.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	23,700	3.76	89,112.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	21,900	2.80	61,320.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	122,300	3.73	456,179.00	
	STARHUB LTD	11,100	3.46	38,406.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	19,500	17.24	336,180.00	
	UOL Group Limited	6,400	5.79	37,056.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	26,000	3.16	82,160.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	26,100	0.96	25,056.00	
	シンガポール・ドル 小計	745,800		2,663,978.50 (213,837,554)	
スイス・フラン	ABB LTD	32,909	17.73	583,476.57	
	ACTELION LTD-REG	1,507	137.40	207,061.80	
	ADECCO SA-REG	2,294	58.35	133,854.90	
	ARYZTA AG	1,159	44.81	51,934.79	
	BALOISE HOLDING AG	661	121.70	80,443.70	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	31	1,087.00	33,697.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	12	5,730.00	68,760.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	68,470.00	136,940.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	7,816	65.00	508,040.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	26,868	13.10	351,970.80	
	DUFREY AG-REG	546	103.80	56,674.80	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	112	466.50	52,248.00	
	GALENICA AG-REG	53	1,420.00	75,260.00	

	GEBERIT AG-REG	554	359.50	199,163.00	
	GIVAUDAN-REG	140	1,870.00	261,800.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,090	40.39	124,805.10	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	808	131.60	106,332.80	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	6,382	37.99	242,452.18	
	LONZA GROUP AG	721	147.30	106,203.30	
	NESTLE SA	47,849	70.85	3,390,101.65	
	NOVARTIS AG	34,146	73.20	2,499,487.20	
	PARGESA HOLDING SA-BR	424	57.15	24,231.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	217	356.25	77,306.25	
	ROCHE HOLDING AG	10,547	255.70	2,696,867.90	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	305	164.00	50,020.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	577	165.20	95,320.40	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	74	1,978.00	146,372.00	
	SIKA AG-BEARER	30	3,849.00	115,470.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	722	118.80	85,773.60	
	SULZER AG-REG	307	92.80	28,489.60	
	SWATCH GROUP AG	410	341.60	140,056.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	427	237.80	101,540.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	908	82.85	75,227.80	
	SWISS RE AG	5,252	91.65	481,345.80	
	SWISSCOM AG	393	482.70	189,701.10	
	SYNGENTA AG	1,392	402.20	559,862.40	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	685	67.00	45,895.00	
	TRANSOCEAN LTD	4,874	8.27	40,307.98	
	UBS GROUP AG	54,825	14.79	810,861.75	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,239	212.80	476,459.20	
スイス・フラン	小計	252,268		15,511,816.57 (1,765,865,198)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	4,022	134.10	539,350.20	
	ASSA ABLOY AB	15,133	164.10	2,483,325.30	
	ATLAS COPCO AB	5,314	182.90	971,930.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	9,822	193.30	1,898,592.60	
	BOLIDEN AB	3,664	124.80	457,267.20	
	ELECTROLUX AB	3,268	193.80	633,338.40	

	GETINGE AB-B SHS	2,725	185.10	504,397.50	
	HENNES & MAURITZ AB	14,258	283.90	4,047,846.20	
	HEXAGON AB-B SHS	3,514	288.00	1,012,032.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,763	53.60	308,896.80	
	ICA GRUPPEN AB	1,073	255.50	274,151.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,228	133.80	298,106.40	
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	3,166	211.50	669,609.00	
	INVESTOR AB	6,873	282.10	1,938,873.30	
	LUNDIN PETROLEUM AB	3,028	132.90	402,421.20	
	NORDEA BANK AB	45,658	83.10	3,794,179.80	
	SANDVIK AB	14,414	78.40	1,130,057.60	
	SECURITAS AB	4,321	122.50	529,322.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	23,042	82.80	1,907,877.60	
	SKANSKA AB-B SHS	5,178	172.10	891,133.80	
	SKF AB	5,396	145.10	782,959.60	
	SVENSKA CELLULOSA AB	8,881	255.20	2,266,431.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	22,635	109.40	2,476,269.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	13,714	165.30	2,266,924.20	
	SWEDISH MATCH AB	2,712	273.80	742,545.60	
	TELE2 AB	4,656	70.50	328,248.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	45,851	77.55	3,555,745.05	
	TELIASONERA AB	38,136	39.32	1,499,507.52	
	VOLVO AB	22,686	85.60	1,941,921.60	
	スウェーデン・クローナ 小計	341,131		40,553,261.27 (540,980,505)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	93	8,220.00	764,460.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	54	8,040.00	434,160.00	
	CARLSBERG AS-B	1,435	605.50	868,892.50	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,346	404.30	544,187.80	
	COLOPLAST-B	1,489	515.00	766,835.00	
	DANSKE BANK A/S	10,605	186.20	1,974,651.00	
	DSV A/S	2,705	271.90	735,489.50	
	ISS A/S	2,039	240.20	489,767.80	
	NOVO-NORDISK A/S	29,412	340.00	10,000,080.00	
	NOVOZYMES A/S	3,233	294.00	950,502.00	
	PANDORA A/S	1,653	838.00	1,385,214.00	
	TDC A/S	11,255	30.16	339,450.80	

	TRYGVESTA AS	1,553	123.30	191,484.90	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	3,361	441.40	1,483,545.40	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	334	570.50	190,547.00	
デンマーク・クローネ 小計		70,567		21,119,267.70 (354,803,697)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	14,621	6.34	92,697.14	
	CONTACT ENERGY LTD	10,226	4.50	46,017.00	
	FLETCHER BUILDING LTD	9,346	6.57	61,403.22	
	MERIDIAN ENERGY LTD	17,834	2.28	40,750.69	
	MIGHTY RIVER POWER	10,006	2.70	27,066.23	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,053	8.03	40,575.59	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	25,509	3.29	84,052.15	
ニュージーランド・ドル 小計		92,595		392,562.02 (29,398,969)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	13,980	98.70	1,379,826.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,706	134.00	362,604.00	
	NORSK HYDRO ASA	17,959	32.70	587,259.30	
	ORKLA ASA	11,048	70.35	777,226.80	
	SCHIBSTED ASA	1,012	231.40	234,176.80	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,258	223.40	281,037.20	
	STATOIL ASA	16,734	118.70	1,986,325.80	
	TELENOR ASA	10,934	124.10	1,356,909.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,414	331.60	800,482.40	
ノルウェー・クローネ 小計		78,045		7,765,847.70 (102,198,556)	
ユーロ	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	7,416	13.22	98,076.60	
	ACCOR	2,836	35.62	101,032.50	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,525	21.13	53,365.87	
	ADIDAS AG	3,136	99.01	310,501.63	
	ADP	485	106.50	51,652.50	
	AEGON NV	23,909	4.30	102,856.51	
	AENA SA	948	103.35	97,975.80	
	AGEAS	2,719	33.91	92,214.88	
	AIR LIQUIDE	5,176	95.14	492,444.64	
	AIRBUS GROUP SE	8,872	55.25	490,178.00	
	AKZO NOBEL NV	3,716	53.20	197,691.20	
	ALLIANZ SE	6,829	134.31	917,216.64	

ALSTOM RGPT	2,977	20.83	62,010.91
ALTICE NV - A-W/I	5,025	12.36	62,134.12
ALTICE NV - B -W/I	1,424	12.49	17,785.76
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	6,648	35.58	236,569.08
ANDRITZ AG	1,057	42.97	45,424.57
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	12,059	104.80	1,263,783.20
ARCELORMITTAL	13,389	3.21	43,059.02
ARKEMA	909	53.30	48,449.70
ASML HOLDING NV	5,199	78.99	410,669.01
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	17,404	11.71	203,800.84
ATLANTIA SPA	6,214	22.86	142,052.04
ATOS SE	1,210	65.31	79,025.10
AXA	29,309	20.40	597,903.60
AXEL SPRINGER SE	636	45.94	29,221.02
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	35,421	0.51	18,135.55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	95,060	5.53	526,537.34
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA	539,896	0.03	17,816.56
BANCO DE SABADELL SA	67,457	1.40	94,911.99
BANCO POPOLARE SC	4,865	7.45	36,244.25
BANCO POPULAR ESPANOL	22,674	2.04	46,254.96
BANCO SANTANDER SA	216,106	3.49	756,154.89
BANK OF IRELAND	379,673	0.24	93,779.23
BANKIA SA	61,328	0.74	45,505.37
BANKINTER SA	9,094	5.86	53,309.02
BASF SE	13,746	60.10	826,134.60
BAYER AG	12,407	98.11	1,217,263.17
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,947	73.70	364,593.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	737	62.55	46,099.35
BEIERSDORF AG	1,342	79.26	106,366.92
BNP PARIBAS	15,903	40.51	644,230.53
BOLLORE	12,742	3.57	45,539.90
BOSKALIS WESTMINSTER	1,186	31.67	37,560.62
BOUYGUES	2,768	34.59	95,758.96
BRENNTAG AG	2,086	43.64	91,043.47
BUREAU VERITAS SA	3,704	17.86	66,171.96

CAIXABANK	35,126	2.46	86,445.08	
CAP GEMINI SA	2,493	75.78	188,919.54	
CARREFOUR SA	8,323	23.52	195,756.96	
CASINO GUICHARD PERRACHON	754	41.00	30,914.00	
CHRISTIAN DIOR SE	737	164.25	121,052.25	
CIE DE SAINT-GOBAIN	7,315	35.34	258,512.10	
CNH INDUSTRIAL NV	12,812	5.69	72,900.28	
CNP ASSURANCES	2,361	12.44	29,382.64	
COLRUYT NV	947	49.22	46,611.34	
COMMERZBANK AG	14,687	7.26	106,627.62	
CONTINENTAL AG	1,646	187.63	308,847.21	
CREDIT AGRICOLE SA	15,057	9.20	138,539.45	
CRH PLC	12,577	22.98	289,082.34	
DAIMLER AG	14,425	63.21	911,833.10	
DANONE	8,855	60.35	534,399.25	
DASSAULT SYSTEMES SA	1,780	69.75	124,155.00	
DELHAIZE GROUP	1,395	91.41	127,516.95	
DEUTSCHE BANK AG	20,596	15.20	313,059.20	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,883	74.24	214,033.92	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	3,214	13.57	43,639.69	
DEUTSCHE POST AG	14,680	21.03	308,808.48	
DEUTSCHE TELEKOM AG	48,551	15.21	738,509.26	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	4,528	24.22	109,672.68	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	8,109	4.91	39,863.84	
E.ON SE	29,931	8.55	256,149.49	
EDENRED	2,825	15.42	43,561.50	
EDF	3,327	10.42	34,683.97	
ELISA OYJ	2,020	32.44	65,528.80	
ENAGAS SA	2,971	25.40	75,478.25	
ENDESA SA	4,369	16.14	70,537.50	
ENEL GREEN POWER SPA	24,430	1.75	42,899.08	
ENEL SPA	105,981	3.62	383,651.22	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	31,437	2.86	89,909.82	
ENGIE	21,961	14.02	307,893.22	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	38,102	11.92	454,175.84	
ERSTE GROUP BANK AG	3,770	25.02	94,344.25	
ESSILOR INTERNATIONA	3,087	109.35	337,563.45	
EURAZEO	562	51.85	29,139.70	

EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,452	26.78	65,664.56	
EVONIK INDUSTRIES AG	1,863	27.70	51,614.41	
EXOR SPA	1,342	27.72	37,200.24	
FERRARI NV	1,247	34.36	42,846.92	
FERROVIAL S.A.	6,061	18.36	111,310.26	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	12,470	5.69	70,954.30	
FINMECCANICA SPA	5,496	9.30	51,140.28	
FORTUM OYJ	5,995	11.69	70,081.55	
FRAPORT AG	656	52.23	34,262.88	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	3,279	76.65	251,335.35	
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,727	56.67	324,594.90	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	934	36.32	33,922.88	
GALP ENERGIA SGPS SA	5,164	10.35	53,447.40	
GAS NATURAL SDG SA	4,738	16.10	76,281.80	
GEA GROUP AG	2,444	40.16	98,151.04	
GEMALTO	1,084	56.27	60,996.68	
GRIFOLS SA	4,016	19.12	76,806.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,075	68.20	73,315.00	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	7,005	9.32	65,335.63	
HANNOVER RUECK SE	801	92.12	73,788.12	
HEIDELBERGCEMENT AG	1,966	65.82	129,408.01	
HEINEKEN HOLDING NV	1,367	66.12	90,386.04	
HEINEKEN NV	3,446	73.79	254,280.34	
HENKEL AG & CO KGAA	1,400	83.45	116,830.00	
HENKEL KGAA-VORZUG	2,655	97.79	259,637.76	
HERMES INTERNATIONAL	361	320.45	115,682.45	
HUGO BOSS AG	897	69.19	62,063.43	
IBERDROLA SA	80,901	6.01	486,376.81	
ILIAD SA	368	224.10	82,468.80	
IMERYS SA	530	54.36	28,810.80	
INDITEX SA	16,286	28.25	460,160.93	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,920	11.20	189,520.92	
ING GROEP NV	57,967	10.32	598,219.44	
INGENICO GROUP	751	91.52	68,731.52	
INTESA SANPAOLO	200,443	2.32	466,631.30	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	11,154	7.01	78,223.00	

JC DECAUX SA	1,089	35.33	38,474.37	
JERONIMO MARTINS	3,363	12.93	43,500.40	
K+S AG	2,559	18.60	47,617.87	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	350	115.20	40,320.00	
KBC GROUP SA	3,685	46.13	169,989.05	
KERING	1,085	159.35	172,894.75	
KERRY GROUP PLC-A	2,435	72.23	175,880.05	
KONE OYJ	5,045	40.34	203,515.30	
KONINKLIJKE AHOLD NV	12,496	19.84	247,920.64	
KONINKLIJKE DSM NV	2,427	43.44	105,441.01	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	14,259	22.39	319,259.01	
L'OREAL SA	3,777	154.65	584,113.05	
LAGARDERE S.C.A.	1,711	26.63	45,572.48	
LANXESS	1,223	37.65	46,045.95	
LEGRAND SA	4,023	44.64	179,606.83	
LINDE AG	2,778	127.00	352,811.55	
LUXOTTICA GROUP SPA	2,357	53.05	125,038.85	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	4,195	154.50	648,127.50	
MAN SE	501	94.24	47,214.24	
MAPFRE SA	13,205	1.73	22,923.88	
MEDIOBANCA SPA	7,640	5.97	45,649.00	
MERCK KGAA	1,844	75.97	140,088.68	
METRO AG	2,356	23.75	55,959.71	
METSO OYJ	1,502	19.98	30,009.96	
MICHELIN (C.G.D.E.)	2,816	85.29	240,176.64	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	2,478	175.51	434,913.78	
NATIXIS	12,811	4.54	58,161.94	
NESTE OYJ	1,726	27.80	47,982.80	
NN GROUP NV	3,172	27.82	88,260.90	
NOKIA OYJ	55,195	5.40	298,053.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,535	33.34	51,176.90	
NUMERICABLE GROUP- W/I	1,506	32.41	48,809.46	
OCI NV	1,143	15.31	17,499.33	
OMV AG	1,971	23.48	46,279.08	
ORANGE S.A.	29,992	15.94	478,072.48	
ORION OYJ-CLASS B	1,394	30.40	42,377.60	
OSRAM LICHT AG	1,192	41.75	49,775.53	
PERNOD-RICARD	3,191	96.80	308,888.80	

PEUGEOT SA	5,981	13.47	80,564.07	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	2,036	40.52	82,498.72	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	3,066	45.40	139,202.53	
PROXIMUS	2,174	30.53	66,372.22	
PRYSMIAN SPA	2,653	17.79	47,196.87	
PUBLICIS GROUPE	2,739	57.25	156,807.75	
QIAGEN NV	3,001	19.24	57,757.24	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	1,554	11.26	17,505.81	
RANDSTAD HOLDINGS NV	1,717	46.69	80,175.31	
RED ELECTRICA DE ESPANA	1,493	71.68	107,018.24	
RELX NV	15,142	14.87	225,237.25	
REMY COINTREAU	337	62.69	21,126.53	
RENAULT SA	2,883	79.53	229,284.99	
REPSOL SA	14,804	8.84	131,000.59	
REXEL SA	4,105	9.95	40,865.27	
ROYAL KPN NV	46,455	3.39	157,621.81	
RTL GROUP	545	74.97	40,861.37	
RWE AG	6,506	10.26	66,784.09	
SAFRAN SA	4,397	53.95	237,218.15	
SAIPEM SPA	3,585	0.33	1,183.05	
SAMPO OYJ	6,663	40.40	269,185.20	
SANOFI	17,734	70.35	1,247,586.90	
SAP SE	14,755	69.70	1,028,467.76	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	8,362	52.36	437,834.32	
SCOR REGROUPE	2,117	31.54	66,780.76	
SIEMENS AG	11,869	84.39	1,001,672.38	
SNAM SPA	29,659	4.90	145,566.37	
SOCIETE BIC SA	404	124.95	50,479.80	
SOCIETE GENERALE	10,863	30.43	330,561.09	
SODEXO	1,276	89.49	114,189.24	
SOLVAY SA	794	80.01	63,527.94	
STMICROELECTRONICS NV	8,661	5.20	45,037.20	
STORA ENSO OYJ	7,438	7.67	57,049.46	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	4,190	16.97	71,125.25	
SYMRISE AG	1,684	57.63	97,048.92	
TECHNIP SA	1,420	39.21	55,685.30	
TELECOM ITALIA SPA	244,090	0.85	208,941.04	

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	8,591	4.57	39,312.41	
	TELEFONICA SA	67,822	9.28	629,659.44	
	TELENET GROUP HOLDING NV	800	47.61	38,088.00	
	TENARIS SA	6,344	9.37	59,443.28	
	TERNA SPA	21,240	4.67	99,360.72	
	THALES SA	1,449	66.13	95,822.37	
	THYSSENKRUPP AG	4,959	14.80	73,393.20	
	TNT EXPRESS NV - W/I	6,965	7.87	54,814.55	
	TOTAL SA	32,603	39.74	1,295,643.22	
	UCB SA	1,770	76.85	136,024.50	
	UMICORE	1,280	38.59	49,401.60	
	UNICREDIT SPA	71,528	3.19	228,603.48	
	UNILEVER NV	24,390	38.92	949,258.80	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA	12,277	3.29	40,415.88	
	UNIPOLSAI SPA	14,495	1.82	26,380.90	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,686	43.87	73,973.25	
	UPM-KYMMENE OYJ	7,188	15.63	112,348.44	
	VALEO SA	1,141	124.10	141,598.10	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	6,377	21.31	135,925.75	
	VINCI SA	7,212	62.89	453,562.68	
	VIVENDI SA	17,659	18.02	318,215.18	
	VOESTALPINE AG	1,536	26.49	40,696.32	
	VOLKSWAGEN AG	481	117.22	56,382.82	
	VOLKSWAGEN AG	2,772	101.70	281,920.71	
	VONOVIA SE	6,991	28.26	197,600.61	
	VOPAK	947	41.31	39,120.57	
	WARTSILA OYJ	1,985	38.25	75,926.25	
	WENDEL	405	85.95	34,809.75	
	WOLTERS KLUWER NV	4,151	31.03	128,805.53	
	ZALANDO SE	1,165	29.00	33,788.49	
	ZARDOYA OTIS SA	2,430	9.25	22,477.50	
	ZODIAC SA	2,725	19.89	54,200.25	
	ユーロ 小計	3,721,597		43,703,985.01 (5,479,168,601)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	180,875	39.35	7,117,431.25	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3,400	63.35	215,390.00	
	BANK OF EAST ASIA	16,600	23.40	388,440.00	

BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	53,039	19.58	1,038,503.62	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD	18,000	12.08	217,440.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	9,000	77.00	693,000.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	39,909	41.30	1,648,241.70	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	40,409	95.60	3,863,100.40	
CLP HOLDINGS LTD	28,143	66.95	1,884,173.85	
FIRST PACIFIC CO	32,000	5.48	175,360.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	31,810	25.75	819,107.50	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	31,157	13.60	423,735.20	
HANG SENG BANK LTD	11,312	126.30	1,428,705.60	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	15,130	41.45	627,138.50	
HONG KONG & CHINA GAS	108,097	13.92	1,504,710.24	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	17,011	171.20	2,912,283.20	
HYSAN DEVELOPMENT CO	9,000	30.35	273,150.00	
KERRY PROPERTIES LTD	9,000	18.82	169,380.00	
LI & FUNG LTD	81,278	4.49	364,938.22	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	12,800	8.76	112,128.00	
MTR CORP	21,255	36.00	765,180.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	73,669	6.23	458,957.87	
NWS HOLDINGS LTD	22,000	11.14	245,080.00	
PCCW LTD	64,000	4.74	303,360.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	19,587	73.90	1,447,479.30	
SANDS CHINA LTD	32,180	26.75	860,815.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	18,000	7.35	132,300.00	
SINO LAND CO	42,000	10.62	446,040.00	
SJM HOLDINGS LTD	26,000	5.50	143,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	27,023	84.95	2,295,603.85	
SWIRE PACIFIC LTD	7,866	75.00	589,950.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	16,400	19.70	323,080.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	18,500	28.10	519,850.00	
WH GROUP LTD	80,000	4.43	354,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	20,733	39.60	821,026.80	
WHEELLOCK & CO LTD	12,000	30.15	361,800.00	

	WYNN MACAU LTD	20,903	8.63	180,392.89	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	10,500	26.80	281,400.00	
香港・ドル	小計	1,280,586		36,406,072.99 (528,616,180)	
合計		17,229,517		44,075,285,993 (44,075,285,993)	

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	4,583.00	82,539.83	
		AMERICAN TOWER REIT INC	6,342.00	553,783.44	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	12,620.00	125,190.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,990.00	338,518.90	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,307.00	259,306.80	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2,474.00	57,718.42	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,164.00	85,949.76	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	5,005.00	427,727.30	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,892.00	154,046.64	
		DUKE REALTY CORP	4,657.00	94,630.24	
		EQUINIX INC	884.00	264,643.08	
		EQUITY RESIDENTIAL	5,454.00	398,796.48	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	969.00	200,699.28	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,614.00	139,126.80	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	964.00	141,611.60	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	8,678.00	227,623.94	
		HCP INC	6,932.00	196,868.80	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	10,603.00	159,681.18	
		IRON MOUNTAIN INC	2,703.00	78,251.85	
		KIMCO REALTY CORP	5,717.00	153,787.30	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	2,000.00	57,240.00	
		MACERICH CO/THE	1,860.00	143,071.20	
		PLUM CREEK TIMBER CO	2,359.00	86,197.86	
PROLOGIS INC	7,784.00	290,576.72			
PUBLIC STORAGE	2,202.00	554,837.94			
REALTY INCOME CORP	3,334.00	200,773.48			

	REGENCY CENTERS CORP	1,279.00	89,990.44	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,652.00	881,321.40	
	SL GREEN REALTY CORP	1,385.00	120,938.20	
	UDR INC	3,550.00	121,268.00	
	VENTAS INC	4,945.00	258,079.55	
	VEREIT	12,190.00	94,106.80	
	VORNADO REALTY TRUST	2,543.00	216,205.86	
	WELLTOWER INC	5,265.00	311,688.00	
アメリカ・ドル 小計		142,900.00	7,566,797.49 (853,913,097)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,894.00	96,215.95	
	HAMMERSON PLC	10,535.00	59,364.72	
	INTU PROPERTIES PLC	12,770.00	36,943.61	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	11,576.00	119,927.36	
	SEGRO PLC	10,105.00	43,875.91	
イギリス・ポンド 小計		58,880.00	356,327.55 (57,482,760)	
オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	15,005.00	110,436.80	
	GOODMAN GROUP	26,454.00	172,215.54	
	GPT GROUP	27,524.00	135,968.56	
	MIRVAC GROUP	57,163.00	106,608.99	
	SCENTRE GROUP	85,045.00	383,552.95	
	STOCKLAND	35,634.00	152,157.18	
	VICINITY CENTRES	51,134.00	154,424.68	
	WESTFIELD CORP	31,608.00	304,385.04	
オーストラリア・ドル 小計		329,567.00	1,519,749.74 (122,750,186)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1,916.00	36,863.84	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,161.00	54,846.18	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	902.00	28,963.22	
カナダ・ドル 小計		4,979.00	120,673.24 (9,879,518)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	28,100.00	66,878.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	27,500.00	38,362.50	
	CAPITALAND MALL TRUST	33,300.00	70,929.00	
	SUNTEC REIT	33,000.00	54,780.00	

シンガポール・ドル 小計		121,900.00	230,949.50 (18,538,316)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	428.00	31,843.20	
	GECINA SA	481.00	54,208.70	
	ICADE	456.00	28,778.16	
	KLEPIERRE	2,973.00	115,188.88	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,479.00	340,243.95	
ユーロ 小計		5,817.00	570,262.89 (71,493,858)	
香港・ドル	LINK REIT	34,871.00	1,509,914.30	
香港・ドル 小計		34,871.00	1,509,914.30 (21,923,956)	
投資証券 合計			1,155,981,691 (1,155,981,691)	
合計			1,155,981,691 (1,155,981,691)	

(注) 通貨種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
1.

(注) 種別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。
2.

(注) 外貨建有価証券の内訳
3.

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	602銘柄	60.08%	65.24%
	投資証券	34銘柄	-%	
イギリス・ポンド	株式	106銘柄	7.51%	8.05%
	投資証券	5銘柄	-%	
イスラエル・シェケル	株式	9銘柄	0.25%	0.26%
オーストラリア・ドル	株式	58銘柄	2.37%	2.77%
	投資証券	8銘柄	-%	
カナダ・ドル	株式	90銘柄	3.30%	3.50%
	投資証券	3銘柄	-%	
シンガポール・ドル	株式	23銘柄	0.45%	0.51%
	投資証券	4銘柄	-%	
スイス・フラン	株式	40銘柄	3.70%	3.90%
スウェーデン・クローナ	株式	29銘柄	1.13%	1.20%
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	0.74%	0.78%
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.06%	0.06%

ノルウェー・クローネ	株式	9銘柄	0.21%	-%	0.23%
ユーロ	株式	228銘柄	11.49%	-%	12.27%
	投資証券	5銘柄	-%	0.15%	
香港・ドル	株式	38銘柄	1.11%	-%	1.22%
	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27年2月23日現在)	(平成28年2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	14,987,772	13,782,884
金銭信託	-	84,310,783
コール・ローン	158,376,605	7,046,368
国債証券	9,974,919,871	7,909,563,357

派生商品評価勘定	37,288	-
未収利息	75,004,646	58,531,213
前払費用	24,845,588	6,494,029
流動資産合計	10,248,171,770	8,079,728,634
資産合計	10,248,171,770	8,079,728,634
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	48,724	761,232
未払金	76,630,521	35,707,501
未払解約金	52,655,428	23,147,597
流動負債合計	129,334,673	59,616,330
負債合計	129,334,673	59,616,330
純資産の部		
元本等		
元本	7,305,510,346	6,098,993,413
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,813,326,751	1,921,118,891
純資産合計	10,118,837,097	8,020,112,304
負債純資産合計	10,248,171,770	8,079,728,634

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27年2月23日現在）	（平成28年2月22日現在）
1. 受益権総口数	7,305,510,346口	6,098,993,413口
2. 1口当たり純資産額	1.3851円	1.3150円
（1万口当たり純資産額）	（13,851円）	（13,150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26年2月22日 至 平成27年2月23日）	（自 平成27年2月24日 至 平成28年2月22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27年2月23日現在)	(平成28年2月22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27年2月23日現在	平成28年2月22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	160,359,008	133,572,114
合計	160,359,008	133,572,114

(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27年2月23日 現在)				(平成28年2月22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	99,614,591	-	99,603,155	11,436	68,058,118	-	67,296,886	761,232
アメリカ・ドル	52,620,425	-	52,615,932	4,493	46,235,349	-	45,665,300	570,049
イギリス・ポンド	8,971,386	-	8,942,230	29,156	2,362,129	-	2,350,307	11,822
カナダ・ドル	3,213,720	-	3,199,261	14,459	1,709,282	-	1,677,609	31,673

スウェーデン・ クローナ	3,010,661	-	3,019,605	8,944	-	-	-	-
ユーロ	31,798,399	-	31,826,127	27,728	17,751,358	-	17,603,670	147,688
合計	99,614,591	-	99,603,155	11,436	68,058,118	-	67,296,886	761,232

(注) 1. 時価の算定方法

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27年2月23日現在)	(平成28年2月22日現在)
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	4,485,540,763円	7,305,510,346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	4,537,837,870円	4,255,788,243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	1,717,868,287円	5,462,305,176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)	566,736,439円	574,139,676円
D C ニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	1,432,950,970円	1,383,232,135円
D C ニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	550,333,214円	507,846,135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)	796,460円	793,190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)	3,257,572,341円	860,707,815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	1,497,120,922円	2,611,637,534円
ニッセイターゲットデートファンドI(適格機関投資家限定)	-円	75,652円
ニッセイターゲットデートファンド(適格機関投資家限定)	-円	76,494円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	-円	158,365,175円
D C ニッセイ外国債券インデックス	-円	2,119,607円

計	7,305,510,346円	6,098,993,413円
---	----------------	----------------

附属明細表（平成28年2月22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	40,000.00	54,874.80	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	30,000.00	41,279.10	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	60,000.00	86,132.40	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	40,000.00	55,801.20	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	40,000.00	55,526.40	
		US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	30,000.00	43,413.00	
		US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	20,000.00	29,146.80	
		US TREASURY N/B 0.625 2017/02/15	40,000.00	40,001.20	
		US TREASURY N/B 0.625 2017/08/31	520,000.00	519,142.00	
		US TREASURY N/B 0.75 2017/03/15	650,000.00	650,832.00	
		US TREASURY N/B 0.75 2017/06/30	490,000.00	490,323.40	
		US TREASURY N/B 0.75 2017/12/31	430,000.00	429,879.60	
		US TREASURY N/B 0.75 2018/03/31	300,000.00	299,904.00	
		US TREASURY N/B 0.875 2017/04/15	640,000.00	641,670.40	
		US TREASURY N/B 0.875 2017/05/15	110,000.00	110,282.70	
		US TREASURY N/B 0.875 2017/06/15	510,000.00	511,213.80	
US TREASURY N/B 0.875 2017/10/15	480,000.00	480,936.00			
US TREASURY N/B 0.875 2019/07/31	270,000.00	268,722.90			

US TREASURY N/B 1 2017/12/15	490,000.00	492,141.30	
US TREASURY N/B 1 2018/03/15	300,000.00	301,488.00	
US TREASURY N/B 1 2018/09/15	320,000.00	321,337.60	
US TREASURY N/B 1 2019/09/30	400,000.00	399,280.00	
US TREASURY N/B 1.125 2018/06/15	310,000.00	312,421.10	
US TREASURY N/B 1.25 2018/11/30	310,000.00	313,208.50	
US TREASURY N/B 1.25 2019/10/31	450,000.00	453,019.50	
US TREASURY N/B 1.375 2018/06/30	280,000.00	283,838.80	
US TREASURY N/B 1.375 2018/09/30	320,000.00	324,524.80	
US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	440,000.00	444,382.40	
US TREASURY N/B 1.375 2020/03/31	460,000.00	464,149.20	
US TREASURY N/B 1.5 2018/12/31	340,000.00	345,790.20	
US TREASURY N/B 1.625 2019/03/31	400,000.00	408,296.00	
US TREASURY N/B 1.625 2019/06/30	350,000.00	357,287.00	
US TREASURY N/B 1.625 2019/08/31	280,000.00	285,751.20	
US TREASURY N/B 1.625 2019/12/31	470,000.00	479,268.40	
US TREASURY N/B 1.625 2020/06/30	480,000.00	488,884.80	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	240,000.00	242,229.60	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	280,000.00	282,450.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	250,000.00	254,580.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	260,000.00	264,651.40	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	270,000.00	274,344.30	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	240,000.00	243,487.20	
US TREASURY N/B 1.875 2017/10/31	560,000.00	570,343.20	

US TREASURY N/B 2 2020/09/30	470,000.00	486,464.10	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	290,000.00	299,900.60	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	270,000.00	279,374.40	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	230,000.00	237,555.50	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	300,000.00	306,900.00	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	300,000.00	306,513.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	300,000.00	312,384.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	160,000.00	166,617.60	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	340,000.00	353,889.00	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	260,000.00	270,613.20	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	240,000.00	249,561.60	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	280,000.00	291,418.40	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	290,000.00	299,514.90	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	230,000.00	240,915.80	
US TREASURY N/B 2.25 2021/07/31	110,000.00	115,280.00	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	300,000.00	313,416.00	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	300,000.00	313,254.00	
US TREASURY N/B 2.375 2017/07/31	540,000.00	552,781.80	
US TREASURY N/B 2.375 2020/12/31	510,000.00	536,775.00	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	300,000.00	316,650.00	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	240,000.00	256,236.00	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	290,000.00	309,142.90	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	190,000.00	185,873.20	
US TREASURY N/B 2.625 2018/04/30	350,000.00	363,888.00	

US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	470,000.00	498,933.20	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	510,000.00	542,170.80	
US TREASURY N/B 2.75 2019/02/15	400,000.00	421,404.00	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	250,000.00	271,542.50	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	230,000.00	249,738.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	110,000.00	114,373.60	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	130,000.00	134,940.00	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	190,000.00	201,696.40	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	210,000.00	221,753.70	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	70,000.00	76,578.60	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	180,000.00	195,208.20	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	190,000.00	205,680.70	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	180,000.00	195,130.80	
US TREASURY N/B 3.125 2017/01/31	40,000.00	40,937.20	
US TREASURY N/B 3.125 2019/05/15	330,000.00	352,661.10	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	260,000.00	283,641.80	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	60,000.00	67,270.20	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	80,000.00	89,693.60	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	130,000.00	144,953.90	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	190,000.00	211,375.00	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	190,000.00	221,756.60	
US TREASURY N/B 3.5 2018/02/15	370,000.00	389,698.80	
US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	430,000.00	471,017.70	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	50,000.00	59,974.50	

US TREASURY N/B 3.625 2020/02/15	90,000.00	98,697.60	
US TREASURY N/B 3.625 2021/02/15	290,000.00	322,758.40	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	160,000.00	195,974.40	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	190,000.00	232,548.60	
US TREASURY N/B 3.75 2018/11/15	410,000.00	442,078.40	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	190,000.00	237,988.30	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	70,000.00	88,429.60	
US TREASURY N/B 4 2018/08/15	320,000.00	345,424.00	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	50,000.00	66,689.00	
US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	80,000.00	106,746.40	
US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	30,000.00	40,858.50	
US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	50,000.00	67,832.00	
US TREASURY N/B 4.5 2017/05/15	460,000.00	481,380.80	
US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	60,000.00	82,938.00	
US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	40,000.00	55,400.00	
US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	70,000.00	96,632.20	
US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	90,000.00	126,354.60	
US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	90,000.00	128,927.70	
US TREASURY N/B 5 2037/05/15	30,000.00	44,241.60	
US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	40,000.00	61,104.40	
WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	70,000.00	87,018.40	
WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	100,000.00	135,707.00	
WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	70,000.00	95,317.60	
アメリカ・ドル 小計	28,590,000.00	30,084,334.20 (3,395,017,114)	

イギリス・ボンド	TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	80,000.00	89,077.60	
	TSY 3 3/4% 2020 3.75 2020/09/07	90,000.00	102,393.90	
	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	90,000.00	104,110.20	
	TSY 4 1/2% 2019 4.5 2019/03/07	80,000.00	89,870.40	
	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	100,000.00	137,339.00	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	90,000.00	130,349.70	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	100,000.00	134,245.00	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	70,000.00	100,761.50	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	60,000.00	77,208.00	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	90,000.00	118,707.30	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	60,000.00	81,892.80	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	80,000.00	110,244.00	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	80,000.00	124,460.00	
	TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	80,000.00	93,252.80	
	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	80,000.00	110,374.40	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	60,000.00	70,980.60	
	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	70,000.00	106,556.80	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	70,000.00	101,710.70	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	70,000.00	92,157.80	
	TSY 5% 2018 5 2018/03/07	90,000.00	98,704.80	
	TSY 8% 2021 8 2021/06/07	60,000.00	82,360.20	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	50,000.00	75,419.00	
	UK TSY 1 1/2% 2021 1.5 2021/01/22	60,000.00	61,915.80	
UK TSY 1 3/4% 2019 1.75 2019/07/22	120,000.00	124,682.40		
UK TSY 1% 2017 1 2017/09/07	150,000.00	151,491.00		
UK TSY 1.25% 2018 1.25 2018/07/22	140,000.00	142,751.00		

	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	120,000.00	125,415.60	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	110,000.00	118,528.30	
	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	100,000.00	111,694.00	
	UK TSY 2% 2020 2 2020/07/22	140,000.00	147,600.60	
	UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	110,000.00	115,930.10	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	80,000.00	113,565.60	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	110,000.00	131,310.30	
	UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	70,000.00	96,783.40	
	UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	100,000.00	125,128.00	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	60,000.00	88,617.00	
	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	20,000.00	22,062.00	
イギリス・ボンド 小計		3,190,000.00	3,909,651.60 (630,704,996)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	110,000.00	113,443.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	20,000.00	19,275.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2018/10/21	180,000.00	186,881.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	110,000.00	117,817.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	60,000.00	63,849.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	20,000.00	20,567.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	40,000.00	44,477.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2017/07/21	170,000.00	175,616.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	100,000.00	116,270.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2020/04/15	130,000.00	143,668.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	50,000.00	61,129.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	180,000.00	198,534.60	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	100,000.00	121,526.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	110,000.00	130,287.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	90,000.00	109,267.20	
	Australia Government Bond 4.75 2027/04/21	110,000.00	133,970.10	
オーストラリア・ドル 小計		1,580,000.00	1,756,582.00 (141,879,128)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	20,000.00	25,396.40	
	CANADA GOVT 5.75 2029/06/01	50,000.00	75,399.00	
	CANADA-GOVT 4.25 2018/06/01	40,000.00	43,429.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2017/05/01	30,000.00	29,928.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.25 2017/11/01	60,000.00	59,805.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2020/09/01	60,000.00	60,618.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	30,000.00	30,231.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2017/08/01	320,000.00	323,673.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2018/03/01	130,000.00	132,104.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2018/09/01	50,000.00	51,010.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2020/03/01	40,000.00	41,608.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	60,000.00	62,525.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	40,000.00	41,052.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2019/03/01	50,000.00	51,939.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2019/09/01	50,000.00	52,226.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	60,000.00	66,006.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	60,000.00	67,082.40	
CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	60,000.00	67,243.80		
CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	30,000.00	35,798.40		

	CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	60,000.00	68,165.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2020/06/01	70,000.00	78,862.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	70,000.00	95,095.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	80,000.00	88,488.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	70,000.00	98,865.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	60,000.00	92,482.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	60,000.00	95,749.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	20,000.00	33,955.00	
カナダ・ドル 小計		1,730,000.00	1,968,741.50 (161,180,867)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	30,000.00	30,744.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2017/04/01	40,000.00	40,660.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	20,000.00	20,426.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.5 2019/06/01	20,000.00	20,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	10,000.00	10,495.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	20,000.00	20,511.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	10,000.00	10,535.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	20,000.00	20,948.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	30,000.00	32,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	30,000.00	32,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.25 2020/09/01	40,000.00	42,940.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	10,000.00	11,164.90	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	20,000.00	22,350.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 4 2018/09/01	40,000.00	42,920.00	
シンガポール・ドル 小計		340,000.00	358,845.30 (28,804,512)	

スイス・フラン	Switzerland Government Bond 2.25 2020/07/06	180,000.00	205,335.00	
スイス・フラン 小計		180,000.00	205,335.00 (23,375,336)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	190,000.00	194,508.70	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	330,000.00	360,211.50	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	250,000.00	294,955.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	400,000.00	484,316.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	200,000.00	273,956.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.75 2017/08/12	350,000.00	372,312.50	
	SWEDISH GOVERNMENT 4.25 2019/03/12	470,000.00	537,755.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 5 2020/12/01	360,000.00	448,272.00	
スウェーデン・クローナ 小計		2,550,000.00	2,966,286.90 (39,570,267)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	260,000.00	285,370.80	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	260,000.00	290,391.40	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	420,000.00	493,214.40	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2017/11/15	240,000.00	258,484.80	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2019/11/15	430,000.00	498,198.00	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	560,000.00	970,972.80	
	KINGDOM OF DENMARK 7 2024/11/10	130,000.00	205,695.10	
デンマーク・クローネ 小計		2,300,000.00	3,002,327.30 (50,439,099)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	90,000.00	93,355.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	270,000.00	286,829.10	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	240,000.00	273,160.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	340,000.00	390,585.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.25 2017/05/19	250,000.00	261,312.50	

	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	360,000.00	405,342.00	
ノルウェー・クローネ	小計	1,550,000.00	1,710,584.80 (22,511,296)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2018/07/25	200,000.00	204,920.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	60,000.00	57,735.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	130,000.00	134,832.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	120,000.00	131,370.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2017/10/25	250,000.00	265,852.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2020/10/25	190,000.00	216,847.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	180,000.00	203,752.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	150,000.00	177,420.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	110,000.00	132,111.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	40,000.00	50,764.00	
ポーランド・ズロチ	小計	1,430,000.00	1,575,604.50 (45,188,337)	
マレーシア・リン ギット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.314 2017/10/31	210,000.00	212,091.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	80,000.00	78,320.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	60,000.00	58,353.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.58 2018/09/28	160,000.00	161,120.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	50,000.00	47,660.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	20,000.00	18,553.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.889 2020/07/31	140,000.00	141,850.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	60,000.00	58,146.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	50,000.00	50,117.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	30,000.00	29,044.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	60,000.00	60,696.00	

	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	60,000.00	61,309.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	70,000.00	72,128.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	30,000.00	30,987.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	130,000.00	133,120.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT 4.378 2019/11/29	180,000.00	185,670.00	
マレーシア・リングgit 小計		1,390,000.00	1,399,169.40 (37,455,765)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	1,140,000.00	1,453,044.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	340,000.00	463,994.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 4.75 2018/06/14	2,150,000.00	2,147,226.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5 2019/12/11	340,000.00	335,277.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	120,000.00	116,442.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	850,000.00	883,158.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	500,000.00	517,440.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	410,000.00	452,082.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2017/12/14	1,250,000.00	1,324,650.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	500,000.00	556,180.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	240,000.00	267,518.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	630,000.00	705,228.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	660,000.00	724,851.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	510,000.00	575,570.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	540,000.00	643,323.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	480,000.00	577,560.00	
メキシコ・ペソ 小計		10,660,000.00	11,743,548.00 (72,692,562)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	80,000.00	81,913.60	

BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	20,000.00	20,631.80	
BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	20,000.00	19,639.60	
BELGIUM KINGDOM 1.25 2018/06/22	40,000.00	41,573.20	
BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	20,000.00	21,704.40	
BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	60,000.00	69,142.80	
BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	70,000.00	82,917.80	
BELGIUM KINGDOM 3 2019/09/28	70,000.00	78,388.80	
BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	30,000.00	38,645.10	
BELGIUM KINGDOM 3.5 2017/06/28	40,000.00	42,124.80	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	80,000.00	94,736.80	
BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	40,000.00	60,752.00	
BELGIUM KINGDOM 4 2017/03/28	40,000.00	41,940.40	
BELGIUM KINGDOM 4 2018/03/28	50,000.00	54,665.00	
BELGIUM KINGDOM 4 2019/03/28	60,000.00	68,160.60	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	60,000.00	74,800.80	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	40,000.00	56,929.60	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	70,000.00	87,126.20	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	80,000.00	102,188.80	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	70,000.00	111,517.70	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	40,000.00	55,436.40	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	90,000.00	147,506.40	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2017/09/28	60,000.00	65,709.00	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	90,000.00	138,725.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2018/04/30	90,000.00	90,192.60	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2019/01/31	20,000.00	19,988.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.5 2017/10/31	80,000.00	80,595.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.15 2020/07/30	80,000.00	81,846.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2020/01/31	100,000.00	103,493.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	90,000.00	89,742.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	50,000.00	50,753.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	50,000.00	48,556.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.1 2017/04/30	120,000.00	122,952.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	110,000.00	114,238.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2019/04/30	100,000.00	107,721.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	110,000.00	120,000.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.75 2018/10/31	80,000.00	87,611.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2017/01/31	60,000.00	62,139.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	100,000.00	117,159.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4 2020/04/30	100,000.00	114,117.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.1 2018/07/30	100,000.00	109,521.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	80,000.00	100,274.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	90,000.00	102,692.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	90,000.00	109,703.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.5 2018/01/31	90,000.00	97,630.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.6 2019/07/30	80,000.00	91,529.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	80,000.00	100,597.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	60,000.00	81,030.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	70,000.00	87,559.50	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	60,000.00	82,909.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	60,000.00	80,566.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	50,000.00	72,463.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	110,000.00	140,496.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2017/07/30	90,000.00	97,065.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	110,000.00	136,296.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	100,000.00	128,149.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	60,000.00	83,141.40	
BTPS 6.5 11/01/27 6.5 2027/11/01	120,000.00	178,718.40	
BUNDES OblIGATION 0 2020/04/17	90,000.00	91,604.70	
BUNDES OblIGATION 0.25 2018/04/13	80,000.00	81,323.20	
BUNDES OblIGATION 0.25 2019/10/11	90,000.00	92,355.30	
BUNDES OblIGATION 0.25 2020/10/16	90,000.00	92,670.30	
BUNDES OblIGATION 0.5 2017/10/13	90,000.00	91,506.60	
BUNDES OblIGATION 0.5 2019/04/12	70,000.00	72,181.90	
BUNDES OblIGATION 1 2018/10/12	80,000.00	83,179.20	
BUNDES OblIGATION 1 2019/02/22	190,000.00	198,523.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	110,000.00	114,116.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	20,000.00	20,606.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	70,000.00	75,952.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	110,000.00	118,993.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	190,000.00	211,606.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	80,000.00	89,422.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	80,000.00	89,630.40	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	80,000.00	90,157.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	140,000.00	160,431.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	90,000.00	102,070.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	80,000.00	92,818.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	100,000.00	114,151.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	70,000.00	98,729.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	60,000.00	85,524.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3 2020/07/04	170,000.00	195,564.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2020/01/04	110,000.00	125,877.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	160,000.00	191,024.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	70,000.00	109,891.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2019/07/04	100,000.00	113,480.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2018/01/04	160,000.00	173,566.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	90,000.00	145,817.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2018/07/04	90,000.00	100,210.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	60,000.00	104,032.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	90,000.00	153,844.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	70,000.00	130,854.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	30,000.00	53,679.30	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2017/06/16	170,000.00	171,116.90	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2017/09/15	150,000.00	151,212.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2017/12/15	140,000.00	141,328.60	
BUONI POLIENNALI DEL 9 2023/11/01	70,000.00	109,784.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.25 2018/05/15	180,000.00	180,655.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES 0.7 2020/05/01	70,000.00	70,768.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.75 2018/01/15	120,000.00	121,645.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.05 2019/12/01	70,000.00	71,892.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.15 2017/05/15	120,000.00	121,930.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	180,000.00	185,104.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	90,000.00	90,306.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	70,000.00	66,777.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	50,000.00	51,947.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	80,000.00	86,125.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2019/05/01	80,000.00	85,781.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	90,000.00	97,755.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	60,000.00	67,357.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2018/12/01	90,000.00	98,361.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	80,000.00	95,141.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	110,000.00	127,087.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	70,000.00	81,074.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	250,000.00	290,602.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	90,000.00	106,820.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2017/02/01	210,000.00	217,919.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	200,000.00	231,522.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	120,000.00	151,041.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/02/01	220,000.00	246,351.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	180,000.00	204,922.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2020/03/01	160,000.00	184,766.40	

BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/02/01	110,000.00	119,462.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/08/01	160,000.00	177,092.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	80,000.00	98,713.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	110,000.00	136,614.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	80,000.00	101,598.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	100,000.00	125,613.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	80,000.00	105,690.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	70,000.00	99,502.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	110,000.00	142,676.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	100,000.00	141,055.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	90,000.00	129,825.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	90,000.00	129,426.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2017/08/01	100,000.00	107,528.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	130,000.00	181,347.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	150,000.00	192,795.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	100,000.00	128,855.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	70,000.00	105,361.20	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	50,000.00	76,851.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	80,000.00	137,127.20	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	70,000.00	113,558.90	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	50,000.00	85,085.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	20,000.00	19,368.80	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	20,000.00	20,708.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2018/09/15	20,000.00	20,798.60	

FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	20,000.00	21,955.80	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	20,000.00	22,111.00	
FINNISH GOVERNMENT 1.875 2017/04/15	20,000.00	20,539.60	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	30,000.00	34,161.60	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	20,000.00	26,706.00	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	20,000.00	24,696.20	
FINNISH GOVERNMENT 3.375 2020/04/15	60,000.00	69,059.40	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	30,000.00	35,661.00	
FINNISH GOVERNMENT 3.875 2017/09/15	30,000.00	32,055.00	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	30,000.00	39,861.30	
FINNISH GOVERNMENT 4.375 2019/07/04	20,000.00	23,193.20	
FRANCE (GOVT OF) 0 2018/02/25	110,000.00	110,925.10	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2020/11/25	90,000.00	91,752.30	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	140,000.00	140,280.00	
FRANCE (GOVT OF) 1 2018/11/25	280,000.00	290,438.40	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	90,000.00	93,754.80	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	40,000.00	42,269.20	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	200,000.00	223,230.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	140,000.00	156,503.20	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	120,000.00	137,440.80	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	140,000.00	162,300.60	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2020/10/25	150,000.00	168,864.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	150,000.00	179,677.50	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	160,000.00	194,960.00	

FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	180,000.00	213,413.40	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	180,000.00	213,904.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	80,000.00	111,804.80	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	250,000.00	289,247.50	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	160,000.00	205,856.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2017/04/25	200,000.00	209,854.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2019/10/25	320,000.00	367,648.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	170,000.00	204,362.10	
FRANCE (GOVT OF) 4 2018/04/25	240,000.00	263,061.60	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	110,000.00	165,663.30	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	70,000.00	116,406.50	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	50,000.00	84,481.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2017/10/25	170,000.00	183,341.60	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2019/04/25	240,000.00	274,982.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	190,000.00	248,909.50	
FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	120,000.00	197,632.80	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	110,000.00	175,566.60	
FRANCE O.A.T. 5.75 2032/10/25	130,000.00	221,830.70	
FRENCH OAT 5.5 2029/04/25	130,000.00	204,571.90	
FRENCH OAT 6 2025/10/25	110,000.00	167,813.80	
FRENCH TREASURY NOTE 1 2017/07/25	120,000.00	122,460.00	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	30,000.00	30,991.50	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	20,000.00	20,099.40	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	20,000.00	20,678.20	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	40,000.00	45,625.20	

IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	40,000.00	48,592.80	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	30,000.00	37,271.40	
IRISH TSY 5.5% 2017 5.5 2017/10/18	30,000.00	32,855.40	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	50,000.00	77,090.50	
ITALY BTP 6 2031/05/01	140,000.00	210,952.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2018/04/15	70,000.00	70,683.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2020/01/15	70,000.00	71,663.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	70,000.00	69,468.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2017/04/15	60,000.00	60,683.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.25 2018/01/15	80,000.00	82,637.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.25 2019/01/15	70,000.00	73,388.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	70,000.00	78,788.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	60,000.00	69,114.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	50,000.00	63,222.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	50,000.00	72,425.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	70,000.00	83,116.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.5 2020/07/15	80,000.00	93,516.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	60,000.00	75,718.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	70,000.00	114,881.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2018/07/15	60,000.00	66,450.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2019/07/15	70,000.00	80,486.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	60,000.00	95,496.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4.5 2017/07/15	60,000.00	64,185.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	60,000.00	94,287.00	

Netherlands Government Bond 2.25 2022/07/15	70,000.00	80,478.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.15 2018/10/19	80,000.00	83,397.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	30,000.00	31,980.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	60,000.00	66,744.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	40,000.00	44,799.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	30,000.00	36,374.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	30,000.00	43,089.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	50,000.00	61,344.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	70,000.00	84,235.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	40,000.00	49,154.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	20,000.00	35,751.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 3.9 2020/07/15	60,000.00	71,084.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	50,000.00	77,693.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.3 2017/09/15	80,000.00	86,004.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.35 2019/03/15	110,000.00	125,939.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	40,000.00	56,919.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	30,000.00	48,455.40	
SPANISH GOVT 6 2029/01/31	100,000.00	144,397.00	
SPANISH GOVT 5.75 07 5.75 2032/07/30	80,000.00	117,700.80	
Spain Government Bond 4.85 2020/10/31	80,000.00	95,357.60	
TREASURY 4 1/2% 2018 4.5 2018/10/18	40,000.00	44,906.40	
TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	50,000.00	59,336.50	
TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	40,000.00	49,186.00	
TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	50,000.00	69,786.50	

	TREASURY 5.9% 2019 5.9 2019/10/18	60,000.00	72,958.20	
ユーロ	小計	21,500,000.00	25,744,134.50 (3,227,542,142)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	790,000.00	861,171.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	430,000.00	299,056.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	310,000.00	214,287.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	250,000.00	228,800.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	420,000.00	334,084.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.25 2020/01/15	280,000.00	267,178.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	190,000.00	177,254.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2018/12/21	300,000.00	296,454.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	380,000.00	334,487.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2017/09/15	240,000.00	240,588.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	280,000.00	246,890.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	340,000.00	299,404.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	200,000.00	177,438.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	520,000.00	460,324.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	100,000.00	92,176.00	
南アフリカ・ランド	小計	5,030,000.00	4,529,595.60 (33,201,936)	
国債証券	合計		7,909,563,357 (7,909,563,357)	
合計			7,909,563,357 (7,909,563,357)	

(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 113銘柄	42.33%	42.92%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	7.86%	7.97%
オーストラリア・ドル	国債証券 16銘柄	1.77%	1.79%
カナダ・ドル	国債証券 27銘柄	2.01%	2.04%
シンガポール・ドル	国債証券 14銘柄	0.36%	0.36%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.29%	0.30%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.49%	0.50%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.63%	0.64%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.28%	0.28%
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	0.56%	0.57%
マレーシア・リングギット	国債証券 16銘柄	0.47%	0.47%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.91%	0.92%
ユーロ	国債証券 243銘柄	40.24%	40.81%
南アフリカ・ランド	国債証券 15銘柄	0.41%	0.42%

(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28年3月31日現在）

資産総額	4,051,679,776円
負債総額	1,124,308円
純資産総額（ - ）	4,050,555,468円
発行済数量	2,491,611,354口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6257円

「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」（平成28年3月31日現在）

資産総額	13,269,678,528円
負債総額	10,235,838円
純資産総額（ - ）	13,259,442,690円
発行済数量	7,350,995,960口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8038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28年3月31日現在）

資産総額	7,441,588,473円
負債総額	7,824,331円
純資産総額（ - ）	7,433,764,142円
発行済数量	3,786,998,705口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9630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28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28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	291	46,807
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	45	8,477
単位型公社債投資信託	4	196
合計	340	55,481

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20期事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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21期事業年度に係る中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,509,845		3,488,730
有価証券		7,325,806		5,209,385
前払費用		207,351		499,710
未収委託者報酬		1,897,225		2,778,650
未収運用受託報酬		1,419,102		1,519,030
未収投資助言報酬		190,027		216,814
繰延税金資産		406,503		417,418
その他		26,376		52,788
流動資産合計		12,982,239		14,182,529
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	102,335	1	88,529
車両	1	1,009	1	588
器具備品	1	105,718	1	90,111

有形固定資産合計	209,063	179,229
無形固定資産		
ソフトウェア	949,954	854,449
ソフトウェア仮勘定	28,053	17,421
その他	8,107	8,075
無形固定資産合計	986,115	879,946
投資その他の資産		
投資有価証券	31,159,584	35,677,217
関係会社株式	66,222	66,222
長期前払費用	-	175,262
差入保証金	284,888	284,888
繰延税金資産	160,839	-
その他	17	17
投資その他の資産合計	31,671,552	36,203,608
固定資産合計	32,866,731	37,262,784
資産合計	45,848,971	51,445,314

負債の部

流動負債

預り金	29,930	33,209
未払償還金	137,842	137,094
未払手数料	711,826	995,185
未払運用委託報酬	508,934	655,766
未払投資助言報酬	310,490	410,223
その他未払金	248,117	324,326
未払費用	79,355	97,490
未払法人税等	1,283,286	1,556,244
賞与引当金	769,569	787,638
その他	168,940	498,615
流動負債合計	4,248,293	5,495,794

固定負債

退職給付引当金	1,106,561	1,253,790
役員退職慰労引当金	19,950	25,400

繰延税金負債	-	13,483
固定負債合計	1,126,511	1,292,673
負債合計	5,374,805	6,788,467
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	20,276,469	23,998,814
利益剰余金合計	20,956,276	24,678,621
株主資本合計	39,238,116	42,960,461
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,236,049	1,696,385
評価・換算差額等合計	1,236,049	1,696,385
純資産合計	40,474,166	44,656,846
負債・純資産合計	45,848,971	51,445,314

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	12,436,743	15,670,934
運用受託報酬	6,674,387	7,825,480
投資助言報酬	791,350	872,448
業務受託料	47,100	47,100

営業収益計		19,949,580		24,415,963
営業費用				
支払手数料		5,367,041		6,834,391
広告宣伝費		13,397		28,551
公告費		161		-
調査費		3,767,832		4,581,959
支払運用委託報酬		1,587,647		1,811,448
支払投資助言報酬		1,228,668		1,722,179
委託調査費		66,025		80,518
調査費		885,490		967,812
委託計算費		128,890		148,832
営業雑経費		538,997		581,870
通信費		55,199		53,825
印刷費		147,275		170,610
協会費		20,172		21,379
その他営業雑経費		316,349		336,053
営業費用計		9,816,320		12,175,604
一般管理費				
役員報酬	1	63,866	1	62,272
給料・手当		2,906,149		2,905,979
賞与引当金繰入額		766,843		782,365
賞与		248,914		237,611
福利厚生費		569,577		532,618
退職給付費用		241,558		283,064
役員退職慰労引当金繰入額		7,300		7,250
その他人件費		97,103		101,498
不動産賃借料		574,467		544,587
その他不動産経費		26,330		25,737
交際費		14,005		20,059
旅費交通費		79,754		100,791
固定資産減価償却費		511,498		440,227
租税公課		93,822		104,874
業務委託費		208,262		194,856
器具備品費		143,717		156,991
保守料		83,044		-
保険料		59,043		56,700
諸経費		48,305		135,187
一般管理費計		6,743,562		6,692,676

営業利益		3,389,697		5,547,682
営業外収益				
受取利息		166		274
有価証券利息		76,250		70,792
受取配当金	4	81,042	4	177,354
為替差益		20,176		31,164
その他営業外収益		13,559		6,906
営業外収益計		191,194		286,492
営業外費用				
控除対象外消費税		4,451		19,444
その他営業外費用		1,182		6,244
営業外費用計		5,634		25,689
経常利益		3,575,257		5,808,485
特別利益				
投資有価証券売却益		1,377		366,068
投資有価証券償還益		102,298		15,343
特別利益計		103,675		381,411
特別損失				
投資有価証券償還損		6,903		-
固定資産除却損	3	8,924	3	8,042
事故損失賠償金	2	2,387	2	25,550
寄付金		142,550		-
特別損失計		160,764		33,593
税引前当期純利益		3,518,168		6,156,304
法人税、住民税及び事業税		1,474,066		2,284,237
法人税等調整額		95,320		14,162
法人税等合計		1,378,745		2,298,400
当期純利益		2,139,422		3,857,904

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金					
					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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金					
					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

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
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,857,904	3,857,904	3,857,904
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,722,344	3,722,344	3,722,344
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	3,857,904
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	460,336	460,336	460,336
当期変動額合計	460,336	460,336	4,182,680
当期末残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846

注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法(定額法)によっております。 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。

	<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。 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>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当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。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。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、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、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。</p>
5. リース取引の処理方法	<p>平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>
6. 消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

(貸借対照表関係)

1. 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	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
建物	254,648千円	272,378千円
車両	6,004	6,425
器具備品	520,399	481,704
計	781,053	760,508

(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25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
器具備品	8,924千円	4,128千円
その他	-	3,914
計	8,924	8,042
4. 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。		
	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
関係会社からの受取配当金	-	41,126千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 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

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 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

平成26年6月26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26年3月31日

効力発生日 平成26年6月26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27年6月25日開催の定時株主総会において、次のとおり決議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27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引は、リース取引開始日が「リース取引に関する会計基準」適用初年度開始前であるため、通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理によっております。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期末残高相当額 (単位：千円)

	前事業年度（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

(単位：千円)

	当事業年度（平成27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	-	-	-

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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1年内	107	-
1年超	-	-

合計	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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
支払リース料	186	108
減価償却費相当額	172	100
支払利息相当額	6	1

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次表に含まれておりません(注2)を参照下さい。

前事業年度(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	23,299,720	72,529
その他有価証券	7,864,894	7,864,894	-

当事業年度(平成27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	3,488,730	3,488,730	-

有価証券			
満期保有目的の債券	5,209,385	5,215,010	5,624
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,414,879	22,498,520	83,640
その他有価証券	13,194,837	13,194,837	-

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27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等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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。

当事業年度(平成27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	3,488,730	-	-	-

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	5,200,000	22,400,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	990,647	9,384,052	1,683,297	3,372
合計	9,679,377	31,784,052	1,683,297	3,372

（注）投資信託受益証券、国債であります。

（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

当事業年度（平成27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	26,620,113	26,710,130	90,016
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,620,113	26,710,130	90,016
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	1,004,151	1,003,400	751
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,004,151	1,003,400	751
合計		27,624,265	27,713,530	89,264

2．その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価または 償却原価 （千円）	差額 （千円）

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	1,799,820	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または償却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

当事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価または 償却原価 （千円）	差額 （千円）
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	3,113,940	3,105,255	8,684
	国債・地方債等	3,113,940	3,105,255	8,684
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
(3)その他（注1）	7,809,441	5,421,939	2,387,501	
	小計	10,923,381	8,527,195	2,396,186
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	1,900,070	1,902,293	2,223
	国債・地方債等	1,900,070	1,902,293	2,223
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
(3)その他（注1）	371,386	376,170	4,783	
	小計	2,271,456	2,278,463	7,006
	合計	13,194,837	10,805,658	2,389,179

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）非上場株式（当事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は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（当事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、前事業年度の貸借対照表計上額は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。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（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	-

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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	1,249,329	366,068	-
合計	1,249,329	366,068	-

（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、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

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。

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

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	1,106,561 千円
退職給付費用	215,268
退職給付の支払額	68,039
退職給付引当金の期末残高	1,253,790

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	215,268 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、44,254千円であります。

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(流動資産)		
繰延税金資産		
賞与引当金	274,274 千円	260,708 千円
未払事業税	98,319	120,645
その他	33,928	36,064
繰延税金資産合計	406,523	417,418
繰延税金負債		
有価証券評価差額	19	-
繰延税金負債合計	19	-
繰延税金資産の純額	406,503	417,418
(固定資産)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	394,378	405,952

税務上の繰延資産償却超過額	7,110	4,573
役員退職慰労引当金	3,835	8,214
投資有価証券評価損	486,598	406,043
投資有価証券評価差額	4,898	2,266
その他	2,461	1,703
小計	899,283	828,753
評価性引当額	97,929	90,623
繰延税金資産合計	801,354	738,130
繰延税金負債		
特別分配金否認	92,089	56,555
投資有価証券評価差額	548,424	695,058
繰延税金負債合計	640,514	751,613
繰延税金資産(は負債)の純額	160,839	13,483

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	38.01 %	法定実効税率	35.64 %
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.15	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.09
住民税均等割	0.17	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.26
税率変更に伴う影響	0.98	住民税均等割	0.09
特定外国子会社留保金課税	0.67	税率変更に伴う影響	1.63
所得拡大促進税制による特別控除額	0.60	特定外国子会社留保金課税	0.44
その他	0.20	所得拡大促進税制による特別控除額	0.37
税効果会計適用後の法人税等の負担率	39.19	その他	0.06
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.33

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27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。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、前事業年度の35.64%から平成27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は33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%に、それぞれ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32,758千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が100,766千円、その他有価証券評価差額金が68,007千円、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

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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	4,553,051
------------	-----------

[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	-	-

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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	200,000	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	3,829,599	未収運用受託報酬	767,087
								投資助言報酬の受取	676,352	未収投資助言報酬	158,782
								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、協議の上決定しております。

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25年4月1日 至平成26年3月31日)	当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	373,212円65銭	411,781円19銭
1株当たり当期純利益金額	19,727円63銭	35,573円77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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
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21期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,317,001
有価証券		6,604,052
前払費用		575,114
未収委託者報酬		3,182,655
未収運用受託報酬		1,977,949
未収投資助言報酬		213,262
繰延税金資産		285,665
その他		70,176
流動資産合計		17,225,876
固定資産		
有形固定資産	1	180,828
無形固定資産		847,760
投資その他の資産		
投資有価証券		35,274,476
関係会社株式		66,222
長期前払費用		25,037
差入保証金		285,623
繰延税金資産		225,874

その他	1,283
投資その他の資産合計	35,878,518
固定資産合計	36,907,107
資産合計	54,132,984

負債の部

流動負債

預り金	31,701
未払収益分配金	241
未払償還金	134,963
未払手数料	1,143,638
未払運用委託報酬	776,102
未払投資助言報酬	492,881
その他未払金	208,263
未払費用	154,443
未払法人税等	1,562,061
前受投資助言報酬	47,034
賞与引当金	443,027
その他	2 290,439
流動負債合計	5,284,799

固定負債

退職給付引当金	1,340,851
役員退職慰労引当金	24,275
固定負債合計	1,365,126

負債合計

6,649,926

純資産の部

株主資本

資本金	10,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840

利益剰余金

利益準備金	139,807
その他利益剰余金	27,810,746
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	27,270,746
利益剰余金合計	27,950,553
株主資本合計	46,232,393
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,250,664
評価・換算差額等合計	1,250,664
純資産合計	47,483,058
負債・純資産合計	54,132,984

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第21期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	11,359,993
運用受託報酬	4,591,997
投資助言報酬	445,992
営業収益計	16,397,983
営業費用	8,169,317
一般管理費	1 3,442,615
営業利益	4,786,050
営業外収益	2 181,075
営業外費用	3 15,447
経常利益	4,951,678
特別利益	4 79,133
特別損失	5 6,385
税引前中間純利益	5,024,426
法人税、住民税及び事業税	1,506,995
法人税等調整額	109,937
法人税等合計	1,616,933

中間純利益

3,407,492

(3)中間株主資本等変動計算書

第21期中間会計期間(自 平成27年4月 1 日 至 平成27年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計		その他利益剰余金					
					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	23,998,814	24,678,621	42,960,461
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,407,492	3,407,492	3,407,492
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	-	-	-	-	-	-	-	3,271,932	3,271,932	3,271,932
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	27,270,746	27,950,553	46,232,393

	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	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	3,407,492
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	445,720	445,720	445,720
当中間期変動額合計	445,720	445,720	2,826,211
当中間期末残高	1,250,664	1,250,664	47,483,058

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第21期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <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>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当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>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（中間貸借対照表関係）

第21期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）	
1．有形固定資産の減価償却累計額	726,224千円
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21期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
1．減価償却の実施額	
有形固定資産	21,451千円
無形固定資産	169,933千円
2．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	139,966千円
有価証券利息	33,571千円
受取利息	267千円
3．営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	8,471千円
控除対象外消費税	6,477千円
4．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	66,441千円
投資有価証券償還益	7,081千円
事故受取保険金	5,609千円
5．特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	6,192千円
投資有価証券売却損	193千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第21期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27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27年6月25日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成27年3月31日	平成27年6月25日

(金融商品関係)

第21期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成27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	4,317,001	4,317,001	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,604,052	6,618,590	14,537
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,416,134	22,498,420	82,285
その他有価証券	12,790,842	12,790,842	-

(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

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

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

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 その他有価証券」には含めておりません。

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

(有価証券関係)

第21期中間会計期間末(平成27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	29,020,186	29,117,010	96,823
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,020,186	29,117,010	96,823
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,020,186	29,117,010	96,823

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	5,810,267	5,829,720	19,452
	国債・地方債等	5,810,267	5,829,720	19,452
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	4,312,989	6,138,058	1,825,069
小計		10,123,256	11,967,778	1,844,522
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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	941,670	823,064	118,606
小計		941,670	823,064	118,606

合計	11,064,926	12,790,842	1,725,916
----	------------	------------	-----------

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 非上場株式(中間貸借対照表計上額67,500千円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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

(デリバティブ取引関係)

第21期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27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21期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27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21期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27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	2,076,382

[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21期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27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21期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27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21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

	第21期中間会計期間 （自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）
1株当たり純資産額	437,841円71銭
1株当たり中間純利益金額	31,420円52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いません。

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	3,407,492千円
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	3,407,492千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27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。以下において同じ）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27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27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27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	1,300,000百万円	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27年5月21日	有価証券報告書
	有価証券届出書
平成27年11月20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27年6月5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27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．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28年4月7日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

青木裕晃

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27年2月24日から平成28年2月22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28年2月22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28年4月7日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

青木裕晃

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27年2月24日から平成28年2月22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28年2月22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28年4月7日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

青木裕晃

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27年2月24日から平成28年2月22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28年2月22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27年11月30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	牧野あや子	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27年4月1日から平成28年3月31日までの第21期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27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。