

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年11月21日提出
【計算期間】	第14期中（自 平成28年2月23日 至 平成28年8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】	該当事項ありません。

1【ファンドの運用状況】

(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9月30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	3,809,419,883	94.98
内 日本	3,809,419,883	94.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	201,321,334	5.02
純資産総額	4,010,741,217	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9月30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	12,522,335,995	94.96
内 日本	12,522,335,995	94.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	664,328,343	5.04
純資産総額	13,186,664,338	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9月30日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	6,999,610,343	94.94
内 日本	6,999,610,343	94.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	372,777,479	5.06
純資産総額	7,372,387,822	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9月30日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	34,153,765,100	97.93
内 日本	34,153,765,100	97.93
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	722,718,467	2.07
純資産総額	34,876,483,567	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）	754,110,000	2.16
内 日本	754,110,000	2.16

（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9月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	26,316,517,220	99.00
内 日本	26,316,517,220	99.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	265,522,043	1.00
純資産総額	26,582,039,263	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9月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	44,666,977,185	94.48
内 アメリカ	27,360,217,981	57.88
内 イギリス	3,331,436,619	7.05
内 スイス	1,861,634,203	3.94
内 カナダ	1,806,893,314	3.82
内 フランス	1,660,232,967	3.51
内 ドイツ	1,627,044,207	3.44
内 オーストラリア	1,217,796,180	2.58
内 オランダ	985,198,738	2.08
内 アイルランド	813,925,234	1.72
内 スペイン	571,281,080	1.21
内 香港	544,637,552	1.15
内 スウェーデン	539,208,429	1.14
内 デンマーク	331,187,906	0.70
内 シンガポール	322,727,673	0.68
内 イタリア	314,191,479	0.66
内 ベルギー	257,955,956	0.55
内 フィンランド	185,004,883	0.39

内	ジャージー	169,053,710	0.36
内	オランダ領キュラソー	165,196,462	0.35
内	バミューダ	145,531,588	0.31
内	ノルウェー	119,515,440	0.25
内	イスラエル	106,770,341	0.23
内	ケイマン諸島	68,092,009	0.14
内	ニュージーランド	37,416,838	0.08
内	オーストリア	34,008,656	0.07
内	ルクセンブルグ	31,843,233	0.07
内	ポルトガル	27,615,322	0.06
内	イギリス領バージン諸島	12,317,945	0.03
内	バプアニューギニア	11,322,183	0.02
内	マン島	4,934,801	0.01
内	モーリシャス	2,784,256	0.01
投資証券		1,253,407,430	2.65
内	アメリカ	938,861,421	1.99
内	オーストラリア	133,307,100	0.28
内	フランス	75,440,295	0.16
内	イギリス	48,473,844	0.10
内	香港	25,569,686	0.05
内	シンガポール	20,431,494	0.04
内	カナダ	11,323,590	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,354,213,001	2.86
純資産総額		47,274,597,616	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）	1,276,177,936	2.70
内 アメリカ	847,299,648	1.79
内 ドイツ	428,878,288	0.91

（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9月30日現在）

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	8,656,086,785	98.64
内 アメリカ	3,697,866,924	42.14

内 フランス	877,730,785	10.00
内 イタリア	836,768,956	9.54
内 イギリス	680,399,484	7.75
内 ドイツ	652,308,456	7.43
内 スペイン	481,328,210	5.48
内 ベルギー	227,108,664	2.59
内 オランダ	205,942,033	2.35
内 カナダ	177,950,230	2.03
内 オーストラリア	169,664,002	1.93
内 オーストリア	138,498,265	1.58
内 メキシコ	72,752,537	0.83
内 アイルランド	69,845,601	0.80
内 デンマーク	60,841,233	0.69
内 ポーランド	53,816,134	0.61
内 フィンランド	52,927,674	0.60
内 南アフリカ	42,600,191	0.49
内 マレーシア	41,219,436	0.47
内 スウェーデン	40,122,609	0.46
内 シンガポール	32,489,428	0.37
内 ノルウェー	22,787,424	0.26
内 スイス	21,118,509	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	119,546,470	1.36
純資産総額	8,775,633,255	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）【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9月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	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	-
4月末日	4,017,806,158	-	1.6188	-
5月末日	4,066,533,706	-	1.6359	-
6月末日	3,928,450,941	-	1.5785	-
7月末日	3,998,745,850	-	1.6072	-
8月末日	4,013,378,120	-	1.5985	-
9月末日	4,010,741,217	-	1.5896	-

【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

平成28年2月23日～ 平成28年8月22日	-
---------------------------	---

【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
平成28年2月23日～ 平成28年8月22日	0.1

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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9月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	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	-
4月末日	13,177,093,476	-	1.7950	-
5月末日	13,398,894,618	-	1.8194	-
6月末日	12,769,978,755	-	1.7221	-
7月末日	13,149,326,697	-	1.7757	-
8月末日	13,224,372,245	-	1.7699	-
9月末日	13,186,664,338	-	1.7578	-

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
平成28年2月23日 ~ 平成28年8月22日	-

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
平成28年2月23日～ 平成28年8月22日	0.4

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）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9月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	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	-
4月末日	7,399,389,319	-	1.9521	-
5月末日	7,542,985,853	-	1.9845	-
6月末日	7,043,521,053	-	1.8426	-
7月末日	7,338,628,471	-	1.9236	-
8月末日	7,409,804,811	-	1.9214	-
9月末日	7,372,387,822	-	1.9058	-

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
平成28年2月23日～ 平成28年8月22日	-

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
平成28年2月23日～ 平成28年8月22日	0.7

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(又は直近日の基準価額)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、前計算期間未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。)

2【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
平成28年2月23日～ 平成28年8月22日	162,293,602	121,707,903	2,495,913,287

(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
平成28年2月23日～ 平成28年8月22日	402,316,484	227,974,976	7,435,794,217

(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
平成28年2月23日 ~ 平成28年8月22日	241,796,248	163,777,268	3,833,194,696

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

3【ファンドの経理状況】

中間財務諸表

DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月23日から平成28年8月22日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月23日から平成28年8月22日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月23日から平成28年8月22日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （平成28年2月22日現在）	第14期中間計算期間 （平成28年8月22日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	179,091,896	1,109,967
コール・ローン	14,967,805	201,420,273
親投資信託受益証券	3,695,513,517	3,754,705,816
未収入金	25,988,571	1,663,194
流動資産合計	3,915,561,789	3,958,899,250
資産合計	3,915,561,789	3,958,899,250
負債の部		
流動負債		
未払解約金	25,945,201	1,706,944
未払受託者報酬	653,599	642,740
未払委託者報酬	3,268,194	3,213,864
その他未払費用	168,840	166,754
流動負債合計	30,035,834	5,730,302
負債合計	30,035,834	5,730,302
純資産の部		
元本等		
元本	2,455,327,588	2,495,913,287
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,430,198,367	1,457,255,661
純資産合計	3,885,525,955	3,953,168,948
負債純資産合計	3,915,561,789	3,958,899,250

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 （自平成27年2月24日 至平成27年8月23日）	第14期中間計算期間 （自平成28年2月23日 至平成28年8月22日）
営業収益		
受取利息	53,604	1,608
有価証券売買等損益	87,448,378	6,535,477
営業収益合計	87,501,982	6,537,085
営業費用		
支払利息	-	49,889
受託者報酬	645,253	642,740
委託者報酬	3,226,420	3,213,864
その他費用	166,363	170,591
営業費用合計	4,038,036	4,077,084
営業利益又は営業損失（ ）	83,463,946	2,460,001
経常利益又は経常損失（ ）	83,463,946	2,460,001
中間純利益又は中間純損失（ ）	83,463,946	2,460,001
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	8,112,969	2,372,534
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,544,500,671	1,430,198,367
剰余金増加額又は欠損金減少額	160,788,642	97,967,645
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	160,788,642	97,967,645
剰余金減少額又は欠損金増加額	164,551,578	70,997,818
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	164,551,578	70,997,818
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,616,088,712	1,457,255,661

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの中間計算期間 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、前計算期間末日が休業日のため、平成28年2月23日から平成28年8月22日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期中間計算期間 (平成28年8月22日現在)
1. 受益権総口数	2,455,327,588口	2,495,913,287口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5825円 (15,825円)	1.5839円 (15,839円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期中間計算期間 (平成28年8月22日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本額の変動

項目	第13期 （平成28年2月22日現在）	第14期中間計算期間 （平成28年8月22日現在）
期首元本額	2,435,551,135円	2,455,327,588円
期中追加設定元本額	470,047,100円	162,293,602円
期中一部解約元本額	450,270,647円	121,707,903円

【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （平成28年2月22日現在）	第14期中間計算期間 （平成28年8月22日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	577,181,340	3,662,387
コール・ローン	48,238,576	664,595,413
親投資信託受益証券	12,024,823,015	12,340,811,287
未収入金	13,329,627	9,017,935
流動資産合計	12,663,572,558	13,018,087,022
資産合計	12,663,572,558	13,018,087,022
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,175,908	9,335,260
未払受託者報酬	2,189,897	2,101,585
未払委託者報酬	12,409,642	11,909,179
その他未払費用	381,284	373,429
流動負債合計	28,156,731	23,719,453
負債合計	28,156,731	23,719,453
純資産の部		
元本等		
元本	7,261,452,709	7,435,794,217
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,373,963,118	5,558,573,352
純資産合計	12,635,415,827	12,994,367,569
負債純資産合計	12,663,572,558	13,018,087,022

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期中間計算期間 (自平成27年2月24日 至平成27年8月23日)	第14期中間計算期間 (自平成28年2月23日 至平成28年8月22日)
営業収益		
受取利息	183,304	5,269
有価証券売買等損益	342,566,750	64,378,643
営業収益合計	342,750,054	64,383,912
営業費用		
支払利息	-	163,118
受託者報酬	2,212,867	2,101,585
委託者報酬	12,539,758	11,909,179
その他費用	375,179	385,924
営業費用合計	15,127,804	14,559,806
営業利益又は営業損失()	327,622,250	49,824,106
経常利益又は経常損失()	327,622,250	49,824,106
中間純利益又は中間純損失()	327,622,250	49,824,106
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	28,972,969	5,948,799
期首剰余金又は期首欠損金()	6,223,884,729	5,373,963,118
剰余金増加額又は欠損金減少額	493,629,696	309,683,240
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	493,629,696	309,683,240
剰余金減少額又は欠損金増加額	471,289,501	168,948,313
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	471,289,501	168,948,313
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	6,544,874,205	5,558,573,352

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの中間計算期間 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、前計算期間末日が休業日のため、平成28年2月23日から平成28年8月22日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期中間計算期間 (平成28年8月22日現在)
1. 受益権総口数	7,261,452,709口	7,435,794,217口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7401円 (17,401円)	1.7475円 (17,475円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期中間計算期間 (平成28年8月22日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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

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

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期中間計算期間 (平成28年8月22日現在)
期首元本額	7,258,743,523円	7,261,452,709円
期中追加設定元本額	943,466,343円	402,316,484円
期中一部解約元本額	940,757,157円	227,974,976円

【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （平成28年2月22日現在）	第14期中間計算期間 （平成28年8月22日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	319,117,980	2,050,294
コール・ローン	26,670,642	372,056,865
親投資信託受益証券	6,712,687,709	6,881,705,783
未収入金	10,677,342	3,260,869
流動資産合計	7,069,153,673	7,259,073,811
資産合計	7,069,153,673	7,259,073,811
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,582,554	3,335,652
未払受託者報酬	1,255,074	1,173,264
未払委託者報酬	7,949,065	7,430,864
その他未払費用	280,255	266,655
流動負債合計	20,066,948	12,206,435
負債合計	20,066,948	12,206,435
純資産の部		
元本等		
元本	3,755,175,716	3,833,194,696
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,293,911,009	3,413,672,680
純資産合計	7,049,086,725	7,246,867,376
負債純資産合計	7,069,153,673	7,259,073,811

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期中間計算期間 (自平成27年2月24日 至平成27年8月23日)	第14期中間計算期間 (自平成28年2月23日 至平成28年8月22日)
営業収益		
受取利息	106,582	2,922
有価証券売買等損益	222,624,230	56,789,282
営業収益合計	222,730,812	56,792,204
営業費用		
支払利息	-	90,881
受託者報酬	1,289,504	1,173,264
委託者報酬	8,167,064	7,430,864
その他費用	283,686	273,609
営業費用合計	9,740,254	8,968,618
営業利益又は営業損失()	212,990,558	47,823,586
経常利益又は経常損失()	212,990,558	47,823,586
中間純利益又は中間純損失()	212,990,558	47,823,586
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	29,949,377	5,345,377
期首剰余金又は期首欠損金()	4,041,374,812	3,293,911,009
剰余金増加額又は欠損金減少額	445,557,140	221,184,201
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	445,557,140	221,184,201
剰余金減少額又は欠損金増加額	441,324,449	143,900,739
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	441,324,449	143,900,739
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	4,228,648,684	3,413,672,680

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの中間計算期間 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、前計算期間末日が休業日のため、平成28年2月23日から平成28年8月22日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第13期 （平成28年2月22日現在）	第14期中間計算期間 （平成28年8月22日現在）
1. 受益権総口数	3,755,175,716口	3,833,194,696口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8772円 (18,772円)	1.8906円 (18,906円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 （平成28年2月22日現在）	第14期中間計算期間 （平成28年8月22日現在）
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本額の変動

項目	第13期 （平成28年2月22日現在）	第14期中間計算期間 （平成28年8月22日現在）
期首元本額	3,763,295,471円	3,755,175,716円
期中追加設定元本額	684,049,192円	241,796,248円
期中一部解約元本額	692,168,947円	163,777,268円

<参考>

開示対象ファンド（DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型））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、中間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、中間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、中間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28年2月22日現在）	（平成28年8月22日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,552,328,027	2,867,138
コール・ローン	129,737,550	520,285,456
株式	33,569,060,310	33,667,283,460
派生商品評価勘定	2,176,240	6,162,440
未収入金	38,804,780	-
未収配当金	53,632,336	45,905,318
前払金	26,650,000	-
差入委託証拠金	122,130,000	24,000,000
流動資産合計	35,494,519,243	34,266,503,812
資産合計	35,494,519,243	34,266,503,812
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,444,040
前受金	-	1,940,000
未払金	1,295,076,600	-
未払解約金	61,994,903	55,610,331
その他未払費用	-	2,275
流動負債合計	1,357,071,503	58,996,646
負債合計	1,357,071,503	58,996,646
純資産の部		
元本等		
元本	26,708,202,183	26,379,219,864
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,429,245,557	7,828,287,302
純資産合計	34,137,447,740	34,207,507,166
負債純資産合計	35,494,519,243	34,266,503,812

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

	<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>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年2月22日現在)	(平成28年8月22日現在)
1. 受益権総口数	26,708,202,183口	26,379,219,864口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2782円 (12,782円)	1.2968円 (12,968円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年2月22日現在)	(平成28年8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	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

株式関連

種類	（平成28年2月22日 現在）				（平成28年8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	568,920,000	-	571,120,000	2,200,000	515,460,000	-	520,200,000	4,740,000
合計	568,920,000	-	571,120,000	2,200,000	515,460,000	-	520,200,000	4,740,000

（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。

（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28年2月22日現在）	（平成28年8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	29,567,458,266円	26,708,202,183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	11,405,221,135円	4,464,816,630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	14,264,477,218円	4,793,798,949円

元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	8,316,998,974円	8,104,146,800円
ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)	7,359,394,307円	6,940,613,594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)	28,333,451円	17,269,000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)	8,035,580円	8,010,702円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	639,417,761円	606,001,319円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,086,722,705円	2,993,536,716円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,271,160,116円	2,230,146,578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)	106,618,067円	82,396,057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)	634,211,990円	547,007,947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)	524,533,318円	487,057,792円
ニッセイ厚生年金型バランス運用(現物型)DB (適格機関投資家限定)	1,336,991,960円	945,168,160円
DCニッセイ国内株式インデックス	6,973,595円	25,279,695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)	312,638円	- 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)	298,736円	- 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	2,224,600,009円	3,169,860,921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)	163,598,976円	222,379,210円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	- 円	345,373円
計	26,708,202,183円	26,379,219,864円

「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(平成28年2月22日現在)	(平成28年8月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	204,100,084	938,013
コール・ローン	17,057,893	170,216,539
国債証券	25,067,271,251	26,334,850,640
未収利息	100,638,043	92,570,401
前払費用	13,638,500	6,938,129

流動資産合計	25,402,705,771	26,605,513,722
資産合計	25,402,705,771	26,605,513,722
負債の部		
流動負債		
未払解約金	82,121,608	53,707,781
その他未払費用	-	1,414
流動負債合計	82,121,608	53,709,195
負債合計	82,121,608	53,709,195
純資産の部		
元本等		
元本	18,912,024,491	19,374,272,460
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,408,559,672	7,177,532,067
純資産合計	25,320,584,163	26,551,804,527
負債純資産合計	25,402,705,771	26,605,513,722

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28年2月22日現在）	（平成28年8月22日現在）
1. 受益権総口数	18,912,024,491口	19,374,272,460口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3389円 (13,389円)	1.3705円 (13,705円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成28年2月22日現在）	（平成28年8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
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

開示対象ファンドの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28年2月22日現在)	(平成28年8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	27,287,875,419円	18,912,024,491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	11,130,629,869円	5,370,620,053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	19,506,480,797円	4,908,372,084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)	1,340,785,796円	1,389,479,002円
DCニッセイ国内債券インデックス	6,601,563,989円	7,062,654,234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)	27,138,778円	16,458,982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)	4,144,471円	4,110,443円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,287,567,160円	1,304,995,264円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,757,297,518円	2,865,098,626円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	759,246,193円	800,423,851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)	301,966,720円	217,925,894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）	761,580,628円	614,263,580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）	291,676,172円	253,267,868円
ニッセイ厚生年金型バランス運用（現物型）D B（適格機 関投資家限定）	2,402,078,684円	1,500,000,181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	2,216,221,801円	3,131,766,852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）	56,775円	- 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）	56,760円	- 円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス balan スファンド（4資産均等型）	160,643,046円	213,827,683円
計	18,912,024,491円	19,374,272,460円

「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28年2月22日現在）	（平成28年8月22日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,099,792,433	481,763,063
金銭信託	518,887,988	2,133,727
コール・ローン	43,366,643	387,196,944
株式	44,075,285,993	42,988,875,594
投資証券	1,155,981,691	1,188,441,140
派生商品評価勘定	34,132,221	17,573,539
未収入金	33,823,068	9,543
未収配当金	86,271,458	87,571,337
差入委託証拠金	719,888,452	982,112,802
流動資産合計	47,767,429,947	46,135,677,689
資産合計	47,767,429,947	46,135,677,689
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,237,978	4,213,394
未払解約金	57,093,478	24,593,806
その他未払費用	-	2,912
流動負債合計	74,331,456	28,810,112
負債合計	74,331,456	28,810,112
純資産の部		
元本等		
元本	39,165,529,544	37,248,041,684

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,527,568,947	8,858,825,893
純資産合計	47,693,098,491	46,106,867,577
負債純資産合計	47,767,429,947	46,135,677,689

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28年2月22日現在）	（平成28年8月22日現在）
1. 受益権総口数	39,165,529,544口	37,248,041,684口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2177円 (12,177円)	1.2378円 (12,378円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成28年2月22日現在）	（平成28年8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
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成28年2月22日 現在）				（平成28年8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。

株式関連

種類	（平成28年2月22日 現在）				（平成28年8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	2,162,458,998	-	2,179,552,412	17,093,414	1,794,359,127	-	1,807,719,271	13,360,144
合計	2,162,458,998	-	2,179,552,412	17,093,414	1,794,359,127	-	1,807,719,271	13,360,144

（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。

（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28年2月22日現在）	（平成28年8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	32,880,647,674円	39,165,529,544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	21,097,909,350円	9,390,213,499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	14,813,027,480円	11,307,701,359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)	327,907,032円	317,324,154円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,109,450,728円	2,089,980,979円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,745,354,731円	1,751,590,605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)	11,023,720,087円	5,183,339,128円
ニッセイ厚生年金型バランス運用D B(適格機関投資家限定)	6,262,929,248円	3,519,648,158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	17,501,750,595円	23,346,064,768円
D Cニッセイ外国株式インデックス	21,751,286円	812,408,299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)	243,270円	- 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)	200,731円	- 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)	172,221,836円	227,416,910円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	- 円	268,683円
計	39,165,529,544円	37,248,041,684円

「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28年2月22日現在)	(平成28年8月22日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	13,782,884	16,798,956
金銭信託	84,310,783	400,933
コール・ローン	7,046,368	72,755,285
国債証券	7,909,563,357	8,438,133,767
派生商品評価勘定	-	116,806
未収利息	58,531,213	56,215,155
前払費用	6,494,029	6,848,715
流動資産合計	8,079,728,634	8,591,269,617
資産合計	8,079,728,634	8,591,269,617
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	761,232	246,797
未払金	35,707,501	52,629,784
未払解約金	23,147,597	4,994,565
その他未払費用	-	240
流動負債合計	59,616,330	57,871,386
負債合計	59,616,330	57,871,386

純資産の部		
元本等		
元本	6,098,993,413	7,000,938,850
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,921,118,891	1,532,459,381
純資産合計	8,020,112,304	8,533,398,231
負債純資産合計	8,079,728,634	8,591,269,617

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28年2月22日現在)	(平成28年8月22日現在)
1. 受益権総口数	6,098,993,413口	7,000,938,850口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3150円 (13,150円)	1.2189円 (12,189円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年2月22日現在)	(平成28年8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	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

デリバティブ取引

通貨関連

種類	（平成28年2月22日 現在）				（平成28年8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	68,058,118	-	67,296,886	761,232	81,809,002	-	81,679,011	129,991
アメリカ・ドル	46,235,349	-	45,665,300	570,049	55,576,695	-	55,483,604	93,091
イギリス・ポンド	2,362,129	-	2,350,307	11,822	3,553,372	-	3,540,945	12,427
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	2,601,586	-	2,582,445	19,141

カナダ・ドル	1,709,282	-	1,677,609	31,673	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	1,572,578	-	1,559,136	13,442
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	980,062	-	976,511	3,551
ユーロ	17,751,358	-	17,603,670	147,688	17,524,709	-	17,536,370	11,661
合計	68,058,118	-	67,296,886	761,232	81,809,002	-	81,679,011	129,991

（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。

（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28年2月22日現在）	（平成28年8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	7,305,510,346円	6,098,993,413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	4,255,788,243円	2,189,455,519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	5,462,305,176円	1,287,510,082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）	574,139,676円	646,126,393円
D Cニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,383,232,135円	1,595,862,461円
D Cニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	507,846,135円	594,431,015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）	793,190円	791,605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）	860,707,815円	584,924,885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	2,611,637,534円	3,341,998,027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）	75,652円	- 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）	76,494円	- 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）	158,365,175円	232,122,447円
D Cニッセイ外国債券インデックス	2,119,607円	4,587,169円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	- 円	94,848円
計	6,098,993,413円	7,000,938,850円

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

平成28年9月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	308	49,413
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	48	9,493
単位型公社債投資信託	4	159
合計	360	59,067

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）【その他】

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。

5【委託会社等の経理状況】

1.財務諸表の作成方法について

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

2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

前事業年度

当事業年度

(平成27年3月31日)

(平成28年3月31日)

資産の部

流動資産

現金・預金		3,488,730		9,619,679
有価証券		5,209,385		7,602,477
前払費用		499,710		390,202
未収委託者報酬		2,778,650		3,426,935
未収運用受託報酬		1,519,030		1,649,081
未収投資助言報酬		216,814		208,775
繰延税金資産		417,418		480,820
その他		52,788		19,980
流動資産合計		14,182,529		23,397,951

固定資産

有形固定資産

建物	1	88,529	1	80,574
車両	1	588	1	294
器具備品	1	90,111	1	114,079
有形固定資産合計		179,229		194,948

無形固定資産

ソフトウェア		854,449		742,019
ソフトウェア仮勘定		17,421		88,417
その他		8,075		8,043
無形固定資産合計		879,946		838,479

投資その他の資産

投資有価証券		35,677,217		35,476,609
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		285,819
繰延税金資産		-		170,956
その他		17		793
投資その他の資産合計		36,203,608		36,000,401

固定資産合計

固定資産合計		37,262,784		37,033,830
--------	--	------------	--	------------

資産合計

資産合計		51,445,314		60,431,781
------	--	------------	--	------------

負債の部

流動負債

預り金	33,209	34,054
未払収益分配金	-	1,531
未払償還金	137,094	118,764
未払手数料	995,185	1,204,424
未払運用委託報酬	655,766	746,912
未払投資助言報酬	410,223	624,770
その他未払金	324,326	447,074
未払費用	97,490	110,997
未払法人税等	1,556,244	2,793,014
賞与引当金	787,638	864,968
その他	498,615	505,003
流動負債合計	5,495,794	7,451,515

固定負債

退職給付引当金	1,253,790	1,404,058
役員退職慰労引当金	25,400	26,800
繰延税金負債	13,483	-
固定負債合計	1,292,673	1,430,858

負債合計

負債合計	6,788,467	8,882,374
------	-----------	-----------

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	23,998,814	31,277,901

利益剰余金合計	24,678,621	31,957,708
---------	------------	------------

株主資本合計	42,960,461	50,239,548
--------	------------	------------

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,696,385	1,309,858
評価・換算差額等合計	1,696,385	1,309,858
純資産合計	44,656,846	51,549,407
負債・純資産合計	51,445,314	60,431,781

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	15,670,934	23,796,732
運用受託報酬	7,825,480	10,253,108
投資助言報酬	872,448	887,392
業務受託料	47,100	-
営業収益計	24,415,963	34,937,233
営業費用		
支払手数料	6,834,391	10,915,789
広告宣伝費	28,551	59,346
調査費	4,581,959	5,358,400
支払運用委託報酬	1,811,448	2,043,036
支払投資助言報酬	1,722,179	2,189,966
委託調査費	80,518	90,937
調査費	967,812	1,034,460
委託計算費	148,832	189,969
営業雑経費	581,870	712,706
通信費	53,825	47,397
印刷費	170,610	207,694
協会費	21,379	22,682
その他営業雑経費	336,053	434,931
営業費用計	12,175,604	17,236,212
一般管理費		
役員報酬	1 62,272	1 69,958
給料・手当	2,905,979	2,984,319
賞与引当金繰入額	782,365	864,968

賞与		237,611		245,495
福利厚生費		532,618		581,952
退職給付費用		283,064		298,054
役員退職慰労引当金繰入額		7,250		7,450
役員退職慰労金		-		100
その他人件費		101,498		134,593
不動産賃借料		544,587		544,913
その他不動産経費		25,737		25,766
交際費		20,059		24,568
旅費交通費		100,791		114,715
固定資産減価償却費		440,227		401,740
租税公課		104,874		183,280
業務委託費		194,856		225,301
器具備品費		156,991		173,657
保険料		56,700		57,047
諸経費		135,187		146,268
一般管理費計		6,692,676		7,084,153
営業利益		5,547,682		10,616,866
営業外収益				
受取利息		274		747
有価証券利息		70,792		66,047
受取配当金	4	177,354	4	214,632
為替差益		31,164		-
その他営業外収益		6,906		32,180
営業外収益計		286,492		313,608
営業外費用				
為替差損		-		18,136
控除対象外消費税		19,444		10,447
その他営業外費用		6,244		499
営業外費用計		25,689		29,083
経常利益		5,808,485		10,901,391
特別利益				
投資有価証券売却益		366,068		100,523
投資有価証券償還益		15,343		17,323
事故受取保険金		-	5	5,609
特別利益計		381,411		123,456
特別損失				
投資有価証券売却損		-		726

固定資産除却損	3	8,042	3	6,419
事故損失賠償金	2	25,550		-
特別損失計		33,593		7,145
税引前当期純利益		6,156,304		11,017,702
法人税、住民税及び事業税		2,284,237		3,740,258
法人税等調整額		14,162		137,203
法人税等合計		2,298,400		3,603,055
当期純利益		3,857,904		7,414,647

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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									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	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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31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
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	7,414,647	7,414,647	7,414,647
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	7,279,087	7,279,087	7,279,087
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,277,901	31,957,708	50,239,548

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	7,414,647

株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	386,526	386,526	386,526
当期変動額合計	386,526	386,526	6,892,580
当期末残高	1,309,858	1,309,858	51,549,407

注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31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 ...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	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。
5．消費税等の会計処理	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。

(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 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	272,378千円	287,659千円
車両	6,425	6,720
器具備品	481,704	453,566
計	760,508	747,946

(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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	4,128千円	6,419千円
その他	3,914	-
計	8,042	6,419

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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
関係会社からの受取配当金	41,126千円	51,062千円

5. 事故受取保険金は、当社が賠償した当社の事務処理誤り等による受託資産に生じた損失に係る損害賠償責任保険契約に基づき、受取った保険金であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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27年6月25日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月25日
基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの 平成28年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。	
株式の種類	普通株式
配当金の総額	135,560千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,250円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

該当するものではありません。

未経過リース料期末残高相当額等

該当するものではありません。

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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
支払リース料	108	-
減価償却費相当額	100	-
支払利息相当額	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資金運用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
其他有価証券	13,194,837	13,194,837	-

当事業年度（平成28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	9,619,679	9,619,679	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,602,477	7,619,170	16,692
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,118,488	22,356,870	238,381
其他有価証券	13,290,620	13,290,620	-

（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

預金はすべて短期であるため、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

決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28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 其他有価証券」には含めておりません。

また、関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(平成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。

当事業年度(平成28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	9,619,679	-	-	-
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	7,600,000	22,100,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	995,984	11,352,737	851,097	1,017
合計	18,215,663	33,452,737	851,097	1,017

(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

当事業年度(平成28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	29,720,965	29,976,040	255,074
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,720,965	29,976,040	255,074
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,720,965	29,976,040	255,074

2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(平成28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	5,882,680	5,808,946	73,733
	国債・地方債等	5,882,680	5,808,946	73,733
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,418,711	4,470,989	1,947,721
	小計	12,301,391	10,279,936	2,021,454
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）	989,229	1,118,670	129,440
	小計	989,229	1,118,670	129,440
	合計	13,290,620	11,398,606	1,892,014

（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	-

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	2,120,246	100,523	726
合計	2,120,246	100,523	726

（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せん。

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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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せん。

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	1,253,790 千円
退職給付費用	220,314
退職給付の支払額	70,046
退職給付引当金の期末残高	1,404,058

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	220,314 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、46,819千円であります。

（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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
（流動資産）		
繰延税金資産		
賞与引当金	260,708 千円	266,903 千円
未払事業税	120,645	179,194
その他	36,064	34,722
繰延税金資産合計	417,418	480,820
（固定資産）		
繰延税金資産		
退職給付引当金	405,952	430,318
税務上の繰延資産償却超過額	4,573	2,980
役員退職慰労引当金	8,214	8,207
投資有価証券評価損	97,089	36,550
投資有価証券評価差額	2,266	39,867
その他	1,703	2,207
小計	519,799	520,132
評価性引当額	90,623	8,246
繰延税金資産合計	429,176	511,885
繰延税金負債		
特別分配金否認	56,555	68,623
投資有価証券評価差額	386,104	272,306
繰延税金負債合計	442,659	340,929
繰延税金資産(は負債)の純額	13,483	170,956

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

当事業年度

(平成27年3月31日)

(平成28年3月31日)

法定実効税率 (調整)	35.64 %	法定実効税率 (調整)	33.06 %
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.09	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.07
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.26	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.15
住民税均等割	0.09	住民税均等割	0.05
税率変更に伴う影響	1.63	税率変更に伴う影響	0.71
特定外国子会社留保金課税	0.44	特定外国子会社留保金課税	0.16
所得拡大促進税制による特別控除額	0.37	所得拡大促進税制による特別控除額	0.35
評価性引当額の増加	0.03	評価性引当額の増減	0.76
その他	0.03	外国税額控除	0.08
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.33	その他	0.00
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.70

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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28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32.34%から平成28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30.86%に、平成30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30.63%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33,334千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が63,097千円、その他有価証券評価差額金が29,763千円、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

当事業年度(自平成27年4月1日 至平成28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	4,199,085

[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	-	-

当事業年度(自平成27年4月1日 至平成28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	3,566,369	未収運用受託報酬	600,637
								投資助言報酬の受取	632,716	未収投資助言報酬	143,284

(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せん。

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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	411,781円19銭	475,337円55銭
1株当たり当期純利益金額	35,573円77銭	68,370円53銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,857,904千円	7,414,647千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月3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28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。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月11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28年2月23日から平成28年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成28年8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中間計算期間(平成28年2月23日から平成28年8月22日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
1. 上記は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。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月11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28年2月23日から平成28年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成28年8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中間計算期間(平成28年2月23日から平成28年8月22日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
1. 上記は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。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月11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28年2月23日から平成28年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の平成28年8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中間計算期間(平成28年2月23日から平成28年8月22日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
1. 上記は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。