

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券報告書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2017年5月19日提出
<b>【計算期間】</b>	第14期（自 2016年2月23日 至 2017年2月21日）
<b>【ファンド名】</b>	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）
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 赤林 富二
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託企画部 茶木 健
<b>【連絡場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

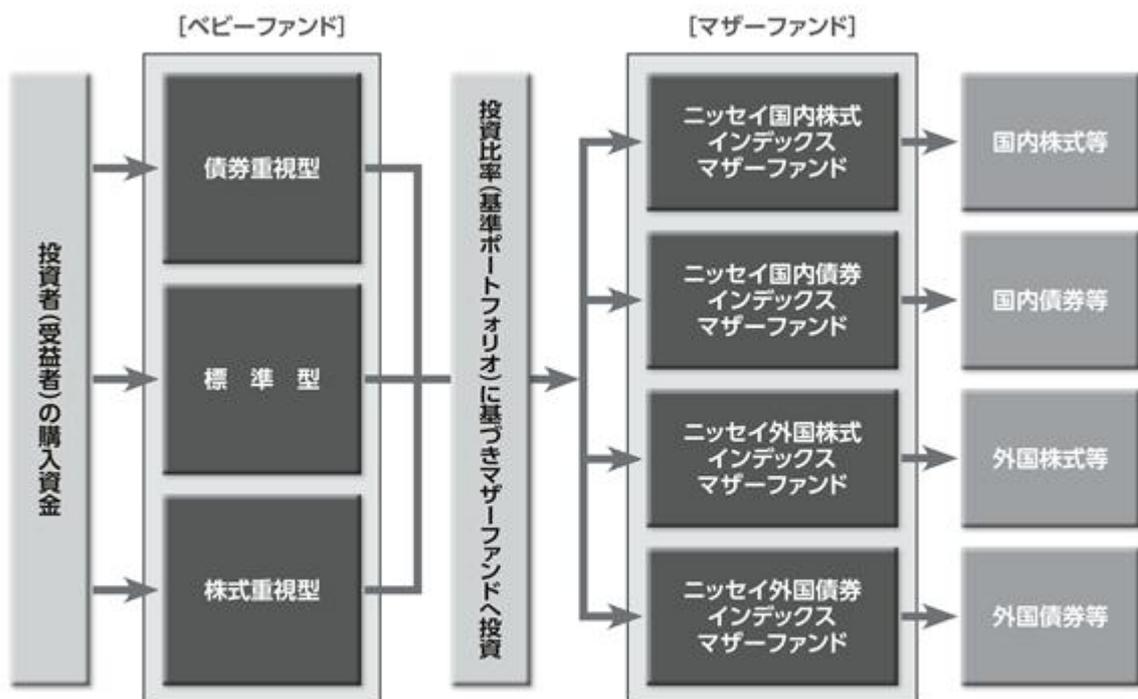
###### 基本方針

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・解約等にとまなない、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)<sup>1</sup>(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<sup>2</sup>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)

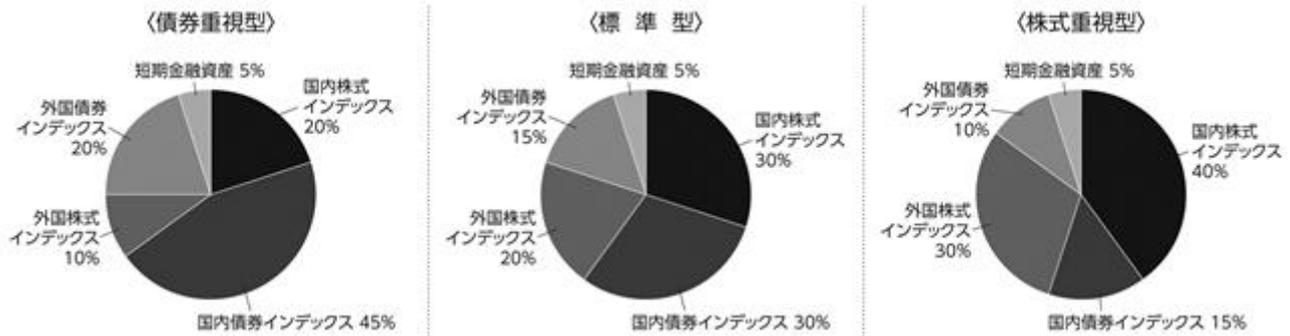
- ・日本を除く世界の主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)<sup>3</sup>の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

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)<sup>4</sup>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に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せん）。

#### 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
		その他資産
追加型		( )
	内外	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	年1回	グローバル (日本含む)  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。
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。

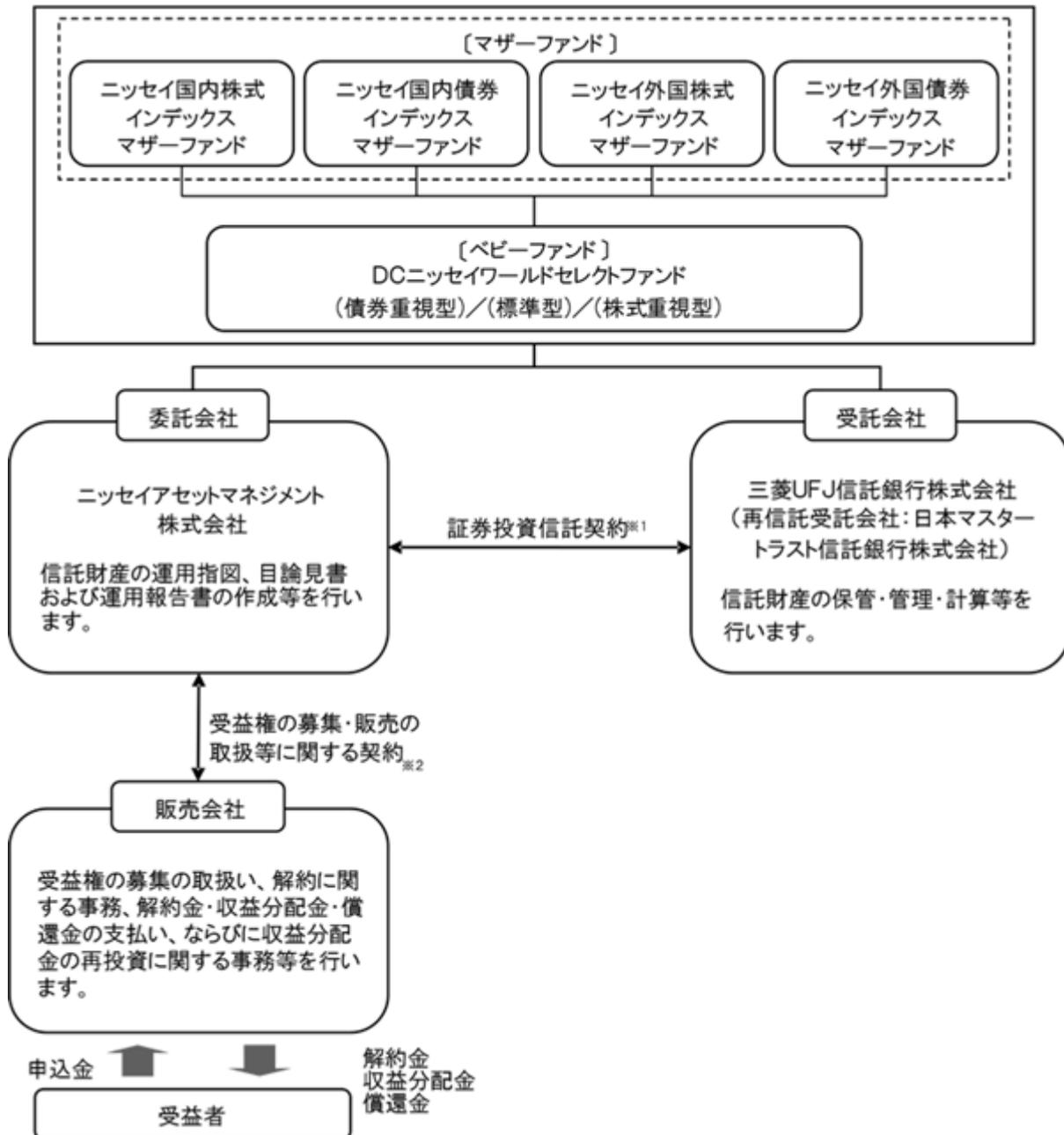
## (2) 【ファンドの沿革】

2003年1月10日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

2014年3月7日 ファンドの仕組みをファンド・オブ・ファンズ方式から、ファミリーファンド方式へ変更し、購入・換金の際に適用される基準価額を購入・換金申込

受付日の翌々営業日から翌営業日へ変更、換金代金の支払開始日を換金申込受付日から起算して、原則として6営業日目から5営業日目へと短縮する変更、および実質的な運用管理費用（信託報酬）の料率（年率）を引下げ

### （３）【ファンドの仕組み】



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

## 委託会社の概況（2017年2月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 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 : 1995年4月4日
7. 沿革
  - 1985年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
  - 1995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。
  - 1998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。
  - 2000年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

## 8. 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

下記の各マザーファンドを主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

	債券重視型	標準型	株式重視型
国内株式インデックス	20%	30%	40%
国内債券インデックス	45%	30%	15%
外国株式インデックス	10%	20%	30%
外国債券インデックス	20%	15%	10%
短期金融資産	5%	5%	5%

基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等にもなう資金フローの影響により、一時的に上記の配分から乖離する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の証券取引所上場株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

国内の証券取引所上場株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

## ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、主に国内の公社債への投資を行うことにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限り、

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

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

このマザーファンドは、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

主として、日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます)の新株予約権をいいます。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権(イ. およびニ. に掲げるものに該当するものを除きます)

ニ. 約束手形(イ. に掲げるものを除きます)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、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

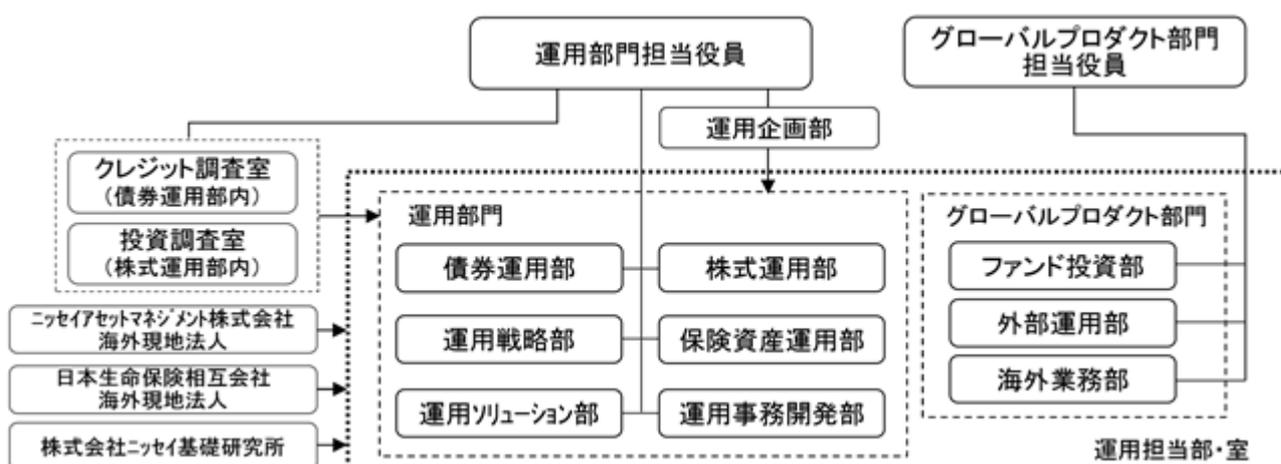
信託金を前記に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下において同じ)により運用することができます。

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。

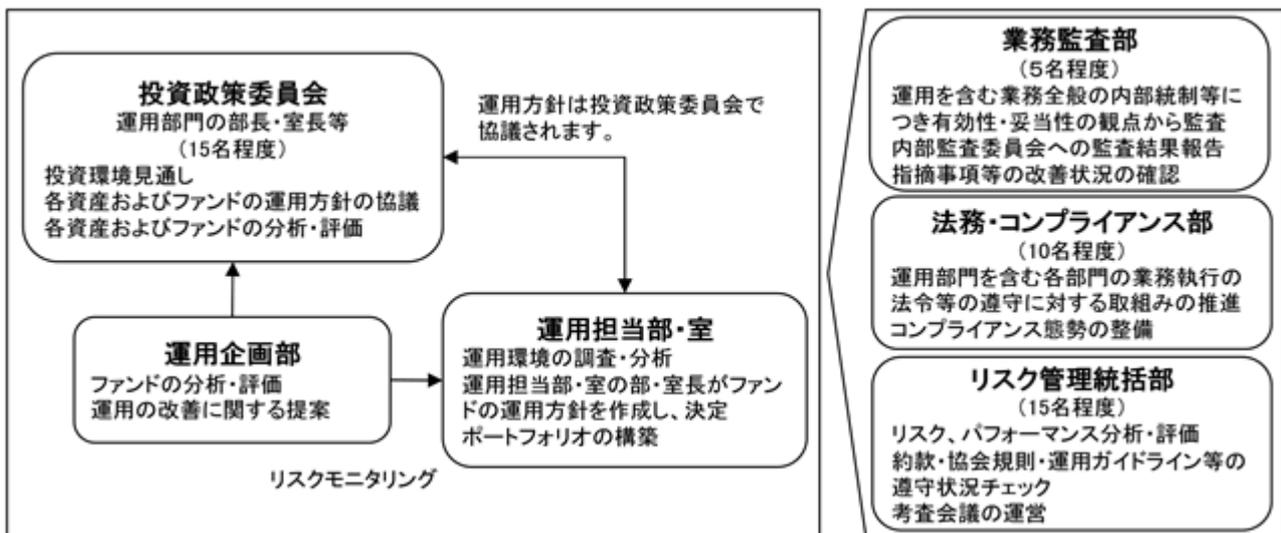
### (3)【運用体制】

#### 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・マネージャー/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



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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、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

## &lt; 分配金受取コースの場合 &gt;

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。

## &lt; 分配金再投資コースの場合 &gt;

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な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます)を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

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

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

##### 同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

### 3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。

ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の6の規定）の適用はありません。

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・債券投資リスク

###### 金利変動リスク

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

###### 信用リスク

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

##### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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

##### ・為替変動リスク

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

##### ・流動性リスク

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

##### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

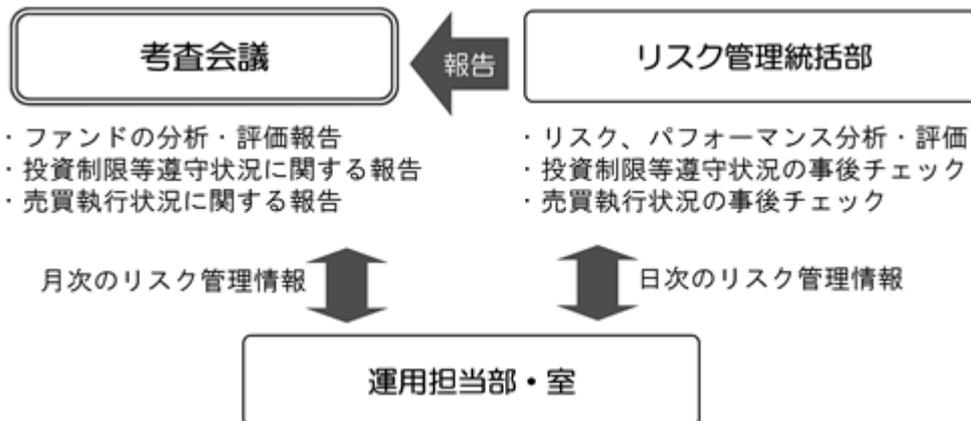
##### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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2017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25.6%保有しています。当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

(2) 投資リスク管理体制



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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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

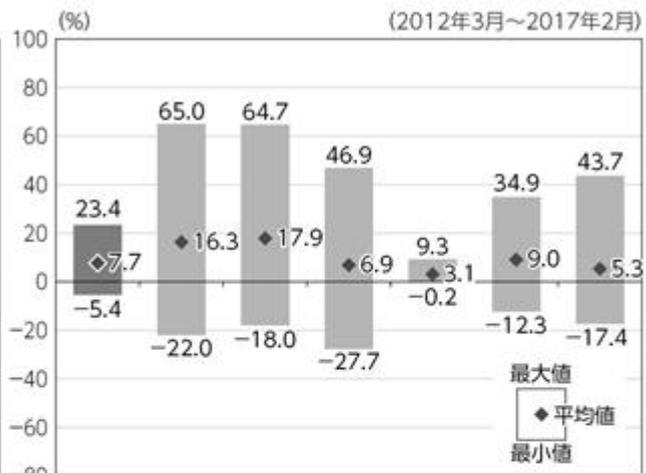
### ●DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



2012/3 2013/3 2014/3 2015/3 2016/3

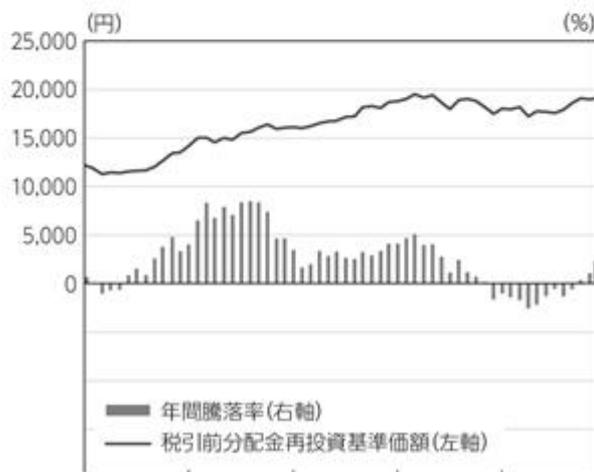
②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

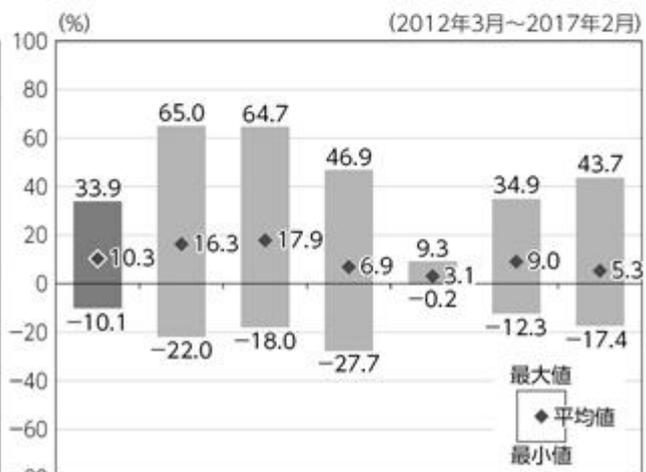
### ●DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



2012/3 2013/3 2014/3 2015/3 2016/3

②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



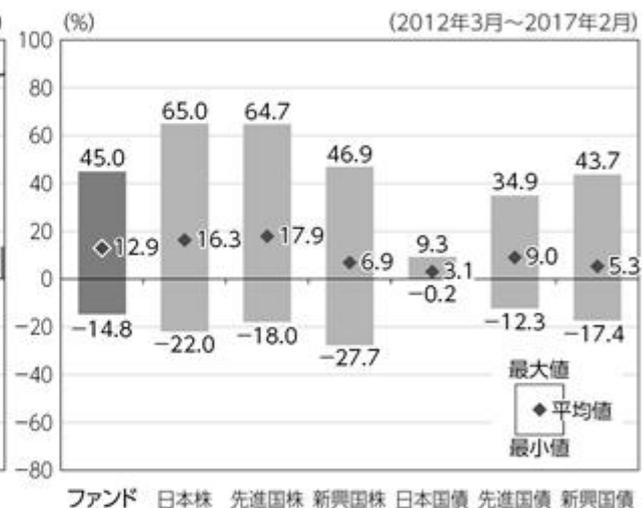
ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

## ●DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



・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年間に於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・ディバーシファイド(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・ディバーシファイドは、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。

## &lt;ご参考&gt;

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

申込手数料	投資者のファンドの取得時に、販売会社からの商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売会社における当該取得にかかる事務手続き等の対価として販売会社が收受
信託報酬のうち「委託会社」の報酬	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価として委託会社が收受
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收受
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收受
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）」

(2017年02月28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	4,125,882,914	94.99
内 日本	4,125,882,914	94.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	217,474,326	5.01
純資産総額	4,343,357,240	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）」

(2017年02月28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	13,835,624,604	94.99
内 日本	13,835,624,604	94.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	730,066,031	5.01
純資産総額	14,565,690,635	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）」

(2017年02月28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	7,867,124,298	94.98
内 日本	7,867,124,298	94.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	415,555,413	5.02
純資産総額	8,282,679,711	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」

(2017年02月28日現在)

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	39,762,402,460	97.46
内 日本	39,762,402,460	97.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,038,087,113	2.54
純資産総額	40,800,489,573	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）	1,043,120,000	2.56
内 日本	1,043,120,000	2.56

(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せん。

## (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」

(2017年02月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	28,809,456,010	98.92
内 日本	28,809,456,010	98.92
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	314,915,906	1.08
純資産総額	29,124,371,916	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」

(2017年02月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	69,365,479,799	95.07
内 アメリカ	43,642,629,844	59.82
内 イギリス	4,685,827,020	6.42
内 カナダ	2,839,574,173	3.89
内 スイス	2,694,073,750	3.69
内 ドイツ	2,521,768,730	3.46
内 フランス	2,482,249,104	3.40
内 オーストラリア	1,899,887,191	2.60
内 オランダ	1,535,878,295	2.11
内 アイルランド	1,180,519,492	1.62
内 スペイン	849,333,443	1.16
内 スウェーデン	812,813,384	1.11
内 香港	793,088,461	1.09
内 シンガポール	527,697,714	0.72
内 デンマーク	455,672,350	0.62
内 イタリア	434,016,491	0.59
内 ベルギー	317,893,366	0.44
内 ジャージー	282,858,120	0.39
内 フィンランド	260,683,522	0.36
内 オランダ領キュラソー	250,301,808	0.34
内 パミュダ	234,666,467	0.32
内 ノルウェー	181,063,702	0.25
内 イスラエル	141,367,944	0.19
内 ケイマン諸島	98,476,412	0.13
内 ルクセンブルグ	59,369,486	0.08
内 オーストリア	53,730,261	0.07
内 ニュージーランド	49,382,724	0.07
内 ボルトガル	38,511,272	0.05
内 パプアニューギニア	16,241,484	0.02
内 イギリス領バージン諸島	13,098,832	0.02
内 マン島	8,804,619	0.01
内 モーリシャス	4,000,338	0.01
投資証券	1,796,698,280	2.46
内 アメリカ	1,376,866,166	1.89
内 オーストラリア	183,450,121	0.25
内 フランス	90,686,563	0.12

内 イギリス	68,309,977	0.09
内 香港	34,903,337	0.05
内 シンガポール	26,864,378	0.04
内 カナダ	15,617,738	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,799,341,119	2.47
純資産総額	72,961,519,198	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)	1,572,956,838	2.16
内 アメリカ	1,052,952,369	1.44
内 ドイツ	520,004,469	0.71

(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」

(2017年02月28日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	10,635,001,704	99.09
内 アメリカ	4,736,181,088	44.13
内 フランス	1,036,524,716	9.66
内 イタリア	987,926,296	9.20
内 イギリス	782,382,083	7.29
内 ドイツ	776,250,923	7.23
内 スペイン	579,688,046	5.40
内 ベルギー	268,742,946	2.50
内 オランダ	240,276,911	2.24
内 カナダ	232,999,932	2.17
内 オーストラリア	225,707,671	2.10
内 オーストリア	153,053,294	1.43
内 メキシコ	88,216,858	0.82
内 アイルランド	83,500,811	0.78
内 ポーランド	66,252,562	0.62
内 フィンランド	65,669,112	0.61
内 デンマーク	62,082,567	0.58
内 南アフリカ	59,631,495	0.56
内 スウェーデン	49,012,473	0.46
内 マレーシア	46,557,043	0.43
内 シンガポール	42,151,627	0.39
内 ノルウェー	29,963,881	0.28
内 スイス	22,229,369	0.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	97,584,837	0.91
純資産総額	10,732,586,541	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】

(2017年02月28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	1,462,057,225	1.3370 1,954,816,089	1.3447 1,966,028,350	- -	45.27%
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	678,164,523	1.2762 865,524,931	1.2727 863,099,988	- -	19.87%
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	557,256,383	1.5629 870,960,296	1.5431 859,902,324	- -	19.80%
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	294,414,512	1.4906 438,878,805	1.4838 436,852,252	- -	10.06%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	94.99
	小計		94.99
合計(対純資産総額比)			94.99

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

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

(2017年02月28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	3,272,033,819	1.3370 4,374,738,756	1.3447 4,399,903,876	- -	30.21%
2	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,805,923,211	1.5629 4,385,625,902	1.5431 4,329,820,106	- -	29.73%
3	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,976,620,129	1.4906 2,946,547,619	1.4838 2,932,908,947	- -	20.14%
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	1,707,387,189	1.2762 2,179,127,168	1.2727 2,172,991,675	- -	14.92%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	94.99
	小計		94.99
合計(対純資産総額比)			94.99

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

投資不動産物件  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
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

(2017年02月28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	2,129,566,370	1.5629 3,328,487,718	1.5431 3,286,133,865	- -	39.67%
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	1,687,634,535	1.4907 2,515,760,641	1.4838 2,504,112,123	- -	30.23%
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	931,259,349	1.3370 1,245,102,200	1.3447 1,252,264,446	- -	15.12%
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	647,924,778	1.2762 826,942,304	1.2727 824,613,864	- -	9.96%

(注)投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	94.98
	小計		94.98
合計(対純資産総額比)			94.98

(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

(2017年02月28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	215,900	6,432.00 1,388,668,800	6,365.00 1,374,203,500	- -	3.37%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,328,400	767.80 1,019,945,520	738.40 980,890,560	- -	2.40%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	140,700	4,771.00 671,279,700	4,751.00 668,465,700	- -	1.64%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	78,900	8,789.00 693,452,100	8,362.00 659,761,800	- -	1.62%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	140,400	4,549.00 638,679,600	4,377.00 614,530,800	- -	1.51%
6	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	159,800	3,574.00 571,125,200	3,489.00 557,542,200	- -	1.37%
7	KDDI 日本	株式 情報・通信業	173,400	2,935.50 509,015,700	2,939.00 509,622,600	- -	1.25%
8	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,380,100	210.40 500,773,040	209.70 499,106,970	- -	1.22%
9	ソニー 日本	株式 電気機器	125,400	3,508.00 439,903,200	3,478.00 436,141,200	- -	1.07%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	110,300	3,774.00 416,272,200	3,757.00 414,397,100	- -	1.02%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	18,000	22,345.00 402,210,000	22,125.00 398,250,000	- -	0.98%
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	69,700	5,242.00 365,367,400	5,222.00 363,973,400	- -	0.89%
13	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	131,000	2,691.00 352,521,000	2,667.00 349,377,000	- -	0.86%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	34,400	10,275.00 353,460,000	10,155.00 349,332,000	- -	0.86%
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	71,000	5,089.00 361,319,000	4,919.00 349,249,000	- -	0.86%
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	8,000	44,250.00 354,000,000	43,460.00 347,680,000	- -	0.85%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	131,500	2,609.50 343,149,250	2,534.50 333,286,750	- -	0.82%
18	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	73,400	4,401.00 323,033,400	4,400.00 322,960,000	- -	0.79%
19	信越化学工業 日本	株式 化学	33,400	9,865.00 329,491,000	9,503.00 317,400,200	- -	0.78%
20	キャノン 日本	株式 電気機器	95,600	3,289.00 314,428,400	3,281.00 313,663,600	- -	0.77%
21	三菱電機 日本	株式 電気機器	189,500	1,681.00 318,549,500	1,647.50 312,201,250	- -	0.77%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	18,600	16,390.00 304,854,000	16,150.00 300,390,000	- -	0.74%
23	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	190,000	1,513.00 287,470,000	1,512.00 287,280,000	- -	0.70%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	130,000	2,258.50 293,605,000	2,195.00 285,350,000	- -	0.70%

25	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	62,800	4,549.00 285,677,200	4,481.00 281,406,800	- -	0.69%
26	花王 日本	株式 化学	47,300	5,727.00 270,887,100	5,801.00 274,387,300	- -	0.67%
27	三井物産 日本	株式 卸売業	158,500	1,703.00 269,925,500	1,719.00 272,461,500	- -	0.67%
28	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	14,800	18,620.00 275,576,000	18,380.00 272,024,000	- -	0.67%
29	日立製作所 日本	株式 電気機器	426,000	626.70 266,974,200	618.80 263,608,800	- -	0.65%
30	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	358,400	750.00 268,800,000	729.30 261,381,120	- -	0.64%

(注) 投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	12.23
		輸送用機器	9.05
		銀行業	8.29
		情報・通信業	7.59
		化学	6.57
		機械	4.97
		医薬品	4.65
		小売業	4.53
		卸売業	4.46
		食料品	4.32
		陸運業	4.08
		サービス業	3.61
		建設業	2.84
		保険業	2.67
		不動産業	2.43
		電気・ガス業	1.73
		その他製品	1.69
		精密機器	1.49
		鉄鋼	1.32
		その他金融業	1.22
		証券、商品先物取引業	1.21
		ガラス・土石製品	0.97
		非鉄金属	0.96
		ゴム製品	0.93
		繊維製品	0.70
		金属製品	0.69
空運業	0.56		
石油・石炭製品	0.54		
鉱業	0.33		
パルプ・紙	0.25		
海運業	0.25		
倉庫・運輸関連業	0.19		
水産・農林業	0.11		
	小計		97.46
合計(対純資産総額比)			97.46

(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 2903月	買建	68	1,050,924,320	1,043,120,000	2.56%

(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

(2017年02月28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321回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	2,051,000,000	105.75 2,169,014,540	105.71 2,168,235,160	1.000000 2022/3/20	7.44%
2	第146回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	1,791,000,000	119.09 2,133,027,270	120.27 2,154,143,160	1.700000 2033/9/20	7.40%
3	第140回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	1,789,000,000	119.06 2,129,983,400	120.09 2,148,410,100	1.700000 2032/9/20	7.38%
4	第26回 利付国債(30年) 日本	国債 証券	1,272,000,000	131.42 1,671,665,120	133.28 1,695,410,640	2.400000 2037/3/20	5.82%
5	第100回 利付国債(20年) 日本	国債 証券	1,268,000,000	123.04 1,560,197,920	123.01 1,559,855,560	2.200000 2028/3/20	5.36%
6	第322回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	1,283,000,000	105.24 1,350,293,350	105.20 1,349,818,640	0.900000 2022/3/20	4.63%
7	第303回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	1,289,000,000	104.11 1,342,029,460	104.14 1,342,441,940	1.400000 2019/9/20	4.61%
8	第113回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	1,320,000,000	100.75 1,329,901,500	100.77 1,330,164,000	0.300000 2018/6/20	4.57%
9	第28回 利付国債(30年) 日本	国債 証券	955,000,000	134.28 1,282,421,750	136.27 1,301,407,150	2.500000 2038/3/20	4.47%
10	第122回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	1,195,000,000	100.76 1,204,153,700	100.84 1,205,097,750	0.100000 2019/12/20	4.14%
11	第334回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	1,138,000,000	104.31 1,187,127,460	104.72 1,191,759,120	0.600000 2024/6/20	4.09%
12	第332回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	1,034,000,000	104.30 1,078,544,720	104.61 1,081,719,100	0.600000 2023/12/20	3.71%
13	第38回 利付国債(30年) 日本	国債 証券	832,000,000	125.02 1,040,236,140	125.20 1,041,664,000	1.800000 2043/3/20	3.58%
14	第312回 利付国債(10年) 日本	国債 証券	836,000,000	105.09 878,553,080	105.20 879,497,080	1.200000 2020/12/20	3.02%
15	第124回 利付国債(5年) 日本	国債 証券	780,000,000	100.81 786,380,400	100.92 787,246,200	0.100000 2020/6/20	2.70%
16	第4回 利付国債(40年) 日本	国債 証券	512,000,000	136.93 701,096,960	141.04 722,170,880	2.200000 2051/3/20	2.48%

17	第373回 利付国債(2年) 日本	国債証券	697,000,000	100.74 702,213,560	100.73 702,143,860	0.100000 2019/2/15	2.41%
18	第128回 利付国債(5年) 日本	国債証券	621,000,000	100.93 626,800,140	101.10 627,855,840	0.100000 2021/6/20	2.16%
19	第88回 利付国債(20年) 日本	国債証券	504,000,000	120.65 608,077,200	121.05 610,117,200	2.300000 2026/6/20	2.09%
20	第306回 利付国債(10年) 日本	国債証券	468,000,000	104.81 490,529,520	104.87 490,819,680	1.400000 2020/3/20	1.69%
21	第95回 利付国債(20年) 日本	国債証券	396,000,000	122.35 484,506,640	122.87 486,565,200	2.300000 2027/6/20	1.67%
22	第329回 利付国債(10年) 日本	国債証券	419,000,000	105.35 441,417,860	105.67 442,769,870	0.800000 2023/6/20	1.52%
23	第70回 利付国債(20年) 日本	国債証券	371,000,000	117.48 435,884,190	117.91 437,446,100	2.400000 2024/6/20	1.50%
24	第76回 利付国債(20年) 日本	国債証券	301,000,000	115.47 347,564,700	115.43 347,453,330	1.900000 2025/3/20	1.19%
25	第365回 利付国債(2年) 日本	国債証券	328,000,000	100.47 329,542,770	100.50 329,653,120	0.100000 2018/6/15	1.13%
26	第94回 利付国債(20年) 日本	国債証券	242,000,000	120.00 290,401,170	120.37 291,312,340	2.100000 2027/3/20	1.00%
27	第318回 利付国債(10年) 日本	国債証券	268,000,000	105.05 281,536,100	105.22 282,000,320	1.000000 2021/9/20	0.97%
28	第115回 利付国債(5年) 日本	国債証券	277,000,000	100.71 278,991,630	100.75 279,094,120	0.200000 2018/9/20	0.96%
29	第133回 利付国債(20年) 日本	国債証券	227,000,000	120.35 273,194,500	121.25 275,257,930	1.800000 2031/12/20	0.95%
30	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	240,000,000	103.36 248,066,400	103.34 248,025,600	0.400000 2025/3/20	0.85%

(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	98.92
	小計		98.92
合計(対純資産総額比)			98.92

(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。

(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

(2017年02月28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	106,368	12,523.72 1,332,123,992	15,412.84 1,639,433,050	- -	2.25%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	146,106	6,824.36 997,081,399	7,229.72 1,056,306,756	- -	1.45%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	7,955	86,129.39 685,159,318	95,522.91 759,884,815	- -	1.04%
4	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	81,847	9,588.96 784,828,061	9,178.14 751,203,421	- -	1.03%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・バイオテク ノロジー・ライフサイ エンス	53,998	12,990.31 701,450,866	13,777.34 743,949,021	- -	1.02%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	71,262	8,832.20 629,400,265	10,178.80 725,361,702	- -	0.99%
7	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	45,871	13,288.72 609,567,024	15,354.30 704,317,535	- -	0.97%
8	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	94,592	5,975.37 565,222,900	6,535.23 618,180,816	- -	0.85%
9	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	176,927	3,451.49 610,662,453	3,370.04 596,252,199	- -	0.82%
10	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	121,592	4,258.41 517,789,059	4,707.25 572,365,060	- -	0.78%
11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	6,104	86,045.00 525,218,700	93,343.75 569,770,291	- -	0.78%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	201,339	2,280.91 459,236,731	2,765.59 556,822,977	- -	0.76%
13	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・サー ビス	5,822	87,831.30 511,353,866	95,638.85 556,809,414	- -	0.76%
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソ ナル用品	50,443	9,274.77 467,847,533	10,230.57 516,061,066	- -	0.71%
15	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	61,419	7,672.30 471,225,052	8,282.22 508,685,731	- -	0.70%
16	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	37,232	12,319.05 458,663,006	12,578.57 468,325,690	- -	0.64%
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	119,698	3,552.80 425,264,025	3,858.55 461,861,531	- -	0.63%
18	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融	24,039	17,821.20 428,403,857	19,206.11 461,695,745	- -	0.63%
19	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	80,644	5,430.16 437,909,869	5,621.24 453,319,794	- -	0.62%

20	MERCK & CO INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	54,559	6,972.70 380,423,572	7,412.07 404,395,454	- -	0.55%
21	COMCAST CORP アメリカ	株式 メディア	95,010	3,870.63 367,749,419	4,224.37 401,358,039	- -	0.55%
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	24,398	14,540.13 354,750,113	16,354.96 399,028,509	- -	0.55%
23	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	57,292	6,272.61 359,370,393	6,755.85 387,056,226	- -	0.53%
24	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	99,342	3,410.39 338,795,486	3,856.30 383,093,110	- -	0.53%
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	93,170	3,948.69 367,899,470	4,109.56 382,888,226	- -	0.52%
26	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	44,078	8,008.02 352,977,620	8,677.93 382,506,217	- -	0.52%
27	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	80,919	4,608.46 372,912,467	4,690.37 379,540,470	- -	0.52%
28	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	13,877	25,931.15 359,846,613	27,154.09 376,817,334	- -	0.52%
29	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	30,635	10,095.15 309,265,123	12,235.27 374,827,557	- -	0.51%
30	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	30,182	11,154.31 336,659,532	12,407.48 374,482,826	- -	0.51%

(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	銀行	9.45
		ソフトウェア・サービス	9.05
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.65
		資本財	7.23
		エネルギー	6.94
		食品・飲料・タバコ	5.76
		素材	4.79
		各種金融	4.27
		保険	4.07
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.88
		ヘルスケア機器・サービス	3.86
		小売	3.81
		公益事業	3.15
		電気通信サービス	2.83
		メディア	2.63
		半導体・半導体製造装置	2.42
		家庭用品・パーソナル用品	2.16
		食品・生活必需品小売り	1.91
		運輸	1.87
		消費者サービス	1.69
		耐久消費財・アパレル	1.63
		自動車・自動車部品	1.45
		商業・専門サービス	0.94
不動産	0.61		
	小計		95.07
投資証券	外国	投資証券	2.46
	小計		2.46
合計（対純資産総額比）			97.53

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

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数 先物取引	シカゴ商品 取引所	S & P 500 EMIN I FUTURE 2017 03	買建	79	1,039,627,797	1,052,952,369	1.44%
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX X 50 201703	買建	132	520,598,655	520,004,469	0.71%

（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

(2017年02月28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	94,550,400	103.75 98,099,886	103.44 97,811,443	2.625000 2020/11/15	0.91%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	93,424,800	100.64 94,028,954	100.63 94,022,718	2.000000 2021/11/15	0.88%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	90,048,000	103.36 93,077,923	102.97 92,724,226	2.750000 2019/2/15	0.86%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	88,922,400	101.44 90,203,692	101.24 90,030,373	2.125000 2021/8/15	0.84%
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	90,048,000	99.84 89,904,711	99.77 89,843,591	1.375000 2020/1/31	0.84%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	84,420,000	103.76 87,594,585	103.43 87,318,138	2.625000 2020/8/15	0.81%
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	79,917,600	105.07 83,971,797	104.43 83,460,347	3.750000 2018/11/15	0.78%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	78,792,000	105.84 83,395,478	105.45 83,091,679	3.125000 2021/5/15	0.77%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	78,792,000	98.92 77,944,986	98.92 77,944,986	0.875000 2019/7/31	0.73%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	77,666,400	99.71 77,447,380	99.78 77,502,523	0.750000 2018/3/31	0.72%
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	76,540,800	99.72 76,334,072	99.63 76,265,253	1.250000 2019/10/31	0.71%
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	70,912,800	106.72 75,679,558	106.12 75,253,372	3.500000 2020/5/15	0.70%
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	73,164,000	100.17 73,294,963	100.12 73,257,649	1.125000 2018/6/15	0.68%
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	72,038,400	99.88 71,956,276	99.85 71,936,825	1.000000 2018/9/15	0.67%
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	70,912,800	101.33 71,861,917	101.21 71,776,517	2.125000 2021/9/30	0.67%
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	70,912,800	101.10 71,695,834	101.13 71,721,205	2.125000 2021/12/31	0.67%
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	69,787,200	102.75 71,712,898	102.56 71,580,731	2.375000 2020/12/31	0.67%
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	69,787,200	102.32 71,412,116	101.91 71,122,927	2.625000 2018/4/30	0.66%
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	66,410,400	105.19 69,863,076	104.30 69,268,703	4.000000 2018/8/15	0.65%
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	68,661,600	100.68 69,132,841	100.59 69,071,509	1.500000 2018/12/31	0.64%
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	67,536,000	102.15 68,994,777	101.97 68,873,212	2.250000 2021/3/31	0.64%
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	66,410,400	100.54 66,775,657	100.43 66,700,613	1.375000 2018/9/30	0.62%
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	66,410,400	99.58 66,132,129	99.53 66,098,935	1.000000 2019/3/15	0.62%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	64,159,200	100.23 64,311,977	100.16 64,266,987	1.250000 2018/11/30	0.60%
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	63,033,600	101.58 64,035,203	101.37 63,900,312	2.125000 2021/6/30	0.60%

26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	63,033,600	101.45 63,949,478	101.29 63,853,036	2.000000 2020/9/30	0.59%
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	60,782,400	104.55 63,552,861	103.99 63,208,833	3.125000 2019/5/15	0.59%
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	61,908,000	99.68 61,713,921	99.60 61,663,463	1.375000 2020/3/31	0.57%
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	61,908,000	99.10 61,351,447	99.05 61,324,826	1.000000 2019/9/30	0.57%
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	59,656,800	102.30 61,029,570	102.22 60,984,760	2.500000 2023/8/15	0.57%

(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	99.09
	小計		99.09
合 計 (対純資産総額比)			99.09

(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】

2017年02月28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5計算期間末 (2008年2月21日)	2,005,643,716	2,005,643,716	1.2719	1.2719
第6計算期間末 (2009年2月23日)	1,837,832,308	1,837,832,308	1.0431	1.0431
第7計算期間末 (2010年2月22日)	2,226,476,366	2,226,476,366	1.1509	1.1509
第8計算期間末 (2011年2月21日)	2,468,732,723	2,468,732,723	1.1802	1.1802
第9計算期間末 (2012年2月21日)	2,562,790,233	2,562,790,233	1.1636	1.1636
第10計算期間末 (2013年2月21日)	3,001,737,472	3,001,737,472	1.3114	1.3114
第11計算期間末 (2014年2月21日)	3,385,973,341	3,385,973,341	1.4672	1.4672
第12計算期間末 (2015年2月23日)	3,980,051,806	3,980,051,806	1.6341	1.6341
第13計算期間末 (2016年2月22日)	3,885,525,955	3,885,525,955	1.5825	1.5825
第14計算期間末 (2017年2月21日)	4,330,175,126	4,330,175,126	1.6728	1.6728
2016年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	-
10月末日	4,050,612,651	-	1.6079	-
11月末日	4,163,758,345	-	1.6478	-
12月末日	4,276,730,215	-	1.6765	-
2017年1月末日	4,288,928,380	-	1.6642	-
2月末日	4,343,357,240	-	1.6711	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第14計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第14計算期間	5.7

(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

2017年02月28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5計算期間末 (2008年2月21日)	6,484,983,703	6,484,983,703	1.3809	1.3809
第6計算期間末 (2009年2月23日)	5,244,908,506	5,244,908,506	1.0030	1.0030
第7計算期間末 (2010年2月22日)	6,824,522,532	6,824,522,532	1.1685	1.1685
第8計算期間末 (2011年2月21日)	7,926,206,447	7,926,206,447	1.2272	1.2272
第9計算期間末 (2012年2月21日)	7,963,099,330	7,963,099,330	1.1781	1.1781
第10計算期間末 (2013年2月21日)	9,660,248,526	9,660,248,526	1.3772	1.3772
第11計算期間末 (2014年2月21日)	11,279,655,180	11,279,655,180	1.6089	1.6089
第12計算期間末 (2015年2月23日)	13,482,628,252	13,482,628,252	1.8574	1.8574
第13計算期間末 (2016年2月22日)	12,635,415,827	12,635,415,827	1.7401	1.7401
第14計算期間末 (2017年2月21日)	14,588,527,021	14,588,527,021	1.9186	1.9186
2016年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	-
10月末日	13,419,199,849	-	1.7916	-
11月末日	13,996,882,148	-	1.8600	-
12月末日	14,419,965,769	-	1.9094	-
2017年1月末日	14,340,988,333	-	1.8990	-
2月末日	14,565,690,635	-	1.9119	-

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
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
第14計算期間	0.0000

## 収益率の推移

	収益率(%)
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
第14計算期間	10.3

(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

2017年02月28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5計算期間末 (2008年2月21日)	3,543,921,213	3,543,921,213	1.4897	1.4897
第6計算期間末 (2009年2月23日)	2,565,505,965	2,565,505,965	0.9552	0.9552
第7計算期間末 (2010年2月22日)	3,635,729,715	3,635,729,715	1.1734	1.1734
第8計算期間末 (2011年2月21日)	4,343,954,086	4,343,954,086	1.2613	1.2613
第9計算期間末 (2012年2月21日)	4,217,589,091	4,217,589,091	1.1770	1.1770
第10計算期間末 (2013年2月21日)	5,347,012,544	5,347,012,544	1.4248	1.4248
第11計算期間末 (2014年2月21日)	6,450,070,317	6,450,070,317	1.7349	1.7349
第12計算期間末 (2015年2月23日)	7,804,670,283	7,804,670,283	2.0739	2.0739
第13計算期間末 (2016年2月22日)	7,049,086,725	7,049,086,725	1.8772	1.8772
第14計算期間末 (2017年2月21日)	8,327,982,509	8,327,982,509	2.1564	2.1564
2016年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	-
10月末日	7,594,858,521	-	1.9573	-
11月末日	8,006,689,223	-	2.0581	-
12月末日	8,249,794,981	-	2.1311	-
2017年1月末日	8,164,314,745	-	2.1234	-
2月末日	8,282,679,711	-	2.1435	-

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
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
第14計算期間	0.0000

## 収益率の推移

	収益率(%)
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
第14計算期間	14.9

(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
第14計算期間	410,584,996	277,359,669	2,588,552,915

(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
第14計算期間	928,099,553	585,769,447	7,603,782,815

(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
第14計算期間	586,496,868	479,619,455	3,862,053,129

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## &lt; 参考情報 &gt;



## 3.運用実績

2017年2月末現在

## DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

## ● 基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

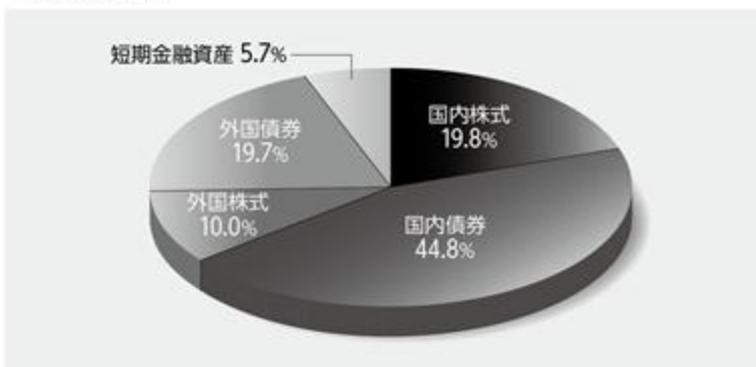
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

基準価額	16,711円
純資産総額	43億円

## ● 分配の推移 1万口当り(税引前)

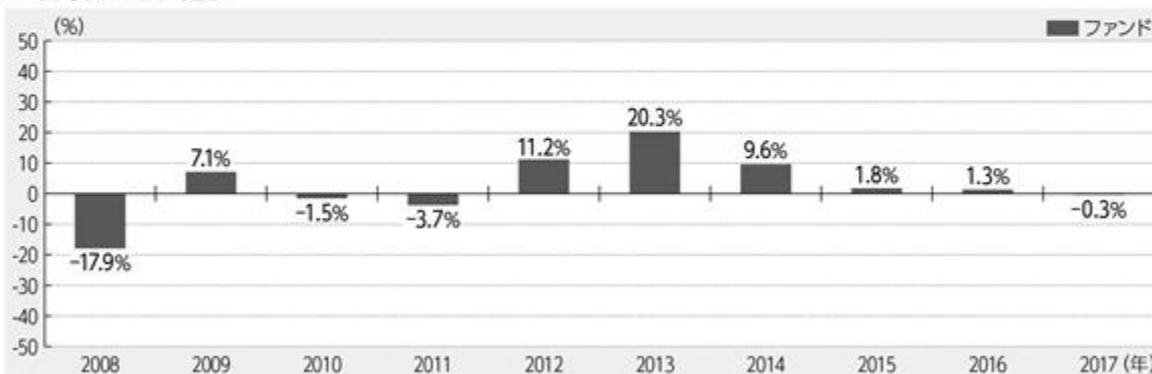
2013年 2月	0円
2014年 2月	0円
2015年 2月	0円
2016年 2月	0円
2017年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ● 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。

・2017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。

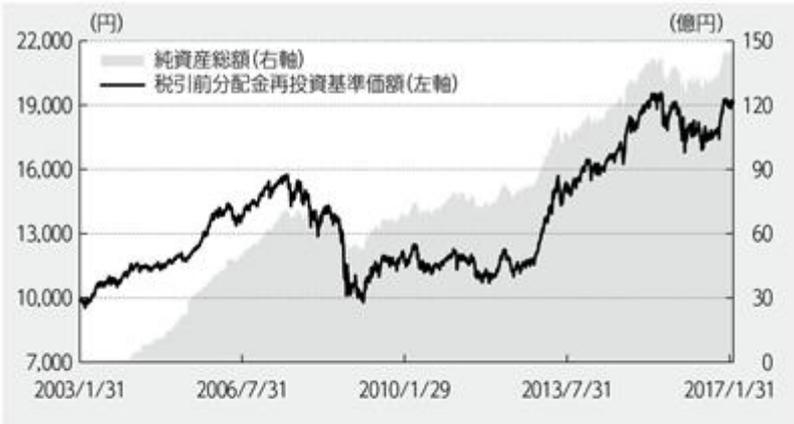
最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2017年2月末現在

## 3.運用実績

## 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



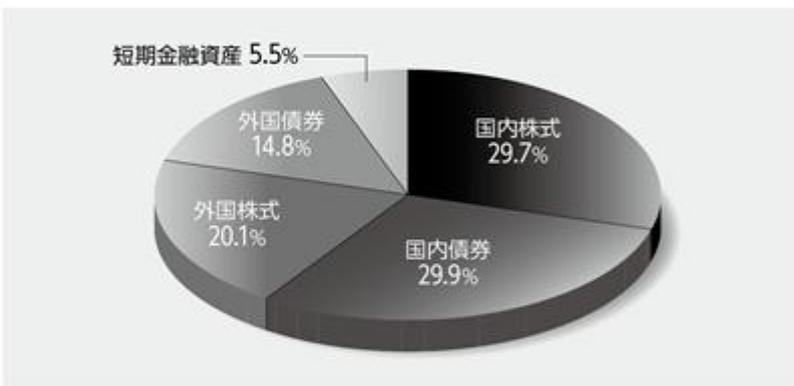
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	19,119円
純資産総額	145億円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

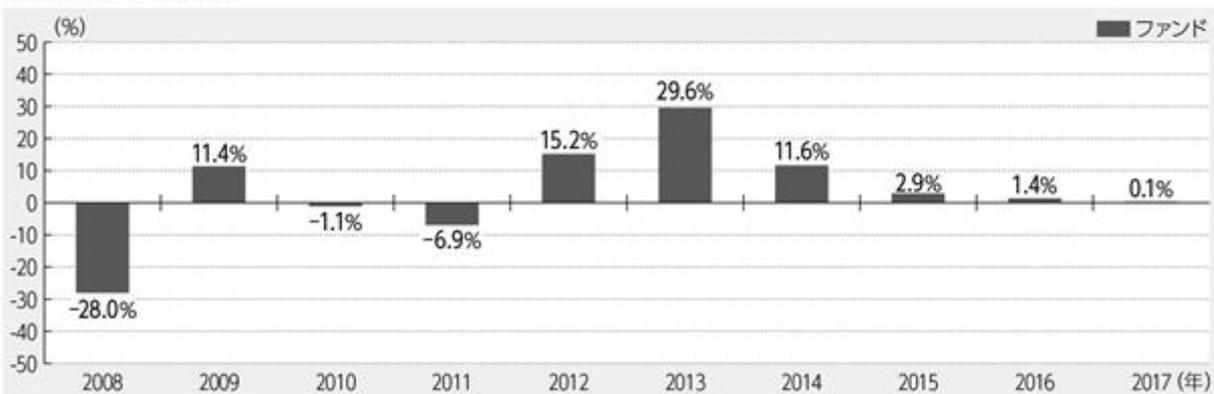
2013年 2月	0円
2014年 2月	0円
2015年 2月	0円
2016年 2月	0円
2017年 2月	0円
直近年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●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。
- ・2017年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

❶ 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。

## 3.運用実績

2017年2月末現在

## DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

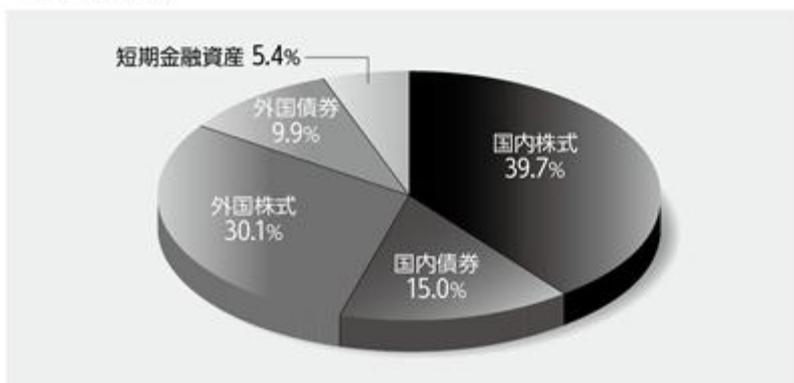
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	21,435円
純資産総額	82億円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

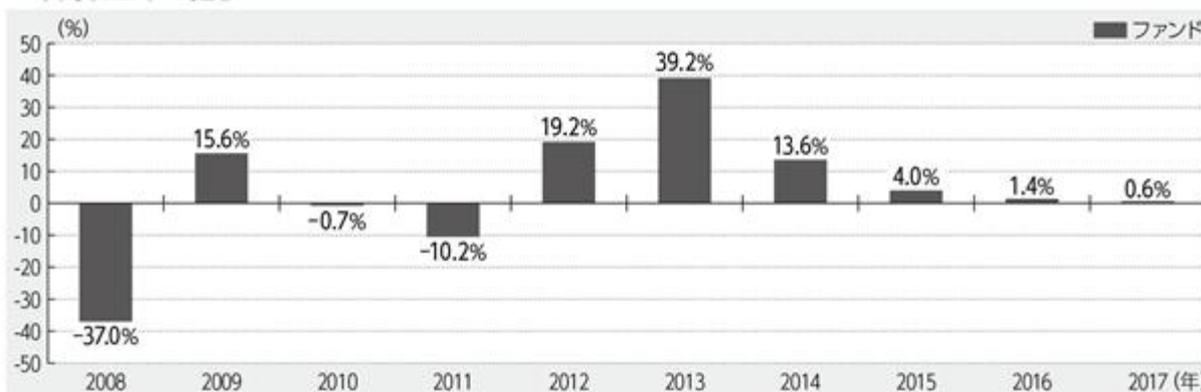
2013年 2月	0円
2014年 2月	0円
2015年 2月	0円
2016年 2月	0円
2017年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## ●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。

・2017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。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

#### 取扱コース

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

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

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

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

#### 換金単位

1口単位とします。

#### 換金価額

換金請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

換金手数料はありません。

#### 信託財産留保額

ありません。

#### 支払開始日

換金請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

## その他

1. 受益者が解約請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行います。委託会社は、解約請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約にかかる受益権口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
2. 換金請求の受付け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。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
10. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目(償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目)までにお支払いします。

### 約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することができます。この場合、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、前記1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記1.から5.の規定にしたがいます。

### 反対者の買取請求権

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

### 公告

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

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

### 運用報告書の作成

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

- ・交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知られたる受益者に交付します。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページ(<http://www.nam.co.jp/>)に掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、交付します。

### 信託事務処理の再信託

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

### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

委託会社と販売会社との間で締結された「受益権の募集・販売の取扱等に関する契約」は、契約期間満了の3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14期計算期間（平成28年2月23日から平成29年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間（平成28年2月23日から平成29年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間（平成28年2月23日から平成29年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	179,091,896	3,172,237
コール・ローン	14,967,805	217,661,838
親投資信託受益証券	3,695,513,517	4,113,574,494
未収入金	25,988,571	2,652,197
流動資産合計	3,915,561,789	4,337,060,766
資産合計	3,915,561,789	4,337,060,766
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	25,945,201	2,695,861
未払受託者報酬	653,599	669,501
未払委託者報酬	3,268,194	3,347,675
その他未払費用	168,840	172,603
流動負債合計	30,035,834	6,885,640
負債合計	30,035,834	6,885,640
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,455,327,588	2,588,552,915
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,430,198,367	1,741,622,211
純資産合計	3,885,525,955	4,330,175,126
負債純資産合計	3,915,561,789	4,337,060,766

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)	第14期 (自平成28年2月23日 至平成29年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	111,596	3,233
有価証券売買等損益	119,701,282	234,786,508
営業収益合計	119,589,686	234,789,741
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	119,637
受託者報酬	1,298,852	1,312,241
委託者報酬	6,494,614	6,561,539
その他費用	335,203	346,777
営業費用合計	8,128,669	8,340,194
営業利益又は営業損失( )	127,718,355	226,449,547
経常利益又は経常損失( )	127,718,355	226,449,547
当期純利益又は当期純損失( )	127,718,355	226,449,547
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( )	5,833,831	11,597,053
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	305,667,426	258,741,186
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	305,667,426	258,741,186
剰余金減少額又は欠損金増加額	286,417,544	162,169,836
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	286,417,544	162,169,836
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( )	1,430,198,367	1,741,622,211

## ( 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、前計算期間末日が休業日のため、平成28年2月23日から平成29年2月21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13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
1 . 受益権総口数	2,455,327,588口	2,588,552,915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)	1.6728円 (16,728円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)	第14期 (自平成28年2月23日 至平成29年2月21日)
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	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(95,370,991円)、収益調整金(1,001,694,869円)及び分配準備積立金(656,028,472円)より分配対象収益は1,753,094,332円(1口当たり0.677249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13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)	第14期 (自平成28年2月23日 至平成29年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。	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	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	137,233,650	192,403,004
合計	137,233,650	192,403,004

(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13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21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	410,584,996円
期中一部解約元本額	450,270,647円	277,359,669円

## (4) 【附属明細表】(平成29年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザー ファンド	555,001,549	867,467,421	
	ニッセイ国内債券インデックス マザー ファンド	1,456,203,801	1,946,944,481	
	ニッセイ外国株式インデックス マザー ファンド	293,238,621	437,130,812	
	ニッセイ外国債券インデックス マザー ファンド	675,414,699	862,031,780	
親投資信託受益証券 合計		2,979,858,670	4,113,574,494	
合計		2,979,858,670	4,113,574,494	

## 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13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	577,181,340	10,686,148
コール・ローン	48,238,576	733,225,907
親投資信託受益証券	12,024,823,015	13,859,840,144
未収入金	13,329,627	5,592,295
流動資産合計	12,663,572,558	14,609,344,494
資産合計	12,663,572,558	14,609,344,494
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	13,175,908	5,534,081
未払受託者報酬	2,189,897	2,235,170
未払委託者報酬	12,409,642	12,666,164
その他未払費用	381,284	382,058
流動負債合計	28,156,731	20,817,473
負債合計	28,156,731	20,817,473
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,261,452,709	7,603,782,815
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,373,963,118	6,984,744,206
純資産合計	12,635,415,827	14,588,527,021
負債純資産合計	12,663,572,558	14,609,344,494

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)	第14期 (自平成28年2月23日 至平成29年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	379,399	10,691
有価証券売買等損益	824,080,309	1,364,341,894
営業収益合計	823,700,910	1,364,352,585
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	395,379
受託者報酬	4,402,764	4,336,755
委託者報酬	24,949,400	24,575,343
その他費用	756,463	779,939
営業費用合計	30,108,627	30,087,416
営業利益又は営業損失（ ）	853,809,537	1,334,265,169
経常利益又は経常損失（ ）	853,809,537	1,334,265,169
当期純利益又は当期純損失（ ）	853,809,537	1,334,265,169
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	19,509,085	47,389,472
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	832,131,617	759,135,328
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	832,131,617	759,135,328
剰余金減少額又は欠損金増加額	808,734,606	435,229,937
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	808,734,606	435,229,937
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（ ）	5,373,963,118	6,984,744,206

## ( 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、前計算期間末日が休業日のため、平成28年2月23日から平成29年2月21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13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
1 . 受益権総口数	7,261,452,709口	7,603,782,815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)	1.9186円 (19,186円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)	第14期 (自平成28年2月23日 至平成29年2月21日)
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	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(479,900,291円)、収益調整金(3,699,358,325円)及び分配準備積立金(3,096,891,122円)より分配対象収益は7,276,149,738円(1口当たり0.956912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13期 （自平成27年2月24日 至平成28年2月22日）	第14期 （自平成28年2月23日 至平成29年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。	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	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	886,280,864	1,194,566,952
合計	886,280,864	1,194,566,952

(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13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21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	928,099,553円
期中一部解約元本額	940,757,157円	585,769,447円

## （４）【附属明細表】（平成29年2月21日現在）

## 第１ 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザー ファンド	2,800,614,924	4,377,361,126	
	ニッセイ国内債券インデックス マザー ファンド	3,265,859,451	4,366,454,085	
	ニッセイ外国株式インデックス マザー ファンド	1,972,920,724	2,941,032,923	
	ニッセイ外国債券インデックス マザー ファンド	1,704,138,534	2,174,992,010	
親投資信託受益証券 合計		9,743,533,633	13,859,840,144	
合計		9,743,533,633	13,859,840,144	

## 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13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	319,117,980	6,104,834
コール・ローン	26,670,642	418,880,827
親投資信託受益証券	6,712,687,709	7,912,623,165
未収入金	10,677,342	4,943,741
流動資産合計	7,069,153,673	8,342,552,567
資産合計	7,069,153,673	8,342,552,567
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,582,554	4,981,669
未払受託者報酬	1,255,074	1,268,999
未払委託者報酬	7,949,065	8,037,238
その他未払費用	280,255	282,152
流動負債合計	20,066,948	14,570,058
負債合計	20,066,948	14,570,058
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,755,175,716	3,862,053,129
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,293,911,009	4,465,929,380
純資産合計	7,049,086,725	8,327,982,509
負債純資産合計	7,069,153,673	8,342,552,567

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)	第14期 (自平成28年2月23日 至平成29年2月21日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	219,534	5,997
有価証券売買等損益	720,433,996	1,097,857,393
営業収益合計	720,214,462	1,097,863,390
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	222,406
受託者報酬	2,544,578	2,442,263
委託者報酬	16,116,129	15,468,102
その他費用	563,941	562,525
営業費用合計	19,224,648	18,695,296
営業利益又は営業損失( )	739,439,110	1,079,168,094
経常利益又は経常損失( )	739,439,110	1,079,168,094
当期純利益又は当期純損失( )	739,439,110	1,079,168,094
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( )	17,240,998	66,491,079
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	755,419,377	582,816,046
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	755,419,377	582,816,046
剰余金減少額又は欠損金増加額	746,203,072	423,474,690
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	746,203,072	423,474,690
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( )	3,293,911,009	4,465,929,380

## ( 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、前計算期間末日が休業日のため、平成28年2月23日から平成29年2月21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13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
1 . 受益権総口数	3,755,175,716口	3,862,053,129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)	2.1564円 (21,564円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第13期 (自平成27年2月24日 至平成28年2月22日)	第14期 (自平成28年2月23日 至平成29年2月21日)
1 . 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	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(344,997,525円)、収益調整金(2,731,898,968円)及び分配準備積立金(1,774,523,509円)より分配対象収益は4,851,420,002円(1口当たり1.256176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13期 （自平成27年2月24日 至平成28年2月22日）	第14期 （自平成28年2月23日 至平成29年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。	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	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	756,941,235	974,903,734
合計	756,941,235	974,903,734

(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13期 (平成28年2月22日現在)	第14期 (平成29年2月21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	586,496,868円
期中一部解約元本額	692,168,947円	479,619,455円

## (4) 【附属明細表】(平成29年2月21日現在)

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザー ファンド	2,128,574,309	3,326,961,644	
	ニッセイ国内債券インデックス マザー ファンド	930,819,366	1,244,505,492	
	ニッセイ外国株式インデックス マザー ファンド	1,686,859,297	2,514,601,154	
	ニッセイ外国債券インデックス マザー ファンド	647,618,017	826,554,875	
親投資信託受益証券 合計		5,393,870,989	7,912,623,165	
合計		5,393,870,989	7,912,623,165	

## 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28年2月22日現在)	(平成29年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,552,328,027	13,610,177
コール・ローン	129,737,550	933,857,005
株式	33,569,060,310	40,287,740,190
派生商品評価勘定	2,176,240	15,177,600
未収入金	38,804,780	-
未収配当金	53,632,336	66,042,813
前払金	26,650,000	-
差入委託証拠金	122,130,000	36,900,000
流動資産合計	35,494,519,243	41,353,327,785
資産合計	35,494,519,243	41,353,327,785
負債の部		
流動負債		
前受金	-	10,110,000
未払金	1,295,076,600	-
未払解約金	61,994,903	69,117,741
その他未払費用	-	1,109
流動負債合計	1,357,071,503	79,228,850
負債合計	1,357,071,503	79,228,850
純資産の部		
元本等		
元本	26,708,202,183	26,406,163,727
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,429,245,557	14,867,935,208
純資産合計	34,137,447,740	41,274,098,935
負債純資産合計	35,494,519,243	41,353,327,785

## 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 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 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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29年2月21日現在）
1. 受益権総口数	26,708,202,183口	26,406,163,727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)	1.5630円 (15,630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27年2月24日 至 平成28年2月22日）	（自 平成28年2月23日 至 平成29年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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28年2月22日現在）	（平成29年2月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （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28年2月22日現在）	（平成29年2月21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	5,047,967,953	222,295,030
合計	5,047,967,953	222,295,030

## （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29年2月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	568,920,000	-	571,120,000	2,200,000	918,090,000	-	933,300,000	15,210,000
合計	568,920,000	-	571,120,000	2,200,000	918,090,000	-	933,300,000	15,210,000

## （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28年2月22日現在）	（平成29年2月21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	10,057,847,879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	10,359,886,335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	7,815,906,431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）	7,359,394,307円	6,331,048,173円
ニッセイ日本バランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	28,333,451円	14,519,352円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	8,035,580円	6,437,094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	555,001,549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	2,800,614,924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	2,128,574,309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）	106,618,067円	46,182,585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）	634,211,990円	225,365,853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）	524,533,318円	217,770,428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	1,897,634,169円
DCニッセイ国内株式インデックス	6,973,595円	33,239,386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	4,117,578,365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	215,958,251円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	- 円	332,858円
計	26,708,202,183円	26,406,163,727円

附属明細表（平成29年2月21日現在）

第1 有価証券明細表  
株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,882.00	2,305,600	
日本水産	25,800	562.00	14,499,600	
マルハニチロ	3,800	3,280.00	12,464,000	
カネコ種苗	800	1,448.00	1,158,400	
サカタのタネ	2,900	3,165.00	9,178,500	
ホクト	2,000	2,149.00	4,298,000	
ショーボンドホールディングス	2,100	4,980.00	10,458,000	
ミライト・ホールディングス	6,200	1,073.00	6,652,600	
サンヨーホームズ	1,900	675.00	1,282,500	
住石ホールディングス	2,900	98.00	284,200	
日鉄鉱業	600	6,040.00	3,624,000	
三井松島産業	1,200	1,509.00	1,810,800	
国際石油開発帝石	104,800	1,126.00	118,004,800	
日本海洋掘削	700	2,425.00	1,697,500	

石油資源開発	3,200	2,718.00	8,697,600
K & O エナジーグループ	1,300	1,781.00	2,315,300
ダイセキ環境ソリューション	800	1,592.00	1,273,600
安藤・間	14,300	843.00	12,054,900
東急建設	7,100	844.00	5,992,400
コムシスホールディングス	7,800	2,029.00	15,826,200
ミサワホーム	2,400	1,056.00	2,534,400
高松コンストラクショングループ	1,500	2,666.00	3,999,000
東建コーポレーション	800	8,080.00	6,464,000
ヤマウラ	2,100	607.00	1,274,700
大成建設	101,000	805.00	81,305,000
大林組	59,700	1,071.00	63,938,700
清水建設	61,000	1,052.00	64,172,000
飛島建設	19,200	175.00	3,360,000
長谷工コーポレーション	23,200	1,307.00	30,322,400
松井建設	2,200	1,063.00	2,338,600
銭高組	3,000	430.00	1,290,000
鹿島建設	87,000	741.00	64,467,000
不動テトラ	16,100	203.00	3,268,300
鉄建建設	12,000	339.00	4,068,000
西松建設	23,000	585.00	13,455,000
三井住友建設	76,300	125.00	9,537,500
大豊建設	7,000	537.00	3,759,000
前田建設工業	12,000	1,003.00	12,036,000
佐田建設	2,800	428.00	1,198,400
奥村組	16,000	708.00	11,328,000
東鉄工業	2,400	3,135.00	7,524,000
浅沼組	7,000	365.00	2,555,000
戸田建設	23,000	673.00	15,479,000
熊谷組	31,000	318.00	9,858,000
青木あすなる建設	1,500	823.00	1,234,500
北野建設	4,000	320.00	1,280,000
植木組	5,000	259.00	1,295,000
三井ホーム	3,000	577.00	1,731,000
矢作建設工業	2,700	1,058.00	2,856,600
ピーエス三菱	3,200	415.00	1,328,000
日本ハウスホールディングス	4,100	518.00	2,123,800
大東建託	7,300	15,805.00	115,376,500
新日本建設	2,400	932.00	2,236,800
N I P P O	5,000	2,165.00	10,825,000
東亜道路工業	4,000	346.00	1,384,000
前田道路	6,000	2,014.00	12,084,000
日本道路	6,000	479.00	2,874,000
東亜建設工業	1,600	1,967.00	3,147,200
若築建設	11,000	153.00	1,683,000
東洋建設	5,700	427.00	2,433,900
五洋建設	22,100	541.00	11,956,100
大林道路	2,100	687.00	1,442,700
世紀東急工業	2,900	517.00	1,499,300
福田組	3,000	1,044.00	3,132,000
日本ドライケミカル	500	2,338.00	1,169,000
住友林業	13,700	1,630.00	22,331,000
日本基礎技術	3,500	364.00	1,274,000
日成ビルド工業	6,000	556.00	3,336,000
巴コーポレーション	3,400	364.00	1,237,600
パナホーム	7,000	1,062.00	7,434,000
大和ハウス工業	58,800	3,137.00	184,455,600
ライト工業	3,800	1,149.00	4,366,200
積水ハウス	62,600	1,815.00	113,619,000
日特建設	2,600	448.00	1,164,800

北陸電気工事	1,300	889.00	1,155,700
ユアテック	3,000	808.00	2,424,000
西部電気工業	500	2,294.00	1,147,000
四電工	3,000	426.00	1,278,000
中電工	2,500	2,366.00	5,915,000
関電工	8,000	923.00	7,384,000
きんでん	13,200	1,487.00	19,628,400
東京エネシス	2,000	965.00	1,930,000
トーエネック	3,000	566.00	1,698,000
住友電設	1,400	1,277.00	1,787,800
日本電設工業	3,200	1,983.00	6,345,600
協和エクシオ	7,800	1,583.00	12,347,400
新日本空調	1,500	1,349.00	2,023,500
日本工営	1,200	2,743.00	3,291,600
N D S	400	2,923.00	1,169,200
九電工	3,900	2,906.00	11,333,400
三機工業	4,400	1,007.00	4,430,800
日揮	18,600	2,066.00	38,427,600
中外炉工業	6,000	240.00	1,440,000
太平電業	3,000	1,072.00	3,216,000
高砂熱学工業	5,500	1,657.00	9,113,500
N E C ネットズエスアイ	1,900	2,133.00	4,052,700
朝日工業社	500	3,135.00	1,567,500
明星工業	3,600	640.00	2,304,000
大気社	2,600	2,884.00	7,498,400
ダイダシ	3,000	981.00	2,943,000
日比谷総合設備	2,200	1,728.00	3,801,600
東芝プラントシステム	3,200	1,603.00	5,129,600
日本製粉	5,900	1,712.00	10,100,800
日清製粉グループ本社	21,800	1,702.00	37,103,600
昭和産業	8,000	611.00	4,888,000
鳥越製粉	1,600	809.00	1,294,400
中部飼料	2,200	1,158.00	2,547,600
フィード・ワン	12,000	186.00	2,232,000
日本甜菜製糖	1,000	2,458.00	2,458,000
三井製糖	1,400	2,664.00	3,729,600
塩水港精糖	4,800	255.00	1,224,000
日新製糖	800	1,883.00	1,506,400
ネクスト	4,600	739.00	3,399,400
ジェイエイシーリクルートメント	1,100	1,564.00	1,720,400
日本M&Aセンター	5,400	3,445.00	18,603,000
タケエイ	1,600	1,044.00	1,670,400
トラスト・テック	800	1,735.00	1,388,000
コシダカホールディングス	600	2,520.00	1,512,000
パソナグループ	1,600	822.00	1,315,200
リンクアンドモチベーション	4,400	463.00	2,037,200
G C A	1,600	968.00	1,548,800
エス・エム・エス	2,600	2,555.00	6,643,000
テンブホールディングス	14,300	1,919.00	27,441,700
リニカル	1,100	1,486.00	1,634,600
クックパッド	4,100	974.00	3,993,400
アイ・ケイ・ケイ	1,800	720.00	1,296,000
森永製菓	3,900	4,705.00	18,349,500
中村屋	500	5,140.00	2,570,000
江崎グリコ	5,000	5,310.00	26,550,000
不二家	11,000	227.00	2,497,000
山崎製パン	14,600	2,208.00	32,236,800
モロゾフ	3,000	504.00	1,512,000
亀田製菓	1,100	4,980.00	5,478,000
寿スピリッツ	1,400	2,699.00	3,778,600

カルビー	8,100	3,790.00	30,699,000
森永乳業	18,000	739.00	13,302,000
六甲バター	900	2,484.00	2,235,600
ヤクルト本社	10,700	6,320.00	67,624,000
明治ホールディングス	11,800	8,700.00	102,660,000
雪印メグミルク	4,300	3,015.00	12,964,500
プリマハム	13,000	448.00	5,824,000
日本ハム	14,000	3,065.00	42,910,000
林兼産業	1,400	877.00	1,227,800
丸大食品	10,000	493.00	4,930,000
S Foods	1,100	3,225.00	3,547,500
伊藤ハム米久ホールディングス	11,500	1,096.00	12,604,000
学情	1,000	1,207.00	1,207,000
スタジオアリス	800	2,211.00	1,768,800
シミックホールディングス	900	1,488.00	1,339,200
システナ	1,400	1,645.00	2,303,000
NJS	900	1,399.00	1,259,100
デジタルアーツ	800	3,435.00	2,748,000
新日鉄住金ソリューションズ	2,900	2,283.00	6,620,700
総合警備保障	6,800	4,330.00	29,444,000
いちご	16,700	378.00	6,312,600
日本駐車場開発	21,100	152.00	3,207,200
コア	1,000	1,363.00	1,363,000
カカクコム	13,200	1,621.00	21,397,200
ルネサンス	900	1,714.00	1,542,600
ディップ	2,400	2,321.00	5,570,400
SBSホールディングス	1,800	829.00	1,492,200
オプトホールディング	1,700	958.00	1,628,600
新日本科学	2,100	562.00	1,180,200
ツクイ	4,400	685.00	3,014,000
キャリアデザインセンター	900	1,162.00	1,045,800
エムスリー	16,100	2,831.00	45,579,100
ツカダ・グローバルホールディング	1,800	625.00	1,125,000
アウトソーシング	1,100	3,750.00	4,125,000
ウェルネット	1,400	1,290.00	1,806,000
ディー・エヌ・エー	8,300	2,486.00	20,633,800
博報堂DYホールディングス	25,700	1,345.00	34,566,500
ぐるなび	2,700	2,223.00	6,002,100
エスアールジータカミヤ	2,000	573.00	1,146,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,000	254.00	1,270,000
ファンコミュニケーションズ	4,700	772.00	3,628,400
WDBホールディングス	1,000	1,327.00	1,327,000
ティア	1,900	716.00	1,360,400
インフォマート	7,900	588.00	4,645,200
サッポロホールディングス	6,500	2,856.00	18,564,000
アサヒグループホールディングス	37,300	4,099.00	152,892,700
麒麟ホールディングス	85,700	1,940.00	166,258,000
宝ホールディングス	14,400	1,128.00	16,243,200
オエノンホールディングス	5,000	260.00	1,300,000
養命酒製造	600	1,871.00	1,122,600
コカ・コーラウエスト	6,700	3,260.00	21,842,000
コカ・コーライーストジャパン	7,700	2,440.00	18,788,000
サントリー食品インターナショナル	13,600	4,680.00	63,648,000
ダイドーグループホールディングス	900	5,680.00	5,112,000
伊藤園	5,900	3,750.00	22,125,000
キーコーヒー	1,800	2,190.00	3,942,000
ユニカフェ	1,300	978.00	1,271,400
日清オイリオグループ	11,000	585.00	6,435,000
不二製油グループ本社	5,300	2,470.00	13,091,000
J-オイルミルズ	900	4,120.00	3,708,000

ローソン	6,100	8,050.00	49,105,000
サンエー	1,300	5,220.00	6,786,000
カワチ薬品	1,400	3,000.00	4,200,000
エービーシー・マート	3,200	6,740.00	21,568,000
高千穂交易	1,200	1,053.00	1,263,600
アスクル	2,100	3,280.00	6,888,000
ゲオホールディングス	2,900	1,382.00	4,007,800
アダストリア	2,700	2,938.00	7,932,600
伊藤忠食品	400	4,515.00	1,806,000
くらコーポレーション	1,100	4,650.00	5,115,000
キャンドゥ	900	1,812.00	1,630,800
エレマテック	700	1,948.00	1,363,600
パルグループホールディングス	900	2,767.00	2,490,300
JALUX	600	2,262.00	1,357,200
エディオン	6,800	1,037.00	7,051,600
あらた	800	2,879.00	2,303,200
サーラコーポレーション	2,200	638.00	1,403,600
ワッツ	1,100	1,265.00	1,391,500
トーメンデバイス	600	2,165.00	1,299,000
ハローズ	600	2,358.00	1,414,800
J Pホールディングス	5,300	257.00	1,362,100
あみやき亭	400	4,095.00	1,638,000
東京エレクトロン デバイス	800	1,619.00	1,295,200
ひらまつ	2,400	659.00	1,581,600
フィールズ	1,300	1,250.00	1,625,000
双日	103,500	295.00	30,532,500
ゲンキー	400	6,370.00	2,548,000
アルフレッサ ホールディングス	20,700	2,040.00	42,228,000
大黒天物産	400	5,110.00	2,044,000
ハニーズ	1,500	1,114.00	1,671,000
ファーマライズホールディングス	2,400	520.00	1,248,000
キッコーマン	14,000	3,425.00	47,950,000
味の素	41,000	2,301.00	94,341,000
キュービー	10,100	2,941.00	29,704,100
ハウス食品グループ本社	7,400	2,397.00	17,737,800
カゴメ	7,100	2,902.00	20,604,200
アリアケジャパン	1,600	6,210.00	9,936,000
ピエトロ	700	1,657.00	1,159,900
エバラ食品工業	600	2,095.00	1,257,000
ニチレイ	9,800	2,573.00	25,215,400
横浜冷凍	4,300	1,041.00	4,476,300
東洋水産	9,800	3,985.00	39,053,000
日清食品ホールディングス	7,800	6,150.00	47,970,000
永谷園ホールディングス	2,000	1,418.00	2,836,000
一正蒲鉾	1,100	1,194.00	1,313,400
フジッコ	1,900	2,451.00	4,656,900
ロック・フィールド	2,100	1,707.00	3,584,700
日本たばこ産業	110,300	3,778.00	416,713,400
ケンコーマヨネーズ	700	2,723.00	1,906,100
わらべや日洋ホールディングス	1,200	2,560.00	3,072,000
なとり	1,000	1,895.00	1,895,000
ユーグレナ	6,400	1,223.00	7,827,200
片倉工業	2,300	1,515.00	3,484,500
グンゼ	14,000	420.00	5,880,000
ヒューリック	36,600	1,082.00	39,601,200
ラサ商事	2,000	705.00	1,410,000
アルペン	1,600	1,985.00	3,176,000
クオール	2,000	1,561.00	3,122,000
アルコニックス	1,000	1,776.00	1,776,000
神戸物産	900	3,715.00	3,343,500

ジェイアイエヌ	1,200	5,890.00	7,068,000
ビックカメラ	10,100	1,099.00	11,099,900
DCMホールディングス	10,600	1,003.00	10,631,800
MonotaRO	6,200	3,330.00	20,646,000
ダイヤモンドダイニング	900	1,685.00	1,516,500
あいホールディングス	3,100	2,277.00	7,058,700
きちり	1,900	658.00	1,250,200
アークランドサービスホールディングス	500	3,185.00	1,592,500
J.フロントリテイリング	22,200	1,770.00	39,294,000
ドトール・日レスホールディングス	3,100	2,204.00	6,832,400
マツモトキヨシホールディングス	3,300	5,310.00	17,523,000
broncoピリー	900	2,806.00	2,525,400
スタートトゥデイ	16,000	2,487.00	39,792,000
物語コーポレーション	500	4,540.00	2,270,000
ココカラファイン	1,800	4,765.00	8,577,000
三越伊勢丹ホールディングス	34,900	1,420.00	49,558,000
東洋紡	74,000	200.00	14,800,000
ユニチカ	51,000	92.00	4,692,000
富士紡ホールディングス	900	3,400.00	3,060,000
日清紡ホールディングス	9,900	1,164.00	11,523,600
倉敷紡績	19,000	240.00	4,560,000
ダイワボウホールディングス	15,000	300.00	4,500,000
シキボウ	10,000	154.00	1,540,000
日東紡績	15,000	506.00	7,590,000
トヨタ紡織	6,200	2,491.00	15,444,200
マクニカ・富士エレホールディングス	3,200	1,664.00	5,324,800
ウエルシアホールディングス	1,700	6,410.00	10,897,000
クリエイトSDホールディングス	2,600	2,612.00	6,791,200
パイタルケーエスケー・ホールディングス	3,300	1,024.00	3,379,200
八洲電機	1,900	643.00	1,221,700
UKCホールディングス	1,100	2,224.00	2,446,400
OCHIホールディングス	900	1,347.00	1,212,300
TOKAIホールディングス	7,700	842.00	6,483,400
三洋貿易	1,000	1,819.00	1,819,000
チムニー	500	2,869.00	1,434,500
ウイン・パートナーズ	1,300	985.00	1,280,500
ジョイフル本田	2,800	3,470.00	9,716,000
鳥貴族	500	2,418.00	1,209,000
キリン堂ホールディングス	1,400	860.00	1,204,000
ホットランド	1,100	1,041.00	1,145,100
すかいらーく	7,500	1,621.00	12,157,500
綿半ホールディングス	800	1,626.00	1,300,800
日本毛織	5,200	914.00	4,752,800
ヨシックス	900	1,320.00	1,188,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,800	1,016.00	5,892,800
野村不動産ホールディングス	11,600	1,940.00	22,504,000
三重交通グループホールディングス	3,100	390.00	1,209,000
サムティ	1,400	1,194.00	1,671,600
日本商業開発	1,000	1,919.00	1,919,000
プレサンスコーポレーション	2,800	1,406.00	3,936,800
ユニゾホールディングス	1,400	3,080.00	4,312,000
THEグローバル社	2,700	455.00	1,228,500
日本管理センター	1,300	1,393.00	1,810,900
サンセイランディック	1,700	766.00	1,302,200
フージャースホールディングス	2,300	625.00	1,437,500
オープンハウス	2,500	2,718.00	6,795,000
東急不動産ホールディングス	42,400	658.00	27,899,200
飯田グループホールディングス	14,600	1,821.00	26,586,600

帝国繊維	1,900	1,704.00	3,237,600
ブックオフコーポレーション	1,500	843.00	1,264,500
日本コークス工業	15,000	104.00	1,560,000
あさひ	1,300	1,317.00	1,712,100
日本調剤	600	3,855.00	2,313,000
コスモス薬品	900	21,460.00	19,314,000
シップヘルスケアホールディングス	3,400	3,060.00	10,404,000
セブン&アイ・ホールディングス	73,400	4,435.00	325,529,000
薬王堂	900	2,493.00	2,243,700
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,700	1,028.00	4,831,600
ツルハホールディングス	4,000	10,390.00	41,560,000
サンマルクホールディングス	1,100	3,490.00	3,839,000
トリドールホールディングス	2,200	2,368.00	5,209,600
帝人	15,200	2,190.00	33,288,000
東レ	135,000	985.20	133,002,000
クラレ	31,300	1,721.00	53,867,300
旭化成	116,000	1,106.00	128,296,000
稲葉製作所	1,000	1,328.00	1,328,000
トーカロ	1,200	2,717.00	3,260,400
SUMCO	19,400	1,770.00	34,338,000
川田テクノロジーズ	400	7,920.00	3,168,000
シーアールイー	800	1,704.00	1,363,200
住江織物	5,000	293.00	1,465,000
日本フェルト	2,400	522.00	1,252,800
イチカワ	4,000	301.00	1,204,000
アツギ	15,000	131.00	1,965,000
コメダホールディングス	2,400	1,942.00	4,660,800
パロックジャパンリミテッド	1,000	1,461.00	1,461,000
クスリのアオキホールディングス	1,600	4,815.00	7,704,000
共和レザー	1,400	925.00	1,295,000
セーレン	4,600	1,580.00	7,268,000
ソトー	1,100	1,167.00	1,283,700
東海染工	9,000	147.00	1,323,000
小松精練	2,600	743.00	1,931,800
ワコールホールディングス	11,000	1,443.00	15,873,000
ホギメディカル	1,200	6,750.00	8,100,000
レナウン	10,700	115.00	1,230,500
T S Iホールディングス	7,700	833.00	6,414,100
T I S	5,800	2,706.00	15,694,800
グリー	10,700	693.00	7,415,100
コーエーテクモホールディングス	4,200	2,173.00	9,126,600
三菱総合研究所	700	3,185.00	2,229,500
ボルテージ	1,200	1,003.00	1,203,600
電算	500	2,444.00	1,222,000
A G S	900	1,906.00	1,715,400
ファインデックス	1,300	976.00	1,268,800
ヒト・コミュニケーションズ	800	1,714.00	1,371,200
K L a b	3,300	812.00	2,679,600
ポルトゥウィン・ビットクルーホールディングス	1,300	1,083.00	1,407,900
ネクソン	19,200	1,917.00	36,806,400
アイスタイル	2,700	962.00	2,597,400
エムアップ	2,000	906.00	1,812,000
エイチーム	1,000	2,210.00	2,210,000
テクノスジャパン	1,400	1,235.00	1,729,000
コロブラ	4,900	1,033.00	5,061,700
ブロードリーフ	4,300	630.00	2,709,000
ハーツユナイテッドグループ	900	1,516.00	1,364,400
メディアドゥ	500	1,750.00	875,000

ブイキューブ	1,800	624.00	1,123,200
サイバーリンクス	1,200	1,040.00	1,248,000
オブティム	200	5,360.00	1,072,000
特種東海製紙	1,100	4,245.00	4,669,500
ティーガイア	1,700	1,853.00	3,150,100
豆蔵ホールディングス	1,300	884.00	1,149,200
テクマトリックス	600	2,480.00	1,488,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,800	257.00	9,457,600
GMOペイメントゲートウェイ	1,400	6,440.00	9,016,000
ザッパラス	2,800	458.00	1,282,400
インターネットイニシアティブ	2,600	2,022.00	5,257,200
さくらインターネット	1,300	1,014.00	1,318,200
SRAホールディングス	900	2,841.00	2,556,900
朝日ネット	2,500	523.00	1,307,500
コムチュア	400	3,580.00	1,432,000
王子ホールディングス	73,000	543.00	39,639,000
日本製紙	8,300	2,115.00	17,554,500
三菱製紙	2,600	786.00	2,043,600
北越紀州製紙	10,400	787.00	8,184,800
中越パルプ工業	7,000	245.00	1,715,000
大王製紙	7,400	1,327.00	9,819,800
阿波製紙	1,400	607.00	849,800
gumi	1,800	1,276.00	2,296,800
パイプドHD	1,100	1,113.00	1,224,300
LINE	2,900	3,515.00	10,193,500
レンゴー	17,900	663.00	11,867,700
トーモク	6,000	333.00	1,998,000
ザ・パック	1,300	3,070.00	3,991,000
AOI TYO HOLDINGS	1,400	842.00	1,178,800
昭和電工	12,400	1,996.00	24,750,400
住友化学	137,000	648.00	88,776,000
住友精化	800	4,755.00	3,804,000
日産化学工業	10,200	3,865.00	39,423,000
ラサ工業	9,000	150.00	1,350,000
クレハ	1,400	4,860.00	6,804,000
テイカ	3,000	733.00	2,199,000
石原産業	3,300	1,120.00	3,696,000
日本曹達	11,000	670.00	7,370,000
東ソー	54,000	1,015.00	54,810,000
トクヤマ	29,000	568.00	16,472,000
セントラル硝子	19,000	545.00	10,355,000
東亜合成	11,600	1,274.00	14,778,400
大阪ソーダ	8,000	494.00	3,952,000
関東電化工業	4,000	1,156.00	4,624,000
デンカ	39,000	613.00	23,907,000
イビデン	12,400	1,932.00	23,956,800
信越化学工業	33,400	9,919.00	331,294,600
日本カーバイド工業	8,000	163.00	1,304,000
堺化学工業	7,000	410.00	2,870,000
エア・ウォーター	15,300	2,173.00	33,246,900
大陽日酸	14,300	1,446.00	20,677,800
日本化学工業	7,000	256.00	1,792,000
日本パーカライジング	9,500	1,406.00	13,357,000
高圧ガス工業	2,800	768.00	2,150,400
四国化成工業	3,000	1,191.00	3,573,000
戸田工業	4,000	286.00	1,144,000
ステラ ケミファ	900	3,340.00	3,006,000
保土谷化学工業	600	3,600.00	2,160,000
日本触媒	2,900	7,480.00	21,692,000

大日精化工業	8,000	721.00	5,768,000
カネカ	25,000	913.00	22,825,000
協和発酵キリン	22,300	1,662.00	37,062,600
三菱瓦斯化学	17,300	2,316.00	40,066,800
三井化学	85,000	565.00	48,025,000
J S R	18,700	2,018.00	37,736,600
東京応化工業	3,500	3,770.00	13,195,000
大阪有機化学工業	1,300	974.00	1,266,200
三菱ケミカルホールディングス	125,300	873.40	109,437,020
K Hネオケム	2,300	1,339.00	3,079,700
ダイセル	25,100	1,412.00	35,441,200
住友ベークライト	16,000	672.00	10,752,000
積水化学工業	42,200	1,893.00	79,884,600
日本ゼオン	16,000	1,308.00	20,928,000
アイカ工業	6,000	2,897.00	17,382,000
宇部興産	94,000	288.00	27,072,000
積水樹脂	2,900	1,885.00	5,466,500
タキロン	4,000	551.00	2,204,000
旭有機材	6,000	241.00	1,446,000
日立化成	10,300	3,230.00	33,269,000
ニチパン	2,000	935.00	1,870,000
リケンテクノス	4,000	547.00	2,188,000
大倉工業	4,000	564.00	2,256,000
積水化成成品工業	2,600	830.00	2,158,000
群栄化学工業	400	3,740.00	1,496,000
タイガースポリマー	1,500	800.00	1,200,000
ミライアル	1,200	942.00	1,130,400
ダイキアクシス	1,100	1,326.00	1,458,600
ダイキョーニシカワ	3,300	1,460.00	4,818,000
日本化薬	12,000	1,588.00	19,056,000
カーリットホールディングス	2,200	598.00	1,315,600
E P Sホールディングス	2,300	1,523.00	3,502,900
プレステージ・インターナショナル	2,600	911.00	2,368,600
アミューズ	1,000	2,062.00	2,062,000
野村総合研究所	13,100	3,895.00	51,024,500
ドリームインキュベータ	600	2,102.00	1,261,200
サイバネットシステム	1,900	818.00	1,554,200
T A C	5,400	232.00	1,252,800
C Eホールディングス	1,100	1,129.00	1,241,900
ケネディクス	24,900	443.00	11,030,700
電通	20,700	6,120.00	126,684,000
インテージホールディングス	1,000	2,207.00	2,207,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,600	947.00	1,515,200
東邦システムサイエンス	1,800	649.00	1,168,200
ぴあ	600	2,921.00	1,752,600
イオンファンタジー	500	3,120.00	1,560,000
シーティーエス	900	1,642.00	1,477,800
メディカルシステムネットワーク	2,800	454.00	1,271,200
日本精化	1,500	939.00	1,408,500
扶桑化学工業	1,300	3,125.00	4,062,500
A D E K A	8,000	1,565.00	12,520,000
日油	15,000	1,263.00	18,945,000
ミヨシ油脂	8,000	143.00	1,144,000
新日本理化	7,500	153.00	1,147,500
ハリマ化成グループ	1,600	796.00	1,273,600
花王	47,300	5,710.00	270,083,000
第一工業製薬	4,000	454.00	1,816,000
三洋化成工業	1,200	4,690.00	5,628,000
武田薬品工業	69,700	5,266.00	367,040,200
アステラス製薬	190,000	1,505.50	286,045,000

大日本住友製薬	13,200	1,972.00	26,030,400
塩野義製薬	25,200	5,547.00	139,784,400
田辺三菱製薬	21,700	2,295.00	49,801,500
あすか製薬	2,000	1,713.00	3,426,000
日本新薬	4,300	6,110.00	26,273,000
ビオフェルミン製薬	400	3,065.00	1,226,000
中外製薬	18,500	3,890.00	71,965,000
科研製薬	3,500	5,910.00	20,685,000
エーザイ	22,900	6,186.00	141,659,400
理研ビタミン	600	4,320.00	2,592,000
ロート製薬	9,100	2,215.00	20,156,500
小野薬品工業	42,200	2,532.50	106,871,500
久光製薬	5,200	6,180.00	32,136,000
持田製薬	1,300	8,410.00	10,933,000
参天製薬	34,300	1,633.00	56,011,900
扶桑薬品工業	600	2,857.00	1,714,200
日本ケミファ	300	5,520.00	1,656,000
ツムラ	6,200	3,405.00	21,111,000
日医工	4,300	1,710.00	7,353,000
テルモ	27,200	3,960.00	107,712,000
みらかホールディングス	4,700	5,130.00	24,111,000
キッセイ薬品工業	3,300	2,879.00	9,500,700
生化学工業	3,400	1,740.00	5,916,000
栄研化学	1,600	3,055.00	4,888,000
日水製薬	300	1,387.00	416,100
鳥居薬品	1,300	2,915.00	3,789,500
JCRファーマ	1,400	2,866.00	4,012,400
東和薬品	900	5,270.00	4,743,000
富士製薬工業	600	3,080.00	1,848,000
沢井製薬	3,200	6,050.00	19,360,000
ゼリア新薬工業	3,800	1,718.00	6,528,400
第一三共	54,700	2,588.50	141,590,950
キョーリン製薬ホールディングス	4,500	2,380.00	10,710,000
大幸薬品	900	1,838.00	1,654,200
ダイト	1,000	2,280.00	2,280,000
大塚ホールディングス	40,000	5,174.00	206,960,000
大正製薬ホールディングス	4,000	9,290.00	37,160,000
ペプチドリーム	3,200	5,220.00	16,704,000
大日本塗料	11,000	234.00	2,574,000
日本ペイントホールディングス	14,400	3,590.00	51,696,000
関西ペイント	19,500	2,190.00	42,705,000
中国塗料	5,300	848.00	4,494,400
日本特殊塗料	1,300	1,793.00	2,330,900
藤倉化成	2,500	675.00	1,687,500
太陽ホールディングス	1,500	4,770.00	7,155,000
DIC	7,300	3,975.00	29,017,500
サカタインクス	3,800	1,636.00	6,216,800
東洋インキSCホールディングス	18,000	564.00	10,152,000
T&K TOKA	1,300	1,109.00	1,441,700
アルプス技研	700	3,110.00	2,177,000
ダイオーズ	1,100	1,074.00	1,181,400
日本空調サービス	2,000	666.00	1,332,000
オリエンタルランド	20,100	6,325.00	127,132,500
フォーカスシステムズ	2,200	593.00	1,304,600
ダスキン	4,800	2,444.00	11,731,200
パーク24	8,900	3,085.00	27,456,500
明光ネットワークジャパン	2,300	1,215.00	2,794,500
ファルコホールディングス	900	1,490.00	1,341,000
クレスコ	500	2,452.00	1,226,000
フジ・メディア・ホールディングス	18,300	1,559.00	28,529,700

秀英予備校	2,800	480.00	1,344,000
ラウンドワン	5,800	876.00	5,080,800
リゾートトラスト	7,200	2,160.00	15,552,000
オービック	6,000	5,310.00	31,860,000
ジャストシステム	2,800	1,201.00	3,362,800
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,100	1,245.00	1,369,500
ヤフー	125,600	528.00	66,316,800
ビー・エム・エル	2,400	2,530.00	6,072,000
ワタベウェディング	2,900	567.00	1,644,300
トレンドマイクロ	9,300	4,840.00	45,012,000
りらいあコミュニケーションズ	3,100	1,094.00	3,391,400
リソー教育	3,200	634.00	2,028,800
日本オラクル	2,800	6,630.00	18,564,000
アルファシステムズ	600	1,952.00	1,171,200
フューチャー	2,400	903.00	2,167,200
CAC Holdings	1,400	1,097.00	1,535,800
ソフトバンク・テクノロジー	400	4,035.00	1,614,000
トーセ	1,500	827.00	1,240,500
ユー・エス・エス	22,500	1,954.00	43,965,000
オービックビジネスコンサルタント	900	5,500.00	4,950,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,000	3,125.00	12,500,000
アイティフォー	2,300	661.00	1,520,300
サイバーエージェント	9,800	3,060.00	29,988,000
楽天	94,800	1,032.50	97,881,000
大塚商会	4,700	5,820.00	27,354,000
総合メディカル	800	4,040.00	3,232,000
サイボウズ	2,700	442.00	1,193,400
セントラルスポーツ	600	3,690.00	2,214,000
パラカ	600	1,973.00	1,183,800
電通国際情報サービス	1,100	2,284.00	2,512,400
デジタルガレージ	2,700	2,085.00	5,629,500
イーエムシステムズ	700	1,624.00	1,136,800
ウェザーニューズ	600	3,550.00	2,130,000
C I J	2,300	533.00	1,225,900
東洋ビジネスエンジニアリング	800	1,550.00	1,240,000
日本エンタープライズ	4,300	281.00	1,208,300
WOWOW	800	3,675.00	2,940,000
スカラ	1,500	851.00	1,276,500
フルキャストホールディングス	1,900	1,084.00	2,059,600
富士フイルムホールディングス	36,900	4,327.00	159,666,300
コニカミノルタ	41,600	1,101.00	45,801,600
資生堂	35,300	2,881.50	101,716,950
ライオン	23,000	1,872.00	43,056,000
高砂香料工業	1,200	3,535.00	4,242,000
マンダム	1,900	5,220.00	9,918,000
ミルボン	1,000	5,360.00	5,360,000
ファンケル	4,000	1,625.00	6,500,000
コーセー	3,000	9,270.00	27,810,000
シーズ・ホールディングス	2,400	3,115.00	7,476,000
シーボン	200	2,556.00	511,200
ポーラ・オルビスホールディングス	1,900	10,970.00	20,843,000
ノエビアホールディングス	1,200	4,285.00	5,142,000
アジュバンコスメジャパン	1,300	974.00	1,266,200
エステー	1,300	1,737.00	2,258,100
アグロ カネショウ	1,000	1,299.00	1,299,000
コニシ	2,900	1,351.00	3,917,900
長谷川香料	2,400	1,968.00	4,723,200
星光PMC	1,000	1,126.00	1,126,000
小林製薬	5,200	5,180.00	26,936,000
荒川化学工業	1,600	2,041.00	3,265,600

メック	1,400	1,215.00	1,701,000
日本高純度化学	500	2,461.00	1,230,500
タカラバイオ	4,000	1,566.00	6,264,000
JCU	600	7,330.00	4,398,000
デクセリアルズ	4,900	1,292.00	6,330,800
アース製薬	1,300	5,180.00	6,734,000
イハラケミカル工業	2,600	1,050.00	2,730,000
大成ラミック	500	2,943.00	1,471,500
クミアイ化学工業	3,800	675.00	2,565,000
日本農薬	4,200	694.00	2,914,800
昭和シェル石油	16,700	1,086.00	18,136,200
富士興産	2,600	490.00	1,274,000
ニチレキ	2,300	929.00	2,136,700
東燃ゼネラル石油	30,000	1,322.00	39,660,000
ユシロ化学工業	1,000	1,455.00	1,455,000
ビービー・カストロール	900	1,666.00	1,499,400
富士石油	4,300	391.00	1,681,300
MORESCO	700	1,762.00	1,233,400
出光興産	8,800	3,540.00	31,152,000
JXホールディングス	206,500	529.90	109,424,350
コスモエネルギーホールディングス	5,600	1,937.00	10,847,200
横浜ゴム	11,200	2,263.00	25,345,600
東洋ゴム工業	9,800	1,803.00	17,669,400
ブリヂストン	62,800	4,545.00	285,426,000
住友ゴム工業	17,400	1,859.00	32,346,600
オカモト	6,000	1,028.00	6,168,000
アキレス	1,500	1,837.00	2,755,500
フコク	800	940.00	752,000
ニッタ	1,700	3,035.00	5,159,500
住友理工	3,400	1,160.00	3,944,000
三ツ星ベルト	5,000	1,010.00	5,050,000
バンドー化学	3,400	1,062.00	3,610,800
旭硝子	92,000	922.00	84,824,000
日本板硝子	8,500	865.00	7,352,500
有沢製作所	3,100	797.00	2,470,700
日本山村硝子	8,000	206.00	1,648,000
日本電気硝子	38,000	709.00	26,942,000
住友大阪セメント	35,000	466.00	16,310,000
太平洋セメント	112,000	406.00	45,472,000
日本ヒューム	1,800	709.00	1,276,200
日本コンクリート工業	4,200	347.00	1,457,400
三谷セキサン	900	2,608.00	2,347,200
アジアパイルホールディングス	2,300	590.00	1,357,000
東海カーボン	17,400	467.00	8,125,800
日本カーボン	9,000	298.00	2,682,000
東洋炭素	1,000	1,968.00	1,968,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	2,954.00	2,954,000
TOTO	13,700	4,260.00	58,362,000
日本碍子	23,500	2,482.00	58,327,000
日本特殊陶業	16,000	2,600.00	41,600,000
MARUWA	700	3,720.00	2,604,000
品川リフラクトリーズ	5,000	302.00	1,510,000
黒崎播磨	4,000	456.00	1,824,000
東京窯業	6,400	208.00	1,331,200
ニッカトー	3,000	425.00	1,275,000
フジインコーポレーテッド	1,600	2,592.00	4,147,200
ニチアス	10,000	1,096.00	10,960,000
新日鐵住金	83,900	2,819.50	236,556,050
神戸製鋼所	32,200	1,156.00	37,223,200
中山製鋼所	2,100	783.00	1,644,300

合同製鐵	1,000	1,895.00	1,895,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	50,800	2,162.50	109,855,000
日新製鋼	8,500	1,579.00	13,421,500
東京製鐵	9,400	1,016.00	9,550,400
共英製鋼	2,000	2,139.00	4,278,000
大和工業	3,700	3,325.00	12,302,500
東京鐵鋼	4,000	471.00	1,884,000
大阪製鐵	1,200	2,179.00	2,614,800
淀川製鋼所	2,600	3,345.00	8,697,000
東洋鋼鈹	4,400	469.00	2,063,600
丸一鋼管	6,200	3,595.00	22,289,000
モリ工業	600	2,368.00	1,420,800
大同特殊鋼	31,000	571.00	17,701,000
日本冶金工業	15,400	233.00	3,588,200
山陽特殊製鋼	11,000	612.00	6,732,000
愛知製鋼	1,100	4,890.00	5,379,000
日立金属	18,900	1,684.00	31,827,600
日本金属	1,000	1,307.00	1,307,000
大平洋金属	12,000	418.00	5,016,000
新日本電工	10,500	333.00	3,496,500
栗本鐵工所	900	2,366.00	2,129,400
日本製鋼所	6,100	2,019.00	12,315,900
三菱製鋼	13,000	256.00	3,328,000
日亜鋼業	4,600	286.00	1,315,600
日本精線	2,000	616.00	1,232,000
大紀アルミニウム工業所	3,000	532.00	1,596,000
日本軽金属ホールディングス	42,100	288.00	12,124,800
三井金属鉱業	51,000	382.00	19,482,000
東邦亜鉛	10,000	631.00	6,310,000
三菱マテリアル	11,600	3,875.00	44,950,000
住友金属鉱山	48,000	1,617.00	77,616,000
DOWAホールディングス	21,000	953.00	20,013,000
古河機械金属	29,000	239.00	6,931,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,100	1,949.00	4,092,900
東邦チタニウム	3,100	994.00	3,081,400
UACJ	24,000	319.00	7,656,000
古河電気工業	6,200	4,080.00	25,296,000
住友電気工業	70,100	1,884.00	132,068,400
フジクラ	24,500	848.00	20,776,000
昭和電線ホールディングス	22,000	92.00	2,024,000
タツタ電線	3,500	463.00	1,620,500
カナレ電気	600	2,253.00	1,351,800
平河ヒューテック	1,000	1,148.00	1,148,000
リョービ	11,000	505.00	5,555,000
アーレスティ	2,200	1,194.00	2,626,800
アサヒホールディングス	2,800	1,976.00	5,532,800
東洋製罐グループホールディングス	13,200	2,088.00	27,561,600
ホッカンホールディングス	5,000	546.00	2,730,000
コロナ	1,100	1,165.00	1,281,500
横河ブリッジホールディングス	3,300	1,412.00	4,659,600
OSJBホールディングス	6,100	251.00	1,531,100
高田機工	5,000	245.00	1,225,000
三和ホールディングス	18,500	1,090.00	20,165,000
文化シャッター	5,200	865.00	4,498,000
三協立山	2,400	1,742.00	4,180,800
アルインコ	1,300	1,057.00	1,374,100
LIXILグループ	25,900	2,785.00	72,131,500
日本フィルコン	2,200	563.00	1,238,600
ノーリツ	3,600	2,173.00	7,822,800
長府製作所	2,000	2,701.00	5,402,000

リンナイ	3,200	8,850.00	28,320,000
ユニプレス	3,400	2,368.00	8,051,200
ダイニチ工業	1,700	734.00	1,247,800
日東精工	2,900	425.00	1,232,500
岡部	3,900	1,008.00	3,931,200
ジーテクト	1,900	2,174.00	4,130,600
東ブレ	3,600	2,932.00	10,555,200
高周波熱錬	3,500	919.00	3,216,500
東京製綱	1,300	1,820.00	2,366,000
サンコール	2,200	558.00	1,227,600
モリテックスチール	4,200	300.00	1,260,000
パイオラックス	900	7,790.00	7,011,000
日本発条	17,500	1,308.00	22,890,000
アドバネクス	700	1,880.00	1,316,000
三浦工業	7,600	1,737.00	13,201,200
タクマ	6,000	1,033.00	6,198,000
テクノプロ・ホールディングス	3,000	3,865.00	11,595,000
Keeper 技研	700	2,130.00	1,491,000
リブセンス	2,700	442.00	1,193,400
ジャパンマテリアル	1,400	1,584.00	2,217,600
ベクトル	1,500	1,236.00	1,854,000
ウチヤマホールディングス	2,800	439.00	1,229,200
キャリアリンク	1,600	732.00	1,171,200
I B J	1,900	601.00	1,141,900
アサンテ	700	1,709.00	1,196,300
N・フィールド	900	1,452.00	1,306,800
アピスト	300	3,925.00	1,177,500
ウィルグループ	1,700	713.00	1,212,100
日本ビューホテル	900	1,360.00	1,224,000
リクルートホールディングス	40,500	5,330.00	215,865,000
ツガミ	5,000	701.00	3,505,000
オークマ	12,000	1,243.00	14,916,000
東芝機械	11,000	490.00	5,390,000
アマダホールディングス	25,000	1,287.00	32,175,000
アイダエンジニアリング	5,300	1,010.00	5,353,000
滝澤鉄工所	8,000	191.00	1,528,000
富士機械製造	5,700	1,529.00	8,715,300
牧野フライス製作所	9,000	1,085.00	9,765,000
オーエスジー	8,500	2,394.00	20,349,000
ダイジェット工業	7,000	182.00	1,274,000
旭ダイヤモンド工業	5,300	941.00	4,987,300
D M G 森精機	11,000	1,819.00	20,009,000
ソディック	4,700	1,108.00	5,207,600
ディスコ	2,200	17,250.00	37,950,000
日東工器	1,100	2,561.00	2,817,100
日本郵政	48,400	1,474.00	71,341,600
ベルシステム24ホールディングス	2,800	1,014.00	2,839,200
豊田自動織機	16,200	5,610.00	90,882,000
豊和工業	2,000	669.00	1,338,000
O K K	10,000	129.00	1,290,000
石川製作所	1,800	757.00	1,362,600
東洋機械金属	2,600	573.00	1,489,800
津田駒工業	8,000	177.00	1,416,000
島精機製作所	2,400	3,830.00	9,192,000
N C ホールディングス	1,300	931.00	1,210,300
フリーー	400	4,640.00	1,856,000
日阪製作所	2,500	933.00	2,332,500
やまびこ	3,400	1,458.00	4,957,200
ペガサスミシン製造	1,800	882.00	1,587,600
ナブテスコ	9,700	3,195.00	30,991,500

三井海洋開発	1,900	2,416.00	4,590,400
レオン自動機	1,600	1,095.00	1,752,000
S M C	5,600	31,700.00	177,520,000
新川	1,500	807.00	1,210,500
ホソカワミクロン	3,000	834.00	2,502,000
ユニオンツール	800	3,690.00	2,952,000
オイレス工業	2,400	2,058.00	4,939,200
日精エー・エス・ビー機械	600	2,410.00	1,446,000
サトーホールディングス	2,300	2,524.00	5,805,200
日本エアテック	1,900	657.00	1,248,300
日精樹脂工業	1,500	1,128.00	1,692,000
小松製作所	85,800	2,848.00	244,358,400
住友重機械工業	54,000	824.00	44,496,000
日立建機	8,300	2,705.00	22,451,500
巴工業	800	1,897.00	1,517,600
井関農機	19,000	260.00	4,940,000
T O W A	1,500	2,030.00	3,045,000
丸山製作所	7,000	194.00	1,358,000
北川鉄工所	900	2,462.00	2,215,800
シンニッタン	200	710.00	142,000
ローツェ	700	2,637.00	1,845,900
クボタ	89,300	1,850.00	165,205,000
荏原実業	900	1,371.00	1,233,900
東洋エンジニアリング	12,000	270.00	3,240,000
三菱化工機	6,000	224.00	1,344,000
月島機械	3,500	1,290.00	4,515,000
帝国電機製作所	1,400	1,053.00	1,474,200
新東工業	4,200	1,026.00	4,309,200
澁谷工業	1,600	2,924.00	4,678,400
アイチコーポレーション	2,600	897.00	2,332,200
小森コーポレーション	4,500	1,527.00	6,871,500
鶴見製作所	1,400	1,555.00	2,177,000
住友精密工業	3,000	375.00	1,125,000
荏原製作所	8,200	3,340.00	27,388,000
石井鐵工所	200	1,793.00	358,600
西島製作所	1,800	1,147.00	2,064,600
北越工業	2,000	970.00	1,940,000
千代田化工建設	14,000	736.00	10,304,000
ダイキン工業	24,200	10,780.00	260,876,000
オルガノ	4,000	498.00	1,992,000
トーヨーカネツ	9,000	316.00	2,844,000
栗田工業	10,500	2,732.00	28,686,000
樫本チエイン	11,000	993.00	10,923,000
日機装	6,100	1,221.00	7,448,100
新興プランテック	4,100	930.00	3,813,000
アネスト岩田	3,200	1,101.00	3,523,200
ダイフク	8,900	2,677.00	23,825,300
加藤製作所	1,000	3,045.00	3,045,000
タダノ	9,300	1,485.00	13,810,500
フジテック	5,200	1,300.00	6,760,000
C K D	5,300	1,499.00	7,944,700
キトー	2,200	1,255.00	2,761,000
平和	5,500	2,984.00	16,412,000
理想科学工業	1,800	2,106.00	3,790,800
S A N K Y O	4,900	4,010.00	19,649,000
日本金銭機械	1,600	1,520.00	2,432,000
マースエンジニアリング	1,000	2,322.00	2,322,000
福島工業	1,100	3,770.00	4,147,000
ダイコク電機	700	1,799.00	1,259,300
竹内製作所	3,200	2,377.00	7,606,400

アマノ	5,500	2,272.00	12,496,000
JUKI	2,800	1,301.00	3,642,800
サンデンホールディングス	11,000	389.00	4,279,000
蛇の目ミシン工業	1,700	797.00	1,354,900
ブラザー工業	23,000	2,072.00	47,656,000
マックス	3,000	1,530.00	4,590,000
モリタホールディングス	3,100	1,552.00	4,811,200
グローリー	5,700	3,805.00	21,688,500
新晃工業	1,200	1,492.00	1,790,400
大和冷機工業	2,900	1,052.00	3,050,800
セガサミーホールディングス	17,600	1,689.00	29,726,400
日本ピストンリング	700	2,385.00	1,669,500
リケン	800	4,370.00	3,496,000
TPR	2,000	3,715.00	7,430,000
ツバキ・ナカシマ	2,000	1,960.00	3,920,000
ホシザキ	3,900	8,930.00	34,827,000
大豊工業	1,400	1,546.00	2,164,400
日本精工	36,500	1,650.00	60,225,000
NTN	41,000	574.00	23,534,000
ジェイテクト	18,900	1,950.00	36,855,000
不二越	18,000	632.00	11,376,000
ミネベアミツミ	32,200	1,413.00	45,498,600
日本トムソン	5,700	564.00	3,214,800
THK	12,500	3,005.00	37,562,500
ユーシン精機	800	2,910.00	2,328,000
前澤給装工業	800	1,525.00	1,220,000
イーグル工業	1,900	1,617.00	3,072,300
日本ピラー工業	1,800	1,560.00	2,808,000
キッツ	8,500	765.00	6,502,500
日立製作所	426,000	633.80	269,998,800
東芝	397,000	183.70	72,928,900
三菱電機	189,500	1,705.50	323,192,250
富士電機	54,000	627.00	33,858,000
東洋電機製造	800	1,742.00	1,393,600
安川電機	20,600	2,146.00	44,207,600
シンフォニアテクノロジー	11,000	313.00	3,443,000
明電舎	16,000	383.00	6,128,000
オリジン電気	4,000	315.00	1,260,000
山洋電気	5,000	882.00	4,410,000
デンヨー	1,600	1,804.00	2,886,400
日立工機	4,800	867.00	4,161,600
三櫻工業	2,300	885.00	2,035,500
マキタ	11,600	7,740.00	89,784,000
東芝テック	11,000	589.00	6,479,000
芝浦メカトロニクス	5,000	281.00	1,405,000
マブチモーター	5,000	6,250.00	31,250,000
日本電産	23,000	10,705.00	246,215,000
東光高岳	900	2,193.00	1,973,700
ダブル・スコープ	1,700	1,821.00	3,095,700
ダイヘン	10,000	730.00	7,300,000
田淵電機	3,200	347.00	1,110,400
ヤーマン	200	6,000.00	1,200,000
JVCケンウッド	13,000	301.00	3,913,000
日新電機	3,600	1,379.00	4,964,400
大崎電気工業	4,000	1,082.00	4,328,000
オムロン	18,900	4,935.00	93,271,500
日東工業	2,600	1,584.00	4,118,400
IDEC	2,300	1,206.00	2,773,800
ジーエス・ユアサコーポレーション	34,000	509.00	17,306,000
サクサホールディングス	5,000	234.00	1,170,000

メルコホールディングス	1,000	3,385.00	3,385,000
日本電気	244,000	281.00	68,564,000
富士通	171,000	658.30	112,569,300
沖電気工業	7,700	1,607.00	12,373,900
岩崎通信機	14,000	91.00	1,274,000
電気興業	5,000	564.00	2,820,000
サンケン電気	10,000	512.00	5,120,000
ナカヨ	3,000	414.00	1,242,000
アイホン	1,000	1,860.00	1,860,000
ルネサスエレクトロニクス	9,200	993.00	9,135,600
セイコーエプソン	26,400	2,563.00	67,663,200
ワコム	13,800	415.00	5,727,000
アルバック	3,300	5,060.00	16,698,000
E I Z O	1,800	3,285.00	5,913,000
ジャパンディスプレイ	33,200	282.00	9,362,400
日本信号	4,900	1,045.00	5,120,500
京三製作所	4,000	408.00	1,632,000
能美防災	2,000	1,522.00	3,044,000
ホーチキ	1,300	1,413.00	1,836,900
エレコム	1,500	2,033.00	3,049,500
日本無線	1,100	1,415.00	1,556,500
パナソニック	202,900	1,252.00	254,030,800
アンリツ	12,900	866.00	11,171,400
富士通ゼネラル	6,000	2,164.00	12,984,000
日立国際電気	4,600	2,540.00	11,684,000
ソニー	125,400	3,521.00	441,533,400
T D K	10,000	7,880.00	78,800,000
帝国通信工業	7,000	189.00	1,323,000
タムラ製作所	7,000	450.00	3,150,000
アルプス電気	16,400	3,490.00	57,236,000
池上通信機	3,000	154.00	462,000
パイオニア	26,700	230.00	6,141,000
日本電波工業	1,700	853.00	1,450,100
鈴木	2,400	578.00	1,387,200
日本トリム	400	4,085.00	1,634,000
ローランド ディー・ジー	900	3,555.00	3,199,500
フォスター電機	2,100	1,953.00	4,101,300
クラリオン	9,000	440.00	3,960,000
S M K	5,000	425.00	2,125,000
ヨコオ	1,300	1,301.00	1,691,300
ティアック	26,000	46.00	1,196,000
ホシデン	5,400	989.00	5,340,600
ヒロセ電機	2,900	14,860.00	43,094,000
日本航空電子工業	6,000	1,534.00	9,204,000
T O A	2,100	1,009.00	2,118,900
日立マクセル	2,600	2,239.00	5,821,400
古野電気	2,300	765.00	1,759,500
ユニデンホールディングス	7,000	169.00	1,183,000
アルパイン	4,200	1,669.00	7,009,800
スミダコーポレーション	1,500	1,322.00	1,983,000
アイコム	1,000	2,395.00	2,395,000
リオン	800	1,586.00	1,268,800
船井電機	2,000	962.00	1,924,000
横河電機	19,300	1,751.00	33,794,300
新電元工業	7,000	480.00	3,360,000
アズビル	5,400	3,600.00	19,440,000
日本光電工業	7,400	2,493.00	18,448,200
チノー	1,100	1,268.00	1,394,800
共和電業	3,100	448.00	1,388,800
日本電子材料	2,000	634.00	1,268,000

堀場製作所	3,500	6,240.00	21,840,000
アドバンテスト	12,100	1,997.00	24,163,700
小野測器	1,400	882.00	1,234,800
エスベック	1,600	1,317.00	2,107,200
パナソニック デバイスSUNX	1,600	846.00	1,353,600
キーエンス	8,000	44,340.00	354,720,000
日置電機	900	2,231.00	2,007,900
シスメックス	13,800	6,470.00	89,286,000
日本マイクロニクス	3,300	921.00	3,039,300
メガチップス	1,700	2,703.00	4,595,100
OBARA GROUP	1,000	5,040.00	5,040,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,800	791.00	1,423,800
澤藤電機	6,000	246.00	1,476,000
デンソー	43,800	5,164.00	226,183,200
コーセル	2,500	1,477.00	3,692,500
イリソ電子工業	600	7,070.00	4,242,000
オブテックスグループ	1,300	3,180.00	4,134,000
千代田インテグレ	900	2,431.00	2,187,900
レーザーテック	2,100	2,862.00	6,010,200
スタンレー電気	12,700	3,170.00	40,259,000
岩崎電気	6,000	176.00	1,056,000
ウシオ電機	10,800	1,457.00	15,735,600
岡谷電機産業	3,000	420.00	1,260,000
ヘリオス テクノ ホールディング	2,300	621.00	1,428,300
日本セラミック	1,500	2,366.00	3,549,000
遠藤照明	1,400	929.00	1,300,600
古河電池	2,000	763.00	1,526,000
双信電機	4,200	305.00	1,281,000
山一電機	1,700	1,490.00	2,533,000
図研	1,200	1,291.00	1,549,200
日本電子	6,000	539.00	3,234,000
カシオ計算機	14,300	1,571.00	22,465,300
ファナック	18,000	22,475.00	404,550,000
日本シイエムケイ	3,800	665.00	2,527,000
エンプラス	800	3,540.00	2,832,000
ローム	8,600	7,480.00	64,328,000
浜松ホトニクス	13,900	3,385.00	47,051,500
三井ハイテック	2,300	885.00	2,035,500
新光電気工業	6,700	792.00	5,306,400
京セラ	29,200	6,236.00	182,091,200
協栄産業	8,000	175.00	1,400,000
太陽誘電	8,600	1,548.00	13,312,800
村田製作所	18,600	16,455.00	306,063,000
ユーシン	2,400	811.00	1,946,400
双葉電子工業	2,900	2,041.00	5,918,900
日東電工	13,400	9,577.00	128,331,800
東海理化電機製作所	4,700	2,277.00	10,701,900
ニチコン	5,600	1,070.00	5,992,000
日本ケミコン	15,000	322.00	4,830,000
KOA	2,500	1,356.00	3,390,000
三井造船	64,000	180.00	11,520,000
日立造船	14,100	650.00	9,165,000
三菱重工業	298,000	449.80	134,040,400
川崎重工業	138,000	359.00	49,542,000
IHI	136,000	341.00	46,376,000
名村造船所	5,300	793.00	4,202,900
サノヤスホールディングス	4,500	295.00	1,327,500
日本車輛製造	6,000	305.00	1,830,000
ニチユ三菱フォークリフト	2,000	723.00	1,446,000
FPG	6,300	1,115.00	7,024,500

島根銀行	900	1,407.00	1,266,300
じもとホールディングス	12,600	197.00	2,482,200
全国保証	4,900	3,675.00	18,007,500
めぶきフィナンシャルグループ	84,500	490.00	41,405,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	2,500	4,005.00	10,012,500
九州フィナンシャルグループ	28,700	793.00	22,759,100
かんぽ生命保険	6,600	2,792.00	18,427,200
ゆうちょ銀行	49,600	1,431.00	70,977,600
富山第一銀行	4,500	552.00	2,484,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	114,800	619.50	71,118,600
西日本フィナンシャルホールディングス	11,900	1,266.00	15,065,400
日産自動車	212,600	1,116.50	237,367,900
いすゞ自動車	51,500	1,547.00	79,670,500
トヨタ自動車	215,900	6,478.00	1,398,600,200
日野自動車	25,300	1,334.00	33,750,200
三菱自動車工業	65,100	695.00	45,244,500
エフテック	900	1,361.00	1,224,900
レシップホールディングス	300	853.00	255,900
G M B	1,100	1,408.00	1,548,800
ファルテック	900	1,423.00	1,280,700
武蔵精密工業	2,100	2,925.00	6,142,500
日産車体	7,800	1,099.00	8,572,200
新明和工業	7,000	1,172.00	8,204,000
極東開発工業	3,500	1,778.00	6,223,000
日信工業	4,000	2,012.00	8,048,000
トピー工業	1,500	3,240.00	4,860,000
ティラド	7,000	311.00	2,177,000
曙ブレーキ工業	8,200	284.00	2,328,800
タチエス	3,000	2,106.00	6,318,000
N O K	8,600	2,604.00	22,394,400
フタバ産業	5,400	793.00	4,282,200
K Y B	20,000	634.00	12,680,000
市光工業	4,000	528.00	2,112,000
大同メタル工業	2,200	1,024.00	2,252,800
プレス工業	9,400	573.00	5,386,200
ミクニ	3,000	435.00	1,305,000
カルソニックカンセイ	12,000	1,283.00	15,396,000
太平洋工業	3,600	1,446.00	5,205,600
ケーヒン	4,100	1,988.00	8,150,800
河西工業	2,400	1,370.00	3,288,000
アイシン精機	16,300	5,670.00	92,421,000
マツダ	56,200	1,620.50	91,072,100
今仙電機製作所	1,600	1,008.00	1,612,800
本田技研工業	159,800	3,596.00	574,640,800
スズキ	35,200	4,512.00	158,822,400
富士重工業	55,100	4,322.00	238,142,200
安永	700	1,679.00	1,175,300
ヤマハ発動機	25,100	2,646.00	66,414,600
ショーワ	4,600	983.00	4,521,800
小糸製作所	10,600	5,890.00	62,434,000
T B K	2,400	528.00	1,267,200
エクセディ	2,400	3,235.00	7,764,000
ミツバ	3,300	2,274.00	7,504,200
豊田合成	5,700	2,863.00	16,319,100
愛三工業	3,100	986.00	3,056,600
ヨロズ	1,700	1,829.00	3,109,300
エフ・シー・シー	2,900	2,270.00	6,583,000
新家工業	8,000	177.00	1,416,000
シマノ	7,200	16,790.00	120,888,000

タカタ	3,200	546.00	1,747,200
テイ・エス テック	4,100	2,933.00	12,025,300
ジャムコ	1,000	2,641.00	2,641,000
小野建	1,500	1,408.00	2,112,000
はるやまホールディングス	1,400	979.00	1,370,600
ノジマ	2,000	1,438.00	2,876,000
佐島電機	1,600	803.00	1,284,800
カッパ・クリエイト	2,500	1,278.00	3,195,000
エコートレーディング	1,800	703.00	1,265,400
伯東	1,200	1,086.00	1,303,200
コンドーテック	1,400	875.00	1,225,000
ライトオン	1,300	978.00	1,271,400
ナガイレーベン	2,500	2,461.00	6,152,500
ジーンズメイト	4,200	257.00	1,079,400
三菱食品	1,900	3,460.00	6,574,000
良品計画	2,300	23,040.00	52,992,000
三城ホールディングス	2,600	479.00	1,245,400
松田産業	1,300	1,589.00	2,065,700
第一興商	2,900	4,745.00	13,760,500
メディカルホールディングス	17,500	1,855.00	32,462,500
アドヴァン	1,800	1,156.00	2,080,800
萩原電気	600	2,165.00	1,299,000
アルビス	500	3,310.00	1,655,000
アズワン	1,400	4,995.00	6,993,000
尾家産業	1,100	1,167.00	1,283,700
シモジマ	1,100	1,200.00	1,320,000
ドウシシャ	2,100	2,132.00	4,477,200
コナカ	2,200	596.00	1,311,200
高速	1,100	1,125.00	1,237,500
ハウス オブ ローゼ	800	1,556.00	1,244,800
イオン北海道	2,000	618.00	1,236,000
ヒマラヤ	1,400	855.00	1,197,000
コーナン商事	2,500	2,206.00	5,515,000
黒田電気	2,400	2,312.00	5,548,800
ネットワンシステムズ	7,600	868.00	6,596,800
エコス	1,000	1,221.00	1,221,000
ワタミ	2,100	1,161.00	2,438,100
マルシェ	1,500	839.00	1,258,500
ドンキホーテホールディングス	11,300	3,955.00	44,691,500
丸文	1,800	741.00	1,333,800
西松屋チェーン	3,100	1,307.00	4,051,700
ゼンショーホールディングス	9,100	1,901.00	17,299,100
ハビネット	1,500	1,442.00	2,163,000
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,687.00	1,855,700
橋本総業ホールディングス	800	1,500.00	1,200,000
日本ライフライン	1,500	2,048.00	3,072,000
サイゼリヤ	2,900	2,637.00	7,647,300
エクセル	800	1,494.00	1,195,200
V Tホールディングス	5,900	526.00	3,103,400
アルゴグラフィックス	800	2,526.00	2,020,800
魚力	900	1,296.00	1,166,400
I D O M	4,700	754.00	3,543,800
日本エム・ディ・エム	1,400	766.00	1,072,400
ユナイテッドアローズ	2,300	3,550.00	8,165,000
進和	1,000	1,789.00	1,789,000
エスケイジャパン	4,000	305.00	1,220,000
ハイデイ日高	1,600	2,901.00	4,641,600
シークス	1,300	4,275.00	5,557,500
京都きもの友禅	1,200	997.00	1,196,400
コロワイド	5,800	1,869.00	10,840,200

ピーシーデポコーポレーション	2,300	562.00	1,292,600
田中商事	1,700	722.00	1,227,400
オーハシテクニカ	1,000	1,444.00	1,444,000
壱番屋	1,600	3,795.00	6,072,000
白銅	800	1,814.00	1,451,200
トップカルチャー	2,500	482.00	1,205,000
P L A N T	1,000	1,199.00	1,199,000
スギホールディングス	3,800	5,360.00	20,368,000
島津製作所	22,900	1,888.00	43,235,200
J M S	4,000	327.00	1,308,000
長野計器	1,700	714.00	1,213,800
ブイ・テクノロジー	400	16,730.00	6,692,000
スター精密	3,100	1,689.00	5,235,900
東京計器	6,000	239.00	1,434,000
オーバル	3,800	270.00	1,026,000
東京精密	3,400	3,825.00	13,005,000
マニー	2,400	2,716.00	6,518,400
ニコン	31,000	1,725.00	53,475,000
トプコン	8,900	2,031.00	18,075,900
オリンパス	28,300	3,970.00	112,351,000
理研計器	1,600	1,648.00	2,636,800
S C R E E Nホールディングス	3,600	7,660.00	27,576,000
キヤノン電子	1,600	1,798.00	2,876,800
タムロン	1,600	2,098.00	3,356,800
H O Y A	36,500	5,074.00	185,201,000
ノーリツ鋼機	1,800	965.00	1,737,000
エー・アンド・デイ	2,600	476.00	1,237,600
キヤノン	95,600	3,271.00	312,707,600
リコー	53,400	996.00	53,186,400
シチズン時計	19,400	745.00	14,453,000
リズム時計工業	7,000	188.00	1,316,000
大研医器	1,600	801.00	1,281,600
メニコン	1,200	3,550.00	4,260,000
スノーピーク	400	2,833.00	1,133,200
パラマウントベッドホールディングス	1,700	4,220.00	7,174,000
S H O B I	2,900	439.00	1,273,100
ニホンフラッシュ	900	1,324.00	1,191,600
前田工織	1,800	1,354.00	2,437,200
アートネイチャー	1,900	758.00	1,440,200
ダンロップスポーツ	1,100	1,053.00	1,158,300
バンダイナムコホールディングス	19,600	3,155.00	61,838,000
共立印刷	3,800	339.00	1,288,200
S H O E I	800	2,550.00	2,040,000
フランスベッドホールディングス	2,200	939.00	2,065,800
マーベラス	3,000	959.00	2,877,000
パイロットコーポレーション	3,100	4,585.00	14,213,500
萩原工業	500	2,619.00	1,309,500
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,200	1,617.00	5,174,400
トッパン・フォームズ	3,200	1,060.00	3,392,000
フジシールインターナショナル	4,000	2,253.00	9,012,000
タカラトミー	6,900	1,204.00	8,307,600
廣濟堂	3,000	394.00	1,182,000
A s - m e エステール	1,700	693.00	1,178,100
アーク	9,800	111.00	1,087,800
レック	600	4,470.00	2,682,000
タカノ	1,400	1,016.00	1,422,400
プロネクサス	1,700	1,260.00	2,142,000
ホクシン	5,900	219.00	1,292,100
大建工業	1,200	2,210.00	2,652,000

きもと	5,000	250.00	1,250,000
凸版印刷	50,000	1,136.00	56,800,000
大日本印刷	51,000	1,196.00	60,996,000
図書印刷	3,000	480.00	1,440,000
共同印刷	5,000	388.00	1,940,000
日本写真印刷	3,000	3,260.00	9,780,000
光村印刷	5,000	271.00	1,355,000
藤森工業	1,400	3,025.00	4,235,000
宝印刷	900	1,590.00	1,431,000
前澤化成工業	1,200	1,207.00	1,448,400
アシックス	17,600	1,978.00	34,812,800
ツツミ	700	2,119.00	1,483,300
J S P	900	2,600.00	2,340,000
ニチハ	2,500	3,165.00	7,912,500
エフピコ	1,600	5,150.00	8,240,000
小松ウオール工業	600	1,932.00	1,159,200
ヤマハ	12,000	2,941.00	35,292,000
河合楽器製作所	700	2,325.00	1,627,500
クリナップ	2,100	838.00	1,759,800
ピジョン	10,700	3,130.00	33,491,000
天馬	1,200	2,136.00	2,563,200
キングジム	1,500	857.00	1,285,500
リンテック	4,200	2,482.00	10,424,400
信越ポリマー	3,600	836.00	3,009,600
東リ	4,400	421.00	1,852,400
イトーキ	3,700	728.00	2,693,600
任天堂	10,900	23,135.00	252,171,500
三菱鉛筆	1,500	5,660.00	8,490,000
松風	900	1,371.00	1,233,900
タカラスタンダード	3,700	1,907.00	7,055,900
コクヨ	9,200	1,565.00	14,398,000
ニフコ	3,300	5,760.00	19,008,000
グローブライド	900	1,808.00	1,627,200
岡村製作所	6,200	1,019.00	6,317,800
日本バルカー工業	1,400	1,889.00	2,644,600
M U T O Hホールディングス	5,000	270.00	1,350,000
伊藤忠商事	128,400	1,642.00	210,832,800
丸紅	172,500	736.30	127,011,750
スクロール	3,600	355.00	1,278,000
ヨンドシーホールディングス	1,300	2,585.00	3,360,500
三陽商会	10,000	178.00	1,780,000
長瀬産業	10,500	1,658.00	17,409,000
蝶理	1,100	2,000.00	2,200,000
豊田通商	19,500	3,365.00	65,617,500
オンワードホールディングス	12,000	871.00	10,452,000
三共生興	2,900	413.00	1,197,700
兼松	37,000	193.00	7,141,000
美津濃	10,000	606.00	6,060,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	7,700	7,030.00	54,131,000
三井物産	158,500	1,714.00	271,669,000
日本紙パルプ商事	9,000	374.00	3,366,000
東京エレクトロン	11,800	11,170.00	131,806,000
日立ハイテクノロジーズ	6,100	4,780.00	29,158,000
カメイ	2,300	1,337.00	3,075,100
東都水産	300	1,966.00	589,800
スターゼン	700	4,830.00	3,381,000
セイコーホールディングス	13,000	471.00	6,123,000
山善	6,700	1,063.00	7,122,100
住友商事	110,400	1,505.00	166,152,000

日本ユニシス	4,800	1,518.00	7,286,400
内田洋行	900	2,566.00	2,309,400
三菱商事	131,500	2,607.00	342,820,500
第一実業	4,000	778.00	3,112,000
キヤノンマーケティングジャパン	5,000	2,279.00	11,395,000
西華産業	6,000	370.00	2,220,000
佐藤商事	1,600	881.00	1,409,600
菱洋エレクトロ	1,700	1,587.00	2,697,900
東京産業	2,600	477.00	1,240,200
ユアサ商事	1,700	3,295.00	5,601,500
神鋼商事	500	2,462.00	1,231,000
小林産業	4,700	276.00	1,297,200
阪和興業	18,000	774.00	13,932,000
カナデン	1,700	1,053.00	1,790,100
菱電商事	3,000	738.00	2,214,000
ニプロ	12,300	1,384.00	17,023,200
フルサト工業	1,000	1,746.00	1,746,000
岩谷産業	19,000	665.00	12,635,000
すてきナイスグループ	8,000	154.00	1,232,000
昭光通商	12,000	101.00	1,212,000
兼松エレクトロニクス	1,100	2,580.00	2,838,000
三愛石油	4,700	973.00	4,573,100
稲畑産業	4,200	1,540.00	6,468,000
明和産業	3,100	424.00	1,314,400
ゴールドウイン	800	5,870.00	4,696,000
ユニ・チャーム	37,700	2,447.00	92,251,900
デサント	4,200	1,258.00	5,283,600
キング	2,500	415.00	1,037,500
ワキタ	3,700	1,071.00	3,962,700
ヤマトインターナショナル	3,000	414.00	1,242,000
東邦ホールディングス	5,600	2,498.00	13,988,800
サンゲツ	6,000	1,933.00	11,598,000
ミツウロコグループホールディングス	2,800	749.00	2,097,200
シナネンホールディングス	800	2,296.00	1,836,800
伊藤忠エネクス	3,900	952.00	3,712,800
サンリオ	5,400	2,219.00	11,982,600
サンワテクノス	1,300	1,107.00	1,439,100
リョーサン	2,600	3,655.00	9,503,000
新光商事	1,900	1,341.00	2,547,900
トーヨー	800	2,544.00	2,035,200
三信電気	1,900	1,353.00	2,570,700
東陽テクニカ	2,300	1,012.00	2,327,600
モスフードサービス	2,300	3,345.00	7,693,500
加賀電子	1,600	2,040.00	3,264,000
三益半導体工業	1,400	1,766.00	2,472,400
ソーダニッカ	2,400	518.00	1,243,200
立花エレテック	1,200	1,329.00	1,594,800
木曽路	2,100	2,377.00	4,991,700
サトレストランシシステムズ	2,100	875.00	1,837,500
千趣会	3,200	789.00	2,524,800
ケーヨー	3,000	586.00	1,758,000
上新電機	4,000	1,100.00	4,400,000
日本瓦斯	3,200	3,340.00	10,688,000
ロイヤルホールディングス	2,900	2,024.00	5,869,600
東天紅	7,000	173.00	1,211,000
いなげや	1,900	1,569.00	2,981,100
島忠	4,500	2,867.00	12,901,500
チヨダ	2,100	2,788.00	5,854,800
ライフコーポレーション	1,300	3,300.00	4,290,000
リンガーハット	2,000	2,304.00	4,608,000

テンアライド	3,200	396.00	1,267,200
A O K Iホールディングス	3,500	1,448.00	5,068,000
オークワ	2,000	1,118.00	2,236,000
コメリ	2,700	2,755.00	7,438,500
青山商事	3,700	4,200.00	15,540,000
しまむら	2,000	14,580.00	29,160,000
はせがわ	2,700	447.00	1,206,900
高島屋	29,000	1,037.00	30,073,000
松屋	3,800	1,053.00	4,001,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,000	1,920.00	17,280,000
近鉄百貨店	7,000	357.00	2,499,000
パルコ	1,700	1,177.00	2,000,900
丸井グループ	18,400	1,583.00	29,127,200
クレディセゾン	13,300	2,206.00	29,339,800
アクシアル リテイリング	1,400	4,480.00	6,272,000
イオン	72,100	1,719.50	123,975,950
イズミ	3,500	4,930.00	17,255,000
平和堂	3,600	2,708.00	9,748,800
フジ	1,900	2,437.00	4,630,300
ヤオコー	2,000	4,620.00	9,240,000
ゼビオホールディングス	2,400	1,833.00	4,399,200
ケーズホールディングス	8,100	2,104.00	17,042,400
P A L T A C	2,800	3,110.00	8,708,000
三谷産業	3,300	382.00	1,260,600
O l y m p i cグループ	1,900	632.00	1,200,800
新生銀行	167,000	213.00	35,571,000
あおぞら銀行	111,000	417.00	46,287,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,328,400	774.00	1,028,181,600
りそなホールディングス	205,100	639.10	131,079,410
三井住友トラスト・ホールディングス	36,600	4,250.00	155,550,000
三井住友フィナンシャルグループ	140,400	4,567.00	641,206,800
第四銀行	21,000	536.00	11,256,000
北越銀行	1,900	2,751.00	5,226,900
千葉銀行	68,000	799.00	54,332,000
群馬銀行	39,000	671.00	26,169,000
武蔵野銀行	2,800	3,720.00	10,416,000
千葉興業銀行	4,800	633.00	3,038,400
筑波銀行	7,300	353.00	2,576,900
七十七銀行	27,000	543.00	14,661,000
青森銀行	14,000	393.00	5,502,000
秋田銀行	11,000	367.00	4,037,000
山形銀行	10,000	494.00	4,940,000
岩手銀行	1,100	4,770.00	5,247,000
東邦銀行	16,000	442.00	7,072,000
東北銀行	9,000	160.00	1,440,000
みちのく銀行	9,000	191.00	1,719,000
ふくおかフィナンシャルグループ	71,000	514.00	36,494,000
静岡銀行	48,000	1,020.00	48,960,000
十六銀行	24,000	412.00	9,888,000
スルガ銀行	17,900	2,576.00	46,110,400
八十二銀行	33,800	727.00	24,572,600
山梨中央銀行	11,000	556.00	6,116,000
大垣共立銀行	23,000	404.00	9,292,000
福井銀行	15,000	285.00	4,275,000
北國銀行	19,000	480.00	9,120,000
清水銀行	600	3,765.00	2,259,000
富山銀行	300	4,165.00	1,249,500
滋賀銀行	16,000	638.00	10,208,000
南都銀行	1,700	4,735.00	8,049,500
百五銀行	16,000	517.00	8,272,000

京都銀行	31,000	969.00	30,039,000
紀陽銀行	6,600	1,914.00	12,632,400
三重銀行	800	2,528.00	2,022,400
ほくほくフィナンシャルグループ	11,700	2,042.00	23,891,400
広島銀行	52,000	554.00	28,808,000
山陰合同銀行	10,500	1,025.00	10,762,500
中国銀行	12,400	1,820.00	22,568,000
鳥取銀行	600	1,913.00	1,147,800
伊予銀行	18,700	849.00	15,876,300
百十四銀行	19,000	399.00	7,581,000
四国銀行	14,000	312.00	4,368,000
阿波銀行	15,000	759.00	11,385,000
大分銀行	10,000	453.00	4,530,000
宮崎銀行	12,000	384.00	4,608,000
佐賀銀行	11,000	311.00	3,421,000
十八銀行	11,000	367.00	4,037,000
沖縄銀行	1,700	4,210.00	7,157,000
琉球銀行	3,600	1,657.00	5,965,200
セブン銀行	65,700	333.00	21,878,100
みずほフィナンシャルグループ	2,380,100	211.70	503,867,170
山口フィナンシャルグループ	17,000	1,330.00	22,610,000
アクリーティブ	2,500	395.00	987,500
芙蓉総合リース	2,000	5,340.00	10,680,000
興銀リース	3,300	2,498.00	8,243,400
東京センチュリー	3,500	3,915.00	13,702,500
SBIホールディングス	19,800	1,574.00	31,165,200
日本証券金融	7,700	648.00	4,989,600
アイフル	29,400	358.00	10,525,200
ポケットカード	1,200	620.00	744,000
長野銀行	700	2,019.00	1,413,300
名古屋銀行	1,500	4,310.00	6,465,000
北洋銀行	28,600	480.00	13,728,000
愛知銀行	600	7,060.00	4,236,000
第三銀行	1,000	1,759.00	1,759,000
中京銀行	700	2,341.00	1,638,700
大光銀行	6,000	250.00	1,500,000
愛媛銀行	2,100	1,419.00	2,979,900
みなと銀行	1,600	2,360.00	3,776,000
京葉銀行	14,000	546.00	7,644,000
関西アーバン銀行	2,400	1,569.00	3,765,600
栃木銀行	9,700	590.00	5,723,000
北日本銀行	500	3,185.00	1,592,500
東和銀行	33,000	126.00	4,158,000
福島銀行	19,000	96.00	1,824,000
大東銀行	9,000	173.00	1,557,000
リコーリース	1,400	3,700.00	5,180,000
イオンフィナンシャルサービス	11,200	2,171.00	24,315,200
アコム	35,200	492.00	17,318,400
ジャックス	10,000	518.00	5,180,000
オリエントコーポレーション	37,900	218.00	8,262,200
日立キャピタル	4,100	3,025.00	12,402,500
アプラスフィナンシャル	10,500	119.00	1,249,500
オリックス	124,100	1,767.00	219,284,700
三菱UFJリース	44,500	632.00	28,124,000
ジャフコ	2,900	3,985.00	11,556,500
トモニホールディングス	14,400	651.00	9,374,400
大和証券グループ本社	164,000	721.20	118,276,800
野村ホールディングス	358,400	755.10	270,627,840
岡三証券グループ	15,000	764.00	11,460,000
丸三証券	5,600	980.00	5,488,000

東洋証券	6,000	279.00	1,674,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,100	665.00	13,366,500
光世証券	7,000	191.00	1,337,000
水戸証券	5,400	319.00	1,722,600
いちよし証券	3,900	902.00	3,517,800
松井証券	10,000	937.00	9,370,000
S O M P Oホールディングス	36,600	4,370.00	159,942,000
だいこう証券ビジネス	2,000	645.00	1,290,000
日本取引所グループ	54,500	1,610.00	87,745,000
マネックスグループ	18,800	296.00	5,564,800
カブドットコム証券	13,100	394.00	5,161,400
極東証券	2,400	1,697.00	4,072,800
岩井コスモホールディングス	1,700	1,118.00	1,900,600
藍澤證券	3,300	659.00	2,174,700
フィデアホールディングス	17,000	219.00	3,723,000
池田泉州ホールディングス	18,600	523.00	9,727,800
アニコム ホールディングス	1,200	2,282.00	2,738,400
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	52,400	3,904.00	204,569,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	16,800	2,040.00	34,272,000
マネーパートナーズグループ	1,700	537.00	912,900
第一生命ホールディングス	105,700	2,226.00	235,288,200
東京海上ホールディングス	71,000	5,141.00	365,011,000
イー・ギャランティ	500	2,606.00	1,303,000
N E Cキャピタルソリューション	700	1,805.00	1,263,500
T & Dホールディングス	63,900	1,839.50	117,544,050
アドバンスクリエイト	500	2,089.00	1,044,500
三井不動産	93,000	2,652.50	246,682,500
三菱地所	130,000	2,275.00	295,750,000
平和不動産	3,300	1,621.00	5,349,300
東京建物	20,300	1,629.00	33,068,700
ダイビル	4,500	1,062.00	4,779,000
京阪神ビルディング	2,900	645.00	1,870,500
住友不動産	42,000	3,262.00	137,004,000
大京	33,000	234.00	7,722,000
テーオーシー	6,800	950.00	6,460,000
東京楽天地	3,000	526.00	1,578,000
レオパレス21	22,100	616.00	13,613,600
スターツコーポレーション	1,800	2,444.00	4,399,200
フジ住宅	2,200	750.00	1,650,000
空港施設	2,100	602.00	1,264,200
明和地所	1,700	720.00	1,224,000
住友不動産販売	1,600	2,857.00	4,571,200
ゴールドクレスト	1,600	2,144.00	3,430,400
リログループ	700	15,620.00	10,934,000
日本エスリード	900	1,524.00	1,371,600
日神不動産	2,300	555.00	1,276,500
タカラレーベン	7,600	603.00	4,582,800
サンヨーハウジング名古屋	1,200	1,014.00	1,216,800
イオンモール	11,300	1,761.00	19,899,300
ファースト住建	800	1,446.00	1,156,800
東祥	400	5,130.00	2,052,000
トーセイ	2,400	777.00	1,864,800
穴吹興産	500	2,666.00	1,333,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,900	1,053.00	11,477,700
サンフロンティア不動産	1,900	1,033.00	1,962,700
ランドビジネス	4,400	294.00	1,293,600
グランディハウス	2,900	418.00	1,212,200
東武鉄道	95,000	576.00	54,720,000

相鉄ホールディングス	28,000	567.00	15,876,000
東京急行電鉄	96,000	831.00	79,776,000
京浜急行電鉄	49,000	1,231.00	60,319,000
小田急電鉄	28,500	2,259.00	64,381,500
京王電鉄	50,000	895.00	44,750,000
京成電鉄	13,300	2,675.00	35,577,500
富士急行	5,000	1,006.00	5,030,000
新京成電鉄	1,000	421.00	421,000
東日本旅客鉄道	34,400	10,315.00	354,836,000
西日本旅客鉄道	17,100	7,420.00	126,882,000
東海旅客鉄道	14,800	18,795.00	278,166,000
西武ホールディングス	24,500	1,962.00	48,069,000
鴻池運輸	2,500	1,435.00	3,587,500
西日本鉄道	21,000	492.00	10,332,000
ハマキョウレックス	1,200	2,081.00	2,497,200
サカイ引越センター	600	3,050.00	1,830,000
近鉄グループホールディングス	179,000	422.00	75,538,000
阪急阪神ホールディングス	22,400	3,785.00	84,784,000
南海電気鉄道	38,000	551.00	20,938,000
京阪ホールディングス	40,000	718.00	28,720,000
神戸電鉄	4,000	381.00	1,524,000
名古屋鉄道	65,000	519.00	33,735,000
山陽電気鉄道	6,000	609.00	3,654,000
トランコム	500	5,470.00	2,735,000
日本通運	69,000	582.00	40,158,000
ヤマトホールディングス	31,800	2,263.50	71,979,300
山九	23,000	717.00	16,491,000
日新	7,000	368.00	2,576,000
丸全昭和運輸	6,000	445.00	2,670,000
センコー	8,000	723.00	5,784,000
トナミホールディングス	4,000	350.00	1,400,000
ニッコンホールディングス	6,000	2,435.00	14,610,000
福山通運	11,000	652.00	7,172,000
セイノーホールディングス	12,500	1,267.00	15,837,500
神奈川中央交通	2,000	724.00	1,448,000
日立物流	3,700	2,361.00	8,735,700
丸和運輸機関	400	2,571.00	1,028,400
C & F ロジホールディングス	1,800	1,569.00	2,824,200
日本郵船	151,000	249.00	37,599,000
商船三井	94,000	365.00	34,310,000
川崎汽船	68,000	300.00	20,400,000
N S ユナイテッド海運	8,000	230.00	1,840,000
飯野海運	9,200	507.00	4,664,400
九州旅客鉄道	13,200	3,365.00	44,418,000
日本航空	32,000	3,691.00	118,112,000
A N A ホールディングス	330,000	327.40	108,042,000
パスコ	1,000	418.00	418,000
三菱倉庫	12,000	1,592.00	19,104,000
三井倉庫ホールディングス	10,000	338.00	3,380,000
住友倉庫	13,000	632.00	8,216,000
澁澤倉庫	5,000	353.00	1,765,000
ヤマタネ	900	1,623.00	1,460,700
乾汽船	1,300	991.00	1,288,300
日本トランスシティ	4,000	464.00	1,856,000
ケイヒン	8,000	158.00	1,264,000
中央倉庫	1,100	1,088.00	1,196,800
安田倉庫	1,600	784.00	1,254,400
東洋埠頭	2,000	190.00	380,000
宇徳	2,800	424.00	1,187,200
上組	21,000	1,061.00	22,281,000

キューソー流通システム	600	2,624.00	1,574,400
郵船ロジスティクス	1,600	1,205.00	1,928,000
近鉄エクスプレス	3,200	1,697.00	5,430,400
エーアイテイー	1,200	1,093.00	1,311,600
内外トランスライン	1,200	1,096.00	1,315,200
東京放送ホールディングス	11,600	2,052.00	23,803,200
日本テレビホールディングス	16,000	2,023.00	32,368,000
朝日放送	1,700	778.00	1,322,600
テレビ朝日ホールディングス	4,800	2,302.00	11,049,600
スカパーJ S A Tホールディングス	11,400	507.00	5,779,800
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,572.00	3,600,800
U - N E X T	1,600	1,138.00	1,820,800
ワイヤレスゲート	700	1,565.00	1,095,500
コネクシオ	1,500	1,571.00	2,356,500
日本通信	14,700	179.00	2,631,300
日本電信電話	140,700	4,727.00	665,088,900
K D D I	173,400	2,956.00	512,570,400
光通信	2,100	11,010.00	23,121,000
N T T ドコモ	131,000	2,700.00	353,700,000
エムティーアイ	2,700	688.00	1,857,600
G M O インターネット	6,400	1,516.00	9,702,400
カドカワ	5,100	1,614.00	8,231,400
学研ホールディングス	6,000	309.00	1,854,000
ゼンリン	2,300	2,188.00	5,032,400
昭文社	1,800	715.00	1,287,000
インプレスホールディングス	8,200	147.00	1,205,400
東京電力ホールディングス	150,700	440.00	66,308,000
中部電力	58,500	1,506.50	88,130,250
関西電力	72,500	1,255.00	90,987,500
中国電力	24,600	1,239.00	30,479,400
北陸電力	17,400	1,113.00	19,366,200
東北電力	44,400	1,459.00	64,779,600
四国電力	16,000	1,151.00	18,416,000
九州電力	39,200	1,265.00	49,588,000
北海道電力	16,600	810.00	13,446,000
沖縄電力	2,600	2,619.00	6,809,400
電源開発	14,100	2,700.00	38,070,000
エフオン	1,200	984.00	1,180,800
イーレックス	700	3,590.00	2,513,000
東京瓦斯	190,000	518.90	98,591,000
大阪瓦斯	172,000	434.30	74,699,600
東邦瓦斯	45,000	794.00	35,730,000
北海道瓦斯	4,000	278.00	1,112,000
広島ガス	3,600	373.00	1,342,800
西部瓦斯	20,000	263.00	5,260,000
静岡ガス	5,500	727.00	3,998,500
メタウォーター	1,000	2,912.00	2,912,000
アイネット	1,100	1,233.00	1,356,300
松竹	12,000	1,344.00	16,128,000
東宝	11,500	3,310.00	38,065,000
エイチ・アイ・エス	3,000	2,983.00	8,949,000
東映	7,000	1,005.00	7,035,000
ラックランド	600	2,020.00	1,212,000
エヌ・ティ・ティ・データ	10,800	5,360.00	57,888,000
共立メンテナンス	1,500	6,930.00	10,395,000
イチネンホールディングス	1,900	1,197.00	2,274,300
建設技術研究所	1,200	1,110.00	1,332,000
スペース	1,000	1,298.00	1,298,000
アインホールディングス	2,100	8,440.00	17,724,000
東京テアトル	8,000	153.00	1,224,000

ナガワ	300	4,665.00	1,399,500
よみうりランド	4,000	460.00	1,840,000
東京都競馬	13,000	257.00	3,341,000
常磐興産	800	1,617.00	1,293,600
カナモト	2,600	2,920.00	7,592,000
東京ドーム	7,400	1,108.00	8,199,200
D T S	1,800	2,580.00	4,644,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,700	3,350.00	22,445,000
シーイーシー	1,000	1,833.00	1,833,000
カブコン	4,100	2,380.00	9,758,000
西尾レントオール	1,500	3,450.00	5,175,000
日本空港ビルデング	5,600	3,945.00	22,092,000
トランス・コスモス	2,200	2,616.00	5,755,200
乃村工藝社	4,000	1,916.00	7,664,000
ジャステック	1,100	1,055.00	1,160,500
S C S K	4,800	4,155.00	19,944,000
藤田観光	6,000	364.00	2,184,000
K N T - C Tホールディングス	10,000	137.00	1,370,000
日本管財	1,600	1,798.00	2,876,800
トーカイ	800	4,090.00	3,272,000
白洋舎	500	2,730.00	1,365,000
セコム	19,300	8,265.00	159,514,500
日本システムウエア	800	1,594.00	1,275,200
セントラル警備保障	800	1,890.00	1,512,000
アイネス	2,200	1,144.00	2,516,800
丹青社	3,200	865.00	2,768,000
メイテック	2,200	4,355.00	9,581,000
T K C	1,600	3,365.00	5,384,000
アサツー ディ・ケイ	3,000	2,937.00	8,811,000
富士ソフト	2,600	2,811.00	7,308,600
応用地質	1,800	1,486.00	2,674,800
船井総研ホールディングス	2,400	1,972.00	4,732,800
N S D	3,700	1,734.00	6,415,800
進学会	2,200	577.00	1,269,400
コナミホールディングス	7,900	4,665.00	36,853,500
学究社	800	1,621.00	1,296,800
ベネッセホールディングス	6,200	3,385.00	20,987,000
イオンディライト	2,100	3,495.00	7,339,500
ナック	1,200	993.00	1,191,600
福井コンピュータホールディングス	500	2,868.00	1,434,000
ニチイ学館	3,200	918.00	2,937,600
ダイセキ	3,200	2,377.00	7,606,400
ステップ	900	1,405.00	1,264,500
日鉄住金物産	1,500	4,900.00	7,350,000
元気寿司	600	2,258.00	1,354,800
トラスコ中山	4,000	2,555.00	10,220,000
ヤマダ電機	58,600	578.00	33,870,800
オートバックスセブン	6,500	1,807.00	11,745,500
アークランドサカモト	3,000	1,426.00	4,278,000
ニトリホールディングス	7,600	12,280.00	93,328,000
グルメ杵屋	1,000	1,044.00	1,044,000
愛眼	6,200	197.00	1,221,400
ケーユーホールディングス	1,500	920.00	1,380,000
吉野家ホールディングス	6,100	1,661.00	10,132,100
加藤産業	2,700	2,933.00	7,919,100
イノテック	2,100	695.00	1,459,500
イエローハット	1,700	2,797.00	4,754,900
松屋フーズ	800	4,240.00	3,392,000
J B C Cホールディングス	1,600	815.00	1,304,000

JKホールディングス	2,000	668.00	1,336,000	
サガミチェーン	2,200	1,379.00	3,033,800	
日伝	700	3,475.00	2,432,500	
関西スーパーマーケット	1,400	1,527.00	2,137,800	
ミロク情報サービス	1,300	1,748.00	2,272,400	
北沢産業	6,100	220.00	1,342,000	
杉本商事	1,000	1,568.00	1,568,000	
因幡電機産業	2,500	3,975.00	9,937,500	
王将フードサービス	1,300	4,250.00	5,525,000	
プレナス	2,000	2,489.00	4,978,000	
ミニストップ	1,300	2,164.00	2,813,200	
アークス	3,300	2,596.00	8,566,800	
パローホールディングス	3,800	2,777.00	10,552,600	
パイテックホールディングス	1,000	1,377.00	1,377,000	
ミスミグループ本社	19,700	2,057.00	40,522,900	
藤久	700	1,744.00	1,220,800	
ベルク	800	4,535.00	3,628,000	
大 庄	900	1,578.00	1,420,200	
タキヒヨー	3,000	488.00	1,464,000	
ファーストリテイリング	2,900	35,610.00	103,269,000	
ソフトバンクグループ	78,900	8,716.00	687,692,400	
スズケン	8,000	3,810.00	30,480,000	
サンドラッグ	3,300	7,430.00	24,519,000	
サクスパー ホールディングス	1,600	1,271.00	2,033,600	
ジェコス	1,200	1,140.00	1,368,000	
やまや	700	1,737.00	1,215,900	
ルネサスイーストン	2,200	615.00	1,353,000	
ペルーナ	4,400	838.00	3,687,200	
合計	26,741,300		40,287,740,190	

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28年2月22日現在)	(平成29年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	204,100,084	3,600,610
コール・ローン	17,057,893	247,054,430
国債証券	25,067,271,251	28,743,836,790
未収利息	100,638,043	104,558,699
前払費用	13,638,500	4,958,929
流動資産合計	25,402,705,771	29,104,009,458
資産合計	25,402,705,771	29,104,009,458
負債の部		
流動負債		
未払解約金	82,121,608	139,598,817
その他未払費用	-	358
流動負債合計	82,121,608	139,599,175
負債合計	82,121,608	139,599,175
純資産の部		
元本等		
元本	18,912,024,491	21,663,216,336
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,408,559,672	7,301,193,947
純資産合計	25,320,584,163	28,964,410,283
負債純資産合計	25,402,705,771	29,104,009,458

## 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に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29年2月21日現在）
1. 受益権総口数	18,912,024,491口	21,663,216,336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)	1.3370円 (13,370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27年2月24日 至 平成28年2月22日）	（自 平成28年2月23日 至 平成29年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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28年2月22日現在）	（平成29年2月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	（平成28年2月22日現在）	（平成29年2月21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	750,573,100	1,554,380
合計	750,573,100	1,554,380

（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28年2月22日現在）	（平成29年2月21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	11,716,936,730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	8,965,744,885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	1,431,394,708円
DCニッセイ国内債券インデックス	6,601,563,989円	7,213,856,650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	16,344,307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	3,900,385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	1,456,203,801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	3,265,859,451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	930,819,366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	143,598,250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	297,207,416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	132,975,984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	2,923,997,739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	3,602,521,350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・インデックスバランスファンド（4資産均等型）	160,643,046円	244,536,929円
計	18,912,024,491円	21,663,216,336円

附属明細表（平成29年2月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額又は口数	評価額 （円）	備考
国債証券	第365回 利付国債（2年）	819,000,000	822,914,820	
	第113回 利付国債（5年）	1,483,000,000	1,494,196,650	
	第115回 利付国債（5年）	277,000,000	278,988,860	
	第122回 利付国債（5年）	1,195,000,000	1,204,141,750	
	第124回 利付国債（5年）	780,000,000	786,372,600	
	第128回 利付国債（5年）	621,000,000	626,793,930	
	第4回 利付国債（40年）	512,000,000	701,081,600	
	第291回 利付国債（10年）	227,000,000	230,843,110	
	第292回 利付国債（10年）	354,000,000	361,508,340	
	第298回 利付国債（10年）	88,000,000	90,487,760	
	第299回 利付国債（10年）	29,000,000	29,915,820	
	第303回 利付国債（10年）	1,289,000,000	1,341,977,900	
	第306回 利付国債（10年）	468,000,000	490,510,800	

第310回	利付国債(10年)	487,000,000	506,747,850
第312回	利付国債(10年)	2,089,000,000	2,195,288,320
第313回	利付国債(10年)	158,000,000	167,171,900
第318回	利付国債(10年)	670,000,000	704,015,900
第325回	利付国債(10年)	60,000,000	62,920,200
第327回	利付国債(10年)	161,000,000	169,088,640
第328回	利付国債(10年)	311,000,000	323,303,160
第329回	利付国債(10年)	1,048,000,000	1,104,130,880
第332回	利付国債(10年)	1,034,000,000	1,078,524,040
第334回	利付国債(10年)	1,138,000,000	1,187,104,700
第26回	利付国債(30年)	1,794,000,000	2,359,719,960
第28回	利付国債(30年)	955,000,000	1,282,383,550
第36回	利付国債(30年)	40,000,000	50,764,800
第38回	利付国債(30年)	62,000,000	76,194,900
第46回	利付国債(30年)	112,000,000	129,672,480
第47回	利付国債(30年)	165,000,000	195,251,100
第68回	利付国債(20年)	94,000,000	108,694,080
第70回	利付国債(20年)	371,000,000	435,861,930
第88回	利付国債(20年)	1,261,000,000	1,521,396,500
第94回	利付国債(20年)	604,000,000	724,775,840
第95回	利付国債(20年)	991,000,000	1,212,468,680
第133回	利付国債(20年)	227,000,000	273,187,690
第140回	利付国債(20年)	1,789,000,000	2,129,929,730
第141回	利付国債(20年)	128,000,000	152,532,480
第146回	利付国債(20年)	1,791,000,000	2,132,973,540
国債証券 合計		25,682,000,000	28,743,836,790
合計		25,682,000,000	28,743,836,790

## 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28年2月22日現在)	(平成29年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,099,792,433	1,272,188,626
金銭信託	518,887,988	14,297,378
コール・ローン	43,366,643	981,009,069
株式	44,075,285,993	68,008,375,861
投資証券	1,155,981,691	1,732,967,961
派生商品評価勘定	34,132,221	56,061,353
未収入金	33,823,068	596,026
未収配当金	86,271,458	100,462,967
差入委託証拠金	719,888,452	713,182,031
流動資産合計	47,767,429,947	72,879,141,272
資産合計	47,767,429,947	72,879,141,272
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,237,978	319,466
未払解約金	57,093,478	233,992,520
その他未払費用	-	1,142
流動負債合計	74,331,456	234,313,128
負債合計	74,331,456	234,313,128
純資産の部		
元本等		
元本	39,165,529,544	48,732,895,288
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	8,527,568,947	23,911,932,856
純資産合計	47,693,098,491	72,644,828,144
負債純資産合計	47,767,429,947	72,879,141,272

## 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 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 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 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 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 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 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29年2月21日現在）
1. 受益権総口数	39,165,529,544口	48,732,895,288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)	1.4907円 (14,907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27年2月24日 至 平成28年2月22日)	(自 平成28年2月23日 至 平成29年2月21日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成28年2月22日現在）	（平成29年2月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 （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28年2月22日現在）	（平成29年2月21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	4,198,124,073	4,892,128,362
投資証券	42,408,248	97,253,740
合計	4,240,532,321	4,989,382,102

## （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29年2月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	262,815,612	-	262,616,440	199,172	382,925,050	-	384,811,200	1,886,150
アメリカ・ドル	175,293,322	-	175,240,520	52,802	233,684,370	-	234,779,400	1,095,030
イギリス・ポンド	-	-	-	-	78,532,720	-	79,172,800	640,080
ユーロ	87,522,290	-	87,375,920	146,370	70,707,960	-	70,859,000	151,040
合計	262,815,612	-	262,616,440	199,172	382,925,050	-	384,811,200	1,886,150

## （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ではありません。

## 株式関連

種類	（平成28年2月22日 現在）				（平成29年2月21日 現在）			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	2,162,458,998	-	2,179,552,412	17,093,414	2,618,145,073	-	2,672,000,810	53,855,737
合計	2,162,458,998	-	2,179,552,412	17,093,414	2,618,145,073	-	2,672,000,810	53,855,737

## （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28年2月22日現在）	（平成29年2月21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	29,482,977,047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	19,915,611,303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）	327,907,032円	293,238,621円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	2,109,450,728円	1,972,920,724円
DC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	1,686,859,297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	12,261,760,498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）	6,262,929,248円	1,813,409,159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	28,401,997,926円
DCニッセイ外国株式インデックス	21,751,286円	2,076,213,892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	226,235,517円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	-円	259,654円
計	39,165,529,544円	48,732,895,288円

附属明細表（平成29年2月21日現在）

第1 有価証券明細表  
株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	11,610	182.95	2,124,049.50	
	ABBOTT LABORATORIES	32,976	44.69	1,473,697.44	
	ABBVIE INC	31,296	61.77	1,933,153.92	
	ACCENTURE PLC	11,943	121.23	1,447,849.89	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	11,373	45.33	515,538.09	
	ACUITY BRANDS INC	822	220.29	181,078.38	
	ADOBE SYSTEMS INC	9,576	119.67	1,145,959.92	
	ADVANCE AUTO PARTS	1,415	161.58	228,635.70	
	AERCAP HOLDINGS NV	2,930	46.65	136,684.50	
	AES CORP	12,230	11.46	140,155.80	
	AETNA INC	6,736	125.27	843,818.72	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	980	168.42	165,051.60	
	AFLAC INC	7,813	71.10	555,504.30	
	AGCO CORP	1,177	63.99	75,316.23	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,238	51.63	322,067.94	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,950	141.50	558,925.00	

AKAMA I TECHNOLOGIES INC	3,358	62.34	209,337.72	
ALBEMARLE CORP	2,144	91.92	197,076.48	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,308	128.82	554,956.56	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,314	101.76	133,719.21	
ALKERMES PLC	2,768	54.57	151,049.76	
ALLEGHANY CORP	296	636.79	188,489.84	
ALLERGAN PLC	7,610	247.35	1,882,333.50	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,130	235.04	265,595.20	
ALLIANT ENERGY CORP	4,241	38.08	161,497.28	
ALLSTATE CORP	7,128	80.44	573,376.32	
ALLY FINANCIAL INC	7,979	23.21	185,192.59	
ALPHABET INC-CL A	5,666	846.55	4,796,552.30	
ALPHABET INC-CL C	5,941	828.07	4,919,563.87	
ALTRIA GROUP INC	37,551	72.97	2,740,096.47	
AMAZON.COM INC	7,742	845.07	6,542,531.94	
AMERCO	140	381.21	53,369.40	
AMEREN CORPORATION	4,725	53.37	252,173.25	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,457	46.91	115,257.87	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	9,504	64.11	609,301.44	
AMERICAN EXPRESS CO	15,077	79.71	1,201,787.67	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,522	62.50	1,282,625.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,472	73.81	256,268.32	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,091	128.99	398,708.09	
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,660	90.76	332,181.60	
AMERITRADE HOLDING CORP	5,019	43.15	216,569.85	
AMETEK INC	4,476	54.50	243,942.00	
AMGEN INC	14,368	173.29	2,489,830.72	
AMPHENOL CORP-CL A	5,934	69.46	412,175.64	
ANADARKO PETROLEUM CORP	10,626	66.77	709,498.02	
ANALOG DEVICES INC	5,895	82.48	486,219.60	
ANSYS INC	1,599	100.27	160,331.73	
ANTERO RESOURCES CORP	2,845	25.07	71,324.15	
ANTHEM INC	5,056	160.25	810,224.00	
AON PLC	5,100	117.53	599,403.00	
APACHE CORP	7,272	55.44	403,159.68	
APPLE INC	103,524	135.72	14,050,277.28	
APPLIED MATERIALS INC	20,726	35.67	739,296.42	
ARAMARK	4,232	35.75	151,294.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,348	94.02	220,758.96	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11,136	44.69	497,667.84	
ARCONIC INC	8,188	29.91	244,903.08	
ARROW ELECTRONICS INC	1,665	73.50	122,377.50	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,316	56.94	188,813.04	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1,144	121.81	139,350.64	
ASSURANT INC	1,091	96.75	105,554.25	
AT&T INC	118,341	41.48	4,908,784.68	

ATMOS ENERGY CORP	1,943	76.04	147,745.72	
AUTODESK INC	3,828	86.40	330,739.20	
AUTOLIV INC	1,698	105.87	179,767.26	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	8,762	99.68	873,396.16	
AUTONATION INC	1,304	47.77	62,292.08	
AUTOZONE INC	565	741.05	418,693.25	
AVERY DENNISON CORP	1,629	79.41	129,358.89	
AVNET INC	2,324	46.41	107,856.84	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,010	29.65	118,896.50	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,647	68.56	112,918.32	
BAKER HUGHES INC	7,806	60.76	474,292.56	
BALL CORP	3,184	73.27	233,291.68	
BANK OF AMERICA CORP	195,956	24.52	4,804,841.12	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,467	47.14	964,814.38	
BARD (C.R.) INC	1,411	242.41	342,040.51	
BAXTER INTERNATIONAL INC	9,386	49.73	466,765.78	
BB&T CORPORATION	15,596	47.96	747,984.16	
BE AEROSPACE INC	1,869	62.83	117,429.27	
BECTON DICKINSON & CO	4,091	180.90	740,061.90	
BED BATH & BEYOND INC	2,822	41.14	116,097.08	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	23,396	168.57	3,943,863.72	
BEST BUY CO INC	5,560	45.24	251,534.40	
BIOGEN INC	4,207	288.94	1,215,570.58	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,284	89.87	295,133.08	
BLACKROCK INC	2,331	388.76	906,199.56	
BOEING CO	11,381	172.71	1,965,612.51	
BORGWARNER INC	3,922	42.38	166,214.36	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	26,088	25.39	662,374.32	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	32,098	54.59	1,752,229.82	
BROADCOM LTD	7,596	210.41	1,598,274.36	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,171	68.58	148,887.18	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	4,060	48.20	195,692.00	
BUNGE LIMITED	2,611	77.78	203,083.58	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,858	79.06	225,953.48	
CA Inc	5,963	32.09	191,352.67	
CABOT OIL & GAS CORP	8,962	23.11	207,111.82	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	5,354	30.20	161,690.80	
CALPINE CORP	6,373	11.47	73,098.31	
CAMPBELL SOUP CO	3,860	58.48	225,732.80	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,706	91.81	891,107.86	
CARDINAL HEALTH INC	6,107	80.71	492,895.97	
CARMAX INC	3,693	67.02	247,504.86	
CARNIVAL CORP	6,836	55.40	378,714.40	
CATERPILLAR INC	11,216	98.85	1,108,701.60	
CBRE GROUP INC	5,650	35.68	201,592.00	
CBS CORP-CL B	7,865	65.69	516,651.85	

CDK GLOBAL INC	2,351	65.47	153,919.97	
CDW CORP/DE	2,707	59.99	162,392.93	
CELANESE CORP-SERIES A	2,772	89.64	248,482.08	
CELGENE CORP	14,895	121.16	1,804,678.20	
CENTENE CORP	3,271	67.61	221,152.31	
CENTERPOINT ENERGY INC	7,980	26.51	211,549.80	
CENTURYLINK INC	10,569	24.28	256,615.32	
CERNER CORP	5,834	56.15	327,579.10	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,267	34.11	145,547.37	
CHARLES SCHWAB CORP	22,837	41.55	948,877.35	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	4,173	326.55	1,362,693.15	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	2,462	101.21	249,179.02	
CHENIERE ENERGY INC	3,774	46.71	176,283.54	
CHEVRON CORP	36,237	110.33	3,998,028.21	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	559	427.61	239,033.99	
CHUBB LTD	8,909	136.19	1,213,316.71	
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,920	49.70	244,524.00	
CIGNA CORP	4,928	143.56	707,463.68	
CIMAREX ENERGY CO	1,813	132.02	239,352.26	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,987	72.67	217,065.29	
CINTAS CORP	1,594	118.61	189,064.34	
CISCO SYSTEMS INC	96,686	33.74	3,262,185.64	
CIT GROUP INC	3,662	43.72	160,102.64	
CITIGROUP INC	55,760	60.17	3,355,079.20	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	9,924	37.84	375,524.16	
CITRIX SYSTEMS INC	2,983	80.50	240,131.50	
CLOROX CO	2,512	133.71	335,879.52	
CME GROUP INC	6,485	122.62	795,190.70	
CMS ENERGY CORP	5,500	43.22	237,710.00	
COACH INC	5,347	38.21	204,308.87	
COCA-COLA CO	78,756	41.23	3,247,109.88	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	11,653	57.96	675,407.88	
COLGATE-PALMOLIVE CO	16,291	71.98	1,172,626.18	
COMCAST CORP	46,235	75.32	3,482,420.20	
COMERICA INC	3,312	72.37	239,689.44	
COMPUTER SCIENCES CORP	2,564	70.56	180,915.84	
CONAGRA BRANDS INC	8,013	39.61	317,394.93	
CONCHO RESOURCES INC	2,695	140.06	377,461.70	
CONOCOPHILLIPS	23,768	47.51	1,129,217.68	
CONSOLIDATED EDISON INC	5,898	73.50	433,503.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,406	161.32	549,455.92	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,701	45.97	78,194.97	
COOPER COS INC/THE	888	195.91	173,968.08	
CORE LABORATORIES N.V.	814	114.12	92,893.68	
CORNING INC	19,919	27.65	550,760.35	
COSTAR GROUP INC	600	209.69	125,814.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	8,409	175.86	1,478,806.74	
COTY INC-CL A	9,104	18.89	171,974.56	
CROWN HOLDINGS INC	2,588	52.78	136,594.64	

CSX CORP	18,344	48.54	890,417.76
CUMMINS INC	3,066	152.91	468,822.06
CVS HEALTH CORP	20,476	79.69	1,631,732.44
D&B CORP	669	108.20	72,385.80
DANAHER CORP	11,924	84.05	1,002,212.20
DARDEN RESTAURANTS INC	2,174	76.73	166,811.02
DAVITA INC	3,197	66.90	213,879.30
DEERE & CO	5,138	110.27	566,567.26
DELL TECHNOLOGIES INC- CL V	4,282	64.59	276,574.38
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	5,241	75.46	395,485.86
DELTA AIR LINES INC	3,568	51.23	182,788.64
DENTSPLY SIRONA INC	4,466	62.68	279,928.88
DEVON ENERGY CORPORATION	9,031	44.17	398,899.27
DEXCOM INC	1,541	81.89	126,192.49
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,431	107.63	154,018.53
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,599	49.79	79,614.21
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,756	71.30	553,002.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	2,755	28.68	79,013.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,244	28.09	119,213.96
DISH NETWORK CORP	4,386	62.89	275,835.54
DOLLAR GENERAL CORP	5,411	77.67	420,272.37
DOLLAR TREE INC	4,535	80.00	362,800.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,125	73.77	894,461.25
DOMINO'S PIZZA INC	884	187.93	166,130.12
DOVER CORP	2,971	79.94	237,501.74
DOW CHEMICAL CO	21,634	61.26	1,325,298.84
DR HORTON INC	6,792	30.49	207,088.08
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/ I	3,571	93.98	335,602.58
DTE ENERGY COMPANY	3,489	98.12	342,340.68
DUKE ENERGY CORP	13,286	78.36	1,041,090.96
E*TRADE FINANCIAL	5,220	37.17	194,027.40
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,837	80.25	227,669.25
EATON CORP PLC	8,712	71.63	624,040.56
EATON VANCE CORP	2,039	43.53	88,757.67
EBAY INC	20,597	33.76	695,354.72
ECOLAB INC	5,050	123.95	625,947.50
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,081	80.02	86,501.62
EDISON INTERNATIONAL	6,307	76.34	481,476.38
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,080	89.74	366,139.20
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	16,792	77.49	1,301,212.08
ELECTRONIC ARTS INC	5,772	87.30	503,895.60
ELI LILLY & CO	19,094	80.39	1,534,966.66
EMERSON ELECTRIC CO	12,347	61.89	764,155.83
ENDO INTERNATIONAL PLC	3,867	13.08	50,580.36
ENTERGY CORP	3,477	73.55	255,733.35
ENVISION HEALTHCARE CORP	1,150	71.59	82,328.50

EOG RESOURCES INC	11,060	99.03	1,095,271.80
EQT CORP	3,323	62.07	206,258.61
EQUIFAX INC	2,283	130.14	297,109.62
ESTEE LAUDER COS INC	4,239	85.00	360,315.00
EVEREST RE GROUP LTD	784	235.12	184,334.08
EVERSOURCE ENERGY	6,173	56.15	346,613.95
EXELON CORP	17,780	35.58	632,612.40
EXPEDIA INC	2,371	119.41	283,121.11
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	3,682	56.50	208,033.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	12,102	69.97	846,776.94
EXXON MOBIL CORP	79,659	81.76	6,512,919.84
F5 NETWORKS INC	1,252	143.35	179,474.20
FACEBOOK INC-A	44,645	133.53	5,961,446.85
FASTENAL CO	5,549	50.71	281,389.79
FEDEX CORP	4,882	193.70	945,643.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	5,995	82.05	491,889.75
FIFTH THIRD BANCORP	14,627	27.54	402,827.58
FIRST DATA CORP- CLASS A	5,659	16.37	92,637.83
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,867	95.60	274,085.20
FIRSTENERGY CORP	8,243	31.01	255,615.43
FISERV INC	4,239	111.98	474,683.22
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,776	166.47	295,650.72
FLEX LTD	10,008	16.44	164,531.52
FLIR SYSTEMS INC	2,530	36.62	92,648.60
FLOWSERVE CORP	2,387	48.37	115,459.19
FLUOR CORP	2,543	56.43	143,501.49
FMC CORP	2,448	58.23	142,547.04
FNF GROUP	4,513	37.64	169,869.32
FOOT LOCKER INC	2,532	71.00	179,772.00
FORD MOTOR CO	71,268	12.58	896,551.44
FORTINET INC	2,684	37.45	100,529.22
FORTIVE CORP	5,963	57.69	344,005.47
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	2,821	57.06	160,966.26
FRANKLIN RESOURCES INC	7,114	42.53	302,558.42
FREEPORT-MCMORAN INC	24,226	14.91	361,209.66
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	21,984	3.29	72,327.36
GAP INC	4,358	24.47	106,640.26
GARMIN LTD	2,058	50.81	104,566.98
GARTNER INC	1,538	103.13	158,613.94
GENERAL DYNAMICS CORP	4,977	189.06	940,951.62
GENERAL ELECTRIC CO	172,197	30.37	5,229,622.89
GENERAL MILLS INC	11,515	59.23	682,033.45
GENERAL MOTORS CO	26,792	37.22	997,198.24
GENUINE PARTS CO	2,849	100.67	286,808.83
GILEAD SCIENCES INC	25,345	69.85	1,770,348.25
GLOBAL PAYMENTS INC	2,962	77.95	230,887.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,017	250.38	1,756,916.46
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	4,796	36.07	172,991.72
H&R BLOCK INC	4,043	20.51	82,921.93

HALLIBURTON CO	16,542	53.71	888,470.82
HANESBRANDS INC	6,940	21.02	145,878.80
HARLEY-DAVIDSON INC	3,444	56.93	196,066.92
HARMAN INTERNATIONAL	1,277	111.01	141,759.77
HARRIS CORP	2,425	109.46	265,440.50
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	7,391	48.36	357,428.76
HASBRO INC	2,121	98.50	208,918.50
HCA HOLDINGS INC	5,846	84.63	494,746.98
HELMERICH & PAYNE	1,964	68.26	134,062.64
HENRY SCHEIN INC	1,567	168.11	263,428.37
HERSHEY CO/THE	2,782	107.25	298,369.50
HESS CORP	5,458	51.75	282,451.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	31,827	24.40	776,578.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,791	58.50	221,773.50
HOLLYFRONTIER CORP	3,050	29.92	91,256.00
HOLOGIC INC	4,811	40.00	192,440.00
HOME DEPOT INC	23,746	143.00	3,395,678.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	13,871	124.56	1,727,771.76
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	21,700	6.81	147,777.00
HORMEL FOODS CORP	5,582	37.26	207,985.32
HP INC	32,780	15.95	522,841.00
HUMANA INC	2,864	204.60	585,974.40
HUNTINGTON BANCSHARES INC	20,715	14.13	292,702.95
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	856	211.91	181,394.96
IDEXX LABORATORIES INC	1,721	142.23	244,777.83
IHS MARKIT LTD	6,895	40.20	277,179.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	6,130	130.31	798,800.30
ILLUMINA INC	2,815	163.37	459,886.55
INCYTE CORP	3,257	120.49	392,435.93
INGERSOLL-RAND PLC	4,944	80.99	400,414.56
INGREDION INC	1,310	120.79	158,234.90
INTEL CORP	90,679	36.48	3,307,969.92
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,418	58.40	666,811.20
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	17,436	180.67	3,150,162.12
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	1,491	122.37	182,453.67
INTERNATIONAL PAPER CO	7,488	52.15	390,499.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7,826	24.50	191,737.00
INTUIT INC	4,673	119.86	560,105.78
INTUITIVE SURGICAL INC	738	724.66	534,799.08
INVESCO LTD	7,829	32.54	254,755.66
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,200	57.61	126,742.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,800	63.86	306,528.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,110	137.19	152,280.90

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,781	101.04	179,952.24	
JM SMUCKER CO	2,230	135.95	303,168.50	
JOHNSON & JOHNSON	52,554	118.86	6,246,568.44	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	17,914	41.91	750,775.74	
JONES LANG LASALLE INC	818	116.28	95,117.04	
JPMORGAN CHASE & CO	69,357	90.23	6,258,082.11	
JUNIPER NETWORKS INC	6,506	28.39	184,705.34	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,027	86.89	176,126.03	
KELLOGG CO	5,061	72.90	368,946.90	
KEYCORP	20,698	18.96	392,434.08	
KIMBERLY-CLARK CORP	6,924	131.93	913,483.32	
KINDER MORGAN INC	36,444	21.77	793,385.88	
KLA-TENCOR CORP	3,009	88.46	266,176.14	
KOHL'S CORP	3,354	41.97	140,767.38	
KRAFT HEINZ CO/THE	11,698	96.65	1,130,611.70	
KROGER CO	17,315	34.01	588,883.15	
L BRANDS INC	4,706	57.51	270,642.06	
L3 TECHNOLOGIES INC	1,480	168.23	248,980.40	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	1,964	139.59	274,154.76	
LAM RESEARCH CORP	3,075	114.90	353,317.50	
LAS VEGAS SANDS CORP	8,358	52.03	434,866.74	
LEAR CORP	1,371	142.37	195,189.27	
LEGGETT & PLATT INC	2,454	48.62	119,313.48	
LENNAR CORP-CL A	3,372	46.46	156,663.12	
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,886	25.56	150,446.16	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,921	57.30	339,273.30	
LIBERTY BROADBAND-C	1,990	86.44	172,015.60	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,581	36.75	168,351.75	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,882	35.58	422,761.56	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	7,764	19.30	149,845.20	
LIBERTY LILAC GROUP-C	2,058	26.54	54,619.32	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	1,980	38.02	75,279.60	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	3,481	37.86	131,790.66	
LINCOLN NATIONAL CORP	4,432	71.69	317,730.08	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	4,603	64.92	298,826.76	
LKQ CORP	5,906	31.94	188,637.64	
LOCKHEED MARTIN CORP	5,079	265.35	1,347,712.65	
LOEWS CORP	5,486	46.98	257,732.28	
LOWE'S COS INC	16,929	76.74	1,299,131.46	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,008	66.73	133,993.84	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,771	92.91	629,093.61	
M&T BANK CORP	2,698	167.91	453,021.18	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,481	79.50	117,739.50	
MACY'S INC	5,789	32.30	186,984.70	
MALLINCKRODT PLC	1,971	54.74	107,892.54	
MANPOWER GROUP	1,246	97.35	121,298.10	
MARATHON OIL CORP	16,216	16.23	263,185.68	

MARATHON PETROLEUM CORP	10,132	50.02	506,802.64	
MARKEL CORP	269	964.71	259,506.99	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	6,352	89.36	567,614.72	
MARSH & MCLENNAN COS INC	9,960	73.52	732,259.20	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,157	217.55	251,705.35	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,948	15.81	125,657.88	
MASCO CORP	6,378	33.52	213,790.56	
MASTERCARD INC-CLASS A	18,629	109.42	2,038,385.18	
MATTEL INC	6,395	26.10	166,909.50	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,449	45.11	245,804.39	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,207	97.59	215,381.13	
MCDONALD'S CORP	16,386	127.80	2,094,130.80	
MCKESSON CORP	4,330	150.25	650,582.50	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,557	87.50	311,237.50	
MEDNAX INC	1,717	70.07	120,310.19	
MEDTRONIC PLC	26,749	78.88	2,109,961.12	
MELCO PBL ENTERTAINMENT-ADR	3,497	16.99	59,414.03	
MERCADOLIBRE INC	730	198.43	144,853.90	
MERCK & CO INC	53,100	65.39	3,472,209.00	
METLIFE INC	17,887	52.97	947,474.39	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	510	471.55	240,490.50	
MGM MIRAGE	8,652	26.60	230,143.20	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,095	38.30	118,538.50	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,130	71.68	296,038.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	19,937	23.35	465,528.95	
MICROSOFT CORP	142,200	64.62	9,188,964.00	
MIDDLEBY CORP	1,053	138.21	145,535.13	
MOBILEYE NV	3,208	45.65	146,445.20	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,209	221.55	267,853.95	
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,609	101.59	366,638.31	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	29,858	42.50	1,268,965.00	
MONSANTO CO	8,413	109.00	917,017.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	7,681	43.63	335,122.03	
MOODY'S CORP	3,330	112.90	375,957.00	
MORGAN STANLEY	27,523	46.15	1,270,186.45	
MOSAIC CO/THE	6,354	33.59	213,430.86	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,938	79.31	233,012.78	
MSCI INC	1,647	94.27	155,262.69	
MURPHY OIL CORP	2,976	28.09	83,595.84	
MYLAN NV	8,730	42.05	367,096.50	
NASDAQ INC	2,101	71.51	150,242.51	
NATIONAL-OILWELL INC	7,230	39.31	284,211.30	
NAVIENT CORP	5,786	15.45	89,393.70	
NETAPP INC	5,333	40.17	214,226.61	
NETFLIX INC	8,237	142.22	1,171,466.14	

NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	8,995	15.19	136,634.05	
NEWELL BRANDS INC	8,329	46.64	388,464.56	
NEWFIELD EXPLORATION CO	3,640	41.82	152,224.80	
NEWMONT MINING CORP	10,134	37.01	375,059.34	
NEWS CORP - CLASS A	7,033	13.08	91,991.64	
NEXTERA ENERGY INC	8,902	126.86	1,129,307.72	
NIELSEN HOLDINGS PLC	6,862	45.08	309,338.96	
NIKE INC	25,910	56.75	1,470,392.50	
NISOURCE INC	6,056	22.70	137,471.20	
NOBLE ENERGY INC	8,241	37.05	305,329.05	
NORDSTROM INC	2,384	45.69	108,924.96	
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,694	122.78	699,109.32	
NORTHERN TRUST CORP	4,115	87.20	358,828.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,260	243.58	794,070.80	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,908	47.69	138,682.52	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	4,943	16.96	83,833.28	
NUCOR CORP	6,119	63.90	391,004.10	
NVIDIA CORP	10,257	107.23	1,099,858.11	
NXP SEMICONDUCTORS NV	5,652	102.40	578,764.80	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,824	268.12	489,050.88	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	14,659	66.27	971,451.93	
OGE ENERGY CORP	3,703	34.62	128,197.86	
OMNICOM GROUP	4,604	85.34	392,905.36	
ONEOK INC	4,035	53.64	216,437.40	
ORACLE CORP	59,373	42.06	2,497,228.38	
PACCAR INC	6,735	68.85	463,704.75	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,719	95.26	163,751.94	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,735	154.76	268,508.60	
PARKER HANNIFIN CORP	2,564	153.89	394,573.96	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	2,784	31.82	88,586.88	
PATTERSON COS INC	1,542	44.08	67,971.36	
PAYCHEX INC	6,215	59.13	367,492.95	
PAYPAL HOLDINGS INC	20,854	41.96	875,033.84	
PENTAIR PLC	3,301	58.13	191,887.13	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	5,612	19.19	107,694.28	
PEPSICO INC	27,653	108.15	2,990,671.95	
PERRIGO CO PLC	2,755	84.47	232,714.85	
PFIZER INC	116,498	33.62	3,916,662.76	
PG&E CORP	9,740	63.92	622,580.80	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	29,816	103.66	3,090,726.56	
PHILLIPS 66	9,021	78.66	709,591.86	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,072	78.70	163,066.40	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,250	192.00	624,000.00	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	1,744	31.93	55,685.92	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,426	126.86	1,195,782.36	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,119	87.16	97,532.04	

PPG INDUSTRIES INC	5,114	102.37	523,520.18
PPL CORPORATION	13,140	35.63	468,178.20
PRAXAIR INC	5,489	117.42	644,518.38
PRICELINE GROUP INC/THE	949	1,637.40	1,553,892.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,471	62.12	339,858.52
PROCTER & GAMBLE CO	49,094	91.09	4,471,972.46
PROGRESSIVE CORP	11,180	38.57	431,212.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,355	111.11	928,324.05
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	9,771	43.49	424,940.79
PULTE GROUP INC	5,650	21.40	120,910.00
PVH CORP	1,481	90.32	133,763.92
QORVO INC	2,336	67.12	156,792.32
QUALCOMM INC	28,299	56.46	1,597,761.54
QUEST DIAGNOSTICS	2,654	95.64	253,828.56
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	2,852	76.75	218,891.00
RALPH LAUREN CORP	1,031	78.39	80,820.09
RANGE RESOURCES CORP	3,391	31.27	106,036.57
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,363	78.86	186,346.18
RAYTHEON CO	5,668	152.86	866,410.48
RED HAT INC	3,485	82.60	287,861.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,489	371.18	552,687.02
REGIONS FINANCIAL CORP	23,914	15.38	367,797.32
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,160	129.09	149,744.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	759	146.04	110,844.36
REPUBLIC SERVICES INC	4,618	60.75	280,543.50
RESMED INC	2,572	72.27	185,878.44
REYNOLDS AMERICAN INC	16,437	60.73	998,219.01
RITE AID CORP	19,310	5.94	114,701.40
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	2,375	48.59	115,401.25
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,478	151.92	376,457.76
ROCKWELL COLLINS INC.	2,499	93.46	233,556.54
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,951	207.14	404,130.14
ROSS STORES INC	7,659	68.55	525,024.45
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,293	95.21	313,526.53
S&P GLOBAL INC	5,067	130.39	660,686.13
SABRE CORP	3,883	21.30	82,707.90
SALESFORCE.COM INC	12,374	81.47	1,008,109.78
SCANA CORP	2,593	65.65	170,230.45
SCHLUMBERGER LTD	26,700	80.65	2,153,355.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,513	76.04	115,048.52
SEAGATE TECHNOLOGY	5,748	47.14	270,960.72
SEALED AIR CORP	3,813	47.76	182,108.88
SEATTLE GENETICS INC	1,805	65.50	118,227.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,496	50.49	126,023.04
SEMPRA ENERGY	4,592	105.85	486,063.20

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,142	41.54	130,518.68	
SERVICENOW INC	3,161	92.74	293,151.14	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,508	311.35	469,515.80	
SIGNATURE BANK	979	159.30	155,954.70	
SIGNET JEWELERS LTD	1,316	73.91	97,265.56	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	32,938	4.94	162,713.72	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,596	96.35	346,474.60	
SMITH (A.O.) CORP	2,688	49.59	133,297.92	
SNAP-ON INC	1,115	172.57	192,415.55	
SOUTHERN CO	18,872	47.80	902,081.60	
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,887	57.32	165,482.84	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,074	8.68	78,762.32	
SPECTRA ENERGY CORP	13,456	41.09	552,907.04	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	494	133.91	66,151.54	
SPLUNK INC	2,431	64.37	156,483.47	
SPRINT CORP	14,641	9.30	136,161.30	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,887	126.65	365,638.55	
STAPLES INC	11,848	9.31	110,304.88	
STARBUCKS CORP	28,145	57.35	1,614,115.75	
STATE STREET CORP	7,466	80.67	602,282.22	
STERICYCLE INC	1,560	85.15	132,834.00	
STRYKER CORP	6,457	126.34	815,777.38	
SUNTRUST BANKS INC	9,442	59.59	562,648.78	
SYMANTEC CORP	11,792	28.80	339,609.60	
SYNCHRONY FINANCIAL	16,012	36.68	587,320.16	
SYNOPSIS INC	2,814	70.51	198,415.14	
SYSCO CORP	10,131	52.35	530,357.85	
T ROWE PRICE GROUP INC	4,743	71.10	337,227.30	
T-MOBILE US INC	5,600	63.92	357,952.00	
TARGA RESOURCES CORP	3,197	58.69	187,631.93	
TARGET CORP	10,487	65.79	689,939.73	
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	273	116.71	31,861.83	
TE CONNECTIVITY LTD	6,826	75.21	513,383.46	
TECHNIPFMC PLC	4,102	32.10	131,674.20	
TEGNA INC	3,802	24.37	92,654.74	
TELEFLEX INC	804	179.91	144,647.64	
TESLA, INC.	2,478	272.23	674,585.94	
TESORO CORP	2,271	86.64	196,759.44	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	17,522	35.20	616,774.40	
TEXAS INSTRUMENTS INC	19,259	76.44	1,472,157.96	
TEXTRON INC	5,171	48.35	250,017.85	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7,573	158.64	1,201,380.72	
TIFFANY & CO	2,394	86.18	206,314.92	
TIME WARNER INC	14,966	96.48	1,443,919.68	
TJX COS INC	12,612	77.19	973,520.28	
TOLL BROTHERS INC	2,906	31.49	91,509.94	
TORCHMARK CORP	2,058	77.12	158,712.96	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,032	54.47	165,153.04	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,563	72.18	184,997.34	
TRANSDIGM GROUP INC	1,033	249.74	257,981.42	

TRAVELERS COS INC/THE	5,519	121.95	673,042.05
TRIMBLE INC	4,559	31.18	142,149.62
TRIPADVISOR INC	2,186	47.06	102,873.16
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	8,518	29.92	254,858.56
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	20,473	30.35	621,355.55
TWITTER INC	10,616	16.62	176,437.92
TYSON FOODS INC-CL A	5,701	65.26	372,047.26
UGI CORP	3,222	47.46	152,916.12
ULTA BEAUTY INC	1,111	275.15	305,691.65
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,353	21.88	73,363.64
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	3,435	19.75	67,841.25
UNION PACIFIC CORP	16,066	109.82	1,764,368.12
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,497	75.96	113,712.12
UNITED PARCEL SERVICE INC	13,426	106.90	1,435,239.40
UNITED RENTALS INC	1,655	126.03	208,579.65
UNITED TECHNOLOGIES CORP	15,267	112.15	1,712,194.05
UNITED THERAPEUTICS CORP	792	168.16	133,182.72
UNITEDHEALTH GROUP INC	18,289	157.62	2,882,712.18
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,732	122.95	212,949.40
UNUM GROUP	4,448	48.51	215,772.48
US BANCORP	32,829	54.88	1,801,655.52
VALERO ENERGY CORP	8,840	65.49	578,931.60
VALSPAR CORP	1,387	111.00	153,957.00
VANTIV INC - CL A	3,031	64.86	196,590.66
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,703	83.61	142,387.83
VERISIGN INC	1,782	82.30	146,658.60
VERISK ANALYTICS INC	3,099	84.90	263,105.10
VERIZON COMMUNICATIONS INC	78,488	49.19	3,860,824.72
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,759	88.33	420,362.47
VF CORP	6,379	52.68	336,045.72
VIACOM INC-CLASS B	6,691	43.99	294,337.09
VISA INC-CLASS A SHARES	36,237	87.46	3,169,288.02
VMWARE INC-CLASS A	1,362	91.22	124,241.64
VOYA FINANCIAL INC	3,638	41.90	152,432.20
VULCAN MATERIALS CO	2,558	119.33	305,246.14
WABCO HOLDINGS INC	967	115.56	111,746.52
WABTEC CORP	1,652	87.77	144,996.04
WAL-MART STORES INC	29,682	69.37	2,059,040.34
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	17,661	85.86	1,516,373.46
WALT DISNEY CO	29,375	110.06	3,233,012.50
WASTE CONNECTIONS INC	3,359	83.60	280,812.40
WASTE MANAGEMENT INC	8,508	72.45	616,404.60
WATERS CORP	1,546	154.33	238,594.18
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	17,083	5.70	97,373.10

WEC ENERGY GROUP INC	6,136	57.54	353,065.44	
WELLS FARGO & CO	92,063	58.09	5,347,939.67	
WESTAR ENERGY INC	2,643	53.05	140,211.15	
WESTERN DIGITAL CORP	5,457	74.91	408,783.87	
WESTERN UNION CO	9,122	19.82	180,798.04	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	4,783	52.66	251,872.78	
WEYERHAEUSER CO	14,337	33.52	480,576.24	
WHIRLPOOL CORP	1,446	177.19	256,216.74	
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	3,409	55.17	188,074.53	
WHOLE FOODS MARKET INC	6,111	30.91	188,891.01	
WILLIAMS COS INC	13,688	28.20	386,001.60	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,526	128.35	324,212.10	
WORKDAY INC-CLASS A	2,232	88.43	197,375.76	
WR BERKLEY CORP	1,796	70.56	126,725.76	
WR GRACE & CO	1,311	71.33	93,513.63	
WW GRAINGER INC	1,104	254.96	281,475.84	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,016	84.85	171,057.60	
WYNN RESORTS LTD	1,489	95.91	142,809.99	
XCEL ENERGY INC	9,866	42.00	414,372.00	
XEROX CORP	15,709	7.44	116,874.96	
XILINX INC	4,875	60.06	292,792.50	
XL GROUP LTD	5,275	40.95	216,011.25	
XYLEM INC	3,262	47.80	155,923.60	
YAHOO! INC	17,336	45.10	781,853.60	
YUM! BRANDS INC	7,093	68.40	485,161.20	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	2,989	30.83	92,150.87	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	2,077	35.39	73,505.03	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,834	116.87	448,079.58	
ZOETIS INC	9,070	52.51	476,265.70	
アメリカ・ドル 小計	5,946,639		397,865,075.59 (45,129,835,524)	
イギリス・ポンド				
3I GROUP PLC	17,132	7.18	123,007.76	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	16,352	2.70	44,150.40	
ADMIRAL GROUP PLC	3,853	18.56	71,511.68	
ANGLO AMERICAN PLC	26,892	13.60	365,731.20	
ANTOFAGASTA PLC	7,100	8.58	60,953.50	
ASHTREAD GROUP PLC	9,642	17.03	164,203.26	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	6,843	25.67	175,659.81	
ASTRAZENECA PLC	24,290	45.70	1,110,053.00	
AUTO TRADER GROUP PLC- WI	18,607	4.01	74,781.53	
AVIVA PLC	77,740	5.05	392,975.70	
BABCOCK INTL GROUP PLC	4,641	9.05	42,024.25	
BAE SYSTEMS PLC	61,069	6.12	373,742.28	
BARCLAYS PLC	324,986	2.37	771,841.75	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	18,263	5.14	93,963.13	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	2,377	28.72	68,267.44	
BHP BILLITON PLC	40,542	14.00	567,588.00	

BP PLC	360,637	4.45	1,605,555.92
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	35,828	49.82	1,785,130.10
BT GROUP PLC	162,971	3.23	526,885.24
BUNZL PLC	6,207	21.82	135,436.74
BURBERRY GROUP PLC	8,111	16.71	135,534.81
CAPITA PLC	12,234	5.14	62,882.76
CARNIVAL PLC	3,646	43.40	158,236.40
CENTRICA PLC	105,686	2.34	247,305.24
COBHAM PLC	31,373	1.12	35,169.13
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,278	19.68	64,511.04
COMPASS GROUP PLC	31,484	14.75	464,389.00
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,427	33.95	82,396.65
DCC PLC	1,641	68.00	111,588.00
DIAGEO PLC	48,381	22.67	1,096,797.27
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	24,982	3.61	90,409.85
DIXONS CARPHONE PLC	17,812	2.99	53,329.12
EASYJET PLC	3,038	9.55	29,028.09
EXPERIAN PLC	18,398	16.08	295,839.84
FRESNILLO PLC	4,017	15.30	61,460.10
G4S PLC	28,594	2.60	74,544.55
GKN PLC	31,401	3.45	108,521.85
GLAXOSMITHKLINE PLC	93,775	16.36	1,534,627.87
GLENCORE PLC	234,655	3.27	767,321.85
HARGREAVES LANSDOWN PLC	4,741	13.63	64,619.83
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,652	20.34	53,941.68
HSBC HOLDINGS PLC	381,672	7.12	2,718,649.65
IMI PLC	4,991	12.10	60,391.10
IMPERIAL BRANDS PLC	18,448	37.37	689,401.76
INMARSAT PLC	8,517	6.28	53,529.34
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,423	38.78	132,743.94
INTERTEK GROUP PLC	2,984	35.13	104,827.92
INVESTEC PLC	12,043	5.87	70,692.41
ITV PLC	68,707	2.03	139,543.91
JOHNSON MATTHEY PLC	3,534	30.62	108,211.08
KINGFISHER PLC	42,201	3.26	137,786.26
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	114,014	2.45	280,132.39
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,234,291	0.67	830,677.84
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,051	31.33	189,577.83
MARKS & SPENCER GROUP PLC	29,682	3.27	97,060.14
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	6,846	8.02	54,904.92
MEGGITT PLC	14,209	4.16	59,123.64
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	12,985	5.01	65,119.77
MONDI PLC/WI	6,681	18.64	124,533.84
MORRISON WM SUPERMARKETS	40,463	2.49	100,874.25
NATIONAL GRID PLC	72,852	9.60	700,034.86
NEXT PLC	2,570	38.43	98,765.10

OLD MUTUAL PLC	94,141	2.16	203,815.26		
PEARSON PLC	15,127	6.42	97,190.97		
PERSIMMON PLC	5,618	20.02	112,472.36		
PETROFAC LTD	4,707	8.69	40,927.36		
PROVIDENT FINANCIAL PLC	2,719	27.92	75,914.48		
PRUDENTIAL PLC	49,487	16.36	809,607.32		
RANDGOLD RESOURCES LTD	1,705	74.50	127,022.50		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12,136	70.41	854,495.76		
RELX PLC	21,068	14.83	312,438.44		
RIO TINTO PLC	23,703	36.46	864,211.38		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	35,289	7.08	249,846.12		
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	67,614	2.58	175,052.64		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	83,081	20.80	1,728,084.80		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	71,928	21.70	1,561,197.24		
ROYAL MAIL PLC	17,615	4.10	72,239.11		
RSA INSURANCE GROUP PLC	18,655	5.82	108,572.10		
SAGE GROUP PLC	19,858	6.34	125,999.01		
SAINSBURY (J) PLC	29,735	2.68	79,719.53		
SCHRODERS PLC	2,432	30.78	74,856.96		
SEVERN TRENT PLC	4,530	23.04	104,371.20		
SHIRE PLC	17,280	48.01	829,612.80		
SKY PLC	20,269	9.96	201,879.24		
SMITH & NEPHEW PLC	17,124	12.01	205,659.24		
SMITHS GROUP PLC	7,201	15.15	109,095.15		
SSE PLC	19,541	15.31	299,172.71		
ST JAMES'S PLACE PLC	9,607	11.02	105,869.14		
STANDARD CHARTERED PLC	62,986	7.65	481,842.90		
STANDARD LIFE PLC	35,958	3.75	134,986.33		
TATE & LYLE PLC	8,570	7.32	62,732.40		
TAYLOR WIMPEY PLC	59,487	1.75	104,459.17		
TESCO PLC	157,123	1.94	305,761.35		
TRAVIS PERKINS PLC	4,571	15.16	69,296.36		
TUI AG-DI	9,094	11.33	103,035.02		
UNILEVER PLC	24,638	35.48	874,156.24		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	12,950	9.49	122,960.25		
VODAFONE GROUP PLC	514,258	1.98	1,020,802.13		
WEIR GROUP PLC/THE	3,946	19.79	78,091.34		
WHITBREAD PLC	3,333	39.19	130,620.27		
WILLIAM HILL PLC	15,718	2.64	41,558.39		
WOLSELEY PLC	4,857	50.15	243,578.55		
WORLDPAY GROUP PLC-W/I	34,109	2.67	91,343.90		
WPP PLC	24,870	18.89	469,794.30		
イギリス・ボンド 小計	5,674,100		34,826,841.29 (4,924,167,089)		
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	745	173.00	128,885.00	
	BANK HAPOLIM BM	19,192	22.75	436,618.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	25,907	16.00	414,512.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	39,444	6.62	261,158.72	
	ELBIT SYSTEMS LTD	429	434.60	186,443.40	

	FRUTAROM	704	198.70	139,884.80	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	9,156	16.62	152,172.72	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,528	61.00	154,208.00	
	NICE LTD	1,096	257.30	282,000.80	
イスラエル・シュケル 小計		99,201		2,155,883.44 (65,905,356)	
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	13,887	24.56	341,064.72	
	ALUMINA LTD	47,685	1.97	93,939.45	
	AMCOR LTD	23,299	14.65	341,330.35	
	AMP LTD	59,638	5.11	304,750.18	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,590	15.62	165,415.80	
	ASX LTD	3,973	51.07	202,901.11	
	AURIZON HOLDINGS LTD	41,118	5.27	216,691.86	
	AUSNET SERVICES	46,598	1.67	78,051.65	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	56,936	30.88	1,758,183.68	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	7,849	11.53	90,498.97	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	9,242	12.20	112,752.40	
	BHP BILLITON LTD	62,107	26.47	1,643,972.29	
	BORAL LTD	22,331	6.06	135,325.86	
	BRAMBLES LTD	32,159	9.47	304,545.73	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	5,101	29.65	151,244.65	
	CHALLENGER LTD	11,478	11.90	136,588.20	
	CIMIC GROUP LIMITED	1,990	37.95	75,520.50	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	11,754	10.06	118,245.24	
	COCHLEAR LTD	1,163	132.25	153,806.75	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	33,280	85.91	2,859,084.80	
	COMPUTERSHARE LIMITED	9,398	13.67	128,470.66	
	CROWN RESORTS LTD	7,143	11.51	82,215.93	
	CSL LIMITED	8,912	119.80	1,067,657.60	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,223	55.01	67,277.23	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,165	30.20	35,183.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,024	6.98	202,587.52	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	12,371	5.03	62,226.13	
	HEALTHSCOPE LTD	34,853	2.28	79,464.84	
	INCITEC PIVOT LTD	32,956	3.77	124,244.12	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	50,278	5.91	297,142.98	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	8,818	18.54	163,485.72	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,088	87.35	531,786.80	
MEDIBANK PRIVATE LTD	53,848	2.78	149,697.44		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	51,789	31.70	1,641,711.30		
NEWCREST MINING LIMITED	15,000	22.99	344,850.00		
OIL SEARCH LTD	25,997	7.07	183,798.79		
ORICA LTD	7,301	18.35	133,973.35		

	ORIGIN ENERGY LIMITED	32,823	6.87	225,494.01	
	QANTAS AIRWAYS LTD	12,202	3.48	42,462.96	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	27,235	12.48	339,892.80	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	2,800	70.88	198,464.00	
	REA GROUP LTD	1,271	55.27	70,248.17	
	RIO TINTO LTD	8,366	67.64	565,876.24	
	SANTOS LTD	29,864	3.93	117,365.52	
	SEEK LTD	6,733	15.74	105,977.42	
	SONIC HEALTHCARE LTD	7,880	21.42	168,789.60	
	SOUTH32 LTD	103,406	2.64	272,991.84	
	SUNCORP GROUP LTD	26,298	13.52	355,548.96	
	TABCORP HOLDINGS LTD	17,261	4.31	74,394.91	
	TATTS GROUP LTD	28,943	4.05	117,219.15	
	TELSTRA CORP LTD	88,731	4.84	429,458.04	
	TPG TELECOM LTD	7,151	6.29	44,979.79	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	14,296	12.34	176,412.64	
	VOCUS GROUP LTD	10,987	4.13	45,376.31	
	WESFARMERS LIMITED	22,044	42.34	933,342.96	
	WESTPAC BANKING CORP	64,979	34.12	2,217,083.48	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	14,926	31.44	469,273.44	
	WOOLWORTHS LTD	25,057	25.50	638,953.50	
	オーストラリア・ドル 小計	1,411,595		22,189,293.34 (1,931,799,878)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,278	61.32	262,326.96	
	AGRIUM INC	2,531	135.64	343,304.84	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,074	61.39	495,662.86	
	ALTAGAS LTD	3,063	31.35	96,025.05	
	ARC RESOURCES LTD	6,454	21.53	138,954.62	
	ATCO LTD -CL 'I'	1,515	45.73	69,280.95	
	BANK OF MONTREAL	12,376	101.55	1,256,782.80	
	BANK OF NOVA SCOTIA	23,074	81.82	1,887,914.68	
	BARRICK GOLD CORP	22,362	26.41	590,580.42	
	BCE INC	2,971	58.77	174,605.67	
	BLACKBERRY LTD	9,158	9.79	89,656.82	
	BOMBARDIER INC	35,810	2.53	90,599.30	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	16,714	48.91	817,481.74	
	CAE INC	5,076	20.42	103,651.92	
	CAMECO CORP	7,298	15.35	112,024.30	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	7,574	116.49	882,295.26	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	15,028	93.85	1,410,377.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	21,173	39.37	833,581.01	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,738	195.89	536,346.82	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,270	157.49	200,012.30	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,447	36.68	89,755.96	
	CCL INDUSTRIES INC -CL B	517	270.00	139,590.00	
	CENOVUS ENERGY INC	16,031	17.88	286,634.28	
	CGI GROUP INC	4,188	63.73	266,901.24	

CI FINANCIAL CORP	4,529	27.90	126,359.10	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	353	610.94	215,661.82	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,891	16.24	160,629.84	
DOLLARAMA INC	2,089	102.96	215,083.44	
ELDORADO GOLD CORP	12,985	4.80	62,328.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	7,288	13.92	101,448.96	
EMERA INC	1,077	45.27	48,755.79	
EMPIRE CO LTD 'A'	3,063	17.15	52,530.45	
ENBRIDGE INC	17,991	54.97	988,965.27	
ENCANA CORP	18,358	16.23	297,950.34	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	448	618.00	276,864.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	3,108	25.45	79,098.60	
FIRST CAPITAL REALTY INC	2,636	20.53	54,117.08	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,599	15.00	188,985.00	
FORTIS INC	7,809	43.20	337,348.80	
FRANCO-NEVADA CORP	3,422	88.06	301,341.32	
GEORGE WESTON LTD	968	110.60	107,060.80	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,094	32.78	134,201.32	
GOLDCORP INC	16,340	22.76	371,898.40	
GREAT-WEST LIFECO INC	5,478	37.40	204,877.20	
HUSKY ENERGY INC	6,506	16.35	106,373.10	
HYDRO ONE LTD	3,684	23.84	87,826.56	
IGM FINANCIAL INC	1,842	42.02	77,400.84	
IMPERIAL OIL LTD	5,741	42.87	246,116.67	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,876	58.48	109,708.48	
INTACT FINANCIAL CORP	2,563	96.69	247,816.47	
INTER PIPELINE LTD	6,611	29.51	195,090.61	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	1,504	20.20	30,380.80	
KEYERA CORP	3,392	41.31	140,123.52	
KINROSS GOLD CORP	22,693	5.06	114,826.58	
LINAMAR CORP	901	60.87	54,843.87	
LOBLAW COS LTD	4,318	68.19	294,444.42	
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,493	59.60	446,582.80	
MANULIFE FINANCIAL CORP	37,859	24.83	940,038.97	
METHANEX CORP	1,652	66.23	109,411.96	
METRO INC	4,354	40.17	174,900.18	
NATIONAL BANK OF CANADA	6,464	58.28	376,721.92	
ONEX CORPORATION	1,590	94.87	150,843.30	
OPEN TEXT CORP	4,490	43.87	196,976.30	
PEMBINA PIPELINE CORP	7,585	42.86	325,093.10	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,042	28.71	87,335.82	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	16,144	24.50	395,528.00	
POWER CORP OF CANADA	6,907	32.23	222,612.61	
POWER FINANCIAL CORP	4,627	35.61	164,767.47	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	3,772	29.90	112,782.80	

	RESTAURANT BRANDS INTERN	4,280	70.67	302,467.60	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	7,187	57.52	413,396.24	
	ROYAL BANK OF CANADA	28,512	99.09	2,825,254.08	
	SAPUTO INC	4,698	45.77	215,027.46	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	4,417	26.03	114,974.51	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	7,877	28.03	220,792.31	
	SILVER WHEATON CORP	7,986	28.22	225,364.92	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	2,772	57.68	159,888.96	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	11,788	49.89	588,103.32	
	SUNCOR ENERGY INC	32,015	42.13	1,348,791.95	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	10,873	27.98	304,226.54	
	THOMSON REUTERS CORP	6,507	58.87	383,067.09	
	TORONTO-DOMINION BANK	35,645	69.44	2,475,188.80	
	TOURMALINE OIL CORP	3,887	31.65	123,023.55	
	TRANSCANADA CORP	16,485	62.24	1,026,026.40	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	18,500	4.53	83,805.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	6,060	21.02	127,381.20	
	VERESEN INC	5,662	14.03	79,437.86	
	VERMILION ENERGY INC	2,131	52.05	110,918.55	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,208	52.95	63,963.60	
	YAMANA GOLD INC	17,114	4.04	69,140.56	
	カナダ・ドル 小計	769,460		32,168,640.78 (2,781,300,682)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND LTD	47,700	3.50	166,950.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	7,400	9.22	68,228.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	43,800	2.42	105,996.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	33,900	18.50	627,150.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	111,100	0.97	108,322.50	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	49,600	2.75	136,400.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	129,800	0.42	55,165.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	1,800	41.82	75,276.00	
	KEPPEL CORP LTD	26,600	6.64	176,624.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	60,300	9.48	571,644.00	
	SATS LTD	14,900	4.95	73,755.00	
	SEMBORP INDUSTRIES LTD	18,600	3.20	59,520.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	10,800	9.85	106,380.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	14,800	7.60	112,480.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	31,300	3.46	108,298.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	29,200	3.62	105,704.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	155,800	3.97	618,526.00	
	STARHUB LTD	14,400	2.81	40,464.00	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	24,900	21.11	525,639.00	
	UOL Group Limited	8,800	6.54	57,552.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	35,500	3.90	138,450.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	34,000	0.92	31,450.00	
	シンガポール・ドル 小計	905,000		4,069,973.50 (324,865,285)	
スイス・フラン	ABB LTD	36,103	22.80	823,148.40	
	ACTELION LTD-REG	1,862	270.00	502,740.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,110	71.15	221,276.50	
	ARYZTA AG	1,592	32.42	51,612.64	
	BALOISE HOLDING AG	915	129.80	118,767.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	41	1,295.00	53,095.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	18	5,630.00	101,340.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	65,700.00	131,400.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	10,017	75.95	760,791.15	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	38,184	15.52	592,615.68	
	DUFREY AG-REG	851	145.60	123,905.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	152	580.00	88,160.00	
	GALENICA AG-REG	72	1,118.00	80,496.00	
	GEBERIT AG-REG	717	428.80	307,449.60	
	GIVAUDAN-REG	178	1,812.00	322,536.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	4,286	48.75	208,942.50	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,096	140.20	153,659.20	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	8,755	56.90	498,159.50	
	LONZA GROUP AG	1,020	179.80	183,396.00	
	NESTLE SA	59,777	73.25	4,378,665.25	
	NOVARTIS AG	42,900	76.70	3,290,430.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	681	66.10	45,014.10	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	314	530.50	166,577.00	
	ROCHE HOLDING AG	13,506	244.00	3,295,464.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	369	191.60	70,700.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	750	194.30	145,725.00	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	105	2,130.00	223,650.00	
	SIKA AG-BEARER	41	5,420.00	222,220.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	982	128.40	126,088.80	
	SWATCH GROUP AG	593	343.60	203,754.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	592	315.70	186,894.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,336	86.25	115,230.00	
	SWISS RE AG	6,180	93.10	575,358.00	
	SWISSCOM AG	520	451.90	234,988.00	
	SYNGENTA AG	1,779	426.90	759,455.10	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	901	67.30	60,637.30	
	UBS GROUP AG	70,257	15.96	1,121,301.72	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,886	279.10	805,482.60	

スイス・フラン	小計	313,440		21,351,127.24 (2,409,901,731)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	5,417	164.40	890,554.80	
	ASSA ABLOY AB	19,342	175.80	3,400,323.60	
	ATLAS COPCO AB	7,423	262.90	1,951,506.70	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	12,978	292.40	3,794,767.20	
	BOLIDEN AB	4,965	281.90	1,399,633.50	
	ELECTROLUX AB	4,435	237.20	1,051,982.00	
	GETINGE AB-B SHS	3,773	146.10	551,235.30	
	HENNES & MAURITZ AB	18,281	243.80	4,456,907.80	
	HEXAGON AB-B SHS	5,027	364.80	1,833,849.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	7,782	76.75	597,268.50	
	ICA GRUPPEN AB	1,471	292.60	430,414.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,123	177.60	554,644.80	
	INVESTOR AB	8,780	359.10	3,152,898.00	
	KINNEVIK AB - B	4,340	239.00	1,037,260.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	670	584.00	391,280.00	
	LUNDIN PETROLEUM AB	3,543	190.50	674,941.50	
	NORDEA BANK AB	58,578	109.10	6,390,859.80	
	SANDVIK AB	20,552	121.60	2,499,123.20	
	SECURITAS AB	5,794	134.70	780,451.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	29,445	104.20	3,068,169.00	
	SKANSKA AB-B SHS	6,241	217.40	1,356,793.40	
	SKF AB	7,358	171.10	1,258,953.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB	11,731	271.00	3,179,101.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN	29,546	131.40	3,882,344.40		
SWEDBANK AB - A SHARES	17,571	231.10	4,060,658.10		
SWEDISH MATCH AB	3,579	282.90	1,012,499.10		
TELE2 AB	7,166	79.90	572,563.40		
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	59,135	53.60	3,169,636.00		
TELIA CO AB	51,625	35.58	1,836,817.50		
VOLVO AB	29,727	118.90	3,534,540.30		
スウェーデン・クローナ	小計	449,398		62,771,978.70 (794,693,250)	
デンマーク・ク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	127	11,970.00	1,520,190.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	71	11,390.00	808,690.00	
	CARLSBERG AS-B	2,049	613.00	1,256,037.00	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,847	418.20	772,415.40	
	COLOPLAST-B	2,169	493.60	1,070,618.40	
	DANSKE BANK A/S	13,251	240.60	3,188,190.60	
	DONG ENERGY A/S	1,644	252.80	415,603.20	
	DSV A/S	3,644	347.50	1,266,290.00	
	GENMAB A/S	1,097	1,395.00	1,530,315.00	
	ISS A/S	3,052	253.00	772,156.00	
	NOVO-NORDISK A/S	36,711	246.00	9,030,906.00	
	NOVOZYMES A/S	4,210	274.60	1,156,066.00	
	PANDORA A/S	2,139	823.00	1,760,397.00	
	TDC A/S	15,214	37.75	574,328.50	
	TRYGVESTA AS	2,022	132.00	266,904.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	4,232	513.50	2,173,132.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,198	132.30	290,795.40	
デンマーク・クローネ	小計	95,677		27,853,034.50	

(450,105,037)

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	18,587	6.94	129,086.71
	CONTACT ENERGY LTD	13,718	4.92	67,492.56
	FLETCHER BUILDING LTD	12,597	10.06	126,725.82
	MERCURY NZ LTD	13,904	3.02	41,990.08
	MERIDIAN ENERGY LTD	23,907	2.63	62,875.41
	RYMAN HEALTHCARE LTD	7,075	8.83	62,472.25
	SPARK NEW ZEALAND LTD	34,656	3.49	120,949.44
ニュージーランド・ドル 小計		124,444		611,592.27 (49,691,871)
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	18,802	140.90	2,649,201.80
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	3,678	131.70	484,392.60
	MARINE HARVEST	7,017	146.60	1,028,692.20
	NORSK HYDRO ASA	24,399	48.73	1,188,963.27
	ORKLA ASA	14,892	75.40	1,122,856.80
	SCHIBSTED ASA	1,365	217.80	297,297.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,772	198.50	351,742.00
	STATOIL ASA	21,569	147.50	3,181,427.50
	TELENOR ASA	14,667	134.40	1,971,244.80
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,257	326.80	1,064,387.60
ノルウェー・クローネ 小計		111,418		13,340,205.57 (181,159,991)
ユーロ	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	13,202	13.85	182,913.71
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	5,183	22.17	114,933.02
	ACCOR	3,128	38.71	121,100.52
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,413	29.45	100,512.85
	ADIDAS AG	3,606	148.23	534,520.98
	ADP	666	107.80	71,794.80
	AEGON NV	34,990	5.08	177,889.16
	AENA SA	1,363	136.00	185,368.00
	AGEAS	3,534	37.25	131,641.50
	AIR LIQUIDE	7,488	104.90	785,491.20
	AIRBUS SE	11,168	66.53	743,007.04
	AKZO NOBEL NV	4,748	63.03	299,266.44
	ALLIANZ SE	8,749	164.43	1,438,598.07
	ALSTOM RGPT	2,893	26.11	75,536.23
	ALTICE NV - A-W/I	6,907	20.57	142,076.99
	ALTICE NV - B -W/I	1,957	20.57	40,255.49
	AMADEUS IT GROUP SA	8,414	43.40	365,209.67
	ANDRITZ AG	1,340	50.85	68,139.00
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14,637	102.45	1,499,560.65
	ARCELORMITTAL	35,324	8.68	306,718.29
	ARKEMA	1,250	96.33	120,412.50
	ASML HOLDING NV	7,078	118.40	838,035.20
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	22,380	14.65	327,867.00
	ATLANTIA SPA	8,520	21.95	187,014.00
	ATOS SE	1,675	105.20	176,210.00
	AXA	37,149	22.35	830,465.89
AXEL SPRINGER SE	867	48.56	42,105.85	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	125,974	6.24	786,959.57	
BANCO DE SABADELL SA	96,379	1.47	141,677.13	

BANCO POPULAR ESPANOL	62,070	0.83	52,076.73
BANCO SANTANDER SA	279,948	5.16	1,445,371.52
BANK OF IRELAND	515,478	0.23	120,106.37
BANKIA SA	83,159	0.94	78,502.09
BANKINTER SA	12,280	7.27	89,386.12
BASF SE	17,610	89.46	1,575,478.65
BAYER AG	15,887	107.12	1,701,926.64
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,363	85.13	541,688.55
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	975	69.63	67,889.25
BEIERSDORF AG	1,821	84.15	153,237.15
BNP PARIBAS	20,354	55.63	1,132,293.02
BOLLORE	17,932	3.69	66,312.53
BOSKALIS WESTMINSTER	1,673	33.22	55,577.06
BOUYGUES	3,858	34.75	134,065.50
BRENTAG AG	2,834	54.74	155,133.16
BUREAU VERITAS SA	5,086	18.73	95,286.21
CAIXABANK	62,989	3.36	211,643.04
CAP GEMINI SA	3,157	82.60	260,768.20
CARREFOUR SA	10,905	22.30	243,236.02
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,037	51.49	53,395.13
CHRISTIAN DIOR SE	1,054	199.65	210,431.10
CIE DE SAINT-GOBAIN	9,597	45.80	439,542.60
CNH INDUSTRIAL NV	19,225	8.80	169,276.12
CNP ASSURANCES	3,132	17.76	55,624.32
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,029	33.39	134,548.45
COLRUYT NV	1,205	45.44	54,755.20
COMMERZBANK AG	19,426	7.44	144,645.99
CONTINENTAL AG	2,105	190.79	401,629.79
COVESTRO AG	1,267	69.11	87,566.17
CREDIT AGRICOLE SA	21,574	11.60	250,366.27
CRH PLC	16,178	32.50	525,865.89
DAIMLER AG	18,475	67.70	1,250,757.50
DANONE	11,370	60.95	693,001.50
DASSAULT AVIATION SA	44	1,078.90	47,471.60
DASSAULT SYSTEMES SA	2,508	76.23	191,184.84
DEUTSCHE BANK AG	26,461	18.48	489,131.58
DEUTSCHE BOERSE AG- TENDER	2,745	84.21	231,170.17
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	4,394	13.42	58,993.84
DEUTSCHE POST AG	18,889	31.90	602,559.10
DEUTSCHE TELEKOM AG	63,202	16.27	1,028,802.15
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	6,458	32.21	208,070.30
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,162	4.92	54,928.20
E.ON SE	38,552	7.13	275,107.07
EDENRED	3,868	20.90	80,860.54
EDF	4,838	9.07	43,880.66
EIFFAGE	1,144	69.23	79,199.12
ELISA OYJ	2,790	31.63	88,247.70
ENAGAS SA	4,242	23.30	98,859.81
ENDESA SA	5,802	19.93	115,662.87
ENEL SPA	147,071	4.00	588,578.14
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	43,338	2.87	124,770.10
ENGIE	28,262	11.09	313,425.58

ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	48,785	14.25	695,186.25	
ERSTE GROUP BANK AG	5,670	29.50	167,265.00	
ESSILOR INTERNATIONA	3,999	107.85	431,292.15	
EURAZEO	757	59.00	44,663.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	206	417.70	86,046.20	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,328	17.70	58,905.60	
EVONIK INDUSTRIES AG	2,933	30.71	90,087.09	
EXOR NV	2,000	45.52	91,040.00	
FERRARI NV	2,268	61.25	138,915.00	
FERROVIAL S.A.	9,184	16.99	156,082.08	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	17,352	10.79	187,228.08	
FORTUM OYJ	8,167	14.37	117,359.79	
FRAPORT AG	899	59.48	53,476.11	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	4,126	76.70	316,464.20	
FRESENIUS SE & CO KGAA	7,872	75.55	594,729.60	
FUCHS PETROLUB AG -PFD	1,260	43.92	55,339.20	
GALP ENERGIA SGPS SA	9,127	13.68	124,902.99	
GAS NATURAL SDG SA	6,381	18.13	115,719.43	
GEA GROUP AG	3,318	39.11	129,773.61	
GEMALTO	1,481	55.28	81,869.68	
GRIFOLS SA	5,462	20.96	114,510.83	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,475	80.31	118,457.25	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	9,413	8.91	83,954.54	
HANNOVER RUECK SE	1,069	107.21	114,609.62	
HEIDELBERGCEMENT AG	2,835	85.55	242,548.42	
HEINEKEN HOLDING NV	1,853	71.41	132,322.73	
HEINEKEN NV	4,424	76.90	340,205.60	
HENKEL AG & CO KGAA	1,973	102.84	202,903.32	
HENKEL KGAA-VORZUG	3,401	119.03	404,824.43	
HERMES INTERNATIONAL	511	406.55	207,747.05	
HOCHTIEF AG	382	141.40	54,014.80	
HUGO BOSS AG	1,222	65.79	80,403.93	
IBERDROLA SA	103,900	6.09	632,751.00	
ILIAD SA	508	197.50	100,330.00	
IMERYS SA	672	76.88	51,663.36	
INDITEX SA	20,860	30.95	645,721.30	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	21,689	16.92	366,999.56	
ING GROEP NV-CVA	74,412	13.45	1,001,213.46	
INGENICO GROUP	1,024	80.14	82,063.36	
INNOGY SE	2,572	34.03	87,525.16	
INTESA SANPAOLO	258,333	2.16	559,549.27	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	15,725	5.99	94,287.10	
JC DECAUX SA	1,480	30.23	44,740.40	
JERONIMO MARTINS	4,539	16.40	74,462.29	
K+S AG	3,482	22.58	78,640.97	
KBC GROEP NV	4,810	58.48	281,288.80	
KERING	1,457	227.60	331,613.20	
KERRY GROUP PLC-A	3,157	69.80	220,358.60	
KONE OYJ	6,447	41.52	267,679.44	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	24,557	20.37	500,226.09	

KONINKLIJKE DSM NV	3,471	60.99	211,696.29
KONINKLIJKE PHILIPS NV	18,208	27.86	507,365.92
L'OREAL SA	4,842	172.65	835,971.30
LAGARDERE S.C.A.	2,324	23.77	55,253.10
LANXESS	1,660	67.41	111,900.60
LEGRAND SA	5,169	55.21	285,380.49
LEONARDO SPA	7,443	11.88	88,422.84
LINDE AG	3,561	153.71	547,368.43
LUXOTTICA GROUP SPA	3,121	49.09	153,209.89
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,370	188.10	1,010,097.00
MAN SE	659	97.00	63,923.00
MAPFRE SA	18,428	2.87	53,017.35
MEDIOBANCA SPA	10,438	7.97	83,190.86
MERCK KGAA	2,480	101.33	251,315.76
METRO AG	3,209	29.80	95,641.03
METSO OYJ	2,049	28.64	58,683.36
MICHELIN (C.G.D.E.)	3,522	105.35	371,042.70
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	3,070	178.00	546,460.00
NATIXIS	17,264	5.39	93,104.75
NESTE OYJ	2,295	34.63	79,475.85
NN GROUP NV	5,982	29.49	176,409.18
NOKIA OYJ	112,248	4.72	530,035.05
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,110	36.60	77,226.00
OMV AG	2,662	35.26	93,862.12
ORANGE S.A.	38,659	14.35	554,756.65
ORION OYJ-CLASS B	1,892	46.81	88,564.52
OSRAM LICHT AG	1,611	56.88	91,635.29
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,487	99.33	147,703.71
PERNOD-RICARD	4,093	107.95	441,839.35
PEUGEOT SA	8,868	18.30	162,328.74
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	2,769	54.00	149,539.84
POSTE ITALIANE SPA	9,621	5.96	57,341.16
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	4,600	39.00	179,413.80
PROXIMUS	2,915	27.75	80,905.82
PRYSMIAN SPA	3,573	23.98	85,680.54
PUBLICIS GROUPE	3,741	62.97	235,570.77
QIAGEN NV	3,922	26.97	105,776.34
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	2,167	21.90	47,468.13
RANDSTAD HOLDINGS NV	2,160	55.55	119,988.00
RED ELECTRICA DE ESPANA	8,055	17.31	139,432.05
RELX NV	19,195	16.51	317,005.42
REMY COINTREAU	412	86.67	35,708.04
RENAULT SA	3,679	86.44	318,012.76
REPSOL SA	20,893	13.72	286,651.96
REXEL SA	5,553	15.73	87,348.69
ROYAL KPN NV	67,124	2.63	176,804.61
RTL GROUP	752	73.47	55,249.44
RWE AG	8,951	13.41	120,068.71
SAFRAN SA	6,024	65.24	393,005.76
SAIPEM SPA	110,022	0.46	50,940.18
SAMPO OYJ	8,537	43.58	372,042.46
SANOFI	22,299	80.55	1,796,184.45

SAP SE	18,858	87.17	1,643,946.15	
SCHAEFFLER AG	3,089	14.67	45,337.25	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	10,797	65.15	703,424.55	
SCOR REGROUPE	2,984	32.33	96,472.72	
SEB SA	425	123.60	52,530.00	
SFR GROUP SA	1,695	26.30	44,578.50	
SIEMENS AG	14,677	121.33	1,780,819.11	
SNAM SPA	47,954	3.81	182,704.74	
SOCIETE BIC SA	539	118.40	63,817.60	
SOCIETE GENERALE	14,712	41.80	615,035.16	
SODEXO	1,768	103.80	183,518.40	
SOLVAY SA	1,359	116.25	157,983.75	
STMICROELECTRONICS NV	11,693	13.58	158,849.40	
STORA ENSO OYJ	9,942	10.29	102,303.18	
SUEZ	6,336	14.64	92,790.72	
SYMRISE AG	2,281	57.71	131,643.35	
TECHNIPFMC PLC	4,004	30.83	123,463.34	
TELECOM ITALIA SPA	273,298	0.77	212,352.54	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	14,058	3.93	55,332.28	
TELEFONICA SA	89,788	9.40	844,096.98	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,079	52.97	57,154.63	
TENARIS SA	8,597	15.70	134,972.90	
TERNA SPA	28,696	4.41	126,606.75	
THALES SA	2,055	90.15	185,258.25	
THYSSENKRUPP AG	6,762	22.91	154,930.94	
TOTAL SA	43,253	47.57	2,057,761.47	
UCB SA	2,338	68.04	159,077.52	
UMICORE	1,720	50.10	86,172.00	
UNICREDIT SPA	10,078	12.75	128,494.50	
UNILEVER NV	31,259	42.49	1,328,351.20	
UNIPOLSAI SPA	20,295	2.00	40,590.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,304	38.19	87,992.06	
UPM-KYMMENE OYJ	10,146	22.74	230,720.04	
VALEO SA	4,587	58.85	269,944.95	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,133	16.01	146,219.33	
VINCI SA	9,777	68.53	670,017.81	
VIVENDI SA	20,097	16.83	338,332.99	
VOESTALPINE AG	2,084	40.95	85,339.80	
VOLKSWAGEN AG	594	145.74	86,569.56	
VOLKSWAGEN AG	3,560	142.55	507,492.24	
VONOVIA SE	8,962	32.86	294,491.32	
VOPAK	1,281	38.95	49,894.95	
WARTSILA OYJ	2,699	49.48	133,546.52	
WENDEL	562	107.75	60,555.50	
WOLTERS KLUWER NV	5,789	37.31	216,016.53	
ZALANDO SE	1,584	37.56	59,501.37	
ZARDOYA OTIS SA	3,339	7.68	25,643.52	
ZODIAC SA	3,737	26.93	100,656.09	
ユーロ 小計	4,258,345		67,651,853.42 (8,124,987,596)	
香港・ドル				
AIA GROUP LTD	231,875	49.10	11,385,062.50	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,600	100.80	463,680.00	
BANK OF EAST ASIA	22,400	32.80	734,720.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	71,039	31.55	2,241,280.45	

CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD	25,000	11.18	279,500.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	13,000	63.50	825,500.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	51,409	52.25	2,686,120.25	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	51,909	92.80	4,817,155.20	
CLP HOLDINGS LTD	32,143	77.40	2,487,868.20	
FIRST PACIFIC CO	42,000	5.77	242,340.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	44,810	36.60	1,640,046.00	
HANG LUNG GROUP LTD	17,000	31.35	532,950.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	41,157	19.68	809,969.76	
HANG SENG BANK LTD	14,712	163.10	2,399,527.20	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	22,743	44.00	1,000,692.00	
HONG KONG & CHINA GAS	151,406	14.98	2,268,061.88	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	22,211	200.80	4,459,968.80	
HYSAN DEVELOPMENT CO	12,000	34.90	418,800.00	
KERRY PROPERTIES LTD	12,000	23.60	283,200.00	
LI & FUNG LTD	111,278	3.43	381,683.54	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	17,600	13.98	246,048.00	
MTR CORP	30,255	40.90	1,237,429.50	
NEW WORLD DEVELOPMENT	104,669	9.37	980,748.53	
NWS HOLDINGS LTD	29,000	13.90	403,100.00	
PCCW LTD	89,000	4.67	415,630.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	27,087	69.10	1,871,711.70	
SANDS CHINA LTD	46,580	32.10	1,495,218.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	24,000	9.22	221,280.00	
SINO LAND CO	56,000	12.60	705,600.00	
SJM HOLDINGS LTD	36,000	6.14	221,040.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	29,023	108.50	3,148,995.50	
SWIRE PACIFIC LTD	11,366	80.25	912,121.50	
SWIRE PROPERTIES LTD	22,000	23.10	508,200.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	26,000	28.10	730,600.00	
WH GROUP LTD	149,000	6.04	899,960.00	
WHARF HOLDINGS LTD	26,733	59.90	1,601,306.70	
WHEELOCK & CO LTD	15,000	48.25	723,750.00	
WYNN MACAU LTD	28,903	13.66	394,814.98	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,000	26.95	377,300.00	
香港・ドル 小計	1,776,908		57,452,980.19 (839,962,571)	
合計	21,935,625		68,008,375,861 (68,008,375,861)	

## 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	AGNC INVESTMENT CORP	5,908.00	115,146.92	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,422.00	165,492.36	
		AMERICAN TOWER REIT INC	8,194.00	885,853.34	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	18,896.00	204,454.72	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,634.00	470,274.36	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,955.00	405,396.45	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5,609.00	131,474.96	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,581.00	129,752.67	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	6,484.00	578,567.32	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,065.00	319,219.75	
		DUKE REALTY CORP	6,555.00	165,251.55	
		EQUINIX INC	1,367.00	511,640.76	
		EQUITY RESIDENTIAL	7,016.00	432,045.28	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,262.00	287,862.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,367.00	182,850.75	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,377.00	193,688.82	
		GGP INC	11,106.00	277,872.12	
		HCP INC	8,971.00	278,728.97	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	14,179.00	260,751.81	
		IRON MOUNTAIN INC	4,588.00	170,444.20	
		KIMCO REALTY CORP	7,992.00	194,445.36	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	2,661.00	103,912.05	
		MACERICH CO/THE	2,249.00	149,356.09	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,386.00	138,073.32	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,683.00	119,983.76	
		PROLOGIS INC	10,103.00	507,069.57	
		PUBLIC STORAGE	2,831.00	639,126.56	
		REALTY INCOME CORP	4,960.00	301,568.00	
		REGENCY CENTERS CORP	1,921.00	133,989.75	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,453.00	266,076.91	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,049.00	1,095,413.41	
		SL GREEN REALTY CORP	1,928.00	214,547.84	
		UDR INC	5,074.00	180,583.66	
		VENTAS INC	6,741.00	419,020.56	
		VEREIT	17,602.00	153,665.46	
		VORNADO REALTY TRUST	3,282.00	360,330.78	
WELLTOWER INC	6,883.00	453,727.36			
アメリカ・ドル 小計			202,334.00	11,597,659.75 (1,315,522,545)	
イギリス・ポンド		BRITISH LAND CO PLC	17,930.00	109,641.95	
		HAMMERSON PLC	14,599.00	85,915.11	
		INTU PROPERTIES PLC	17,565.00	48,356.44	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,170.00	160,498.60	
		SEGRO PLC	15,343.00	76,484.85	

イギリス・ポンド 小計		80,607.00	480,896.95 (67,994,020)	
オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	19,752.00	184,088.64	
	GOODMAN GROUP	37,610.00	279,442.30	
	GPT GROUP	36,990.00	181,620.90	
	MIRVAC GROUP	76,515.00	164,507.25	
	SCENTRE GROUP	107,780.00	485,010.00	
	STOCKLAND	49,168.00	225,681.12	
	VICINITY CENTRES	68,086.00	198,811.12	
	WESTFIELD CORP	40,303.00	365,548.21	
オーストラリア・ドル 小計		436,204.00	2,084,709.54 (181,494,813)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	2,633.00	61,559.54	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,001.00	80,696.89	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,256.00	42,377.44	
カナダ・ドル 小計		6,890.00	184,633.87 (15,963,444)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	44,400.00	109,668.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	37,600.00	58,092.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	46,200.00	90,321.00	
	SUNTEC REIT	44,800.00	76,832.00	
シンガポール・ドル 小計		173,000.00	334,913.00 (26,732,755)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	674.00	52,531.56	
	GECINA SA	759.00	92,635.95	
	ICADE	709.00	48,658.67	
	KLEPIERRE	4,091.00	146,641.89	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,918.00	423,206.70	
ユーロ 小計		8,151.00	763,674.77 (91,717,340)	
香港・ドル	LINK REIT	43,371.00	2,294,325.90	
香港・ドル 小計		43,371.00	2,294,325.90 (33,543,044)	
投資証券 合計			1,732,967,961 (1,732,967,961)	
合計			1,732,967,961 (1,732,967,961)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金 額に対する比率	
アメリカ・ドル	株式	601銘柄	62.12%	-	66.60%
	投資証券	37銘柄	-		
イギリス・ポンド	株式	104銘柄	6.78%	-	7.16%
	投資証券	5銘柄	-		
イスラエル・シケル	株式	9銘柄	0.09%	-	0.09%
オーストラリア・ドル	株式	58銘柄	2.66%	-	3.03%
	投資証券	8銘柄	-		
カナダ・ドル	株式	90銘柄	3.83%	-	4.01%
	投資証券	3銘柄	-		
シンガポール・ドル	株式	22銘柄	0.45%	-	0.50%
	投資証券	4銘柄	-		
スイス・フラン	株式	38銘柄	3.32%	-	3.46%
スウェーデン・クローナ	株式	30銘柄	1.09%	-	1.14%
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.62%	-	0.65%
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.07%	-	0.07%
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.25%	-	0.26%
ユーロ	株式	231銘柄	11.18%	-	11.78%
	投資証券	5銘柄	-		
香港・ドル	株式	39銘柄	1.16%	-	1.25%
	投資証券	1銘柄	-		

(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28年2月22日現在)	(平成29年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	13,782,884	44,592,859
金銭信託	84,310,783	1,703,310
コール・ローン	7,046,368	116,871,965
国債証券	7,909,563,357	10,586,152,868
派生商品評価勘定	-	228,403
未収利息	58,531,213	76,894,825
前払費用	6,494,029	6,438,669
流動資産合計	8,079,728,634	10,832,882,899
資産合計	8,079,728,634	10,832,882,899
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	761,232	170,501
未払金	35,707,501	95,765,701
未払解約金	23,147,597	25,116,084
その他未払費用	-	96
流動負債合計	59,616,330	121,052,382
負債合計	59,616,330	121,052,382
純資産の部		
元本等		
元本	6,098,993,413	8,392,729,180
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,921,118,891	2,319,101,337
純資産合計	8,020,112,304	10,711,830,517
負債純資産合計	8,079,728,634	10,832,882,899

## 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 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 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 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29年2月21日現在)
1. 受益権総口数	6,098,993,413口	8,392,729,180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)	1.2763円 (12,763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27年2月24日 至 平成28年2月22日）	（自 平成28年2月23日 至 平成29年2月21日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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28年2月22日現在）	（平成29年2月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	（平成28年2月22日現在）	（平成29年2月21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	133,572,114	76,676,294
合計	133,572,114	76,676,294

(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29年2月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	68,058,118	-	67,296,886	761,232	91,618,507	-	91,676,409	57,902
アメリカ・ドル	46,235,349	-	45,665,300	570,049	57,305,276	-	57,244,048	61,228
イギリス・ポンド	2,362,129	-	2,350,307	11,822	5,162,783	-	5,206,384	43,601
カナダ・ドル	1,709,282	-	1,677,609	31,673	1,772,075	-	1,777,710	5,635
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	1,375,715	-	1,381,378	5,663
ユーロ	17,751,358	-	17,603,670	147,688	24,386,170	-	24,444,788	58,618
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	1,616,488	-	1,622,101	5,613
合計	68,058,118	-	67,296,886	761,232	91,618,507	-	91,676,409	57,902

(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28年2月22日現在）	（平成29年2月21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	4,704,500,235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	2,410,764,468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）	574,139,676円	675,414,699円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,383,232,135円	1,704,138,534円
DC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	647,618,017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	789,995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	1,195,726,527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	3,884,647,482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	255,884,039円
DCニッセイ外国債券インデックス	2,119,607円	28,406,600円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	-円	103,287円
計	6,098,993,413円	8,392,729,180円

附属明細表（平成29年2月21日現在）

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額又は口数	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS 5.25 2028/11/15	50,000.00	63,746.00	
		US TREASURY BONDS 5.25 2029/02/15	40,000.00	51,195.20	
		US TREASURY BONDS 5.375 2031/02/15	80,000.00	106,680.80	
		US TREASURY BONDS 5.5 2028/08/15	40,000.00	51,824.80	
		US TREASURY BONDS 6 2026/02/15	50,000.00	64,605.00	
		US TREASURY BONDS 6.125 2027/11/15	60,000.00	80,554.20	
		US TREASURY BONDS 6.5 2026/11/15	30,000.00	40,572.60	
		US TREASURY N/B 0.75 2018/03/31	690,000.00	688,488.90	
		US TREASURY N/B 0.875 2019/06/15	420,000.00	415,716.00	
		US TREASURY N/B 0.875 2019/07/31	700,000.00	692,097.00	
		US TREASURY N/B 1 2018/03/15	520,000.00	520,405.60	

US TREASURY N/B 1 2018/09/15	640,000.00	639,020.80	
US TREASURY N/B 1 2019/03/15	480,000.00	477,561.60	
US TREASURY N/B 1 2019/09/30	550,000.00	544,368.00	
US TREASURY N/B 1.125 2018/06/15	650,000.00	650,936.00	
US TREASURY N/B 1.25 2018/11/30	570,000.00	570,752.40	
US TREASURY N/B 1.25 2019/10/31	680,000.00	677,103.20	
US TREASURY N/B 1.375 2018/06/30	530,000.00	532,480.40	
US TREASURY N/B 1.375 2018/09/30	590,000.00	592,483.90	
US TREASURY N/B 1.375 2019/12/15	500,000.00	499,000.00	
US TREASURY N/B 1.375 2020/01/31	800,000.00	797,808.00	
US TREASURY N/B 1.375 2020/03/31	550,000.00	547,525.00	
US TREASURY N/B 1.375 2021/01/31	430,000.00	423,782.20	
US TREASURY N/B 1.375 2023/06/30	300,000.00	285,879.00	
US TREASURY N/B 1.375 2023/09/30	280,000.00	265,812.40	
US TREASURY N/B 1.5 2018/12/31	610,000.00	613,452.60	
US TREASURY N/B 1.5 2023/03/31	290,000.00	279,429.50	
US TREASURY N/B 1.5 2026/08/15	400,000.00	368,264.00	
US TREASURY N/B 1.625 2019/03/31	400,000.00	402,952.00	
US TREASURY N/B 1.625 2019/06/30	410,000.00	412,706.00	
US TREASURY N/B 1.625 2019/08/31	520,000.00	523,187.60	
US TREASURY N/B 1.625 2019/12/31	510,000.00	512,386.80	
US TREASURY N/B 1.625 2020/06/30	510,000.00	510,357.00	
US TREASURY N/B 1.625 2022/08/15	370,000.00	362,337.30	
US TREASURY N/B 1.625 2022/11/15	420,000.00	409,810.80	
US TREASURY N/B 1.625 2026/02/15	380,000.00	355,566.00	
US TREASURY N/B 1.625 2026/05/15	380,000.00	354,688.20	
US TREASURY N/B 1.75 2022/03/31	270,000.00	267,224.40	
US TREASURY N/B 1.75 2022/05/15	400,000.00	395,232.00	
US TREASURY N/B 1.75 2022/09/30	290,000.00	285,307.80	
US TREASURY N/B 1.75 2023/05/15	510,000.00	497,887.50	

US TREASURY N/B 1.875 2022/05/31	80,000.00	79,546.40	
US TREASURY N/B 2 2020/09/30	560,000.00	566,692.00	
US TREASURY N/B 2 2021/11/15	830,000.00	833,627.10	
US TREASURY N/B 2 2022/02/15	410,000.00	411,279.20	
US TREASURY N/B 2 2023/02/15	530,000.00	526,602.70	
US TREASURY N/B 2 2025/02/15	420,000.00	409,399.20	
US TREASURY N/B 2 2025/08/15	390,000.00	378,311.70	
US TREASURY N/B 2 2026/11/15	380,000.00	365,449.80	
US TREASURY N/B 2.125 2021/06/30	560,000.00	567,016.80	
US TREASURY N/B 2.125 2021/08/15	790,000.00	798,516.20	
US TREASURY N/B 2.125 2021/09/30	630,000.00	636,589.80	
US TREASURY N/B 2.125 2021/12/31	630,000.00	636,073.20	
US TREASURY N/B 2.125 2022/06/30	280,000.00	281,638.00	
US TREASURY N/B 2.125 2022/12/31	300,000.00	300,480.00	
US TREASURY N/B 2.125 2025/05/15	410,000.00	402,517.50	
US TREASURY N/B 2.25 2021/03/31	600,000.00	611,010.00	
US TREASURY N/B 2.25 2023/12/31	360,000.00	360,658.80	
US TREASURY N/B 2.25 2024/11/15	400,000.00	397,984.00	
US TREASURY N/B 2.25 2025/11/15	400,000.00	395,060.00	
US TREASURY N/B 2.25 2046/08/15	240,000.00	202,516.80	
US TREASURY N/B 2.375 2020/12/31	580,000.00	594,181.00	
US TREASURY N/B 2.375 2024/08/15	410,000.00	412,574.80	
US TREASURY N/B 2.5 2023/08/15	530,000.00	540,101.80	
US TREASURY N/B 2.5 2024/05/15	390,000.00	396,380.40	
US TREASURY N/B 2.5 2045/02/15	260,000.00	232,791.00	
US TREASURY N/B 2.5 2046/02/15	250,000.00	223,387.50	
US TREASURY N/B 2.5 2046/05/15	240,000.00	214,329.60	
US TREASURY N/B 2.625 2018/04/30	620,000.00	631,959.80	
US TREASURY N/B 2.625 2020/08/15	750,000.00	774,990.00	
US TREASURY N/B 2.625 2020/11/15	790,000.00	816,662.50	

US TREASURY N/B 2.75 2019/02/15	750,000.00	772,380.00	
US TREASURY N/B 2.75 2023/11/15	520,000.00	537,529.20	
US TREASURY N/B 2.75 2024/02/15	300,000.00	310,113.00	
US TREASURY N/B 2.75 2042/08/15	150,000.00	142,429.50	
US TREASURY N/B 2.75 2042/11/15	170,000.00	161,246.70	
US TREASURY N/B 2.875 2043/05/15	250,000.00	242,625.00	
US TREASURY N/B 2.875 2045/08/15	250,000.00	241,687.50	
US TREASURY N/B 2.875 2046/11/15	230,000.00	222,695.20	
US TREASURY N/B 3 2042/05/15	110,000.00	109,587.50	
US TREASURY N/B 3 2044/11/15	250,000.00	248,007.50	
US TREASURY N/B 3 2045/05/15	260,000.00	257,673.00	
US TREASURY N/B 3 2045/11/15	250,000.00	247,695.00	
US TREASURY N/B 3.125 2019/05/15	540,000.00	561,513.60	
US TREASURY N/B 3.125 2021/05/15	700,000.00	737,184.00	
US TREASURY N/B 3.125 2041/11/15	80,000.00	81,540.00	
US TREASURY N/B 3.125 2042/02/15	110,000.00	112,087.80	
US TREASURY N/B 3.125 2043/02/15	190,000.00	193,190.10	
US TREASURY N/B 3.125 2044/08/15	270,000.00	274,395.60	
US TREASURY N/B 3.375 2044/05/15	250,000.00	266,015.00	
US TREASURY N/B 3.5 2018/02/15	260,000.00	266,580.60	
US TREASURY N/B 3.5 2020/05/15	630,000.00	668,316.60	
US TREASURY N/B 3.5 2039/02/15	70,000.00	76,731.90	
US TREASURY N/B 3.625 2021/02/15	310,000.00	332,363.40	
US TREASURY N/B 3.625 2043/08/15	200,000.00	222,288.00	
US TREASURY N/B 3.625 2044/02/15	250,000.00	277,802.50	
US TREASURY N/B 3.75 2018/11/15	710,000.00	741,808.00	
US TREASURY N/B 3.75 2043/11/15	250,000.00	283,992.50	
US TREASURY N/B 3.875 2040/08/15	110,000.00	126,739.80	
US TREASURY N/B 4 2018/08/15	590,000.00	615,853.80	
US TREASURY N/B 4.25 2039/05/15	60,000.00	73,026.00	

	US TREASURY N/B 4.25 2040/11/15	100,000.00	121,714.00	
	US TREASURY N/B 4.375 2038/02/15	50,000.00	62,242.00	
	US TREASURY N/B 4.375 2039/11/15	80,000.00	99,012.00	
	US TREASURY N/B 4.5 2036/02/15	90,000.00	113,930.10	
	US TREASURY N/B 4.5 2038/05/15	40,000.00	50,626.40	
	US TREASURY N/B 4.5 2039/08/15	90,000.00	113,248.80	
	US TREASURY N/B 4.625 2040/02/15	140,000.00	179,275.60	
	US TREASURY N/B 4.75 2041/02/15	120,000.00	156,753.60	
	US TREASURY N/B 5 2037/05/15	40,000.00	53,695.20	
	US TREASURY NOTES 6.25 2030/05/15	50,000.00	70,773.00	
	WI TREASURY SEC. 3.75 2041/08/15	100,000.00	113,050.00	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2040/05/15	100,000.00	123,796.00	
	WI TREASURY SEC. 4.375 2041/05/15	100,000.00	124,121.00	
	アメリカ・ドル 小計	41,090,000.00	41,616,852.10 (4,720,599,534)	
イギリス・債券	TSY 3 3/4% 2019 3.75 2019/09/07	90,000.00	98,280.90	
	TSY 3 3/4% 2020 3.75 2020/09/07	110,000.00	123,532.20	
	TSY 3 3/4% 2021 3.75 2021/09/07	90,000.00	103,440.60	
	TSY 4 1/2% 2019 4.5 2019/03/07	110,000.00	119,940.70	
	TSY 4 1/2% 2034 4.5 2034/09/07	130,000.00	183,543.10	
	TSY 4 1/2% 2042 4.5 2042/12/07	120,000.00	182,982.00	
	TSY 4 1/4% 2036 4.25 2036/03/07	130,000.00	180,550.50	
	TSY 4 1/4% 2046 4.25 2046/12/07	100,000.00	152,483.00	
	TSY 4 1/4% 2027 4.25 2027/12/07	80,000.00	103,556.00	
	TSY 4 1/4% 2032 4.25 2032/06/07	110,000.00	148,491.20	
	TSY 4 1/4% 2039 4.25 2039/09/07	90,000.00	128,505.60	
	TSY 4 1/4% 2040 4.25 2040/12/07	100,000.00	144,555.00	
	TSY 4 1/4% 2055 4.25 2055/12/07	110,000.00	185,823.00	
	TSY 4 3/4% 2020 4.75 2020/03/07	110,000.00	125,208.60	
	TSY 4 3/4% 2030 4.75 2030/12/07	90,000.00	125,793.00	
	TSY 4% 2022 4 2022/03/07	70,000.00	82,220.60	

	TSY 4% 2060 4 2060/01/22	90,000.00	150,694.20	
	TSY 4.75% 2038 4.75 2038/12/07	90,000.00	136,235.70	
	TSY 5 2025 5 2025/03/07	100,000.00	130,945.00	
	TSY 5% 2018 5 2018/03/07	110,000.00	115,618.80	
	TSY 8% 2021 8 2021/06/07	80,000.00	106,063.20	
	UK TREASURY 6 2028/12/07	60,000.00	90,448.20	
	UK TSY 1 1/2% 2021 1.5 2021/01/22	180,000.00	187,732.80	
	UK TSY 1 1/2% 2026 1.5 2026/07/22	110,000.00	112,689.50	
	UK TSY 1 1/2% 2047 1.5 2047/07/22	50,000.00	45,500.00	
	UK TSY 1 3/4% 2019 1.75 2019/07/22	180,000.00	186,967.80	
	UK TSY 1.25% 2018 1.25 2018/07/22	200,000.00	203,300.00	
	UK TSY 1.75% 2022 1.75 2022/09/07	150,000.00	159,189.00	
	UK TSY 1.75% 2057 1.75 2057/07/22	20,000.00	19,844.40	
	UK TSY 2 1/4% 2023 2.25 2023/09/07	120,000.00	131,347.20	
	UK TSY 2 3/4% 2024 2.75 2024/09/07	120,000.00	135,877.20	
	UK TSY 2% 2020 2 2020/07/22	160,000.00	169,200.00	
	UK TSY 2% 2025 2 2025/09/07	140,000.00	150,421.60	
	UK TSY 3 1/2% 2068 3.5 2068/07/22	110,000.00	174,766.90	
	UK TSY 3 1/4% 2044 3.25 2044/01/22	150,000.00	190,744.50	
	UK TSY 3 3/4% 2052 3.75 2052/07/22	100,000.00	149,988.00	
	UK TSY 3.5% 2045 3.5 2045/01/22	140,000.00	186,663.40	
	UK TSY 4 1/4% 2049 4.25 2049/12/07	90,000.00	142,641.00	
	UNITED KINGDOM GILT 0.5 2022/07/22	90,000.00	89,247.60	
	UNITED KINGDOM GILT 1.75 2037/09/07	30,000.00	29,218.50	
	UNITED KINGDOM GILT 2.5 2065/07/22	80,000.00	99,349.60	
	イギリス・ボンド 小計	4,390,000.00	5,483,600.10 (775,326,218)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 2020/11/21	120,000.00	118,465.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.25 2028/05/21	90,000.00	84,365.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2019/10/21	80,000.00	81,704.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2024/04/21	150,000.00	151,728.00	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2027/11/21	120,000.00	118,812.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 2.75 2035/06/21	40,000.00	36,445.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3 2047/03/21	50,000.00	42,923.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2018/10/21	120,000.00	122,949.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2025/04/21	170,000.00	177,168.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2029/04/21	80,000.00	82,114.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.25 2039/06/21	20,000.00	18,931.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 3.75 2037/04/21	50,000.00	51,910.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.25 2026/04/21	190,000.00	213,218.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2020/04/15	190,000.00	204,383.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.5 2033/04/21	70,000.00	81,155.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 4.75 2027/04/21	170,000.00	199,314.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.25 2019/03/15	200,000.00	213,768.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.5 2023/04/21	140,000.00	164,441.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2021/05/15	220,000.00	251,823.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT 5.75 2022/07/15	130,000.00	152,629.10	
	オーストラリア・ドル 小計	2,400,000.00	2,568,250.70 (223,591,906)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT 2.75 2064/12/01	20,000.00	22,046.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2018/11/01	100,000.00	99,592.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.5 2022/03/01	80,000.00	77,412.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2020/09/01	90,000.00	89,221.50	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/03/01	80,000.00	78,984.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 2021/09/01	90,000.00	88,553.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 1 2027/06/01	40,000.00	36,916.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2018/03/01	110,000.00	110,688.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.25 2018/09/01	190,000.00	191,502.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2020/03/01	100,000.00	101,696.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2023/06/01	80,000.00	80,608.80	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 2026/06/01	80,000.00	78,560.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2019/03/01	160,000.00	163,102.40	

	CANADIAN GOVERNMENT 1.75 2019/09/01	100,000.00	102,280.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 2025/06/01	80,000.00	83,975.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.5 2024/06/01	80,000.00	85,553.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2022/06/01	90,000.00	96,993.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 2.75 2048/12/01	60,000.00	64,530.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.25 2021/06/01	70,000.00	76,262.90	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2020/06/01	70,000.00	75,698.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.5 2045/12/01	100,000.00	121,639.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 3.75 2019/06/01	110,000.00	117,251.20	
	CANADIAN GOVERNMENT 4 2041/06/01	110,000.00	141,343.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 4.25 2018/06/01	170,000.00	177,667.00	
	CANADIAN GOVERNMENT 5 2037/06/01	80,000.00	113,681.60	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2029/06/01	70,000.00	98,350.70	
	CANADIAN GOVERNMENT 5.75 2033/06/01	70,000.00	103,384.40	
	CANADIAN GOVERNMENT 8 2027/06/01	20,000.00	31,534.20	
	カナダ・ドル 小計	2,500,000.00	2,709,028.90 (234,222,639)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT 0.5 2018/04/01	30,000.00	29,844.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.125 2026/06/01	20,000.00	19,808.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.25 2021/06/01	40,000.00	41,020.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.375 2025/06/01	20,000.00	20,280.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.5 2019/06/01	60,000.00	61,755.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2023/07/01	30,000.00	31,440.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2042/04/01	20,000.00	20,900.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.75 2046/03/01	10,000.00	10,476.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2029/07/01	10,000.00	10,420.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 2.875 2030/09/01	20,000.00	20,844.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3 2024/09/01	30,000.00	31,860.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.125 2022/09/01	30,000.00	32,085.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.25 2020/09/01	50,000.00	53,025.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 3.375 2033/09/01	50,000.00	55,750.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT 3.5 2027/03/01	30,000.00	33,030.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT 4 2018/09/01	50,000.00	52,230.00	
シンガポール・ドル	小計	500,000.00	524,768.10 (41,886,990)	
スイス・フラン	SWITZERLAND 2.25 2020/07/06	180,000.00	199,332.00	
スイス・フラン	小計	180,000.00	199,332.00 (22,498,603)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT 1 2026/11/12	390,000.00	402,335.70	
	SWEDISH GOVERNMENT 1.5 2023/11/13	460,000.00	499,279.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 2.5 2025/05/12	420,000.00	490,123.20	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2022/06/01	550,000.00	652,536.50	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5 2039/03/30	300,000.00	403,176.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 4.25 2019/03/12	570,000.00	627,524.40	
	SWEDISH GOVERNMENT 5 2020/12/01	620,000.00	745,165.60	
スウェーデン・クローナ	小計	3,310,000.00	3,820,140.80 (48,362,983)	
デンマーク・クロー ネ	KINGDOM OF DENMARK 0.25 2018/11/15	280,000.00	284,320.40	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5 2023/11/15	360,000.00	397,512.00	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75 2025/11/15	490,000.00	550,956.00	
	KINGDOM OF DENMARK 3 2021/11/15	560,000.00	649,303.20	
	KINGDOM OF DENMARK 4 2019/11/15	570,000.00	640,309.50	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5 2039/11/15	780,000.00	1,317,583.80	
デンマーク・クローネ	小計	3,040,000.00	3,839,984.90 (62,054,156)	
ノルウェー・クロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.5 2026/02/19	160,000.00	158,300.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 1.75 2025/03/13	310,000.00	314,860.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 2 2023/05/24	370,000.00	385,928.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3 2024/03/14	240,000.00	265,567.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 3.75 2021/05/25	540,000.00	602,159.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT 4.5 2019/05/22	460,000.00	499,546.20	
ノルウェー・クローネ	小計	2,080,000.00	2,226,362.90 (30,234,008)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 0 2018/10/25	150,000.00	145,020.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2018/07/25	300,000.00	302,910.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2026/07/25	230,000.00	208,138.50	

	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5 2027/07/25	50,000.00	44,585.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25 2025/07/25	180,000.00	175,185.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4 2023/10/25	200,000.00	206,810.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 2020/10/25	280,000.00	304,780.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5 2019/10/25	270,000.00	291,675.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2021/10/25	430,000.00	481,385.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2022/09/23	170,000.00	191,624.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75 2029/04/25	40,000.00	47,405.60	
ポーランド・ズロチ	小計	2,300,000.00	2,399,518.70 (66,754,610)	
マレーシア・リングット	MALAYSIA GOVERNMENT 3.418 2022/08/15	140,000.00	136,703.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.48 2023/03/15	140,000.00	136,570.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.58 2018/09/28	260,000.00	261,612.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.733 2028/06/15	50,000.00	47,256.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.844 2033/04/15	20,000.00	18,400.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.889 2020/07/31	190,000.00	191,527.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.892 2027/03/15	100,000.00	97,455.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.9 2026/11/30	60,000.00	59,347.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 3.955 2025/09/15	50,000.00	49,806.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.127 2032/04/15	30,000.00	28,377.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.16 2021/07/15	200,000.00	203,500.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.181 2024/07/15	60,000.00	60,690.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.232 2031/06/30	120,000.00	116,811.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.254 2035/05/31	20,000.00	19,042.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.378 2019/11/29	200,000.00	204,700.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.392 2026/04/15	60,000.00	61,383.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.498 2030/04/15	70,000.00	70,249.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.736 2046/03/15	40,000.00	39,692.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT 4.935 2043/09/30	30,000.00	30,312.60	
マレーシア・リングット	小計	1,840,000.00	1,833,437.80 (46,642,658)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2024/12/05	1,690,000.00	1,960,298.60	

	MEX BONOS DESARR FIX RT 10 2036/11/20	340,000.00	411,525.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 4.75 2018/06/14	2,050,000.00	1,997,766.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5 2019/12/11	1,380,000.00	1,311,579.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 5.75 2026/03/05	690,000.00	614,969.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2021/06/10	2,200,000.00	2,150,104.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 6.5 2022/06/09	750,000.00	727,642.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.5 2027/06/03	410,000.00	410,057.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2031/05/29	800,000.00	799,152.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2034/11/23	640,000.00	632,832.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 7.75 2042/11/13	880,000.00	861,520.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2020/06/11	660,000.00	679,371.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8 2023/12/07	510,000.00	529,640.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2018/12/13	600,000.00	616,908.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2029/05/31	690,000.00	738,382.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT 8.5 2038/11/18	780,000.00	826,207.20	
	メキシコ・ペソ 小計	15,070,000.00	15,267,956.40 (84,889,838)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2 2023/10/22	30,000.00	30,169.80	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2025/06/22	90,000.00	92,116.80	
	BELGIUM KINGDOM 0.8 2027/06/22	40,000.00	39,834.40	
	BELGIUM KINGDOM 1 2026/06/22	80,000.00	82,370.40	
	BELGIUM KINGDOM 1 2031/06/22	60,000.00	58,267.20	
	BELGIUM KINGDOM 1.25 2018/06/22	70,000.00	71,764.70	
	BELGIUM KINGDOM 1.6 2047/06/22	30,000.00	28,170.30	
	BELGIUM KINGDOM 1.9 2038/06/22	30,000.00	31,900.20	
	BELGIUM KINGDOM 2.15 2066/06/22	20,000.00	19,994.20	
	BELGIUM KINGDOM 2.25 2023/06/22	80,000.00	91,406.40	
	BELGIUM KINGDOM 2.6 2024/06/22	90,000.00	105,149.70	
	BELGIUM KINGDOM 3 2019/09/28	70,000.00	76,454.70	
	BELGIUM KINGDOM 3 2034/06/22	40,000.00	50,389.20	
	BELGIUM KINGDOM 3.75 2020/09/28	120,000.00	138,283.20	

BELGIUM KINGDOM 3.75 2045/06/22	60,000.00	86,493.60	
BELGIUM KINGDOM 4 2018/03/28	60,000.00	63,078.60	
BELGIUM KINGDOM 4 2019/03/28	80,000.00	87,717.60	
BELGIUM KINGDOM 4 2022/03/28	80,000.00	97,474.40	
BELGIUM KINGDOM 4 2032/03/28	50,000.00	69,298.50	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2021/09/28	110,000.00	133,380.50	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2022/09/28	110,000.00	137,144.70	
BELGIUM KINGDOM 4.25 2041/03/28	100,000.00	152,884.00	
BELGIUM KINGDOM 4.5 2026/03/28	70,000.00	94,439.80	
BELGIUM KINGDOM 5 2035/03/28	120,000.00	191,378.40	
BELGIUM KINGDOM 5.5 2028/03/28	120,000.00	179,714.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2018/04/30	120,000.00	120,741.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.25 2019/01/31	110,000.00	110,867.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.4 2022/04/30	20,000.00	19,877.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.75 2021/07/30	120,000.00	122,475.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.15 2020/07/30	100,000.00	103,645.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.3 2026/10/31	110,000.00	107,123.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.4 2020/01/31	140,000.00	145,780.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.6 2025/04/30	120,000.00	122,214.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2026/04/30	130,000.00	134,481.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1.95 2030/07/30	130,000.00	127,769.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.15 2025/10/31	120,000.00	126,601.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2019/04/30	130,000.00	138,243.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.75 2024/10/31	140,000.00	155,257.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 2.9 2046/10/31	50,000.00	49,860.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.45 2066/07/30	30,000.00	30,955.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.75 2018/10/31	130,000.00	138,892.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.8 2024/04/30	130,000.00	153,910.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4 2020/04/30	150,000.00	168,829.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.1 2018/07/30	120,000.00	127,508.40	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.2 2037/01/31	110,000.00	138,318.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.3 2019/10/31	120,000.00	134,016.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 2023/10/31	140,000.00	171,281.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.5 2018/01/31	100,000.00	104,504.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.6 2019/07/30	130,000.00	144,834.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.65 2025/07/30	140,000.00	175,945.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.7 2041/07/30	90,000.00	121,746.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.8 2024/01/31	100,000.00	125,260.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.85 2020/10/31	100,000.00	117,288.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.9 2040/07/30	90,000.00	124,247.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2028/10/31	80,000.00	107,544.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.15 2044/10/31	80,000.00	114,856.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.4 2023/01/31	130,000.00	165,259.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.5 2021/04/30	150,000.00	182,940.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.75 2032/07/30	120,000.00	175,491.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.85 2022/01/31	150,000.00	189,348.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 5.9 2026/07/30	100,000.00	137,732.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 6 2029/01/31	130,000.00	186,982.90	
BUNDES OBLIGATION 0 2020/04/17	110,000.00	112,702.70	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/04/09	120,000.00	123,226.80	
BUNDES OBLIGATION 0 2021/10/08	130,000.00	133,542.50	
BUNDES OBLIGATION 0.25 2018/04/13	190,000.00	192,481.40	
BUNDES OBLIGATION 0.25 2019/10/11	100,000.00	102,900.00	
BUNDES OBLIGATION 0.25 2020/10/16	110,000.00	113,899.50	
BUNDES OBLIGATION 0.5 2019/04/12	110,000.00	113,247.20	
BUNDES OBLIGATION 1 2018/10/12	170,000.00	175,251.30	
BUNDES OBLIGATION 1 2019/02/22	210,000.00	217,944.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0 2026/08/15	150,000.00	146,853.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25 2027/02/15	30,000.00	29,880.60	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2025/02/15	140,000.00	146,141.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5 2026/02/15	150,000.00	155,089.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2024/08/15	110,000.00	119,322.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1 2025/08/15	140,000.00	151,492.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2022/09/04	280,000.00	310,508.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/02/15	110,000.00	122,409.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2023/05/15	130,000.00	144,990.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5 2024/05/15	110,000.00	123,311.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75 2024/02/15	190,000.00	216,197.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2022/01/04	100,000.00	112,522.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2 2023/08/15	100,000.00	115,077.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2021/01/04	130,000.00	146,229.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2044/07/04	110,000.00	147,251.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5 2046/08/15	120,000.00	162,256.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3 2020/07/04	230,000.00	259,571.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2020/01/04	140,000.00	156,591.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2021/07/04	210,000.00	246,126.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25 2042/07/04	100,000.00	149,770.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5 2019/07/04	150,000.00	165,640.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4 2037/01/04	140,000.00	221,277.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2018/07/04	110,000.00	117,807.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.25 2039/07/04	80,000.00	133,963.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2034/07/04	120,000.00	199,449.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 4.75 2040/07/04	90,000.00	161,914.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 6.25 2030/01/04	60,000.00	103,395.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2018/03/16	210,000.00	211,971.90	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0 2018/09/14	100,000.00	101,381.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.05 2019/10/15	80,000.00	79,488.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.1 2019/04/15	100,000.00	99,958.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.25 2018/05/15	210,000.00	211,045.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.3 2018/10/15	70,000.00	70,371.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.45 2021/06/01	90,000.00	89,005.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2020/11/01	90,000.00	90,530.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.65 2023/10/15	70,000.00	66,072.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.7 2020/05/01	90,000.00	90,813.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 0.95 2023/03/15	100,000.00	97,657.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.05 2019/12/01	90,000.00	91,854.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.25 2026/12/01	110,000.00	101,288.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.35 2022/04/15	250,000.00	253,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.45 2022/09/15	80,000.00	81,017.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.5 2025/06/01	120,000.00	116,067.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.6 2026/06/01	110,000.00	105,164.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 1.65 2032/03/01	120,000.00	107,587.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2 2025/12/01	120,000.00	119,272.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.15 2021/12/15	170,000.00	179,538.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.25 2036/09/01	70,000.00	64,432.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.45 2033/09/01	50,000.00	48,410.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2019/05/01	100,000.00	105,059.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.5 2024/12/01	120,000.00	125,356.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.7 2047/03/01	80,000.00	71,410.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8 2067/03/01	30,000.00	24,868.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.25 2046/09/01	80,000.00	79,912.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2018/12/01	130,000.00	137,992.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.5 2030/03/01	140,000.00	154,651.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/03/01	160,000.00	179,870.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/05/01	140,000.00	157,495.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2021/08/01	330,000.00	372,560.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75 2024/09/01	120,000.00	135,987.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2020/09/01	140,000.00	157,110.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4 2037/02/01	170,000.00	196,441.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/02/01	290,000.00	313,472.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2019/09/01	230,000.00	252,836.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25 2020/03/01	290,000.00	323,703.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/02/01	130,000.00	135,801.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2018/08/01	160,000.00	170,547.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2023/05/01	140,000.00	165,069.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2024/03/01	140,000.00	165,634.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5 2026/03/01	120,000.00	142,855.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2023/08/01	150,000.00	180,052.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2028/09/01	130,000.00	159,266.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75 2044/09/01	90,000.00	113,017.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2025/03/01	140,000.00	171,626.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2034/08/01	140,000.00	181,363.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2039/08/01	110,000.00	142,521.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5 2040/09/01	150,000.00	193,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.25 2029/11/01	170,000.00	219,420.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/09/01	130,000.00	159,621.80	

BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5 2022/11/01	130,000.00	159,862.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES 5.75 2033/02/01	100,000.00	138,417.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6 2031/05/01	180,000.00	251,575.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES 6.5 2027/11/01	170,000.00	236,019.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES 9 2023/11/01	70,000.00	102,850.30	
DEUTSCHLAND REP 4.75 2028/07/04	70,000.00	104,205.50	
DEUTSCHLAND REP 5.5 2031/01/04	110,000.00	182,989.40	
DEUTSCHLAND REP 5.625 2028/01/04	90,000.00	141,201.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5 2027/07/04	70,000.00	114,747.50	
FINNISH GOVERNMENT 0 2023/09/15	20,000.00	19,947.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.375 2020/09/15	30,000.00	30,907.80	
FINNISH GOVERNMENT 0.5 2026/04/15	40,000.00	40,086.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.75 2031/04/15	20,000.00	19,571.00	
FINNISH GOVERNMENT 0.875 2025/09/15	20,000.00	20,850.40	
FINNISH GOVERNMENT 1.125 2018/09/15	40,000.00	41,152.80	
FINNISH GOVERNMENT 1.5 2023/04/15	30,000.00	32,865.90	
FINNISH GOVERNMENT 1.625 2022/09/15	30,000.00	32,984.70	
FINNISH GOVERNMENT 2 2024/04/15	30,000.00	34,021.50	
FINNISH GOVERNMENT 2.625 2042/07/04	30,000.00	39,228.00	
FINNISH GOVERNMENT 2.75 2028/07/04	30,000.00	36,895.50	
FINNISH GOVERNMENT 3.375 2020/04/15	60,000.00	67,441.80	
FINNISH GOVERNMENT 3.5 2021/04/15	30,000.00	34,896.30	
FINNISH GOVERNMENT 4 2025/07/04	40,000.00	52,440.80	
FINNISH GOVERNMENT 4.375 2019/07/04	20,000.00	22,393.60	
FRANCE (GOVT OF) 0 2018/02/25	110,000.00	110,620.40	
FRANCE (GOVT OF) 0 2019/02/25	120,000.00	121,122.00	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/02/25	30,000.00	30,196.50	
FRANCE (GOVT OF) 0 2020/05/25	80,000.00	80,676.80	
FRANCE (GOVT OF) 0 2021/05/25	110,000.00	110,412.50	
FRANCE (GOVT OF) 0.25 2020/11/25	180,000.00	182,984.40	

FRANCE (GOVT OF) 0.25 2026/11/25	120,000.00	111,166.80	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2019/11/25	110,000.00	112,585.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2025/05/25	200,000.00	196,318.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5 2026/05/25	180,000.00	172,681.20	
FRANCE (GOVT OF) 1 2018/05/25	150,000.00	152,910.00	
FRANCE (GOVT OF) 1 2018/11/25	330,000.00	338,662.50	
FRANCE (GOVT OF) 1 2025/11/25	160,000.00	162,059.20	
FRANCE (GOVT OF) 1.25 2036/05/25	110,000.00	100,944.80	
FRANCE (GOVT OF) 1.5 2031/05/25	160,000.00	160,816.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2023/05/25	310,000.00	337,292.40	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2024/11/25	180,000.00	195,795.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75 2066/05/25	40,000.00	33,913.20	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2022/10/25	180,000.00	200,705.40	
FRANCE (GOVT OF) 2.25 2024/05/25	200,000.00	224,956.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2020/10/25	190,000.00	209,038.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5 2030/05/25	190,000.00	216,191.50	
FRANCE (GOVT OF) 2.75 2027/10/25	210,000.00	243,646.20	
FRANCE (GOVT OF) 3 2022/04/25	310,000.00	356,565.10	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2021/10/25	240,000.00	276,681.60	
FRANCE (GOVT OF) 3.25 2045/05/25	150,000.00	188,031.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2020/04/25	290,000.00	324,858.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.5 2026/04/25	210,000.00	257,928.30	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2019/10/25	360,000.00	399,895.20	
FRANCE (GOVT OF) 3.75 2021/04/25	260,000.00	302,151.20	
FRANCE (GOVT OF) 4 2018/04/25	180,000.00	189,633.60	
FRANCE (GOVT OF) 4 2038/10/25	160,000.00	223,307.20	
FRANCE (GOVT OF) 4 2055/04/25	100,000.00	147,539.00	
FRANCE (GOVT OF) 4 2060/04/25	70,000.00	104,914.60	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2019/04/25	310,000.00	341,620.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.25 2023/10/25	260,000.00	326,216.80	

FRANCE (GOVT OF) 4.5 2041/04/25	190,000.00	284,669.40	
FRANCE (GOVT OF) 4.75 2035/04/25	160,000.00	238,568.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.5 2029/04/25	180,000.00	266,455.80	
FRANCE (GOVT OF) 5.75 2032/10/25	180,000.00	287,260.20	
FRANCE (GOVT OF) 6 2025/10/25	170,000.00	245,065.20	
IRISH TSY 0.8% 2022 0.8 2022/03/15	40,000.00	41,410.00	
IRISH TSY 1% 2026 1 2026/05/15	50,000.00	49,697.00	
IRISH TSY 1.7% 2037 1.7 2037/05/15	20,000.00	19,171.20	
IRISH TSY 2% 2045 2 2045/02/18	40,000.00	38,553.60	
IRISH TSY 2.4% 2030 2.4 2030/05/15	50,000.00	54,883.00	
IRISH TSY 3.4% 2024 3.4 2024/03/18	60,000.00	71,516.40	
IRISH TSY 3.9% 2023 3.9 2023/03/20	30,000.00	36,396.90	
ITALIAN GOVT 7.25 2026/11/01	70,000.00	100,614.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2018/04/15	90,000.00	90,817.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0 2022/01/15	50,000.00	50,737.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2020/01/15	90,000.00	92,374.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25 2025/07/15	90,000.00	89,527.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.5 2026/07/15	90,000.00	90,272.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.25 2019/01/15	100,000.00	103,786.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 1.75 2023/07/15	100,000.00	111,914.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2 2024/07/15	90,000.00	102,429.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.25 2022/07/15	90,000.00	102,424.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.5 2033/01/15	80,000.00	99,303.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.75 2047/01/15	70,000.00	96,785.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.25 2021/07/15	110,000.00	128,220.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.5 2020/07/15	90,000.00	102,645.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2023/01/15	90,000.00	111,162.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT 3.75 2042/01/15	100,000.00	157,701.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2018/07/15	100,000.00	106,718.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2019/07/15	70,000.00	77,952.70	

	NETHERLANDS GOVERNMENT 4 2037/01/15	90,000.00	138,984.30	
	NETHERLANDS GOVERNMENT 5.5 2028/01/15	80,000.00	121,566.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.25 2019/10/18	80,000.00	81,932.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 2026/10/20	60,000.00	60,871.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.15 2018/10/19	30,000.00	30,934.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.2 2025/10/20	60,000.00	64,050.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.5 2047/02/20	20,000.00	19,756.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.65 2024/10/21	60,000.00	66,479.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 1.75 2023/10/20	80,000.00	89,206.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 2.4 2034/05/23	40,000.00	47,972.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.15 2044/06/20	40,000.00	55,320.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.4 2022/11/22	70,000.00	84,275.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.5 2021/09/15	100,000.00	117,747.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.65 2022/04/20	60,000.00	72,049.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.8 2062/01/26	20,000.00	33,324.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 3.9 2020/07/15	80,000.00	92,191.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.15 2037/03/15	70,000.00	105,856.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.35 2019/03/15	80,000.00	88,344.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 4.85 2026/03/15	60,000.00	83,607.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA 6.25 2027/07/15	50,000.00	78,661.50	
	TREASURY 4 1/2% 2018 4.5 2018/10/18	50,000.00	54,082.00	
	TREASURY 4 1/2% 2020 4.5 2020/04/18	70,000.00	80,518.20	
	TREASURY 5% 2020 5 2020/10/18	50,000.00	59,637.50	
	TREASURY 5.4% 2025 5.4 2025/03/13	70,000.00	94,752.70	
	TREASURY 5.9% 2019 5.9 2019/10/18	80,000.00	93,285.60	
	ユーロ 小計	30,000,000.00	34,714,322.60 (4,169,190,144)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5 2026/12/21	1,090,000.00	1,213,889.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.25 2036/03/31	630,000.00	454,828.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.5 2041/02/28	510,000.00	366,287.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6.75 2021/03/31	450,000.00	430,690.50	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7 2031/02/28	720,000.00	598,204.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.25 2020/01/15	280,000.00	275,730.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 7.75 2023/02/28	290,000.00	282,080.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2018/12/21	300,000.00	301,632.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8 2030/01/31	530,000.00	484,589.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.25 2032/03/31	480,000.00	439,776.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.5 2037/01/31	490,000.00	446,081.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2044/01/31	600,000.00	553,938.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.75 2048/02/28	720,000.00	662,126.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8.875 2035/02/28	250,000.00	238,500.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9 2040/01/31	160,000.00	152,404.80	
	南アフリカ・ランド 小計	7,500,000.00	6,900,758.50 (59,898,584)	
国債証券 合計			10,586,152,868 (10,586,152,868)	
合計			10,586,152,868 (10,586,152,868)	

(注) 1. 通貨種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

(注) 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金 額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 114銘柄	44.07%	44.59%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	7.24%	7.32%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	2.09%	2.11%
カナダ・ドル	国債証券 28銘柄	2.19%	2.21%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.39%	0.40%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	0.21%	0.21%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.45%	0.46%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.58%	0.59%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.28%	0.29%
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	0.62%	0.63%
マレーシア・リンギット	国債証券 19銘柄	0.44%	0.44%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.79%	0.80%
ユーロ	国債証券 265銘柄	38.92%	39.38%
南アフリカ・ランド	国債証券 15銘柄	0.56%	0.57%

(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)」 (2017年02月28日現在)

資産総額	4,346,838,606円
負債総額	3,481,366円
純資産総額( - )	4,343,357,240円
発行済数量	2,599,108,487口
1口当たり純資産額( / )	1.6711円

「DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)」 (2017年02月28日現在)

資産総額	14,570,701,978円
負債総額	5,011,343円
純資産総額( - )	14,565,690,635円
発行済数量	7,618,492,548口
1口当たり純資産額( / )	1.9119円

「DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)」 (2017年02月28日現在)

資産総額	8,292,561,616円
負債総額	9,881,905円
純資産総額( - )	8,282,679,711円
発行済数量	3,864,037,556口
1口当たり純資産額( / )	2.1435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、解約請求の受付け、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

2017年2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年間に於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。

2017年2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	322	52,916
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	55	10,443
単位型公社債投資信託	3	112
合計	380	63,472

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21期事業年度（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。

また、第22期事業年度に係る中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
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
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
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
<b>無形固定資産</b>				
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
<b>投資その他の資産</b>				
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		37,262,784		37,033,830
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									
	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	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									
	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	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	<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．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）

	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)
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。		
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。

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	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 (平成27年3月31日)	当事業年度 (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。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第22期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		15,063,257
有価証券		6,100,434
前払費用		332,057
未収委託者報酬		3,387,820
未収運用受託報酬		1,987,018
未収投資助言報酬		77,619
繰延税金資産		235,224
その他		12,300
流動資産合計		27,195,731
固定資産		
有形固定資産	1	177,912
無形固定資産		939,013
投資その他の資産		
投資有価証券		32,061,699
関係会社株式		66,222
差入保証金		285,884
繰延税金資産		358,138
その他		56
投資その他の資産合計		32,772,001
固定資産合計		33,888,927
資産合計		61,084,658

## 負債の部

## 流動負債

預り金	34,656
未払収益分配金	2,498
未払償還金	83,820
未払手数料	1,148,447
未払運用委託報酬	732,230
未払投資助言報酬	460,615
その他未払金	205,555
未払費用	162,124
未払法人税等	1,392,159
前受投資助言報酬	46,905
賞与引当金	412,947
その他	203,375
流動負債合計	<u>4,885,336</u>

## 固定負債

退職給付引当金	1,473,953
役員退職慰労引当金	20,525
固定負債合計	<u>1,494,478</u>

## 負債合計

6,379,815

## 純資産の部

## 株主資本

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

## 利益剰余金

利益準備金	139,807
その他利益剰余金	
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	34,819,634
利益剰余金合計	<u>35,499,441</u>

## 株主資本合計

53,781,281

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	923,561
評価・換算差額等合計	<u>923,561</u>

## 純資産合計

54,704,843

## 負債・純資産合計

61,084,658

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第22期中間会計期間

(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		12,190,330
運用受託報酬		4,378,762
投資助言報酬		282,418
営業収益計		16,851,511
営業費用		8,389,290
一般管理費	1	3,636,282
営業利益		4,825,938
営業外収益	2	156,270
営業外費用	3	17,987
経常利益		4,964,221
特別利益	4	277,431
特別損失	5	7,077
税引前中間純利益		5,234,575
法人税、住民税及び事業税		1,327,094
法人税等調整額		238,395
法人税等合計		1,565,490
中間純利益		3,669,085

## (3)中間株主資本等変動計算書

第22期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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	31,277,901	31,957,708	50,239,548
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	8,207	8,207	8,207
遡及処理後当期首残 高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	31,286,108	31,965,915	50,247,755
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,669,085	3,669,085	3,669,085
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	-	-	-	-	-	-	-	3,533,525	3,533,525	3,533,525
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	34,819,634	35,499,441	53,781,281

	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	1,309,858	1,309,858	51,549,407
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	8,207
遡及処理後当期首残 高	1,309,858	1,309,858	51,557,614
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	3,669,085
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	386,296	386,296	386,296
当中間期変動額合計	386,296	386,296	3,147,228
当中間期末残高	923,561	923,561	54,704,843

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	第22期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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>其他有価証券 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（ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備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>

（会計方針の変更）

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日。以下「回収可能性適用指針」という。）を当中間会計期間から適用し、繰延税金資産の回収可能性に関する会計処理の方法の一部を見直しております。

回収可能性適用指針の適用については、回収可能性適用指針第49項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点において回収可能性適用指針第49項(3) から に該当する定めを適用した場合の繰延税金資産の額と、前事業年度末の繰延税金資産の額との差額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加算しております。

この結果、当中間会計期間の期首において、繰延税金資産（投資その他の資産）が8,207千円、繰越利益剰余金が8,207千円増加しております。

当中間会計期間の期首の純資産に影響額が反映されたことにより、中間株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は8,207千円増加しております。

（平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ74千円増加しております。

## (中間貸借対照表関係)

第22期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	767,987千円
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22期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1.減価償却の実施額	
有形固定資産	24,369千円
無形固定資産	155,387千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	90,866千円
時効成立収益分配金・償還金	34,943千円
有価証券利息	28,471千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	11,944千円
為替差損	5,980千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	195,321千円
投資有価証券売却益	82,110千円
5.特別損失のうち主要なもの	
事故損失賠償金	4,746千円
投資有価証券売却損	2,080千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第22期中間会計期間  
(自 平成28年4月1日  
至 平成28年9月30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28年6月24日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成28年3月31日	平成28年6月24日

## (金融商品関係)

第22期中間会計期間末(平成28年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28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	15,063,257	15,063,257	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,100,434	6,120,410	19,975
投資有価証券			
満期保有目的の債券	19,015,969	19,219,090	203,120
その他有価証券	12,978,229	12,978,229	-

## (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(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22期中間会計期間末（平成28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	25,116,403	25,339,500	223,096
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	25,116,403	25,339,500	223,096
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		25,116,403	25,339,500	223,096

## 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	5,807,626	5,876,090	68,463
	国債・地方債等	5,807,626	5,876,090	68,463
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	2,505,459	4,016,701	1,511,241
小計		8,313,086	9,892,791	1,579,705
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)	3,331,200	3,085,438	245,761
小計		3,331,200	3,085,438	245,761
合計		11,644,286	12,978,229	1,333,943

(注1) 投資信託受益証券等であります。

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

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

(デリバティブ取引関係)

第22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28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22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28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22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. サービスごとの情報

当社のサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の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

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

[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22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28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22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28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22期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

該当事項はありません。

## ( 1 株当たり情報 )

	第22期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1株当たり純資産額	504,433円86銭
1株当たり中間純利益金額	33,832円67銭

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

2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	3,669,085千円
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	<u>3,669,085千円</u>
期中平均株式数	108千株

## ( 重要な後発事象 )

第22期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

2016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

2016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

(2016年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
株式会社千葉銀行	145,069百万円	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。
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
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。

2016年5月20日	有価証券報告書 有価証券届出書
2016年11月21日	半期報告書 有価証券届出書の訂正届出書

# 独立監査人の監査報告書

平成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

- 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。
- XBR 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29年3月28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 青木 裕 晃 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成28年2月23日から平成29年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の平成29年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）が別途保管しております。
2. XBR 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29年3月28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 青木 裕 晃 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成28年2月23日から平成29年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の平成29年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

- 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。
- XBR 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29年3月28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 青木 裕 晃 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)の平成28年2月23日から平成29年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)の平成29年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)が別途保管しております。
2. XBR 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11月29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28年4月1日から平成29年3月31日までの第22期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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。