

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年11月21日提出
【計算期間】	第17期中(自 2019年2月22日 至 2019年8月21日)
【ファンド名】	DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 啓介
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【縦覧に供する場所】	該当事項ありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)」

(2019年8月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	11,840,059,101	95.10
内 日本	11,840,059,101	95.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	609,541,524	4.90
純資産総額	12,449,600,625	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)」

(2019年8月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	27,326,711,451	95.13
内 日本	27,326,711,451	95.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,399,060,314	4.87
純資産総額	28,725,771,765	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)」

(2019年8月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	13,575,872,918	95.13
内 日本	13,575,872,918	95.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	695,682,771	4.87
純資産総額	14,271,555,689	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」

(2019年8月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	59,997,634,560	97.40
内 日本	59,997,634,560	97.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,599,730,973	2.60
純資産総額	61,597,365,533	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)	1,570,400,000	2.55
内 日本	1,570,400,000	2.55

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

その他資産として、株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

(参考情報)

「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」

(2019年8月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	37,823,771,170	98.85
内 日本	37,823,771,170	98.85
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	438,632,068	1.15
純資産総額	38,262,403,238	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」

(2019年8月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	178,796,320,185	94.95
内 アメリカ	118,234,316,398	62.79
内 イギリス	10,242,128,180	5.44
内 スイス	7,065,069,915	3.75
内 カナダ	7,057,801,029	3.75
内 フランス	6,854,780,663	3.64
内 ドイツ	5,604,357,232	2.98
内 オーストラリア	4,166,303,664	2.21
内 オランダ	3,893,325,381	2.07
内 アイルランド	2,922,310,851	1.55
内 香港	1,950,840,591	1.04
内 スペイン	1,906,599,867	1.01
内 スウェーデン	1,690,507,042	0.90
内 イタリア	1,297,465,631	0.69
内 デンマーク	1,213,541,527	0.64
内 シンガポール	833,695,128	0.44
内 ベルギー	676,084,115	0.36
内 フィンランド	656,719,617	0.35
内 バミューダ	450,493,767	0.24
内 ノルウェー	432,512,939	0.23
内 ジャージー	334,858,768	0.18
内 イスラエル	290,358,967	0.15
内 ケイマン諸島	244,487,504	0.13
内 オランダ領キュラソー	221,539,380	0.12
内 ニュージーランド	166,822,979	0.09
内 オーストリア	147,093,184	0.08
内 ポルトガル	102,844,312	0.05
内 ルクセンブルグ	81,232,773	0.04
内 パプアニューギニア	32,445,394	0.02
内 イギリス領バージン諸島	19,754,499	0.01
内 モーリシャス	6,028,888	0.00
投資証券	5,192,253,309	2.76
内 アメリカ	4,273,903,145	2.27
内 オーストラリア	369,620,252	0.20

内 フランス	196,543,085	0.10
内 香港	120,013,228	0.06
内 イギリス	110,233,636	0.06
内 シンガポール	85,498,121	0.05
内 カナダ	36,441,842	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,317,885,405	2.29
純資産総額	188,306,458,899	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)	4,086,062,062	2.17
内 アメリカ	3,037,922,598	1.61
内 ドイツ	750,311,189	0.40
内 イギリス	297,828,275	0.16

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

その他資産として、株価指数先物取引を利用しております。時価は、取引所の発表する清算値段によっております。

(参考情報)

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」

(2019年8月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	23,285,590,918	99.05
内 アメリカ	11,177,759,422	47.55
内 フランス	2,321,644,716	9.88
内 イタリア	2,094,812,663	8.91
内 ドイツ	1,498,866,423	6.38
内 イギリス	1,457,563,419	6.20
内 スペイン	1,308,884,916	5.57
内 ベルギー	587,554,448	2.50
内 オーストラリア	454,115,220	1.93
内 カナダ	446,828,205	1.90
内 オランダ	434,257,497	1.85
内 オーストリア	326,877,727	1.39
内 メキシコ	171,802,564	0.73
内 アイルランド	166,967,816	0.71
内 フィンランド	135,717,215	0.58
内 ポーランド	129,818,774	0.55
内 デンマーク	122,767,232	0.52
内 南アフリカ	122,258,858	0.52
内 マレーシア	104,162,855	0.44
内 シンガポール	92,183,400	0.39
内 スウェーデン	77,662,496	0.33
内 ノルウェー	53,085,052	0.23
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	222,918,658	0.95
純資産総額	23,508,509,576	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率であります。

(2) 【運用実績】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)」

【純資産の推移】

2019年8月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第15計算期間末 (2018年2月21日)	8,063,626,857	8,063,626,857	1.7587	1.7587
第16計算期間末 (2019年2月21日)	10,111,525,053	10,111,525,053	1.7614	1.7614
2018年8月末日	9,575,905,627	-	1.7715	-
9月末日	9,773,740,913	-	1.7997	-
10月末日	9,659,249,076	-	1.7433	-
11月末日	9,823,829,414	-	1.7574	-
12月末日	9,568,292,431	-	1.7062	-
2019年1月末日	9,945,014,103	-	1.7349	-
2月末日	10,151,929,895	-	1.7603	-
3月末日	10,304,402,482	-	1.7719	-
4月末日	10,451,925,331	-	1.7815	-
5月末日	10,531,097,356	-	1.7490	-
6月末日	10,812,380,446	-	1.7737	-
7月末日	12,286,528,668	-	1.7835	-
8月末日	12,449,600,625	-	1.7764	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
2019年2月22日～ 2019年8月21日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第15計算期間	5.1
第16計算期間	0.2
2019年2月22日～ 2019年8月21日	0.4

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額により算出しております（第1計算期間については、前計算期間末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。

「DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)」

純資産の推移

2019年8月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第15計算期間末 (2018年2月21日)	20,339,334,655	20,339,334,655	2.0634	2.0634
第16計算期間末 (2019年2月21日)	24,036,451,161	24,036,451,161	2.0548	2.0548
2018年8月末日	22,626,610,854	-	2.0940	-
9月末日	23,346,920,447	-	2.1436	-
10月末日	22,669,282,147	-	2.0382	-
11月末日	23,207,195,700	-	2.0598	-
12月末日	22,437,360,586	-	1.9551	-
2019年1月末日	23,490,889,755	-	2.0098	-
2月末日	24,125,968,327	-	2.0546	-
3月末日	24,438,772,072	-	2.0661	-
4月末日	24,928,290,862	-	2.0912	-
5月末日	24,675,122,428	-	2.0248	-
6月末日	25,428,062,145	-	2.0629	-
7月末日	28,794,481,145	-	2.0811	-
8月末日	28,725,771,765	-	2.0501	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
2019年2月22日～ 2019年8月21日	-

収益率の推移

	収益率(%)
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
第15計算期間	7.5
第16計算期間	0.4
2019年2月22日～ 2019年8月21日	0.8

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額により算出しております（第1計算期間については、前計算期間末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。

「DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)」

純資産の推移

2019年8月30日現在、同日前1年以内における各月末及び各計算期間末の純資産の推移は次のとおりであります。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第15計算期間末 (2018年2月21日)	10,879,143,991	10,879,143,991	2.3709	2.3709
第16計算期間末 (2019年2月21日)	12,332,756,808	12,332,756,808	2.3458	2.3458
2018年8月末日	12,082,371,085	-	2.4238	-
9月末日	12,476,183,445	-	2.4998	-
10月末日	11,843,506,198	-	2.3332	-
11月末日	12,179,940,410	-	2.3641	-
12月末日	11,310,645,649	-	2.1930	-
2019年1月末日	11,999,496,454	-	2.2785	-
2月末日	12,408,205,105	-	2.3467	-
3月末日	12,499,298,329	-	2.3575	-
4月末日	12,797,705,374	-	2.4022	-
5月末日	12,483,968,163	-	2.2936	-
6月末日	12,885,334,325	-	2.3477	-
7月末日	14,428,056,970	-	2.3762	-
8月末日	14,271,555,689	-	2.3149	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
2019年2月22日～ 2019年8月21日	-

収益率の推移

	収益率(%)
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
第15計算期間	9.9
第16計算期間	1.1
2019年2月22日～ 2019年8月21日	2.0

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（又は直近日の基準価額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた額により算出しております（第1計算期間については、前計算期間末分配落基準価額の代わりに、設定時の基準価額を用います。）。

2【設定及び解約の実績】

「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第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
第15計算期間	2,361,820,149	365,488,159	4,584,884,905
第16計算期間	1,655,374,012	499,770,847	5,740,488,070
2019年2月22日～ 2019年8月21日	1,455,987,402	273,881,689	6,922,593,783

(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
第15計算期間	3,154,753,330	901,476,667	9,857,059,478
第16計算期間	2,639,726,677	799,319,778	11,697,466,377
2019年2月22日～ 2019年8月21日	2,762,523,933	575,196,749	13,884,793,561

(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
第15計算期間	1,365,271,724	638,735,089	4,588,589,764
第16計算期間	1,229,209,838	560,358,494	5,257,441,108
2019年2月22日～ 2019年8月21日	1,159,298,168	311,238,000	6,105,501,276

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

3【ファンドの経理状況】

中間財務諸表

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

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

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年2月22日から2019年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

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

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年2月22日から2019年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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

2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年2月22日から2019年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23,694,645	4,391,894
コール・ローン	483,675,548	608,496,106
親投資信託受益証券	9,614,081,430	11,635,006,760
未収入金	3,875,855	5,870,408
流動資産合計	10,125,327,478	12,253,765,168
資産合計	10,125,327,478	12,253,765,168
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,968,697	5,911,587
未払受託者報酬	1,583,105	1,752,848
未払委託者報酬	7,915,733	8,764,380
その他未払費用	334,890	347,570
流動負債合計	13,802,425	16,776,385
負債合計	13,802,425	16,776,385
純資産の部		
元本等		
元本	5,740,488,070	6,922,593,783
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,371,036,983	5,314,395,000
純資産合計	10,111,525,053	12,236,988,783
負債純資産合計	10,125,327,478	12,253,765,168

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期中間計算期間 (自2018年2月22日 至2018年8月21日)	第17期中間計算期間 (自2019年2月22日 至2019年8月21日)
営業収益		
受取利息	2,633	4,895
有価証券売買等損益	16,127,981	34,469,718
営業収益合計	16,125,348	34,474,613
営業費用		
支払利息	171,947	209,663
受託者報酬	1,446,723	1,752,848
委託者報酬	7,233,797	8,764,380
その他費用	355,750	365,389
営業費用合計	9,208,217	11,092,280
営業利益又は営業損失()	25,333,565	23,382,333
経常利益又は経常損失()	25,333,565	23,382,333
中間純利益又は中間純損失()	25,333,565	23,382,333
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,638,078	1,950,440
期首剰余金又は期首欠損金()	3,478,741,952	4,371,036,983
剰余金増加額又は欠損金減少額	736,748,187	1,130,764,429
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	736,748,187	1,130,764,429
剰余金減少額又は欠損金増加額	158,591,232	208,838,305
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	158,591,232	208,838,305
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	4,029,927,264	5,314,395,000

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
1. 受益権総口数	5,740,488,070口	6,922,593,783口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7614円 (17,614円)	1.7677円 (17,677円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
期首元本額	4,584,884,905円	5,740,488,070円
期中追加設定元本額	1,655,374,012円	1,455,987,402円
期中一部解約元本額	499,770,847円	273,881,689円

【DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	55,414,772	10,145,464
コール・ローン	1,131,174,180	1,405,652,189
親投資信託受益証券	22,875,580,833	26,906,383,444
未収入金	12,211,935	41,537,476
流動資産合計	24,074,381,720	28,363,718,573
資産合計	24,074,381,720	28,363,718,573
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,565,885	43,045,120
未払受託者報酬	3,732,107	4,133,145
未払委託者報酬	21,148,826	23,421,351
その他未払費用	483,741	506,949
流動負債合計	37,930,559	71,106,565
負債合計	37,930,559	71,106,565
純資産の部		
元本等		
元本	11,697,466,377	13,884,793,561
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	12,338,984,784	14,407,818,447
純資産合計	24,036,451,161	28,292,612,008
負債純資産合計	24,074,381,720	28,363,718,573

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期中間計算期間 (自2018年2月22日 至2018年8月21日)	第17期中間計算期間 (自2019年2月22日 至2019年8月21日)
営業収益		
受取利息	6,031	11,370
有価証券売買等損益	169,457	251,504,482
営業収益合計	163,426	251,493,112
営業費用		
支払利息	395,522	486,974
受託者報酬	3,416,269	4,133,145
委託者報酬	19,359,051	23,421,351
その他費用	561,153	548,340
営業費用合計	23,731,995	28,589,810
営業利益又は営業損失()	23,895,421	280,082,922
経常利益又は経常損失()	23,895,421	280,082,922
中間純利益又は中間純損失()	23,895,421	280,082,922
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	3,147,845	3,125,153
期首剰余金又は期首欠損金()	10,482,275,177	12,338,984,784
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,280,505,534	2,959,427,187
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,280,505,534	2,959,427,187
剰余金減少額又は欠損金増加額	375,708,100	607,385,449
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	375,708,100	607,385,449
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	11,360,029,345	14,407,818,447

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
1. 受益権総口数	11,697,466,377口	13,884,793,561口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0548円 (20,548円)	2.0377円 (20,377円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
期首元本額	9,857,059,478円	11,697,466,377円
期中追加設定元本額	2,639,726,677円	2,762,523,933円
期中一部解約元本額	799,319,778円	575,196,749円

【DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	28,230,712	5,050,016
コール・ローン	576,269,673	699,678,735
親投資信託受益証券	11,743,366,017	13,342,330,307
未収入金	12,284,668	8,342,695
流動資産合計	12,360,151,070	14,055,401,753
資産合計	12,360,151,070	14,055,401,753
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,767,377	8,410,989
未払受託者報酬	1,944,880	2,097,282
未払委託者報酬	12,317,869	13,283,049
その他未払費用	364,136	370,620
流動負債合計	27,394,262	24,161,940
負債合計	27,394,262	24,161,940
純資産の部		
元本等		
元本	5,257,441,108	6,105,501,276
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	7,075,315,700	7,925,738,537
純資産合計	12,332,756,808	14,031,239,813
負債純資産合計	12,360,151,070	14,055,401,753

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期中間計算期間 (自2018年2月22日 至2018年8月21日)	第17期中間計算期間 (自2019年2月22日 至2019年8月21日)
営業収益		
受取利息	3,178	5,731
有価証券売買等損益	27,677,413	292,119,349
営業収益合計	27,680,591	292,113,618
営業費用		
支払利息	208,284	245,174
受託者報酬	1,831,143	2,097,282
委託者報酬	11,597,521	13,283,049
その他費用	406,655	391,481
営業費用合計	14,043,603	16,016,986
営業利益又は営業損失()	13,636,988	308,130,604
経常利益又は経常損失()	13,636,988	308,130,604
中間純利益又は中間純損失()	13,636,988	308,130,604
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	3,961,432	417,802
期首剰余金又は期首欠損金()	6,290,554,227	7,075,315,700
剰余金増加額又は欠損金減少額	838,815,012	1,578,171,516
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	838,815,012	1,578,171,516
剰余金減少額又は欠損金増加額	340,474,818	419,200,273
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	340,474,818	419,200,273
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	6,798,569,977	7,925,738,537

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
1. 受益権総口数	5,257,441,108口	6,105,501,276口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3458円 (23,458円)	2.2981円 (22,981円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第16期 (2019年2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2019年8月21日現在)
期首元本額	4,588,589,764円	5,257,441,108円
期中追加設定元本額	1,229,209,838円	1,159,298,168円
期中一部解約元本額	560,358,494円	311,238,000円

<参考>

開示対象ファンド(DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型))は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日(以下、「計算日」という。)における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、それらは監査意見の対象外であります。

<参考>

開示対象ファンド(DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型))は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日(以下、「計算日」という。)における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、それらは監査意見の対象外であります。

<参考>

開示対象ファンド(DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型))は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券は、すべて各マザーファンドの受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日(以下、「計算日」という。)における各マザーファンドの状況は次に示すとおりであります、それらは監査意見の対象外であります。

「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	47,564,462	8,578,731
コール・ローン	970,926,881	1,188,581,606
株式	57,385,765,970	59,429,929,550
派生商品評価勘定	39,356,380	2,140,560
未収配当金	91,169,006	89,307,025
差入委託証拠金	24,645,000	35,640,000
流動資産合計	58,559,427,699	60,754,177,472
資産合計	58,559,427,699	60,754,177,472
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	8,894,440
前受金	41,505,000	2,645,000
未払解約金	194,719,481	116,359,172
その他未払費用	801	1,591
流動負債合計	236,225,282	127,900,203
負債合計	236,225,282	127,900,203
純資産の部		
元本等		
元本	34,479,781,252	38,109,536,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	23,843,421,165	22,516,740,746
純資産合計	58,323,202,417	60,626,277,269
負債純資産合計	58,559,427,699	60,754,177,472

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
1. 受益権総口数	34,479,781,252口	38,109,536,523口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6915円 (16,915円)	1.5908円 (15,908円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2019年2月21日現在）	（2019年8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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

株式関連

種類	(2019年2月21日 現在)				(2019年8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	814,445,000	-	853,830,000	39,385,000	1,080,955,000	-	1,074,240,000	6,715,000
合計	814,445,000	-	853,830,000	39,385,000	1,080,955,000	-	1,074,240,000	6,715,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

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

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

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(2019年2月21日現在)	(2019年8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	28,178,885,286円	34,479,781,252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	15,224,610,246円	7,727,756,864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	8,923,714,280円	4,098,001,593円
元本の内訳		
ファンド名		
ニッセイTOPIXオープン	6,998,062,126円	6,728,451,440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)	5,016,960,919円	4,763,395,907円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,238,783円	-円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,210,362円	4,182,206円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,206,781,976円	1,524,912,346円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,302,209,365円	5,323,614,771円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,930,765,501円	3,530,366,943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)	12,596,798円	9,354,616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)	44,117,130円	41,837,637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)	51,034,232円	54,043,504円
DCニッセイ国内株式インデックス	158,510,666円	308,252,587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	13,120,980,625円	14,777,186,366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)	474,668,180円	608,278,228円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	26,528,689円	67,490,497円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,748,346円	76,386,450円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	16,200,912円	49,524,601円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	26,018,748円	100,006,784円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,123,269円	30,565,675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(6資産均等型)	22,218,183円	39,352,901円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	25,051,252円	26,339,965円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	2,050,565円	3,188,901円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	703,909円	918,805円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	1,345,741円	2,389,751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(8資産均等型)	11,655,177円	16,572,509円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	286,258円	4,139,855円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	274,453円	4,276,925円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	258,941円	6,848,520円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	180,146円	7,657,833円
計	34,479,781,252円	38,109,536,523円

「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	11,873,276	3,169,390
コール・ローン	242,367,554	439,118,436
国債証券	33,074,891,690	37,398,335,750
未収利息	117,373,446	123,077,017
前払費用	10,506,161	13,146,112
流動資産合計	33,457,012,127	37,976,846,705
資産合計	33,457,012,127	37,976,846,705
負債の部		
流動負債		
未払解約金	45,767,919	86,734,600
その他未払費用	270	322
流動負債合計	45,768,189	86,734,922
負債合計	45,768,189	86,734,922
純資産の部		
元本等		
元本	24,325,661,001	26,860,180,321
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	9,085,582,937	11,029,931,462
純資産合計	33,411,243,938	37,890,111,783
負債純資産合計	33,457,012,127	37,976,846,705

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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 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	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
1. 受益権総口数	24,325,661,001口	26,860,180,321口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3735円 (13,735円)	1.4106円 (14,106円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2019年2月21日現在)	(2019年8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ぬ。	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。 (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。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(2019年2月21日現在)	(2019年8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	21,904,812,960円	24,325,661,001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	7,943,730,896円	5,488,655,779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	5,522,882,855円	2,954,136,459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)	1,557,046,416円	1,610,985,166円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,458,047,358円	7,633,693,657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)	3,873,777円	- 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)	2,711,106円	2,692,700円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	3,293,604,354円	3,919,663,075円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,192,194,563円	6,054,994,704円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,326,131,472円	1,506,876,979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)	41,651,617円	30,270,061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)	62,579,577円	57,087,835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)	32,356,597円	32,352,725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	4,780,485,190円	5,317,571,266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)	574,978,974円	693,992,153円
計	24,325,661,001円	26,860,180,321円

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	388,094,903	714,208,888
金銭信託	111,174,221	17,601,325
コール・ローン	2,269,384,208	2,438,660,237
株式	156,190,082,429	175,364,989,167
投資証券	4,073,157,868	5,026,635,570
派生商品評価勘定	134,259,059	36,835,315
未収入金	32,983	10,524,111
未収配当金	222,399,264	331,504,990
差入委託証拠金	1,479,571,172	1,717,946,783
流動資産合計	164,868,156,107	185,658,906,386
資産合計	164,868,156,107	185,658,906,386
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,018,478	17,097,192
未払金	-	148,636,409
未払解約金	421,904,508	334,140,069
その他未払費用	1,521	2,723
流動負債合計	422,924,507	499,876,393
負債合計	422,924,507	499,876,393
純資産の部		
元本等		
元本	94,844,967,281	107,407,368,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	69,600,264,319	77,751,661,493
純資産合計	164,445,231,600	185,159,029,993
負債純資産合計	164,868,156,107	185,658,906,386

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	（2019年2月21日現在）	（2019年8月21日現在）
1. 受益権総口数	94,844,967,281口	107,407,368,500口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7338円 (17,338円)	1.7239円 (17,239円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2019年2月21日現在）	（2019年8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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

通貨関連

種類	(2019年2月21日 現在)				(2019年8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								
売 建	-	-	-	-	3,116,617,043	-	3,116,496,250	120,793
アメリカ・ドル	-	-	-	-	2,333,102,833	-	2,332,616,130	486,703
イギリス・ポンド	-	-	-	-	218,969,679	-	219,320,280	350,601
ユーロ	-	-	-	-	564,544,531	-	564,559,840	15,309
買 建	1,729,795,897	-	1,735,928,240	6,132,343	4,970,887,355	-	4,972,430,250	1,542,895
アメリカ・ドル	1,181,436,898	-	1,183,137,060	1,700,162	3,513,001,551	-	3,515,424,300	2,422,749
イギリス・ポンド	151,340,332	-	153,482,000	2,141,668	422,220,565	-	425,716,560	3,495,995
ユーロ	397,018,667	-	399,309,180	2,290,513	1,035,665,239	-	1,031,289,390	4,375,849
合計	1,729,795,897	-	1,735,928,240	6,132,343	8,087,504,398	-	8,088,926,500	1,663,688

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

株式関連

種類	(2019年2月21日 現在)				(2019年8月21日 現在)			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,761,415,590	-	3,888,523,826	127,108,236	4,282,642,701	-	4,300,717,136	18,074,435
合計	3,761,415,590	-	3,888,523,826	127,108,236	4,282,642,701	-	4,300,717,136	18,074,435

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

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

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

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(2019年2月21日現在)	(2019年8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	70,849,080,074円	94,844,967,281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	37,550,145,965円	22,562,322,281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	13,554,258,758円	9,999,921,062円
元本の内訳		
ファンド名		
D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	595,531,315円	698,653,460円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,819,138,551円	3,241,321,544円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,160,421,182円	2,419,396,083円
ニッセイ/パナゴラ・外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	- 円	1,333,802,005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)	- 円	3,849,654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)	- 円	22,964,535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)	- 円	32,903,423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)	11,698,042,919円	11,525,937,107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	65,072,270,014円	72,900,642,046円
D Cニッセイ外国株式インデックス	11,899,518,770円	14,339,593,541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)	468,264,447円	557,400,550円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	19,393,803円	45,866,812円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,566,941円	70,004,086円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	11,777,271円	33,474,092円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	18,901,250円	67,551,278円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	6,227,388円	19,383,725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(6資産均等型)	21,917,060円	36,069,604円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,928,154円	24,117,420円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	2,040,927円	2,921,364円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	700,329円	841,845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(8資産均等型)	11,598,689円	15,188,102円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	210,461円	2,821,073円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	199,701円	2,898,069円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	188,906円	4,653,204円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	129,203円	5,113,878円
計	94,844,967,281円	107,407,368,500円

「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	42,879,632	720,009,021
金銭信託	3,632,937	2,051,902
コール・ローン	74,158,657	284,290,570
国債証券	18,552,550,153	22,909,405,404
派生商品評価勘定	27,062	136,753
未収利息	126,320,979	125,772,713
前払費用	9,531,810	12,723,821
流動資産合計	18,809,101,230	24,054,390,184
資産合計	18,809,101,230	24,054,390,184
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	392,219
未払金	60,842,044	857,938,891
未払解約金	27,415,629	50,328,406
その他未払費用	87	135
流動負債合計	88,257,760	908,659,651
負債合計	88,257,760	908,659,651
純資産の部		
元本等		
元本	14,029,005,797	16,953,612,730
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,691,837,673	6,192,117,803
純資産合計	18,720,843,470	23,145,730,533
負債純資産合計	18,809,101,230	24,054,390,184

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	(2019年2月21日現在)	(2019年8月21日現在)
1. 受益権総口数	14,029,005,797口	16,953,612,730口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3344円 (13,344円)	1.3652円 (13,652円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2019年2月21日現在）	（2019年8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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）にて記載したとおりであります。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

通貨関連

種類	(2019年2月21日 現在)				(2019年8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	63,756,714	-	63,783,776	27,062	221,400,530	-	221,145,064	255,466
アメリカ・ドル	46,857,170	-	46,882,796	25,626	124,321,930	-	124,209,554	112,376
イギリス・ポンド	2,961,702	-	2,961,805	103	11,668,277	-	11,673,601	5,324
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	3,057,323	-	3,057,238	85
カナダ・ドル	-	-	-	-	4,011,958	-	4,006,091	5,867
シンガポール・ドル	-	-	-	-	1,654,221	-	1,651,553	2,668
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	2,514,362	-	2,500,178	14,184
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	1,803,261	-	1,805,615	2,354
ユーロ	13,937,842	-	13,939,175	1,333	72,369,198	-	72,241,234	127,964
合計	63,756,714	-	63,783,776	27,062	221,400,530	-	221,145,064	255,466

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

(その他の注記)

開示対象ファンドの開示対象期間における当ファンドの元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	(2019年2月21日現在)	(2019年8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	11,229,834,925円	14,029,005,797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	5,563,822,764円	4,245,566,849円
開示対象ファンドの開示対象期間中の一部解約元本額	2,764,651,892円	1,320,959,916円
元本の内訳		
ファンド名		
D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,511,175,019円	1,813,427,167円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	2,682,173,293円	3,156,085,064円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	913,366,571円	1,047,337,388円
ニッセイ/パナゴラ・外国債券インデックスS A(適格機関投資家限定)	- 円	602,374,594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)	- 円	5,063,014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)	- 円	14,833,423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)	- 円	14,970,585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	7,539,991,502円	8,183,741,342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)	594,022,813円	723,408,983円
D Cニッセイ外国債券インデックス	631,268,627円	782,951,989円
D Cニッセイターゲットデートファンド2055	8,572,161円	20,740,792円
D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	86,130,485円	454,101,438円
D Cニッセイターゲットデートファンド2045	5,218,659円	15,176,136円
D Cニッセイターゲットデートファンド2035	8,555,537円	31,255,064円
D Cニッセイターゲットデートファンド2025	3,599,749円	11,443,463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(6資産均等型)	27,811,628円	46,785,334円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	2,202,592円	2,768,935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(8資産均等型)	14,590,750円	19,966,994円
D Cニッセイターゲットデートファンド2060	92,162円	1,271,797円
D Cニッセイターゲットデートファンド2050	88,320円	1,312,508円
D Cニッセイターゲットデートファンド2040	84,480円	2,125,237円
D Cニッセイターゲットデートファンド2030	61,449円	2,471,483円
計	14,029,005,797円	16,953,612,730円

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

2019年8月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

2019年8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	400	60,615
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	109	25,796
単位型公社債投資信託	2	88
合計	511	86,500

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

(3) 【その他】

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。

5【委託会社等の経理状況】

1.財務諸表の作成方法について

委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、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。

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

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24期事業年度（自2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		19,824,114		18,401,863
有価証券		7,102,076		8,008,550
前払費用		421,985		608,442
未収委託者報酬		4,433,940		4,705,229
未収運用受託報酬		1,806,719		1,911,554
未収投資助言報酬		101,471		168,445
その他		323,490		31,744
流動資産合計		34,013,799		33,835,830
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	82,291	1	72,641
車両	1	4,900	1	3,268
器具備品	1	94,283	1	95,277
有形固定資産合計		181,475		171,187
無形固定資産				
ソフトウェア		889,998		968,052
ソフトウェア仮勘定		44,035		24,478
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		942,047		1,000,545
投資その他の資産				
投資有価証券		34,455,496		36,902,679
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		14,723		167,886
差入保証金		299,871		293,513
繰延税金資産		778,580		1,066,925
その他		14,474		87,940
投資その他の資産合計		35,629,369		38,585,168
固定資産合計		36,752,892		39,756,901
資産合計		70,766,691		73,592,732

負債の部

流動負債

預り金	70,706	65,641
未払収益分配金	3,465	6,368
未払手数料	1,700,145	1,736,084
未払運用委託報酬	703,881	702,648
未払投資助言報酬	771,152	723,039
その他未払金	437,257	461,392
未払費用	109,199	113,233
未払法人税等	2,548,634	1,996,248
賞与引当金	864,699	853,083
その他	377,984	289,152
流動負債合計	7,587,128	6,946,893

固定負債

退職給付引当金	1,682,532	1,801,748
役員退職慰労引当金	18,200	22,500

固定負債合計	1,700,732	1,824,248
--------	-----------	-----------

負債合計	9,287,861	8,771,142
------	-----------	-----------

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	41,733,107	45,192,421
---------	------------	------------

利益剰余金合計	42,412,914	45,872,228
---------	------------	------------

株主資本合計	60,694,754	64,154,068
--------	------------	------------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	779,438	711,399
--------------	---------	---------

繰延ヘッジ損益	4,637	43,878
---------	-------	--------

評価・換算差額等合計	784,076	667,521
------------	---------	---------

純資産合計	61,478,830	64,821,590
-------	------------	------------

負債・純資産合計	70,766,691	73,592,732
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	26,937,202	26,471,631
運用受託報酬	11,497,098	11,784,292
投資助言報酬	493,070	610,372
その他営業収益	-	16,907
営業収益計	38,927,371	38,883,204
営業費用		
支払手数料	12,354,679	11,518,158
広告宣伝費	31,453	23,965
公告費	260	130
調査費	5,782,852	5,954,296
支払運用委託報酬	1,754,925	1,695,119
支払投資助言報酬	2,906,672	3,019,717
委託調査費	82,637	106,467
調査費	1,038,617	1,132,991
委託計算費	216,637	229,936
営業雑経費	794,505	812,655
通信費	45,726	49,932
印刷費	179,345	190,576
協会費	32,226	34,445
その他営業雑経費	537,207	537,701
営業費用計	19,180,389	18,539,142
一般管理費		
役員報酬	83,616	137,828
給料・手当	3,439,572	3,685,286
賞与引当金繰入額	864,584	851,086
賞与	248,146	279,376
福利厚生費	662,791	710,135
退職給付費用	330,209	311,969
役員退職慰労引当金繰入額	2,450	8,350
役員退職慰労金	-	150
その他人件費	148,712	151,765
不動産賃借料	630,692	673,220
その他不動産経費	26,725	30,378
交際費	26,650	29,832
旅費交通費	152,875	209,373
固定資産減価償却費	396,898	405,606
租税公課	332,001	325,740
業務委託費	223,322	261,111
器具備品費	282,137	332,440
保険料	54,193	52,393
寄付金	162	-
諸経費	175,371	189,822
一般管理費計	8,081,115	8,645,865
営業利益	11,665,865	11,698,196
営業外収益		
受取利息	165	573
有価証券利息	33,950	24,008

受取配当金	176,877		124,674
金融派生商品収益	-		35,286
為替差益	-		22,977
時効成立償還金	27,718		-
その他営業外収益	13,552		14,395
営業外収益計	252,264		221,915
営業外費用			
為替差損	15,293		-
金融派生商品費用	-		20,127
控除対象外消費税	13,239		17,501
雑損失	27,789		-
その他営業外費用	657		1,080
営業外費用計	56,980		38,709
経常利益	11,861,150		11,881,403
特別利益			
投資有価証券売却益	201,537		655,395
投資有価証券償還益	31,108		46,876
固定資産売却益	1	169	1
特別利益計	232,815		702,272
特別損失			
投資有価証券売却損	107		81,265
投資有価証券償還損	15,469		68,047
固定資産除却損	2	5,271	2
事故損失賠償金	-		3
特別損失計	20,848		150,913
税引前当期純利益	12,073,117		12,432,761
法人税、住民税及び事業税	3,912,569		3,862,523
法人税等調整額	157,154		43,320
法人税等合計	3,755,414		3,905,844
当期純利益	8,317,703		8,526,917

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2017年4月1日 至2018年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					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	38,693,404	39,373,211	57,655,051
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,278,000	5,278,000	5,278,000
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,317,703	8,317,703	8,317,703
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,039,703	3,039,703	3,039,703
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	41,733,107	42,412,914	60,694,754

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	812,844	-	812,844	58,467,896
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,278,000
当期純利益	-	-	-	8,317,703
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	33,405	4,637	28,768	28,768
当期変動額合計	33,405	4,637	28,768	3,010,934
当期末残高	779,438	4,637	784,076	61,478,830

当事業年度(自2018年4月1日 至2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本									株主資本 合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金				利益剰余 金合計		
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	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	41,733,107	42,412,914	60,694,754	
当期変動額											
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	5,067,603	5,067,603	5,067,603	
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	8,526,917	8,526,917	8,526,917	
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,459,314	3,459,314	3,459,314	
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	45,192,421	45,872,228	64,154,068	

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	779,438	4,637	784,076	61,478,830
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	5,067,603
当期純利益	-	-	-	8,526,917
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	68,039	48,515	116,554	116,554
当期変動額合計	68,039	48,515	116,554	3,342,759
当期末残高	711,399	43,878	667,521	64,821,590

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019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．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．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、2016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>
4．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。</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>
5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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。

6. ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
8. 連結納税制度の適用を前提とした会計処理	<p>日本生命保険相互会社及び当社を含む一部の子会社は、2018年12月に連結納税制度の承認申請を行い、翌事業年度より連結納税制度が適用されることとなったため、当事業年度より「連結納税制度を適用する場合の税効果会計に関する当面の取扱い(その1)」(2015年1月16日 企業会計基準委員会 実務対応報告第5号)及び「連結納税制度を適用する場合の税効果会計に関する当面の取扱い(その2)」(2015年1月16日 企業会計基準委員会 実務対応報告第7号)に基づき、連結納税制度の適用を前提とした会計処理を行っております。</p>

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」に表示していた「繰延税金資産」437,736千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」778,580千円に含めて表示しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

(1) 概要

本会計基準により、顧客と約束する財又はサービスを提供する履行義務の実質的な実施主体についての評価を行ったうえで、約束した財又はサービスが顧客に移転された時点で、当該財又はサービスと交換に権利を得ると見込む対価を反映した金額で、収益を認識することが求められます。

(2) 適用予定日

2021年4月1日以後開始する会計年度の期首から適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時点において、評価中であります。

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物附属設備	313,759千円	325,809千円
車両	1,828	3,460
器具備品	469,355	474,339
計	784,943	803,609

(損益計算書関係)

1. 固定資産売却益の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
車両	169千円	-

2. 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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
器具備品	5,271千円	623千円
ソフトウェア	-	465
計	5,271	1,089

3. 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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2017年4月1日 至2018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

2017年6月23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	5,278,000千円
1株当たり配当額	48,686円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23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

2018年6月22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	5,000,103千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	46,106円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月22日

当事業年度(自2018年4月1日 至2019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

2018年6月22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	5,000,103千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	46,106円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月22日

2019年3月19日開催の臨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
配当財産の種類	投資有価証券
配当財産の帳簿価額	67,500千円
譲渡株数	1,350株
1株当たり配当額	-
基準日	2019年3月19日
効力発生日	2019年3月22日

(注) 配当財産のすべてを普通株式(108千株)の唯一の株主である日本生命保険相互会社に対して割り当てることとしており、1株当たり配当額は定めておりません。

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
2019年6月28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	未定 千円
配当の原資	未定
1株当たり配当額	未定 円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

(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。

上記の自社設定投資信託の一部につきましてはデリバティブを用いてヘッジを行っております。デリバティブを用いたヘッジ取引につきましては、外貨建て資産の為替変動リスクを回避する目的で為替予約、外国株式の価格変動リスクを回避する目的で株価指数先物を使ってヘッジ会計を適用しております。ヘッジ会計の適用にあたっては、資金運用規則のほか資金運用リスク管理規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類及び選択したヘッジ手段を明確にし、また事前の有効性の確認、事後の有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運用しております。ヘッジの有効性判定については資金運用リスク管理規程に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2018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	19,824,114	19,824,114	-
有価証券			
満期保有目的の債券	7,102,076	7,115,800	13,723
投資有価証券			
満期保有目的の債券	14,652,704	14,687,680	34,975
その他有価証券	19,735,292	19,735,292	-
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	103,394	103,394	-

()デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については で示しております。

当事業年度(2019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	18,401,863	18,401,863	-
有価証券			
満期保有目的の債券	2,199,830	2,205,940	6,109
その他有価証券	5,808,720	5,808,720	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,649,504	17,681,300	31,795
その他有価証券	19,253,174	19,253,174	-
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	47,244	47,244	-

() デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

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。

デリバティブ

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
非上場株式	67,500	-
関係会社株式	66,222	66,222

非上場株式については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(2018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	19,824,114	-	-	-
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	7,100,000	14,650,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	2,896,071	14,413,880	2,089,902	299,797
合計	29,820,185	29,063,880	2,089,902	299,797

(注) 投資信託受益証券、国債であります。

当事業年度(2019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	18,401,863	-	-	-
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	2,200,000	17,650,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	7,033,352	15,714,537	2,156,988	138,951
合計	27,635,215	33,364,537	2,156,988	138,951

(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(2018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	15,606,746	15,660,060	53,313
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	15,606,746	15,660,060	53,313
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	6,148,033	6,143,420	4,613
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	6,148,033	6,143,420	4,613
合計		21,754,780	21,803,480	48,699

当事業年度(2019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	18,749,335	18,787,460	38,124
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	18,749,335	18,787,460	38,124
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	1,100,000	1,099,780	220
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,100,000	1,099,780	220
合計		19,849,335	19,887,240	37,904

2. その他有価証券

前事業年度(2018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	5,824,610	5,803,679	20,930
	国債・地方債等	5,824,610	5,803,679	20,930
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	7,066,429	5,762,409	1,304,019
	小計	12,891,039	11,566,089	1,324,949
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)	6,844,252	7,045,700	201,447
	小計	6,844,252	7,045,700	201,447
	合計	19,735,292	18,611,789	1,123,502

当事業年度(2019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	5,808,720	5,801,046	7,673
	国債・地方債等	5,808,720	5,801,046	7,673
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注1)	13,421,370	12,553,359	868,010
	小計	19,230,090	18,354,406	875,684
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)	5,831,804	5,981,670	149,865
	小計	5,831,804	5,981,670	149,865
	合計	25,061,894	24,336,076	725,818

(注1) 投資信託受益証券等であります。

(注2) 非上場株式(前事業年度の貸借対照表計上額は67,500千円、当事業年度の貸借対照表計上額は-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(前事業年度の貸借対照表計上額は66,222千円、当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2017年4月1日 至2018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	344,430	201,537	107
合計	344,430	201,537	107

当事業年度(自2018年4月1日 至2019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	2,232,532	655,395	81,265
合計	2,232,532	655,395	81,265

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 株価指数先物関連

前事業年度(2018年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	新興国株価指数先物売建	投資有価証券	1,022,464	-	31,858
合計			1,022,464	-	31,858

(注1) 時価の算定方法 取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度(2019年3月31日)

該当事項はありません。

(2) 通貨関連

前事業年度(2018年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	為替予約取引米ドル売建	投資有価証券	1,988,812	-	71,536
合計			1,988,812	-	71,536

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度(2019年3月31日)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(千円)	契約額等のうち1年超(千円)	時価(千円)
原則的処理方法	為替予約取引米ドル売建	投資有価証券	1,909,028	-	47,244
合計			1,909,028	-	47,244

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(注2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については で示しております。

(退職給付関係)

前事業年度(自2017年4月1日 至2018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	1,519,642 千円
退職給付費用	248,707
退職給付の支払額	85,817
退職給付引当金の期末残高	1,682,532

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 248,707 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、54,955千円であります。

当事業年度(自2018年4月1日 至2019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	1,682,532 千円
退職給付費用	229,805
退職給付の支払額	110,589
退職給付引当金の期末残高	1,801,748

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 229,805 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、58,788千円であります。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	264,770 千円	261,214 千円
未払事業税	138,553	119,420
退職給付引当金	515,191	551,695
税務上の繰延資産償却超過額	3,662	6,126
役員退職慰労引当金	5,572	6,889
投資有価証券評価差額	61,683	88,160
その他	48,864	62,896
小計	1,038,300	1,096,402
評価性引当額	47	9
繰延税金資産合計	1,038,253	1,096,393
繰延税金負債		
繰延ヘッジ損益	2,021	-
特別分配金否認	9,827	5,022
投資有価証券評価差額	247,824	24,444
繰延税金負債合計	259,672	29,467
繰延税金資産(は負債)の純額	778,580	1,066,925

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（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2017年4月1日 至2018年3月31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、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。

当事業年度（自2018年4月1日 至2019年3月31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、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]

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2017年4月1日 至2018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	150,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,608,592	未収運用受託報酬	833,260
								投資助言報酬の受取	132,212	未収投資助言報酬	11,876

当事業年度(自2018年4月1日 至2019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	100,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,299,726	未収運用受託報酬	762,239
								投資助言報酬の受取	130,542	未収投資助言報酬	11,530

(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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	566,896円85銭	597,720円47銭
1株当たり当期純利益金額	76,697円61銭	78,626円78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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	8,317,703千円	8,526,917千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	8,317,703千円	8,526,917千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

2019年5月31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 樋口 誠之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 牧野 あや子

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第24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2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2019年9月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)の2019年2月22日から2019年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)の2019年8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中間計算期間(2019年2月22日から2019年8月21日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年9月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)の2019年2月22日から2019年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)の2019年8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中間計算期間(2019年2月22日から2019年8月21日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)が別途保管しております。
2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年9月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)の2019年2月22日から2019年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)の2019年8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中間計算期間(2019年2月22日から2019年8月21日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。