

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年2月19日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 宇治原 潔
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	<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
【届出の対象とした募集内国投 資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

<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
（以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。基準価額は日々変動します。なお、便宜上１万口当りに換算した価額で表示されます。

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、委託会社へは後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

なお、販売会社につきましては、後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（７）【申込期間】

継続申込期間：平成28年2月20日（土）～平成29年2月20日（月）

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、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）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

（９）【払込期日】

取得申込者は、各販売会社が定める期日（詳しくは販売会社にお問合せください）までに、申込代金を各販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に各々の販売会社より、委託会社の指定する口座を經由して、追加信託金として受託会社の指定するファンド口座(受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座)に払込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。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)

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【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

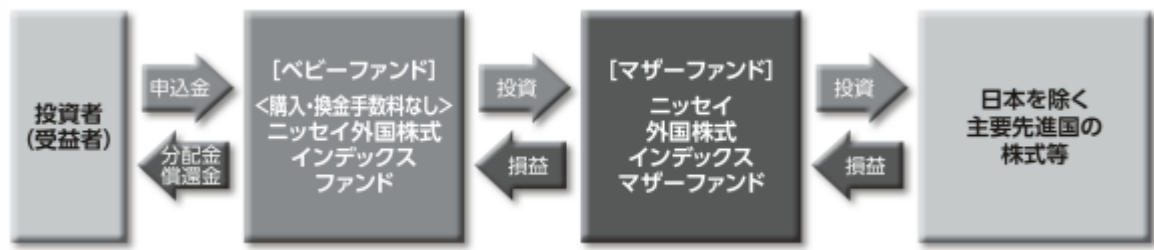
ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

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。

<イメージ図>



ファンドの特色

日本を除く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めざします。

- ・当社独自の計量モデル等を活用し、ポートフォリオを構築します。
- ・原則として、対円での為替ヘッジは行いません。
為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

購入時および換金時の手数料は無料です。

- ・購入時の購入時手数料および換金時の換金時手数料、信託財産留保額はありませぬ。
保有期間中に運用管理費用(信託報酬)等をファンドからご負担いただきます。

<MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）について>

同指数は、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。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。

<MSCI指数にかかる免責条項等>

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc. が独占的に所有しています。MSCI Inc. およびMSCI指数は、MSCI Inc. およびその関係会社のサービスマークであり、ニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます）は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc. とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc. により決定、作成および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮に入れる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc. は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの獨創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約に基づき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害（逸失利益を含む）につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc. の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc. に問合せることなく、当ファンドを保証、推奨、売買または宣伝するためにいかなるMSCI Inc. のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc. の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc. との関係は一切主張することはできません。

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

3,000億円とします。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／海外／株式／インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

ファンドの商品分類表・属性区分表は以下の通りです（該当区分を網掛け表示しています）。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型 追 加 型	国 内 海 外 内 外	株 式 債 券 不動産投信 その他資産 () 資産複合	インデックス型 特 殊 型

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	対象 インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グローバル (日本除 く)			日経225
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)	日 本 北 米 欧 州 アジア	ファミリー ファンド	あ り ()	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア 中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し	その他 (MSCI コクサイ・ インデックス)
その他資産 (投資信託証券 (株式(一 般)))	日 々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)			
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。

海外 目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

株式	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

属性区分表

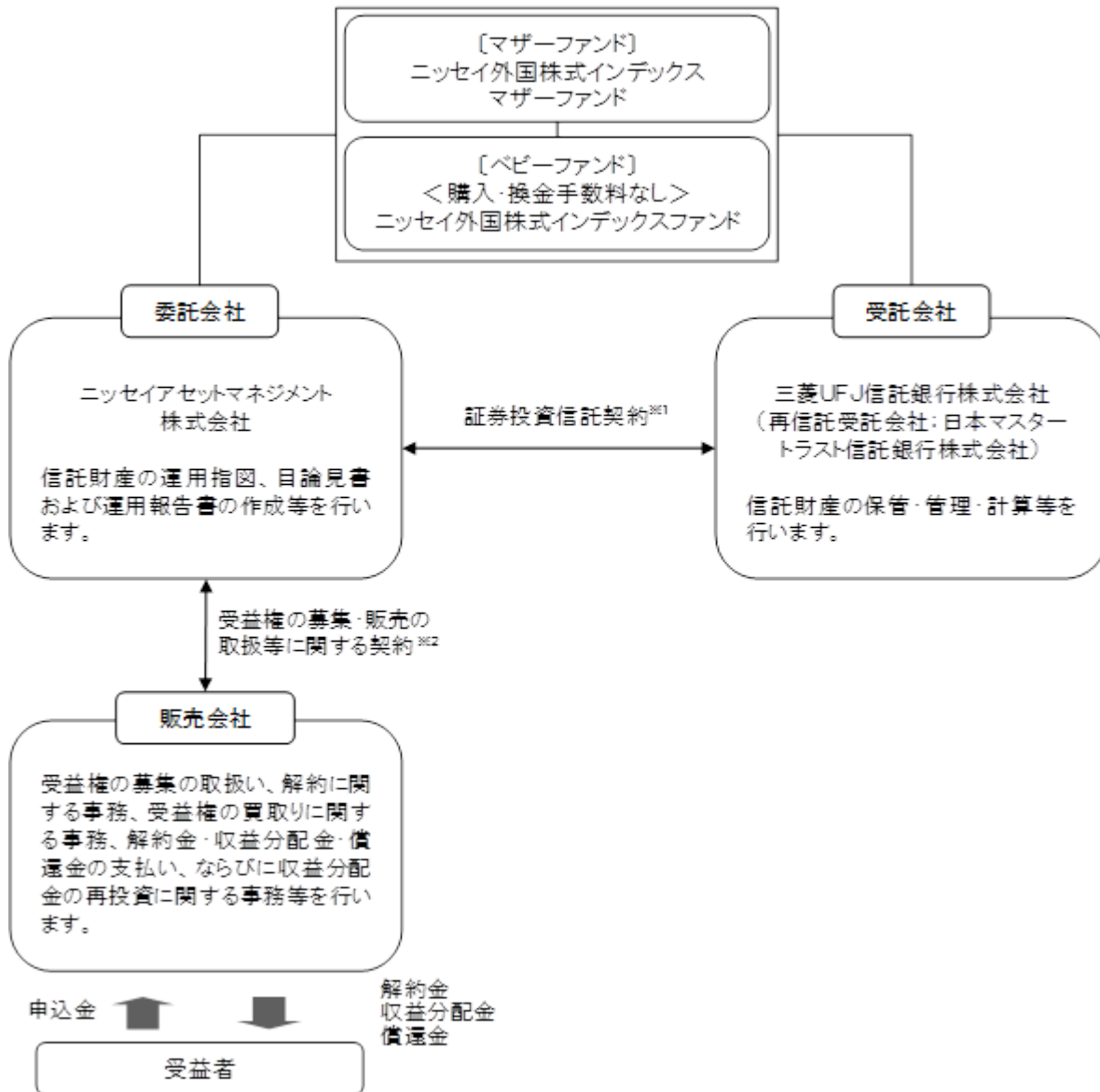
その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本除く)	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く)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。
その他の指数 (MSCIコクサイ・ インデックス)	目論見書または約款において、MSCIコクサイ・インデックスの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成25年12月10日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(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、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

委託会社の概況（平成27年12月末現在）

1. 委託会社の名称 : ニッセイアセットマネジメント株式会社
2. 本店の所在の場所 : 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
3. 資本金の額 : 100億円
4. 代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 宇治原 潔
5. 金融商品取引業者登録番号 : 関東財務局長（金商）第369号
6. 設立年月日 : 平成7年4月4日
7. 沿革

昭和60年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。

平成7年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。

- 平成10年7月1日 ニッセイ投信株式会社(存続会社)とニッセイ投資顧問株式会社(消滅会社)が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
- 平成12年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

8. 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主として、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを通じて、実質的に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めざします。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質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。

（参考）マザーファンドの概要

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドを主要投資対象とします。なお直接、株式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ます）

八．約束手形

二．金銭債権

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「ニッセイ外国株式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書
- 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または新優先出資引受権を表示する証券（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．までの証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます）
- 14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます）
- 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます）
- 16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。有価証券にかかるものに限りません）
- 17．預託証書（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せん）
- 20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
- 21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 22．外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの

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

金融商品

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

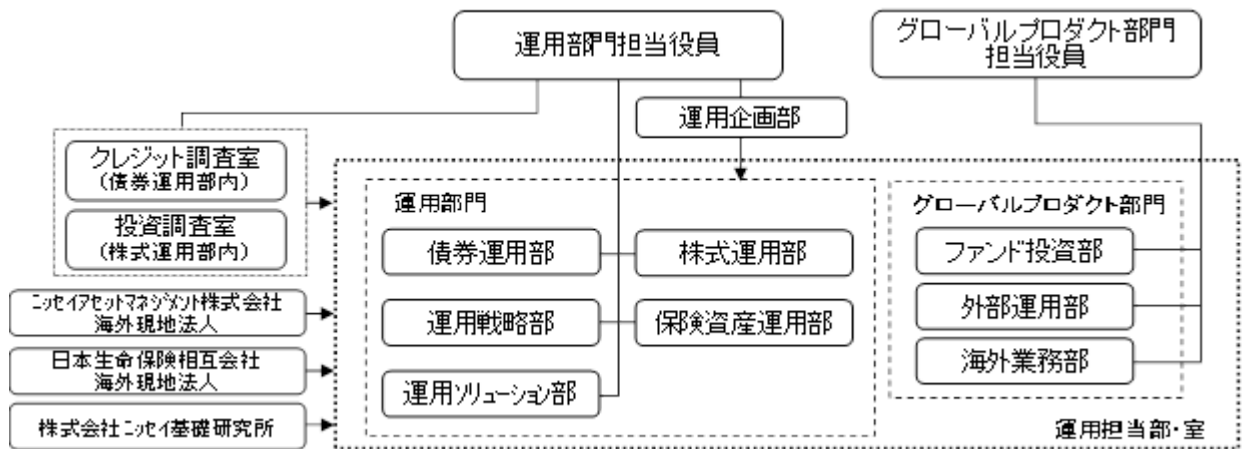
- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で5．の権利の性質を有するもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記に掲げる金融商品により運用することができます。

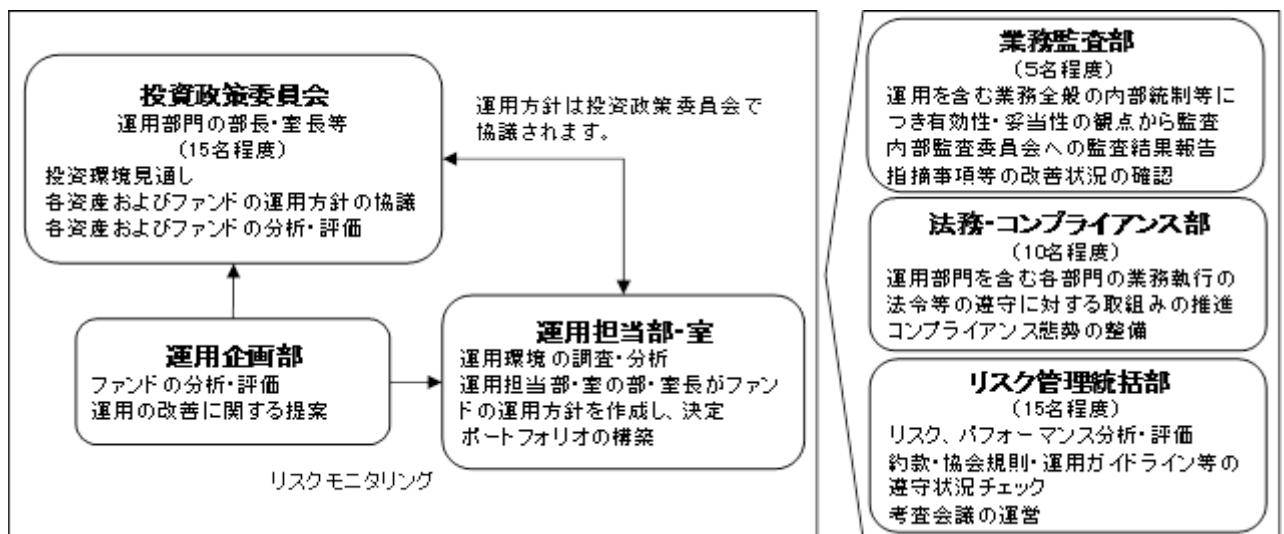
(3) 【運用体制】

委託会社の組織体制



社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネジャー/アナリスト服務規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

委託会社は、受託会社（再信託先も含む）に対して日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性について、監査人による報告書を定期的に受託会社より受取っています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益(ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます)および売買益(評価益を含みます。ただし、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます)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。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

3. 留保益の運用方針

留保益(収益分配にあてず信託財産に留保した収益)については、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11月20日(年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日)です。

支払方法

<分配金受取コースの場合>

税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。

<分配金再投資コースの場合>

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

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には、制限を設けません。

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。

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。

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10%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。

投資信託証券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。

外貨建資産への実質投資割合には、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。

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、金融商品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、金融商品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．国内の金融商品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）、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）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）ならびに外国の金融商品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．国内の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品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．国内の金融商品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金融商品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を効率的に運用するため、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．信託財産に属する資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するため、ならびに信託財産を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。また、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することを目標に運用しますので、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きにより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。

・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。

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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）に連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担することなどから基準価額と当該指数との動きが完全に一致しないことがあります。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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。

・ファミリーファンド方式に関する留意点

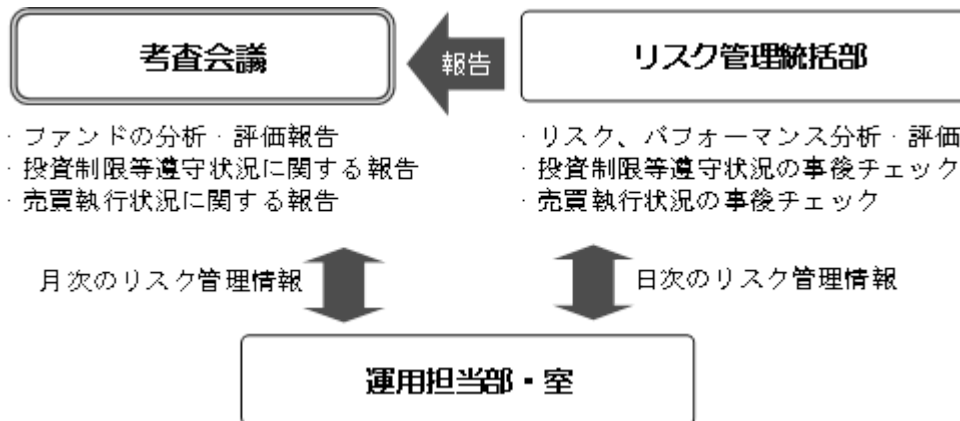
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は平成27年10月末現在、ファンドの主要投資対象である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32.2%保有しています。

当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

(2) 投資リスク管理体制



1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。

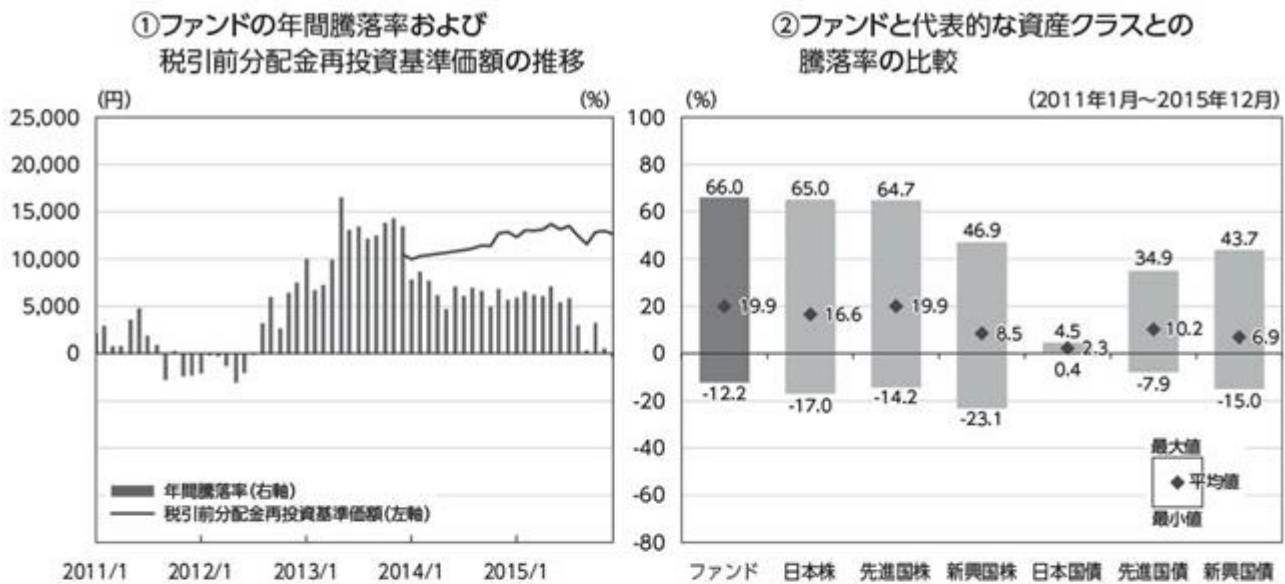
- ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。
- ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の考査会議で報告します。

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

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

（参考情報）

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



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドの設定日以降のデータが5年分に満たないため、ファンドの騰落率において、設定日前のデータに関してはファンドのベンチマーク(MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース))を用いて算出しています。したがって、グラフにおけるファンドの騰落率は、すべてがファンドの実績ではありませんのでご注意ください。

- ・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年0.2592%（税抜0.24%）以内の率（以下「信託報酬率」といいます）をかけた額とします。なお、平成28年2月19日現在の信託報酬率は年0.2592%（税抜0.24%）であり、その配分は次の通りとします。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.105%	0.105%	0.030%

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 0.00432% （税抜0.004%）
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.00540% （税抜0.005%）
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.00756% （税抜0.007%）
10億円以下 の部分	年 0.01080% （税抜0.010%）

信託事務の諸費用

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支払います。

借入金の利息

信託財産において一部解約金の支払資金の手当て、または再投資に関する収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入を行った場合、当該借入金の利息は、借入れのつど信託財産中から支払います。

信託財産留保額

ありません。

上記の、およびの費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「4 手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

<ご参考>

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

- 分配時 : 分配時の「普通分配金」に対して課税されます。
「元本払戻金（特別分配金）」は非課税です。
- 解約請求・償還時 : 個人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額と取得価額の差益に対して課税されます。
法人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して課税されます。
- 買取請求時 : 買取請求時の買取価額と取得価額の差益に対して課税されます。

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

- 分配時 : 分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収され申告不要制度が適用されます。
なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。
- 解約請求・償還・買取請求時 : 解約請求、償還および買取請求時の差益は、上場株式等の譲渡所得として、以下の税率による申告分離課税の対象となり確定申告を行う必要があります。ただし、源泉徴収選択口座（特定口座）を選択した場合、申告不要制度が適用されます。

税率（個人）

平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%・地方税5%）
平成50年 1 月 1 日以降	20%（所得税15%・地方税5%）

税率は原則として20%（所得税15%・地方税5%）ですが、平成49年12月31日までは、復興特別所得税（所得税額に2.1%をかけた額）が付加されるため上記の税率となります。

確定申告等により、解約請求、償還および買取請求時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます）の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります）等との損益通算が可能です。また、解約請求、償還および買取請求時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります）等については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

<少額投資非課税制度について>

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」（平成28年4月1日より投資が可能となる「ジュニアNISA」が新たに創設される予定です）をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

分配時の普通分配金、解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して以下の税率により源泉徴収されます。

益金不算入制度の適用はありません。

税率（法人）

平成49年12月31日まで	15.315%（所得税15%・復興特別所得税0.315%）
平成50年 1 月 1 日以降	15%（所得税15%）

税率は原則として15%（所得税のみ）ですが、平成49年12月31日までは、復興特別所得税（所得税額に2.1%をかけた額）が付加されるため上記の税率となります。

個別元本

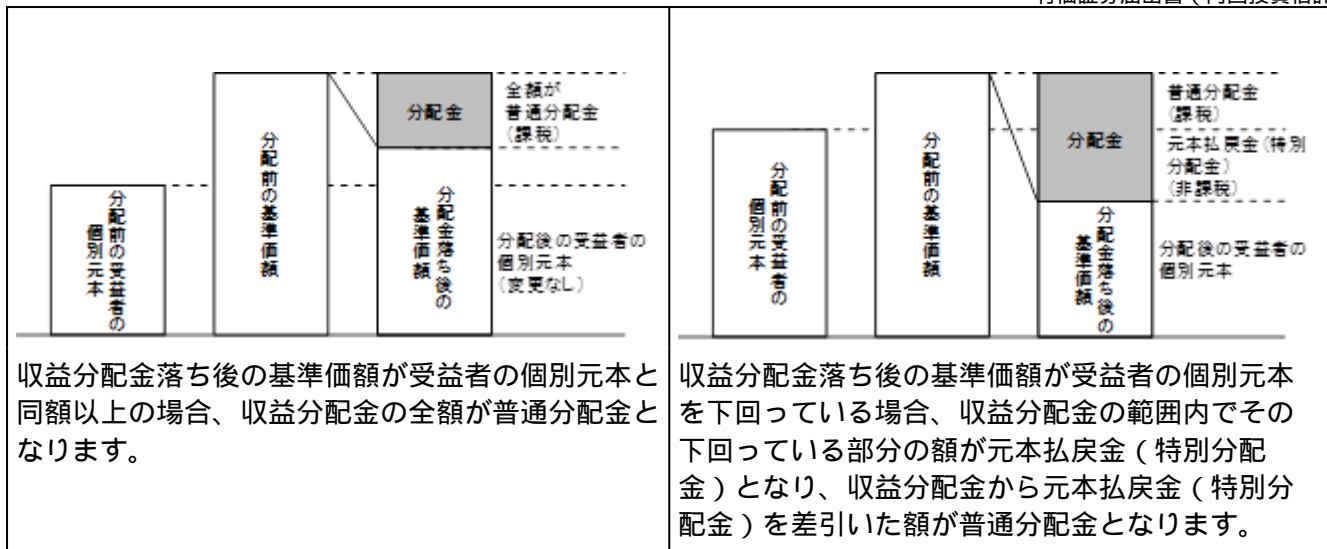
- 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を差引いた額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店毎に、分配金受取コースと分配金再投資コースの両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

収益分配金は分配前の受益者の個別元本と基準価額の関係により、課税扱いの普通分配金と、個別元本の一部払戻しに相当する非課税扱いの元本払戻金（特別分配金）に区分されます。

普通分配金	元本払戻金（特別分配金）
-------	--------------



投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税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】

「＜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」

(平成27年12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	20,829,532,541	100.00
内 日本	20,829,532,541	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	141,051	0.00
純資産総額	20,829,391,490	100.00

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

(参考情報)

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

(平成27年12月30日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	48,378,175,496	92.49
内 アメリカ	29,580,128,707	56.55
内 イギリス	3,854,290,042	7.37
内 スイス	2,108,820,815	4.03
内 フランス	1,874,103,841	3.58
内 ドイツ	1,860,316,532	3.56
内 カナダ	1,655,416,309	3.16
内 オーストラリア	1,250,920,736	2.39
内 オランダ	1,002,703,009	1.92
内 アイルランド	852,782,061	1.63
内 スペイン	663,718,043	1.27
内 スウェーデン	608,887,608	1.16
内 香港	529,886,610	1.01
内 イタリア	450,005,323	0.86
内 デンマーク	391,998,056	0.75
内 シンガポール	300,806,483	0.58
内 ベルギー	297,839,397	0.57
内 フィンランド	186,206,426	0.36
内 ジャージー	159,239,293	0.30
内 オランダ領キュラソー	148,951,257	0.28
内 バミューダ	139,337,350	0.27
内 イスラエル	136,054,049	0.26
内 ノルウェー	115,042,650	0.22
内 ケイマン諸島	58,579,332	0.11

	内 オーストリア	35,905,509	0.07
	内 ニュージーランド	32,743,589	0.06
	内 ポルトガル	29,787,745	0.06
	内 ルクセンブルグ	21,742,013	0.04
	内 イギリス領バージン諸島	12,820,592	0.02
	内 パプアニューギニア	11,013,163	0.02
	内 マン島	5,388,279	0.01
	内 モーリシャス	2,740,677	0.01
投資証券		1,249,033,517	2.39
	内 アメリカ	926,797,443	1.77
	内 オーストラリア	126,489,606	0.24
	内 フランス	74,334,896	0.14
	内 イギリス	69,611,582	0.13
	内 香港	22,911,169	0.04
	内 シンガポール	18,519,082	0.04
	内 カナダ	10,369,739	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,680,889,502	5.13
純資産総額		52,308,098,515	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）	2,589,491,013	4.95
内 アメリカ	1,737,460,923	3.32
内 ドイツ	852,030,090	1.63

（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。

（２）【投資資産】

「＜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」

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成27年12月30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	14,686,267,039	1.4479 21,265,368,232	1.4183 20,829,532,541	- -	100.00%

（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	100.00
	小計		100.00
合計（対純資産総額比）			100.00

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考情報）

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」

投資有価証券の主要銘柄

（平成27年12月30日現在）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 又は 額面金額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	評価単価（円） 評価金額（円）	利率 （%） 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハードウェアおよび機器	78,966	14,297.15 1,128,989,355	13,115.13 1,035,649,466	- -	1.98%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	105,235	6,510.49 685,131,925	6,820.49 717,754,843	- -	1.37%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	57,706	9,684.87 558,875,632	9,547.48 550,947,319	- -	1.05%
4	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	130,717	3,651.04 477,253,649	3,772.68 493,153,516	- -	0.94%
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	38,339	12,364.14 474,029,096	12,547.05 481,041,668	- -	0.92%
6	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	5,504	79,757.27 438,984,038	83,699.72 460,683,268	- -	0.88%
7	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	67,495	6,745.17 455,265,354	6,668.52 450,092,223	- -	0.86%

8	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	51,179	8,153.20 417,273,019	8,089.31 414,002,934	- -	0.79%
9	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	44,143	9,237.64 407,777,165	9,132.22 403,123,940	- -	0.77%
10	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	4,283	89,088.74 381,567,089	93,665.72 401,170,304	- -	0.77%
11	FACEBOOK INC-A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	29,734	12,804.25 380,721,835	12,936.62 384,657,714	- -	0.74%
12	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	4,015	91,666.20 368,039,831	95,759.51 384,474,455	- -	0.74%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	37,526	9,201.45 345,293,756	9,692.21 363,710,232	- -	0.70%
14	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	85,324	4,055.69 346,048,182	4,212.90 359,462,102	- -	0.69%
15	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	85,378	3,895.65 332,603,490	3,959.62 338,064,974	- -	0.65%
16	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	31,501	10,912.63 343,758,827	10,633.00 334,950,133	- -	0.64%
17	ROCHE HOLDING AG スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,730	33,084.05 321,907,819	33,843.31 329,295,503	- -	0.63%
18	VERIZON COMMUNICATIONS INC アメリカ	株式 電気通信サービス	56,430	5,517.77 311,368,312	5,693.99 321,312,312	- -	0.61%
19	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	57,179	5,198.31 297,234,675	5,271.86 301,439,860	- -	0.58%
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	144,517	2,132.21 308,141,522	2,084.14 301,193,775	- -	0.58%
21	WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	22,226	14,286.53 317,532,483	12,914.91 287,046,985	- -	0.55%
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	17,784	15,323.53 272,513,717	16,125.55 286,776,905	- -	0.55%
23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	26,007	10,962.83 285,110,525	11,005.66 286,224,264	- -	0.55%

24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	65,823	4,141.20 272,586,738	4,274.41 281,355,042	- -	0.54%
25	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	41,678	6,630.65 276,352,456	6,389.91 266,318,994	- -	0.51%
26	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B アメリカ	株式 各種金融	16,389	16,462.29 269,800,478	16,178.62 265,151,491	- -	0.51%
27	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	270,560	938.50 253,921,813	973.63 263,426,923	- -	0.50%
28	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	27,045	9,659.21 261,233,423	9,553.51 258,374,897	- -	0.49%
29	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	20,315	12,829.47 260,630,717	12,466.24 253,251,860	- -	0.48%
30	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	38,992	6,539.43 254,985,736	6,433.33 250,848,691	- -	0.48%

（注）投資比率は、純資産総額に対する各銘柄の評価金額の比率であります。

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.88
		銀行	8.79
		ソフトウェア・サービス	8.31
		資本財	6.74
		エネルギー	6.27
		食品・飲料・タバコ	6.04
		保険	4.20
		素材	4.02
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.92
		各種金融	3.89
		小売	3.85
		ヘルスケア機器・サービス	3.47
		公益事業	3.05
		電気通信サービス	3.03
メディア	2.82		
家庭用品・パーソナル用品	2.12		

		食品・生活必需品小売り	2.04
		半導体・半導体製造装置	1.77
		消費者サービス	1.75
		運輸	1.71
		耐久消費財・アパレル	1.69
		自動車・自動車部品	1.65
		商業・専門サービス	0.87
		不動産	0.65
	小計		92.49
投資証券	外国	投資証券	2.39
	小計		2.39
合 計（対純資産総額比）			94.87

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	取引所名称	資産名	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T U R E 2 0 1 6 0 3	買建	139	1,711,538,517	1,737,460,923	3.32%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 2 0 1 6 0 3	買建	196	842,436,180	852,030,090	1.63%

（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。

（3）【運用実績】

「＜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」

【純資産の推移】

平成27年12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1計算期間末 （平成26年11月20日）	5,755,823,102	5,755,823,102	1.2526	1.2526

第2計算期間末 (平成27年11月20日)	19,029,945,526	19,029,945,526	1.2964	1.2964
平成26年12月末日	6,829,472,575	-	1.2854	-
平成27年1月末日	7,334,697,367	-	1.2312	-
2月末日	8,331,022,519	-	1.3009	-
3月末日	9,248,166,846	-	1.2983	-
4月末日	9,989,744,848	-	1.3097	-
5月末日	11,129,206,722	-	1.3674	-
6月末日	11,978,407,444	-	1.3128	-
7月末日	14,075,683,999	-	1.3493	-
8月末日	14,999,742,771	-	1.2419	-
9月末日	15,119,212,217	-	1.1564	-
10月末日	18,033,839,721	-	1.2822	-
11月末日	19,317,063,393	-	1.2959	-
12月末日	20,829,391,490	-	1.2648	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	25.3
第2計算期間	3.5

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

(4) 【設定及び解約の実績】

「＜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」

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1計算期間	6,310,970,246	1,715,745,266	4,595,224,980
第2計算期間	14,317,781,361	4,234,346,844	14,678,659,497

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

〈参考情報〉

2015年12月末現在

● 基準価額・純資産の推移

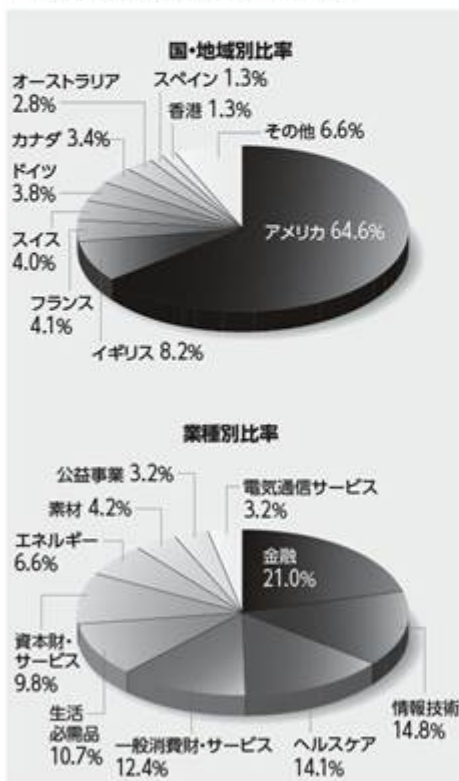


- ・ 基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後のものです。
- ・ 税引前分配金再投資基準価額は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

● 基準価額および純資産総額

基準価額	12,648円	
純資産総額	208億円	
● 分配の推移 1万口当り(税引前)		
第1期	2014年11月	0円
第2期	2015年11月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計		0円

● 主要な資産の状況(マザーファンド)



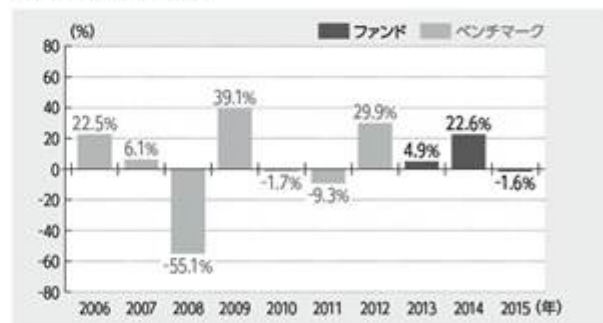
- ・ 上記グラフはすべて対組入株式等評価額比です。
- ・ 国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
- ・ 業種はGICS分類（セクター）によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。

● 組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	2.1%
2	マイクロソフト	情報技術	1.4%
3	エクソンモービル	エネルギー	1.1%
4	GE(ゼネラル・エレクトリック)	資本財・サービス	1.0%
5	ジョンソン・エンド・ジョンソン	ヘルスケア	1.0%
6	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	0.9%
7	ウェルズ・ファーゴ・アンド・カンパニー	金融	0.9%
8	JPMorgan Chase & Co.	金融	0.8%
9	ネスレ	生活必需品	0.8%
10	アルファベット(C)	情報技術	0.8%

- ・ 業種はGICS分類（セクター）によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。
- ・ 比率は対組入株式等評価額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ 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。
- ・ 2013年はファンド設定時から年末まで、2015年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
- ・ 2012年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

■ 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。

■ 最新の運用実績については、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を行います（ただし、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、申込みの受付を行いません）。

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。

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

取扱コース

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

分配金再投資コースを選択した場合、販売会社と「自動けいぞく（累積）投資契約」（同様の権利義務を規定する名称の異なる契約または規定も含みます）を締結します。なお、販売会社によっては、定期引出契約を締結できる場合があります。

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

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、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. 定期引出契約とは、分配金再投資コースにおいて、分配金を再投資せず、定期的に分配金を受取るための契約です。
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）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

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を行います（ただし、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、換金の受付を行いません）。

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。

金融商品取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付を中止することおよび既に受付けた換金の受付を取消することがあります。

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

買取価額：買取請求受付日の翌営業日の基準価額とします（税法上の一定の要件を満たしている場合）。それ以外の場合は、買取請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該買取りに関して当該買取りをを行う販売会社にかかる源泉徴収税額に相当する金額を差引いた額とします。

換金方法および受益者によって課税上の取扱いが異なります。詳細は「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご確認ください。

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

解約請求受付日または買取請求受付日から起算して、原則として6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. 換金請求の受け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）

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

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。
外国株式	金融商品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。

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます)

ホームページ <http://www.nam.co.jp/>

(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11月21日から翌年11月20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。
 - ・受益権の口数が30億口を下回っている場合
 - ・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、書面による決議(以下「書面決議」といいます)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 前記2.から4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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2.から4.までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
6. 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。
7. 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「約款の変更等 2.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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「 約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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。

9. 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。

約款の変更等

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またはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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。なお、約款は当該「 約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2.から5.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1.から6.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 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7.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求の不適用

ファンドは、受益者からの換金請求に対して、この信託契約の一部を解約することにより公正な価格をもって支払いに応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、前記「 繰上償還」に規定する信託契約の解約または前記「 約款の変更等」に規定する重大な約款の変更等を行う場合の書面決議において反対した受益者からの買取請求を受付けません。

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れてい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、税金を差引いた後、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、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。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) 書面決議における議決権

委託会社が、書面決議において信託契約の解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます)または重大な約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、受益権の口数に応じて議決権を有し、これを行行使することができます。

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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) 当ファンドの第1期計算期間については、設定日である平成25年12月10日を期首としております。

3) 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2期計算期間（平成26年11月21日から平成27年11月20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】

【＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国株式インデックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (平成26年11月20日現在)	第2期 (平成27年11月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,199,962	30,483,366
親投資信託受益証券	5,755,890,126	19,030,162,875
未収入金	47,934,871	61,001,371
流動資産合計	5,811,024,959	19,121,647,612
資産合計	5,811,024,959	19,121,647,612
負債の部		
流動負債		
未払解約金	47,605,043	60,351,008
未払受託者報酬	936,641	3,941,923
未払委託者報酬	6,369,416	26,805,341
その他未払費用	290,757	603,814
流動負債合計	55,201,857	91,702,086
負債合計	55,201,857	91,702,086
純資産の部		
元本等		
元本	4,595,224,980	14,678,659,497
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,160,598,122	4,351,286,029
純資産合計	5,755,823,102	19,029,945,526
負債純資産合計	5,811,024,959	19,121,647,612

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（単位：円）

	第1期 （自平成25年12月10日 至平成26年11月20日）	第2期 （自平成26年11月21日 至平成27年11月20日）
営業収益		
受取利息	721	5,625
有価証券売買等損益	898,869,722	421,115,798
営業収益合計	898,870,443	421,121,423
営業費用		
受託者報酬	1,367,615	6,090,123
委託者報酬	9,300,278	41,413,349
その他費用	519,967	1,048,702
営業費用合計	11,187,860	48,552,174
営業利益又は営業損失（ ）	887,682,583	372,569,249
経常利益又は経常損失（ ）	887,682,583	372,569,249
当期純利益又は当期純損失（ ）	887,682,583	372,569,249
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（ ）	85,099,161	19,434,362
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	1,160,598,122
剰余金増加額又は欠損金減少額	428,256,476	3,978,877,477
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	428,256,476	3,978,877,477
剰余金減少額又は欠損金増加額	70,241,776	1,141,324,457
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	70,241,776	1,141,324,457
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（ ）	1,160,598,122	4,351,286,029

（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。
--------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 （平成26年11月20日現在）	第2期 （平成27年11月20日現在）
1. 受益権総口数	4,595,224,980口	14,678,659,497口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2526円 (12,526円)	1.2964円 (12,964円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 （自平成25年12月10日 至平成26年11月20日）	第2期 （自平成26年11月21日 至平成27年11月20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（59,362,536円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（743,220,886円）、収益調整金（358,014,700円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,160,598,122円（1口当たり0.252566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（225,496,864円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（127,638,023円）、収益調整金（3,513,381,985円）及び分配準備積立金（484,769,157円）より分配対象収益は4,351,286,029円（1口当たり0.296436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1期 （自平成25年12月10日 至平成26年11月20日）	第2期 （自平成26年11月21日 至平成27年11月20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1期 (平成26年11月20日現在)	第2期 (平成27年11月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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1期 (平成26年11月20日現在)	第2期 (平成27年11月20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	811,352,034	393,322,138
合計	811,352,034	393,322,138

(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1期 (平成26年11月20日現在)	第2期 (平成27年11月20日現在)
期首元本額	27,540,533円	4,595,224,980円
期中追加設定元本額	6,283,429,713円	14,317,781,361円
期中一部解約元本額	1,715,745,266円	4,234,346,844円

(4) 【附属明細表】 (平成27年11月20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	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	13,093,548,146	19,030,162,875	
親投資信託受益証券	合計	13,093,548,146	19,030,162,875	
合計		13,093,548,146	19,030,162,875	

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（＜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）は、「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、すべて同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。）における同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。

「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

	（平成26年11月20日現在）	（平成27年11月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	209,970,675	571,026,544
コール・ローン	1,671,000,057	517,375,725
株式	40,398,440,068	47,696,457,467
投資証券	900,017,857	1,205,171,823
派生商品評価勘定	94,747,579	42,032,891
未収入金	480,945	1,242,993
未収配当金	67,568,440	89,473,109
差入委託証拠金	780,832,127	1,011,545,971
流動資産合計	44,123,057,748	51,134,326,523
資産合計	44,123,057,748	51,134,326,523
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,304,486	2,180,811
未払解約金	178,818,151	251,957,534
流動負債合計	194,122,637	254,138,345
負債合計	194,122,637	254,138,345
純資産の部		
元本等		
元本	31,417,345,029	35,008,790,381
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,511,590,082	15,871,397,797
純資産合計	43,928,935,111	50,880,188,178
負債純資産合計	44,123,057,748	51,134,326,523

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27年11月20日現在）
1. 受益権総口数	31,417,345,029口	35,008,790,381口
2. 1口当たり純資産額	1.3982円	1.4534円
（1万口当たり純資産額）	（13,982円）	（14,534円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成25年12月10日 至 平成26年11月20日）	（自 平成26年11月21日 至 平成27年11月20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は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27年11月20日現在）
----	-----------------	-----------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)にて記載したとおりであります。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年11月20日現在	平成27年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,911,060,397	1,865,846,743
投資証券	51,880,774	5,258,479
合計	1,962,941,171	1,871,105,222

(デリバティブ取引等に関する注記)

デリバティブ取引

通貨関連

種類	(平成26年11月20日 現在)				(平成27年11月20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	208,609,549	-	208,467,397	142,152	1,242,151	-	1,236,509	5,642
アメリカ・ドル	114,549,365	-	114,486,407	62,958	1,242,151	-	1,236,509	5,642
イギリス・ポンド	32,475,173	-	32,444,352	30,821	-	-	-	-
イスラエル・シケル	432,973	-	433,100	127	-	-	-	-

オーストラリア・ドル	23,151,477	-	23,147,836	3,641	-	-	-	-
カナダ・ドル	10,885,145	-	10,876,480	8,665	-	-	-	-
シンガポール・ドル	3,575,868	-	3,577,365	1,497	-	-	-	-
スイス・フラン	683,756	-	682,976	780	-	-	-	-
ノルウェー・クローネ	954,913	-	952,889	2,024	-	-	-	-
ユーロ	17,807,160	-	17,776,800	30,360	-	-	-	-
香港・ドル	4,093,719	-	4,089,192	4,527	-	-	-	-
合計	208,609,549	-	208,467,397	142,152	1,242,151	-	1,236,509	5,642

(注) 時価の算定方法

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

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

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

2. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	(平成26年11月20日 現在)				(平成27年11月20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	2,683,148,750	-	2,762,449,691	79,300,941	1,779,316,317	-	1,819,162,755	39,846,438
合計	2,683,148,750	-	2,762,449,691	79,300,941	1,779,316,317	-	1,819,162,755	39,846,438

(注) 時価の算定方法

1. 株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

4. 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	（平成26年11月20日現在）	（平成27年11月20日現在）
開示対象ファンドの開示対象期間の期首元本額	21,596,188,879円	31,417,345,029円
開示対象ファンドの開示対象期間中の追加設定元本額	14,098,099,089円	18,394,745,440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	4,276,942,939円	14,803,300,088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）	280,880,216円	278,615,081円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	1,889,015,758円	1,896,276,758円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	1,629,062,131円	1,651,202,428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）	11,302,699,162円	11,034,706,520円
ニッセイ厚生年金型バランス運用DB（適格機関投資家限定）	12,199,044,845円	6,967,231,514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	4,116,642,917円	13,093,548,146円
DCニッセイ外国株式インデックス	- 円	2,911,000円
ニッセイターゲットデートファンドI（適格機関投資家限定）	- 円	239,362円
ニッセイターゲットデートファンド（適格機関投資家限定）	- 円	196,060円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）	- 円	83,863,512円
計	31,417,345,029円	35,008,790,381円

附属明細表（平成27年11月20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	8,350	158.38	1,322,473.00	
	ABBOTT LABORATORIES	19,597	45.73	896,170.81	
	ABBVIE INC	22,663	60.55	1,372,244.65	
	ACCENTURE PLC	8,249	107.28	884,952.72	
	ACE LTD	4,289	115.57	495,679.73	

ACTIVISION BLIZZARD INC	6,834	37.01	252,926.34	
ACUITY BRANDS INC	592	225.40	133,436.80	
ADOBE SYSTEMS INC	6,590	91.76	604,698.40	
ADT CORP/THE	2,405	34.06	81,914.30	
ADVANCE AUTO PARTS	986	162.37	160,096.82	
AES CORP	9,236	9.57	88,388.52	
AETNA INC	4,601	99.89	459,593.89	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	731	176.71	129,175.01	
AFLAC INC	5,682	65.37	371,432.34	
AGCO CORP	1,121	48.21	54,043.41	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,518	38.50	173,943.00	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,689	139.96	376,352.44	
AIRGAS INC	922	138.75	127,927.50	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,339	59.21	138,492.19	
ALBEMARLE CORP	1,577	50.69	79,938.13	
ALCOA INC	17,453	8.76	152,888.28	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,952	174.48	515,064.96	
ALKERMES PLC	2,005	73.07	146,505.35	
ALLEGHANY CORP	216	510.50	110,268.00	
ALLERGAN PLC	5,172	302.05	1,562,202.60	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	838	286.07	239,726.66	
ALLIANT ENERGY CORP	1,557	60.45	94,120.65	
ALLSTATE CORP	5,375	63.37	340,613.75	
ALLY FINANCIAL INC	5,823	19.36	112,733.28	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,022	102.86	105,122.92	
ALPHABET INC-CL A	3,798	759.94	2,886,252.12	
ALPHABET INC-CL C	4,062	738.41	2,999,421.42	
ALTERA CORP	4,062	52.69	214,026.78	
ALTRIA GROUP INC	25,918	57.46	1,489,248.28	
AMAZON.COM INC	5,216	661.27	3,449,184.32	
AMEREN CORPORATION	3,309	43.70	144,603.30	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,366	42.30	100,081.80	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	6,488	56.32	365,404.16	
AMERICAN EXPRESS CO	12,022	72.74	874,480.28	

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,531	61.98	1,086,571.38	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,410	57.27	138,020.70	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,381	114.97	273,743.57	
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,753	99.19	273,070.07	
AMERITRADE HOLDING CORP	3,667	36.58	134,138.86	
AMETEK INC	3,249	55.79	181,261.71	
AMGEN INC	10,015	159.49	1,597,292.35	
AMPHENOL CORP-CL A	4,176	54.58	227,926.08	
ANADARKO PETROLEUM CORP	6,684	59.64	398,633.76	
ANALOG DEVICES INC	4,222	59.77	252,348.94	
ANSYS INC	1,211	91.50	110,806.50	
ANTERO RESOURCES CORP	1,167	22.72	26,514.24	
ANTHEM INC	3,487	127.86	445,847.82	
AON PLC	3,699	93.82	347,040.18	
APACHE CORP	5,056	49.54	250,474.24	
APPLE INC	75,925	118.78	9,018,371.50	
APPLIED MATERIALS INC	16,198	18.20	294,803.60	
ARAMARK	3,065	32.34	99,122.10	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,687	74.07	124,956.09	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	8,161	36.43	297,305.23	
ARROW ELECTRONICS INC	1,281	57.41	73,542.21	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,242	43.87	98,356.54	
ASHLAND INC	874	112.60	98,412.40	
ASSURANT INC	899	85.67	77,017.33	
AT&T INC	81,149	33.62	2,728,229.38	
AUTODESK INC	3,050	62.39	190,289.50	
AUTOLIV INC	1,193	125.56	149,793.08	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	6,184	86.39	534,235.76	
AUTONATION INC	1,041	63.04	65,624.64	
AUTOZONE INC	419	779.06	326,426.14	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	3,425	125.21	428,844.25	
AVERY DENNISON CORP	1,264	66.00	83,424.00	
AVNET INC	1,816	45.82	83,209.12	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,047	29.50	60,386.50	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,370	55.55	76,103.50	

BAKER HUGHES INC	5,392	50.87	274,291.04	
BALL CORP	1,794	68.41	122,727.54	
BANK OF AMERICA CORP	138,310	17.69	2,446,703.90	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	14,746	43.83	646,317.18	
BARD (C.R.) INC	999	181.96	181,778.04	
BAXALTA INC -W/I	7,132	34.48	245,911.36	
BAXTER INTERNATIONAL INC	7,132	37.91	270,374.12	
BB&T CORPORATION	10,228	38.54	394,187.12	
BE AEROSPACE INC	1,503	45.30	68,085.90	
BECTON DICKINSON & CO	2,754	149.96	412,989.84	
BED BATH & BEYOND INC	2,229	53.81	119,942.49	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	15,350	136.63	2,097,270.50	
BEST BUY CO INC	4,133	30.67	126,759.11	
BIOGEN INC	3,097	289.44	896,395.68	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,114	103.11	217,974.54	
BLACKROCK INC	1,620	359.09	581,725.80	
BOEING CO	8,658	149.24	1,292,119.92	
BORGWARNER INC	3,037	42.38	128,708.06	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	17,637	17.62	310,763.94	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	21,968	66.94	1,470,537.92	
BROADCOM CORP	7,284	52.80	384,595.20	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	1,615	106.52	172,029.80	
BUNGE LIMITED	1,874	66.13	123,927.62	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,968	68.31	134,434.08	
CA Inc	4,402	28.34	124,752.68	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	2,727	31.11	84,836.97	
CABOT OIL & GAS CORP	5,622	20.50	115,251.00	
CALPINE CORP	4,800	14.57	69,936.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	2,574	68.37	175,984.38	
CAMPBELL SOUP CO	2,532	49.47	125,258.04	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,182	79.58	571,543.56	
CARDINAL HEALTH INC	4,353	87.36	380,278.08	
CARMAX INC	2,814	56.35	158,568.90	
CARNIVAL CORP	5,455	51.54	281,150.70	
CATERPILLAR INC	7,547	70.02	528,440.94	

CBRE GROUP INC	4,027	36.32	146,260.64	
CBS CORP-CL B	6,038	51.75	312,466.50	
CDK GLOBAL INC	1,847	48.61	89,782.67	
CELANESE CORP-SERIES A	2,071	71.80	148,697.80	
CELGENE CORP	10,451	114.15	1,192,981.65	
CENTENE CORP	1,526	54.47	83,121.22	
CENTERPOINT ENERGY INC	5,541	17.10	94,751.10	
CENTURYLINK INC	7,650	28.47	217,795.50	
CERNER CORP	4,063	57.90	235,247.70	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,173	46.57	147,766.61	
CHARLES SCHWAB CORP	15,555	33.04	513,937.20	
CHARTER COMMUNICATION-A	1,139	186.13	212,002.07	
CHENIERE ENERGY INC	2,941	50.20	147,638.20	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,380	5.40	45,252.00	
CHEVRON CORP	24,743	90.83	2,247,406.69	
CHICAGO BRIDGE & IRON- NY SHR	1,367	42.74	58,425.58	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	410	611.51	250,719.10	
CHUBB CORP	3,021	130.92	395,509.32	
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,721	85.65	147,403.65	
CIGNA CORP	3,391	127.83	433,471.53	
CIMAREX ENERGY CO	1,264	115.32	145,764.48	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,102	60.75	127,696.50	
CINTAS CORP	1,330	90.76	120,710.80	
CISCO SYSTEMS INC	67,085	27.37	1,836,116.45	
CIT GROUP INC	2,329	42.66	99,355.14	
CITIGROUP INC	39,975	55.06	2,201,023.50	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,773	26.12	150,790.76	
CITRIX SYSTEMS INC	2,157	72.62	156,641.34	
CLOROX CO	1,774	124.32	220,543.68	
CME GROUP INC	4,225	97.18	410,585.50	
CMS ENERGY CORP	3,795	35.44	134,494.80	
COACH INC	3,701	29.66	109,771.66	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	4,067	7.81	31,763.27	
COCA-COLA CO	54,534	43.11	2,350,960.74	
COCA-COLA ENTERPRISES	2,885	50.77	146,471.45	

COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	8,039	65.24	524,464.36	
COLGATE-PALMOLIVE CO	11,326	66.38	751,819.88	
COLUMBIA PIPELINE GROUP -W/I	4,278	19.28	82,479.84	
COMCAST CORP	27,991	62.62	1,752,796.42	
COMCAST CORP	5,320	62.69	333,510.80	
COMERICA INC	2,375	46.34	110,057.50	
COMPUTER SCIENCES CORP	1,873	70.04	131,184.92	
CONAGRA FOODS INC	5,757	41.10	236,612.70	
CONCHO RESOURCES INC	1,615	109.12	176,228.80	
CONOCOPHILLIPS	16,226	53.56	869,064.56	
CONSOL ENERGY INC	3,182	7.83	24,915.06	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,887	63.19	245,619.53	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,261	137.46	310,797.06	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,296	34.61	44,854.56	
COOPER COS INC/THE	653	144.44	94,319.32	
CORE LABORATORIES N.V.	607	112.90	68,530.30	
CORNING INC	16,513	18.99	313,581.87	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,793	162.83	943,274.19	
CROWN HOLDINGS INC	1,921	50.91	97,798.11	
CSX CORP	13,189	29.21	385,250.69	
CUMMINS INC	2,263	98.57	223,063.91	
CVS HEALTH CORP	14,858	92.49	1,374,216.42	
D&B CORP	507	108.01	54,761.07	
DANAHER CORP	8,085	96.95	783,840.75	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,532	54.42	83,371.44	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	2,323	73.21	170,066.83	
DEERE & CO	4,194	74.94	314,298.36	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	3,808	83.94	319,643.52	
DELTA AIR LINES INC	2,807	48.51	136,167.57	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	1,879	61.09	114,788.11	
DEVON ENERGY CORPORATION	5,239	45.98	240,889.22	
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,322	37.61	49,720.42	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,813	57.65	335,119.45	

DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	1,964	30.56	60,019.84	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3,881	28.86	112,005.66	
DISH NETWORK CORP	3,042	63.74	193,897.08	
DOLLAR GENERAL CORP	4,004	62.61	250,690.44	
DOLLAR TREE INC	3,003	67.16	201,681.48	
DOMINION RESOURCES INC/VA	7,832	68.82	538,998.24	
DOVER CORP	2,149	65.35	140,437.15	
DOW CHEMICAL CO	15,519	53.32	827,473.08	
DR HORTON INC	4,443	32.06	142,442.58	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	2,588	89.32	231,160.16	
DTE ENERGY COMPANY	2,429	80.93	196,578.97	
DUKE ENERGY CORP	9,134	68.49	625,587.66	
E*TRADE FINANCIAL	3,907	30.11	117,639.77	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,006	70.90	142,225.40	
EATON CORP PLC	6,137	56.77	348,397.49	
EATON VANCE CORP	1,634	37.88	61,895.92	
EBAY INC	14,425	28.77	415,007.25	
ECOLAB INC	3,539	117.91	417,283.49	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	875	79.78	69,807.50	
EDISON INTERNATIONAL	4,308	60.30	259,772.40	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,450	155.93	226,098.50	
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	11,914	66.99	798,118.86	
ELECTRONIC ARTS INC	4,149	71.08	294,910.92	
ELI LILLY & CO	13,182	83.72	1,103,597.04	
EMC CORP/MASSACHUSETTS	25,570	25.04	640,272.80	
EMERSON ELECTRIC CO	8,785	50.14	440,479.90	
ENDO INTERNATIONAL PLC	2,728	59.41	162,070.48	
ENERGEN CORP	1,111	57.39	63,760.29	
ENSCO PLC	3,229	17.20	55,538.80	
ENTERGY CORP	2,419	65.84	159,266.96	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	2,509	25.67	64,406.03	
EOG RESOURCES INC	7,229	82.65	597,476.85	
EQT CORP	1,992	59.56	118,643.52	
EQUIFAX INC	1,615	109.88	177,456.20	

ESTEE LAUDER COS INC	3,030	84.57	256,247.10	
EVEREST RE GROUP LTD	600	186.06	111,636.00	
EVERSOURCE ENERGY	4,315	51.04	220,237.60	
EXELON CORP	11,371	28.16	320,207.36	
EXPEDIA INC	1,387	128.09	177,660.83	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	2,684	49.25	132,187.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	9,592	83.56	801,507.52	
EXXON MOBIL CORP	55,071	80.30	4,422,201.30	
F5 NETWORKS INC	981	103.47	101,504.07	
FACEBOOK INC-A	28,164	106.26	2,992,706.64	
FASTENAL CO	3,652	39.46	144,107.92	
FEDEX CORP	3,591	163.35	586,589.85	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	3,743	66.08	247,337.44	
FIFTH THIRD BANCORP	10,854	20.42	221,638.68	
FIREEYE INC	1,547	22.92	35,457.24	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,923	66.94	128,725.62	
FIRSTENERGY CORP	5,705	31.21	178,053.05	
FISERV INC	3,131	96.66	302,642.46	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,020	151.57	154,601.40	
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	7,613	11.13	84,732.69	
FLIR SYSTEMS INC	1,967	29.85	58,714.95	
FLOWSERVE CORP	1,801	45.84	82,557.84	
FLUOR CORP	1,963	48.87	95,931.81	
FMC CORP	1,876	42.61	79,936.36	
FMC TECHNOLOGIES INC	3,105	33.41	103,738.05	
FNF GROUP	3,423	35.27	120,729.21	
FOOT LOCKER INC	1,838	61.53	113,092.14	
FORD MOTOR CO	48,835	14.57	711,525.95	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	2,161	54.54	117,860.94	
FRANKLIN RESOURCES INC	5,350	41.58	222,453.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	14,276	8.41	120,061.16	
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	1,538	34.42	52,937.96	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	15,708	4.96	77,911.68	
GAMESTOP CORP-CLASS A	1,510	38.46	58,074.60	

GAP INC	3,376	25.09	84,703.84	
GARMIN LTD	1,603	37.00	59,311.00	
GARTNER INC	1,138	87.47	99,540.86	
GENERAL DYNAMICS CORP	3,686	145.20	535,207.20	
GENERAL ELECTRIC CO	132,765	30.27	4,018,796.55	
GENERAL MILLS INC	7,857	56.91	447,141.87	
GENERAL MOTORS CO	19,033	36.14	687,852.62	
GENUINE PARTS CO	2,036	89.01	181,224.36	
GILEAD SCIENCES INC	19,367	106.51	2,062,779.17	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,119	193.03	988,120.57	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	3,639	33.81	123,034.59	
H&R BLOCK INC	3,689	36.47	134,537.83	
HALLIBURTON CO	11,195	38.04	425,857.80	
HANESBRANDS INC	5,418	30.75	166,603.50	
HARLEY-DAVIDSON INC	2,720	49.81	135,483.20	
HARMAN INTERNATIONAL	957	100.84	96,503.88	
HARRIS CORP	1,684	83.21	140,125.64	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	5,496	46.02	252,925.92	
HASBRO INC	1,516	75.60	114,609.60	
HCA HOLDINGS INC	4,375	65.39	286,081.25	
HELMERICH & PAYNE	1,515	54.74	82,931.10	
HENRY SCHEIN INC	1,116	155.05	173,035.80	
HERSHEY CO/THE	2,022	85.09	172,051.98	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	5,294	16.75	88,674.50	
HESS CORP	3,459	60.10	207,885.90	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	23,912	13.78	329,507.36	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,626	23.50	155,711.00	
HOLLYFRONTIER CORP	2,499	50.26	125,599.74	
HOLOGIC INC	3,227	39.85	128,595.95	
HOME DEPOT INC	17,117	126.86	2,171,462.62	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,785	105.04	1,027,816.40	
HORMEL FOODS CORP	1,955	68.84	134,582.20	
HP INC	23,912	13.79	329,746.48	
HUMANA INC	1,916	164.25	314,703.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	10,889	11.73	127,727.97	

IHS INC-CLASS A	928	120.94	112,232.32	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	4,364	92.48	403,582.72	
ILLUMINA INC	1,900	173.77	330,163.00	
INCYTE CORP	2,124	116.43	247,297.32	
INGERSOLL-RAND PLC	3,564	58.67	209,099.88	
INTEL CORP	62,492	34.30	2,143,475.60	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,467	262.93	385,718.31	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	12,321	136.74	1,684,773.54	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	1,098	117.84	129,388.32	
INTERNATIONAL PAPER CO	5,447	41.26	224,743.22	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,680	23.30	132,344.00	
INTUIT INC	3,455	97.42	336,586.10	
INTUITIVE SURGICAL INC	484	504.17	244,018.28	
INVESCO LTD	5,760	33.19	191,174.40	
ISIS PHARMACEUTICALS INC	1,691	61.77	104,453.07	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,753	42.74	74,923.22	
JARDEN CORP	2,589	44.77	115,909.53	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	825	145.04	119,658.00	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,338	77.60	103,828.80	
JM SMUCKER CO	1,364	121.28	165,425.92	
JOHNSON & JOHNSON	36,535	102.49	3,744,472.15	
JOHNSON CONTROLS INC	8,611	45.70	393,522.70	
JONES LANG LASALLE INC	608	161.79	98,368.32	
JPMORGAN CHASE & CO	48,881	67.66	3,307,288.46	
JUNIPER NETWORKS INC	4,842	30.20	146,228.40	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,473	93.65	137,946.45	
KELLOGG CO	3,562	66.47	236,766.14	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	1,549	47.88	74,166.12	
KEYCORP	10,997	13.08	143,840.76	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,800	121.66	583,968.00	
KINDER MORGAN INC	24,254	23.66	573,849.64	
KLA-TENCOR CORP	2,157	66.90	144,303.30	
KOHL'S CORP	2,726	45.18	123,160.68	
KRAFT HEINZ CO/THE	7,846	73.34	575,425.64	

KROGER CO	12,284	37.32	458,438.88	
L BRANDS INC	3,280	92.13	302,186.40	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,111	125.36	139,274.96	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	1,344	120.29	161,669.76	
LAM RESEARCH CORP	2,200	77.92	171,424.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	5,352	46.07	246,566.64	
LEAR CORP	1,047	124.48	130,330.56	
LEGG MASON INC	1,411	43.77	61,759.47	
LEGGETT & PLATT INC	1,880	44.95	84,506.00	
LENNAR CORP-CL A	2,344	50.59	118,582.96	
LEUCADIA NATIONAL CORP	4,439	18.12	80,434.68	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	4,110	50.71	208,418.10	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,151	42.00	132,342.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	8,386	40.37	338,542.82	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	5,951	26.43	157,284.93	
LIBERTY MEDIA CORP	1,155	41.03	47,389.65	
LIBERTY MEDIA CORP - C	3,002	39.39	118,248.78	
LINCOLN NATIONAL CORP	3,378	55.59	187,783.02	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	3,237	45.61	147,639.57	
LINKEDIN CORP - A	1,453	250.21	363,555.13	
LKQ CORP	4,110	29.48	121,162.80	
LOCKHEED MARTIN CORP	3,542	224.00	793,408.00	
LOEWS CORP	3,817	37.86	144,511.62	
LOWE'S COS INC	12,481	73.39	915,980.59	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,534	47.33	72,604.22	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	5,298	93.12	493,349.76	
M&T BANK CORP	2,106	125.43	264,155.58	
MACY'S INC	4,441	38.54	171,156.14	
MALLINCKRODT PLC	1,588	60.08	95,407.04	
MANPOWER GROUP	1,054	90.51	95,397.54	
MARATHON OIL CORP	9,023	17.64	159,165.72	
MARATHON PETROLEUM CORP	7,160	55.81	399,599.60	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	2,957	72.57	214,589.49	
MARSH & MCLENNAN COS INC	7,088	55.58	393,951.04	

MARTIN MARIETTA MATERIALS	780	160.62	125,283.60	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	5,863	8.77	51,418.51	
MASCO CORP	4,716	29.95	141,244.20	
MASTERCARD INC-CLASS A	13,230	98.93	1,308,843.90	
MATTEL INC	4,521	24.40	110,312.40	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,954	39.65	156,776.10	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,567	84.72	132,756.24	
MCDONALD'S CORP	12,622	113.30	1,430,072.60	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	3,602	96.39	347,196.78	
MCKESSON CORP	3,052	185.36	565,718.72	
MDU RESOURCES GROUP INC	2,582	18.11	46,760.02	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	2,725	82.76	225,521.00	
MEDIVATION INC	2,128	41.29	87,865.12	
MEDTRONIC PLC	18,642	75.75	1,412,131.50	
MERCK & CO INC	37,231	54.28	2,020,898.68	
METLIFE INC	12,445	50.75	631,583.75	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	380	340.00	129,200.00	
MGM MIRAGE	6,030	22.53	135,855.90	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	2,660	40.88	108,740.80	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,843	47.18	134,132.74	
MICRON TECHNOLOGY INC	14,513	15.87	230,321.31	
MICROSOFT CORP	101,266	53.94	5,462,288.04	
MOHAWK INDUSTRIES INC	837	191.38	160,185.06	
MOLSON COORS BREWING CO -B	2,057	93.88	193,111.16	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	21,427	44.58	955,215.66	
MONSANTO CO	6,271	95.83	600,949.93	
MONSTER BEVERAGE CORP	1,885	149.36	281,543.60	
MOODY'S CORP	2,399	103.43	248,128.57	
MORGAN STANLEY	19,442	34.17	664,333.14	
MOSAIC CO/THE	4,310	32.31	139,256.10	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,724	72.45	197,353.80	
MURPHY OIL CORP	2,377	30.18	71,737.86	
MYLAN NV	5,485	51.22	280,941.70	

NABORS INDUSTRIES LTD	4,053	8.99	36,436.47	
NASDAQ INC	1,598	59.36	94,857.28	
NATIONAL-OILWELL INC	5,184	37.60	194,918.40	
NAVIENT CORP	5,476	11.70	64,069.20	
NETAPP INC	4,175	30.97	129,299.75	
NETFLIX INC	5,311	120.22	638,488.42	
NETSUITE INC	546	86.45	47,201.70	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	6,007	15.96	95,871.72	
NEWELL RUBBERMAID INC	3,640	43.93	159,905.20	
NEWMONT MINING CORP	7,065	18.05	127,523.25	
NEWS CORP - CLASS A	5,519	14.19	78,314.61	
NEXTERA ENERGY INC	5,858	100.99	591,599.42	
NIELSEN HOLDINGS PLC	4,719	47.67	224,954.73	
NIKE INC	8,994	125.78	1,131,265.32	
NOBLE ENERGY INC	5,740	36.60	210,084.00	
NORDSTROM INC	1,872	55.60	104,083.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	4,076	96.85	394,760.60	
NORTHERN TRUST CORP	2,983	75.40	224,918.20	
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,428	188.26	457,095.28	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,162	56.86	122,931.32	
NRG ENERGY INC	4,747	11.93	56,631.71	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	3,578	20.20	72,275.60	
NUCOR CORP	4,300	41.81	179,783.00	
NVIDIA CORP	7,237	31.12	225,215.44	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,334	268.96	358,792.64	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,104	75.30	760,831.20	
OCEANEERING INTL INC	1,386	44.38	61,510.68	
OGE ENERGY CORP	2,710	26.28	71,218.80	
OMNICOM GROUP	3,332	73.15	243,735.80	
ONEOK INC	2,803	28.98	81,230.94	
ORACLE CORP	46,006	39.02	1,795,154.12	
PACCAR INC	4,676	51.06	238,756.56	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,329	66.47	88,338.63	
PALO ALTO NETWORKS INC	940	167.39	157,346.60	
PARKER HANNIFIN CORP	1,859	103.71	192,796.89	
PARTNERRE LTD	610	138.95	84,759.50	

PATTERSON COS INC	1,224	48.28	59,094.72	
PAYCHEX INC	4,404	54.05	238,036.20	
PAYPAL HOLDINGS INC	14,347	36.19	519,217.93	
PENTAIR PLC	2,424	56.77	137,610.48	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	4,355	16.43	71,552.65	
PEPCO HOLDINGS INC	3,247	25.94	84,227.18	
PEPSICO INC	19,448	100.93	1,962,886.64	
PERRIGO CO PLC	1,927	154.63	297,972.01	
PFIZER INC	81,113	32.29	2,619,138.77	
PG&E CORP	6,337	53.19	337,065.03	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	20,405	86.25	1,759,931.25	
PHILLIPS 66	7,143	92.38	659,870.34	
PINNACLE WEST CAPITAL	1,514	62.87	95,185.18	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,962	141.10	276,838.20	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6,811	95.10	647,726.10	
POLARIS INDUSTRIES INC	850	105.04	89,284.00	
PPG INDUSTRIES INC	3,596	103.37	371,718.52	
PPL CORPORATION	8,836	34.11	301,395.96	
PRAXAIR INC	3,797	115.56	438,781.32	
PRECISION CASTPARTS CORP	1,817	231.18	420,054.06	
PRICELINE GROUP INC/THE	681	1,284.65	874,846.65	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,182	50.72	212,111.04	
PROCTER & GAMBLE CO	35,717	76.22	2,722,349.74	
PROGRESSIVE CORP	7,842	31.40	246,238.80	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,942	87.40	519,330.80	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,693	39.52	264,507.36	
PULTE GROUP INC	4,412	19.08	84,180.96	
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	403	67.35	27,142.05	
PVH CORP	1,111	88.91	98,779.01	
QORVO INC	2,019	55.77	112,599.63	
QUALCOMM INC	21,481	48.39	1,039,465.59	
QUANTA SERVICES INC	2,867	21.55	61,783.85	
QUEST DIAGNOSTICS	1,934	67.85	131,221.90	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,257	69.07	86,820.99	

RACKSPACE HOSTING INC	1,609	25.67	41,303.03	
RALPH LAUREN CORP	807	122.71	99,026.97	
RANGE RESOURCES CORP	2,280	31.70	72,276.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,747	56.96	99,509.12	
RAYTHEON CO	4,022	126.00	506,772.00	
REALOGY HOLDINGS CORP	1,988	41.39	82,283.32	
RED HAT INC	2,473	81.32	201,104.36	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,000	581.35	581,350.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	17,903	10.14	181,536.42	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	644	110.57	71,207.08	
REPUBLIC SERVICES INC	3,241	44.02	142,668.82	
RESMED INC	1,890	58.24	110,073.60	
REYNOLDS AMERICAN INC	11,305	46.12	521,386.60	
RITE AID CORP	13,345	7.67	102,356.15	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,825	50.72	92,564.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,811	105.76	191,531.36	
ROCKWELL COLLINS INC.	1,731	92.26	159,702.06	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,365	189.44	258,585.60	
ROSS STORES INC	5,455	46.20	252,021.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,362	94.35	222,854.70	
SALESFORCE.COM INC	8,206	80.64	661,731.84	
SANDISK CORP	2,781	75.02	208,630.62	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,787	105.23	188,046.01	
SCANA CORP	1,859	60.00	111,540.00	
SCHLUMBERGER LTD	16,735	77.92	1,303,991.20	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,104	56.72	62,618.88	
SEAGATE TECHNOLOGY	4,251	34.28	145,724.28	
SEALED AIR CORP	2,867	45.66	130,907.22	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,920	54.05	103,776.00	
SEMPRA ENERGY	3,109	101.66	316,060.94	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,302	45.00	103,590.00	
SERVICENOW INC	1,967	85.75	168,670.25	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,049	272.82	286,188.18	
SIGNET JEWELERS LTD	999	139.71	139,570.29	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,424	4.15	142,859.60	

SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,581	78.00	201,318.00	
SNAP-ON INC	798	168.82	134,718.36	
SOUTHERN CO	11,999	45.18	542,114.82	
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,322	46.87	108,832.14	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	5,404	9.78	52,851.12	
SPECTRA ENERGY CORP	8,829	27.28	240,855.12	
SPLUNK INC	1,687	62.76	105,876.12	
SPRINT CORP	11,330	4.05	45,886.50	
ST JUDE MEDICAL INC	3,685	62.52	230,386.20	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,079	107.34	223,159.86	
STAPLES INC	8,615	12.05	103,810.75	
STARBUCKS CORP	19,764	61.46	1,214,695.44	
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	2,287	72.22	165,167.14	
STATE STREET CORP	5,406	72.62	392,583.72	
STERICYCLE INC	1,116	120.82	134,835.12	
STRYKER CORP	4,478	95.41	427,245.98	
SUNEDISON INC	3,885	2.86	11,111.10	
SUNTRUST BANKS INC	6,772	43.60	295,259.20	
SYMANTEC CORP	9,138	19.99	182,714.31	
SYNCHRONY FINANCIAL	2,265	31.65	71,687.25	
SYNOPSIS INC	2,112	52.52	110,922.24	
SYSCO CORP	7,797	41.40	322,795.80	
T ROWE PRICE GROUP INC	3,482	76.38	265,955.16	
T-MOBILE US INC	3,780	37.73	142,619.40	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	709	93.87	66,553.83	
TARGET CORP	7,987	70.55	563,482.85	
TE CONNECTIVITY LTD	5,359	67.09	359,535.31	
TEGNA INC	3,104	27.70	85,980.80	
TERADATA CORP	2,072	28.42	58,886.24	
TESLA MOTORS INC	1,248	221.80	276,806.40	
TESORO CORP	1,696	113.79	192,987.84	
TEXAS INSTRUMENTS INC	13,714	57.95	794,726.30	
TEXTRON INC	3,630	43.32	157,251.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,244	137.40	720,525.60	
TIFFANY & CO	1,732	74.24	128,583.68	
TIME WARNER CABLE	3,727	184.00	685,768.00	
TIME WARNER INC	10,902	70.98	773,823.96	

TJX COS INC	8,964	67.70	606,862.80	
TOLL BROTHERS INC	2,259	37.03	83,650.77	
TORCHMARK CORP	1,700	60.22	102,374.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	2,263	54.48	123,288.24	
TOWERS WATSON & CO-CL A	936	131.40	122,990.40	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,832	89.24	163,487.68	
TRANSDIGM GROUP INC	726	235.90	171,263.40	
TRAVELERS COS INC/THE	4,184	115.02	481,243.68	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,645	22.17	80,809.65	
TRIPADVISOR INC	1,582	84.55	133,758.10	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	6,095	30.32	184,800.40	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	16,498	29.95	494,115.10	
TWITTER INC	6,612	26.32	174,027.84	
TYCO INTERNATIONAL PLC	5,646	35.83	202,296.18	
TYSON FOODS INC-CL A	4,097	44.46	182,152.62	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	801	164.50	131,764.50	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,368	89.25	211,344.00	
UNION PACIFIC CORP	11,640	87.04	1,013,145.60	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,317	58.50	77,044.50	
UNITED PARCEL SERVICE INC	9,328	104.10	971,044.80	
UNITED RENTALS INC	1,302	75.56	98,379.12	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	11,125	98.30	1,093,587.50	
UNITED THERAPEUTICS CORP	625	148.84	93,025.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	12,541	110.63	1,387,410.83	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,200	119.08	142,896.00	
UNUM GROUP	3,340	36.67	122,477.80	
URBAN OUTFITTERS INC	1,468	22.29	32,721.72	
US BANCORP	23,321	44.15	1,029,622.15	
VALERO ENERGY CORP	6,706	71.14	477,064.84	
VANTIV INC - CL A	1,990	52.04	103,559.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,345	79.38	106,766.10	
VERISIGN INC	1,432	86.60	124,011.20	
VERISK ANALYTICS INC	2,095	73.27	153,500.65	

VERIZON COMMUNICATIONS INC	53,874	45.76	2,465,274.24	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,209	130.08	417,426.72	
VF CORP	4,482	63.49	284,562.18	
VIACOM INC-CLASS B	4,705	52.21	245,648.05	
VISA INC-CLASS A SHARES	25,791	80.15	2,067,148.65	
VMWARE INC-CLASS A	1,084	58.44	63,348.96	
VOYA FINANCIAL INC	3,065	41.60	127,504.00	
VULCAN MATERIALS CO	1,808	104.75	189,388.00	
WABCO HOLDINGS INC	759	104.61	79,398.99	
WABTEC CORP	1,313	77.75	102,085.75	
WAL-MART STORES INC	21,219	60.70	1,287,993.30	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	11,492	82.83	951,882.36	
WALT DISNEY CO	21,289	118.71	2,527,217.19	
WASTE MANAGEMENT INC	6,030	53.63	323,388.90	
WATERS CORP	1,123	131.55	147,730.65	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	10,376	10.51	109,051.76	
WEC ENERGY GROUP INC	4,279	50.26	215,062.54	
WELLS FARGO & CO	64,445	55.97	3,606,986.65	
WESTERN DIGITAL CORP	3,092	62.01	191,734.92	
WESTERN UNION CO	6,971	19.08	133,006.68	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	643	59.77	38,432.11	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	3,520	50.18	176,633.60	
WEYERHAEUSER CO	6,941	31.93	221,626.13	
WHIRLPOOL CORP	1,055	159.72	168,504.60	
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	2,374	39.70	94,247.80	
WHITING PETROLEUM CORP	2,867	17.01	48,767.67	
WHOLE FOODS MARKET INC	4,657	29.93	139,384.01	
WILLIAMS COS INC	9,367	37.72	353,323.24	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	2,191	45.26	99,164.66	
WORKDAY INC-CLASS A	1,439	84.30	121,307.70	
WR BERKLEY CORP	1,356	54.49	73,888.44	
WW GRAINGER INC	810	198.31	160,631.10	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	1,618	76.80	124,262.40	
WYNN RESORTS LTD	1,136	61.78	70,182.08	
XCEL ENERGY INC	6,888	35.72	246,039.36	
XEROX CORP	13,546	10.43	141,284.78	

	XILINX INC	3,479	48.92	170,192.68	
	XL GROUP PLC	3,951	38.08	150,454.08	
	XYLEM INC	2,453	37.67	92,404.51	
	YAHOO! INC	11,718	32.62	382,299.75	
	YUM! BRANDS INC	5,694	71.68	408,145.92	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	1,398	25.23	35,271.54	
	ZILLOW GROUP INC - CL A	695	26.45	18,382.75	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,314	104.07	240,817.98	
	ZOETIS INC	6,272	46.90	294,156.80	
アメリカ・ドル	小計	4,223,816		249,181,020.90 (30,639,298,330)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	13,047	4.96	64,804.44	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	12,961	3.38	43,924.82	
	ADMIRAL GROUP PLC	2,944	16.41	48,311.04	
	AGGREKO PLC	3,593	9.92	35,642.56	
	AMEC FOSTER WHEELER PLC	5,504	4.79	26,375.16	
	ANGLO AMERICAN PLC	18,716	4.50	84,353.01	
	ANTOFAGASTA PLC	5,413	5.01	27,119.13	
	ARM HOLDINGS PLC	18,643	10.84	202,090.12	
	ASHTREAD GROUP PLC	6,812	10.52	71,662.24	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,794	35.04	167,981.76	
	ASTRAZENECA PLC	16,649	44.28	737,300.96	
	AVIVA PLC	53,112	5.04	267,684.48	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	3,527	10.00	35,270.00	
	BAE SYSTEMS PLC	41,728	4.84	202,005.24	
	BARCLAYS PLC	220,488	2.29	506,901.91	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	13,395	5.77	77,289.15	
	BG GROUP PLC	44,996	10.38	467,283.46	
	BHP BILLITON PLC	27,722	8.88	246,365.41	
	BP PLC	240,445	3.85	925,953.69	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	24,559	38.60	948,100.19	
	BT GROUP PLC	110,838	4.91	544,325.41	
	BUNZL PLC	4,597	18.86	86,699.42	
	BURBERRY GROUP PLC	5,999	12.79	76,727.21	
	CAPITA PLC	8,982	12.51	112,364.82	
	CARNIVAL PLC	2,486	34.42	85,568.12	

CENTRICA PLC	67,067	2.13	143,255.11	
COBHAM PLC	16,098	2.90	46,700.29	
COCA-COLA HBC AG-CDI	2,818	16.16	45,538.88	
COMPASS GROUP PLC	21,841	10.75	234,790.75	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,845	28.35	52,305.75	
DIAGEO PLC	33,119	19.02	630,088.97	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	18,584	4.06	75,451.04	
DIXONS CARPHONE PLC	13,302	4.59	61,135.99	
EASYJET PLC	2,325	17.14	39,850.50	
EXPERIAN PLC	13,294	12.17	161,787.98	
FRESNILLO PLC	3,108	6.99	21,740.46	
G4S PLC	21,353	2.25	48,215.07	
GKN PLC	22,115	3.01	66,743.07	
GLAXOSMITHKLINE PLC	64,129	13.47	863,817.63	
GLENCORE PLC	145,794	0.94	137,046.36	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,664	14.91	54,630.24	
HSBC HOLDINGS PLC	256,853	5.25	1,348,735.10	
ICAP PLC	7,785	5.08	39,586.72	
IMI PLC	3,841	9.17	35,221.97	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	12,620	34.92	440,690.40	
INMARSAT PLC	6,349	10.69	67,870.81	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,185	25.02	79,688.70	
INTERTEK GROUP PLC	2,182	26.57	57,975.74	
INVESTEC PLC	7,809	5.42	42,324.78	
ITV PLC	52,219	2.67	139,529.16	
JOHNSON MATTHEY PLC	2,760	26.94	74,354.40	
KINGFISHER PLC	31,165	3.56	111,072.06	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	78,257	2.68	209,963.53	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	752,342	0.73	551,466.68	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,198	25.85	108,518.30	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	22,177	5.19	115,209.51	
MEGGITT PLC	10,604	3.88	41,185.93	
MELROSE INDUSTRIES PLC	14,029	2.80	39,281.20	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	10,147	4.12	41,886.81	
MONDI PLC/WI	4,993	14.94	74,595.42	

MORRISON WM SUPERMARKETS	29,752	1.54	45,996.59	
NATIONAL GRID PLC	49,453	9.39	464,610.93	
NEXT PLC	1,967	78.05	153,524.35	
OLD MUTUAL PLC	65,961	2.02	133,307.18	
PEARSON PLC	10,821	8.15	88,191.15	
PERSIMMON PLC	4,140	18.40	76,176.00	
PETROFAC LTD	3,658	7.88	28,843.33	
PRUDENTIAL PLC	33,835	15.18	513,615.30	
RANDGOLD RESOURCES LTD	1,250	40.51	50,637.50	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,465	63.15	534,564.75	
RELX PLC	14,992	11.86	177,805.12	
REXAM PLC	9,697	5.60	54,351.68	
RIO TINTO PLC	16,607	22.90	380,300.30	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	24,174	5.41	130,781.34	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	2,177,244	0.00	2,177.24	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	43,225	3.15	136,245.20	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	51,480	16.66	857,656.80	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	31,946	16.81	537,171.99	
ROYAL MAIL PLC	11,277	4.76	53,757.45	
RSA INSURANCE GROUP PLC	13,692	4.40	60,244.80	
SABMILLER PLC	12,768	40.18	513,018.24	
SAGE GROUP PLC	14,622	5.61	82,102.53	
SAINSBURY (J) PLC	18,809	2.53	47,624.38	
SCHRODERS PLC	1,670	29.55	49,348.50	
SEVERN TRENT PLC	3,275	22.14	72,508.50	
SHIRE PLC	7,800	47.18	368,004.00	
SKY PLC	14,147	11.03	156,041.41	
SMITH & NEPHEW PLC	12,015	11.25	135,168.75	
SMITHS GROUP PLC	5,349	10.06	53,810.94	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	3,781	7.07	26,750.57	
SSE PLC	13,114	14.75	193,431.50	
ST JAMES' S PLACE PLC	7,016	9.68	67,914.88	
STANDARD CHARTERED PLC	33,445	5.93	198,328.85	
STANDARD LIFE PLC	26,408	4.04	106,873.17	
TATE & LYLE PLC	6,538	5.94	38,835.72	

	TAYLOR WIMPEY PLC	43,918	1.85	81,380.05	
	TESCO PLC	106,960	1.72	183,971.20	
	TRAVIS PERKINS PLC	3,373	19.65	66,279.45	
	TUI AG-DI	6,710	11.30	75,823.00	
	TULLOW OIL PLC	12,707	2.03	25,833.33	
	UNILEVER PLC	16,912	28.20	476,918.40	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,378	9.74	91,388.61	
	VODAFONE GROUP PLC	350,197	2.21	775,686.35	
	WEIR GROUP PLC/THE	2,992	11.31	33,839.52	
	WHITBREAD PLC	2,444	45.15	110,346.60	
	WILLIAM HILL PLC	12,439	3.47	43,250.40	
	WOLSELEY PLC	3,517	37.17	130,726.89	
	WPP PLC	17,301	15.15	262,110.15	
イギリス・ポンド 小計		6,019,162		21,341,633.95 (4,009,025,938)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	497	152.80	75,941.60	
	BANK HAPOLIM BM	14,652	20.28	297,142.56	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	19,563	14.61	285,815.43	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	27,634	8.60	237,652.40	
	DELEK GROUP LTD	65	893.70	58,090.50	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	7,007	19.77	138,528.39	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	42	865.00	36,330.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,939	46.15	89,484.85	
	NICE SYSTEMS LTD	803	251.50	201,954.50	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	11,356	237.80	2,700,456.80	
イスラエル・シュケル 小計		83,558		4,121,397.03 (130,813,142)	
オーストラリア・ドル	AGL ENERGY LTD	9,955	16.89	168,139.95	
	ALUMINA LTD	38,642	1.23	47,529.66	
	AMCOR LTD	17,087	13.81	235,971.47	
	AMP LTD	41,773	5.84	243,954.32	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	8,537	9.66	82,467.42	
	ASCIANO LTD	14,299	8.90	127,261.10	
	ASX LTD	3,042	41.53	126,334.26	
	AURIZON HOLDINGS LTD	32,029	5.53	177,120.37	
	AUSNET SERVICES	34,596	1.57	54,315.72	

AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	37,041	27.52	1,019,368.32	
BANK OF QUEENSLAND LTD	6,062	14.35	86,989.70	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	7,522	11.15	83,870.30	
BHP BILLITON LTD	42,645	20.42	870,810.90	
BORAL LTD	13,045	5.60	73,052.00	
BRAMBLES LTD	22,501	10.85	244,135.85	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,878	32.35	125,453.30	
CIMIC GROUP LIMITED	1,729	26.17	45,247.93	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	8,948	9.30	83,216.40	
COCHLEAR LTD	907	92.82	84,187.74	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	22,606	79.14	1,789,038.84	
COMPUTERSHARE LIMITED	7,770	11.57	89,898.90	
CROWN RESORTS LTD	5,587	12.05	67,323.35	
CSL LIMITED	6,233	98.10	611,457.30	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	875	37.34	32,672.50	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	22,779	2.17	49,430.43	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	9,456	3.97	37,540.32	
HEALTHSCOPE LTD	19,409	2.85	55,315.65	
ILUKA RESOURCES LIMITED	6,360	6.19	39,368.40	
INCITEC PIVOT LTD	25,036	3.79	94,886.44	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	34,161	5.71	195,059.31	
MACQUARIE GROUP LTD	4,193	82.47	345,796.71	
MEDIBANK PRIVATE LTD	41,161	2.33	95,905.13	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	34,996	29.72	1,040,081.12	
NEWCREST MINING LIMITED	10,648	11.68	124,368.64	
ORICA LTD	5,682	16.65	94,605.30	
ORIGIN ENERGY LIMITED	16,642	5.45	90,698.90	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	4,237	8.08	34,234.96	
QANTAS AIRWAYS LTD	8,837	3.85	34,022.45	
QBE INSURANCE GROUP LTD	18,857	12.86	242,501.02	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	2,093	67.98	142,282.14	
REA GROUP LTD	914	50.41	46,074.74	

	RIO TINTO LTD	5,868	48.68	285,654.24	
	SANTOS LTD	15,078	4.33	65,287.74	
	SANTOS LTD - RTS	8,869	0.47	4,168.43	
	SEEK LTD	5,038	14.13	71,186.94	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,654	20.43	115,511.22	
	SOUTH32 LTD	74,186	1.31	97,554.59	
	SUNCORP GROUP LTD	18,556	13.38	248,279.28	
	TABCORP HOLDINGS LTD	13,356	4.65	62,105.40	
	TATTS GROUP LTD	23,663	4.15	98,201.45	
	TELSTRA CORP LTD	60,874	5.43	330,545.82	
	TPG TELECOM LTD	4,750	10.40	49,400.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	9,905	7.59	75,178.95	
	WESFARMERS LIMITED	15,107	38.70	584,640.90	
	WESTPAC BANKING CORP	41,615	31.58	1,314,201.70	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	10,255	30.50	312,777.50	
	WOOLWORTHS LTD	16,990	23.65	401,813.50	
	WORLEYPARSONS LTD	3,227	6.31	20,362.37	
	オーストラリア・ドル 小計	985,761		13,468,859.29 (1,190,916,538)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,917	35.96	104,895.32	
	AGRIUM INC	1,839	126.14	231,971.46	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	5,536	60.50	334,928.00	
	ALTAGAS LTD	1,922	32.40	62,272.80	
	ARC RESOURCES LTD	4,871	18.52	90,210.92	
	ATCO LTD -CL 'I'	1,142	37.54	42,870.68	
	BANK OF MONTREAL	8,532	76.55	653,124.60	
	BANK OF NOVA SCOTIA	16,014	60.78	973,330.92	
	BARRICK GOLD CORP	15,654	10.02	156,853.08	
	BAYTEX ENERGY CORP	2,868	5.51	15,802.68	
	BCE INC	2,131	58.40	124,450.40	
	BLACKBERRY LTD	7,070	10.26	72,538.20	
	BOMBARDIER INC	27,145	1.28	34,745.60	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	11,409	45.56	519,794.04	
	CAE INC	3,938	15.04	59,227.52	
	CAMECO CORP	5,630	16.48	92,782.40	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	5,239	100.46	526,309.94	

CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	10,696	79.85	854,075.60	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	14,449	33.06	477,683.94	
CANADIAN OIL SANDS LTD	6,774	8.80	59,611.20	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,081	197.31	410,602.11	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,006	124.20	124,945.20	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,839	34.42	63,298.38	
GENOVUS ENERGY INC	11,111	20.07	222,997.77	
CGI GROUP INC	3,054	56.37	172,153.98	
CI FINANCIAL CORP	3,277	31.60	103,553.20	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	261	559.00	145,899.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	6,668	17.37	115,823.16	
DOLLARAMA INC	1,702	89.59	152,482.18	
ELDORADO GOLD CORP	10,028	4.33	43,421.24	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,424	26.92	65,254.08	
ENBRIDGE INC	11,312	49.61	561,188.32	
ENCANA CORP	11,320	10.73	121,463.60	
ENERPLUS CORP	2,890	6.81	19,680.90	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	293	679.68	199,146.24	
FINNING INTERNATIONAL INC	2,435	19.51	47,506.85	
FIRST CAPITAL REALTY INC	1,773	19.40	34,396.20	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,629	5.27	50,744.83	
FORTIS INC	3,861	38.10	147,104.10	
FRANCO-NEVADA CORP	2,128	63.95	136,085.60	
GEORGE WESTON LTD	734	108.87	79,910.58	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,163	39.84	126,013.92	
GOLDCORP INC	10,808	16.18	174,873.44	
GREAT-WEST LIFECO INC	4,131	35.72	147,559.32	
HUSKY ENERGY INC	4,665	18.71	87,282.15	
IGM FINANCIAL INC	1,402	38.60	54,117.20	
IMPERIAL OIL LTD	4,020	42.35	170,247.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,419	43.50	61,726.50	
INTACT FINANCIAL CORP	1,818	88.65	161,165.70	

INTER PIPELINE LTD	4,522	23.82	107,714.04	
JEAN COUTU GROUP INC- CLASS A	1,179	20.82	24,546.78	
KEYERA CORP	2,437	39.55	96,383.35	
KINROSS GOLD CORP	15,936	2.49	39,680.64	
LOBLAW COS LTD	3,071	68.49	210,332.79	
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,428	59.90	325,137.20	
MANULIFE FINANCIAL CORP	25,966	22.17	575,666.22	
MEG ENERGY CORP	2,229	11.45	25,522.05	
METHANEX CORP	1,298	50.84	65,990.32	
METRO INC	3,401	38.62	131,346.62	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,306	43.35	186,665.10	
ONEX CORPORATION	1,250	82.59	103,237.50	
OPEN TEXT CORP	1,655	63.53	105,142.15	
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	925	9.26	8,565.50	
PEMBINA PIPELINE CORP	4,627	31.47	145,611.69	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	2,174	27.24	59,219.76	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	11,237	27.43	308,230.91	
POWER CORP OF CANADA	5,072	31.65	160,528.80	
POWER FINANCIAL CORP	3,416	34.06	116,348.96	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,011	26.11	52,507.21	
RESTAURANT BRANDS INTERN	2,749	49.53	136,157.97	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	5,002	52.08	260,504.16	
ROYAL BANK OF CANADA	19,016	76.21	1,449,209.36	
SAPUTO INC	3,479	32.34	112,510.86	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,650	27.27	154,075.50	
SILVER WHEATON CORP	5,677	17.19	97,587.63	
SNC-LAVALIN GROUP INC	2,170	42.36	91,921.20	
SUN LIFE FINANCIAL INC	8,080	44.71	361,256.80	
SUNCOR ENERGY INC	19,052	37.11	707,019.72	
TECK RESOURCES LTD-CL B	7,887	6.06	47,795.22	
THOMSON REUTERS CORP	4,875	52.93	258,033.75	
TORONTO-DOMINION BANK	24,385	54.62	1,331,908.70	
TOURMALINE OIL CORP	2,568	26.65	68,437.20	
TRANSALTA CORP	4,028	5.34	21,509.52	
TRANSCANADA CORP	9,377	43.54	408,274.58	

	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	14,406	3.58	51,573.48	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	4,292	111.79	479,802.68	
	VERESEN INC	4,106	10.90	44,755.40	
	VERMILION ENERGY INC	1,568	39.28	61,591.04	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	997	50.75	50,597.75	
	YAMANA GOLD INC	13,001	2.57	33,412.57	
カナダ・ドル 小計		541,533		18,564,434.73 (1,715,725,058)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND LTD	36,700	3.15	115,605.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,700	7.56	43,092.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	33,600	3.05	102,480.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	23,100	17.00	392,700.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	83,900	0.75	62,925.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	44,500	2.12	94,340.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	98,800	0.36	35,568.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	1,600	32.70	52,320.00	
	KEPPEL CORP LTD	19,700	6.76	133,172.00	
	NOBLE GROUP LTD	66,400	0.42	28,220.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	39,600	8.95	354,420.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	13,800	3.33	45,954.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	11,600	2.19	25,404.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	8,300	10.58	87,814.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,400	7.68	87,552.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	25,100	3.99	100,149.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	22,800	2.93	66,804.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	107,800	3.87	417,186.00	
	STARHUB LTD	11,300	3.58	40,454.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	17,300	20.02	346,346.00	
UOL Group Limited	6,700	6.16	41,272.00		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,400	2.94	80,556.00		
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	28,000	1.11	31,080.00		

シンガポール・ドル 小計		745,100		2,785,413.00 (242,219,514)	
スイス・フラン	ABB LTD	28,954	19.06	551,863.24	
	ACTELION LTD-REG	1,384	140.20	194,036.80	
	ADECCO SA-REG	2,288	69.65	159,359.20	
	ARYZTA AG	1,214	47.69	57,895.66	
	BALOISE HOLDING AG	661	123.20	81,435.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	31	1,084.00	33,604.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	11	6,155.00	67,705.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	74,620.00	149,240.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	6,861	77.70	533,099.70	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	20,471	23.47	480,454.37	
	DUFREY AG-REG	570	121.60	69,312.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	116	414.50	48,082.00	
	GEBERIT AG-REG	507	338.30	171,518.10	
	GIVAUDAN-REG	125	1,832.00	229,000.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,013	47.88	144,262.44	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG- REG	809	135.90	109,943.10	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	5,734	55.55	318,523.70	
	LONZA GROUP AG	721	158.00	113,918.00	
	NESTLE SA	42,481	76.10	3,232,804.10	
	NOVARTIS AG	29,987	90.00	2,698,830.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	433	64.05	27,733.65	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	218	367.75	80,169.50	
	ROCHE HOLDING AG	9,258	272.30	2,520,953.40	
	SCHINDLER HOLDING AG- REG	302	165.00	49,830.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	600	165.20	99,120.00		
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	73	1,932.00	141,036.00		
SIKA AG-BEARER	31	3,343.00	103,633.00		
SONOVA HOLDING AG-REG	722	128.90	93,065.80		
SULZER AG-REG	307	105.20	32,296.40		
SWATCH GROUP AG	411	362.60	149,028.60		
SWISS LIFE HOLDING AG- REG	428	244.10	104,474.80		

	SWISS PRIME SITE-REG	955	76.95	73,487.25	
	SWISS RE AG	4,625	96.70	447,237.50	
	SWISSCOM AG	358	523.50	187,413.00	
	SYNGENTA AG	1,224	376.60	460,958.40	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	704	69.25	48,752.00	
	TRANSOCEAN LTD	5,084	14.72	74,836.48	
	UBS GROUP AG	48,114	20.00	962,280.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,971	271.00	534,141.00	
スイス・フラン	小計	221,758		15,635,333.39 (1,894,689,700)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	4,222	154.90	653,987.80	
	ASSA ABLOY AB	13,334	180.10	2,401,453.40	
	ATLAS COPCO AB	5,310	209.50	1,112,445.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	9,070	227.30	2,061,611.00	
	BOLIDEN AB	3,906	152.40	595,274.40	
	ELECTROLUX AB	3,270	246.80	807,036.00	
	GETINGE AB-B SHS	2,863	217.40	622,416.20	
	HENNES & MAURITZ AB	12,550	320.90	4,027,295.00	
	HEXAGON AB-B SHS	3,526	316.30	1,115,273.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,970	56.25	335,812.50	
	ICA GRUPPEN AB	1,119	318.70	356,625.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,388	154.60	369,184.80	
	INVESTMENT AB KINNEVIK- B SHS	3,191	267.10	852,316.10	
	INVESTOR AB	6,197	325.60	2,017,743.20	
	LUNDIN PETROLEUM AB	3,217	132.80	427,217.60	
	NORDEA BANK AB	40,151	96.90	3,890,631.90	
	SANDVIK AB	14,517	84.75	1,230,315.75	
	SECURITAS AB	4,568	129.80	592,926.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	20,642	91.50	1,888,743.00	
	SKANSKA AB-B SHS	5,237	166.60	872,484.20	
	SKF AB	5,445	153.50	835,807.50	
	SVENSKA CELLULOSA AB	7,970	249.70	1,990,109.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	19,885	118.90	2,364,326.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	12,017	194.70	2,339,709.90	
	SWEDISH MATCH AB	2,705	289.40	782,827.00	
	TELE2 AB	4,871	86.05	419,149.55	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	40,367	81.90	3,306,057.30	

	TELIASONERA AB	36,108	43.05	1,554,449.40	
	VOLVO AB	20,760	88.25	1,832,070.00	
スウェーデン・クローナ 小計		315,376		41,655,299.50 (589,422,487)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	93	10,150.00	943,950.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	57	9,975.00	568,575.00	
	CARLSBERG AS-B	1,431	608.50	870,763.50	
	COLOPLAST-B	1,481	550.50	815,290.50	
	DANSKE BANK A/S	9,277	189.60	1,758,919.20	
	DSV A/S	2,511	277.10	695,798.10	
	ISS A/S	2,121	236.50	501,616.50	
	NOVO-NORDISK A/S	25,821	379.20	9,791,323.20	
	NOVOZYMES A/S	3,150	333.70	1,051,155.00	
	PANDORA A/S	1,482	835.50	1,238,211.00	
	TDC A/S	11,903	36.01	428,627.03	
	TRYGVESTA AS	1,616	132.70	214,443.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	3,013	431.60	1,300,410.80	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	341	641.50	218,751.50	
デンマーク・クローネ 小計		64,297		20,397,834.53 (360,225,757)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	15,474	5.20	80,464.80	
	CONTACT ENERGY LTD	10,431	5.03	52,467.93	
	FLETCHER BUILDING LTD	9,855	7.05	69,477.75	
	MERIDIAN ENERGY LTD	18,418	2.20	40,519.60	
	MIGHTY RIVER POWER	10,290	2.80	28,812.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,242	7.46	39,105.32	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	27,089	3.24	87,903.80	
ニュージーランド・ドル 小計		96,799		398,751.20 (32,159,284)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	13,171	113.90	1,500,176.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,836	137.20	389,099.20	
	NORSK HYDRO ASA	18,916	32.55	615,715.80	
	ORKLA ASA	11,130	71.15	791,899.50	
	SEADRILL LTD	5,148	53.90	277,477.20	
	STATOIL ASA	15,023	134.60	2,022,095.80	
	SUBSEA 7 SA	3,740	69.75	260,865.00	
	TELENOR ASA	10,293	154.00	1,585,122.00	

	YARA INTERNATIONAL ASA	2,435	405.30	986,905.50	
ノルウェー・クローネ 小計		82,692		8,429,356.90 (120,286,923)	
ユーロ	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	6,784	14.61	99,114.24	
	ACCOR	2,828	40.44	114,364.32	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,595	31.00	80,445.00	
	ADIDAS AG	2,809	87.60	246,071.20	
	ADP	500	109.60	54,800.00	
	AEGON NV	23,376	5.50	128,568.00	
	AENA SA	941	104.45	98,287.45	
	AGEAS	2,719	40.59	110,364.21	
	AIR LIQUIDE	4,550	114.95	523,022.50	
	AIRBUS GROUP SE	7,793	65.87	513,324.91	
	AKZO NOBEL NV	3,300	65.43	215,919.00	
	ALCATEL-LUCENT	39,465	3.73	147,362.31	
	ALLIANZ SE	5,999	160.60	963,487.39	
	ALSTOM RGPT	2,957	29.14	86,181.76	
	ALTICE NV - A-W/I	3,719	14.03	52,196.16	
	ALTICE NV - B -W/I	1,277	14.38	18,363.26	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	5,891	38.29	225,595.84	
	ANDRITZ AG	1,109	49.24	54,607.16	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	10,596	116.35	1,232,844.60	
	ARCELORMITTAL	14,152	4.94	69,939.18	
	ARKEMA	937	66.14	61,973.18	
	ASML HOLDING NV	4,571	86.69	396,259.99	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	15,335	17.69	271,276.15	
	ATLANTIA SPA	5,618	24.78	139,214.04	
	ATOS SE	1,177	76.46	89,993.42	
	AXA	25,824	24.74	638,885.76	
	AXEL SPRINGER SE	670	52.21	34,985.39	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	35,597	1.45	51,900.42		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	82,784	7.80	646,460.25		
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA	530,692	0.05	26,534.60		
BANCO DE SABADELL SA	66,307	1.78	118,291.68		
BANCO POPOLARE SC	4,881	13.39	65,356.59		

BANCO POPULAR ESPANOL	22,719	3.45	78,448.70
BANCO SANTANDER SA	188,100	5.20	979,248.60
BANK OF IRELAND	367,360	0.32	119,392.00
BANKIA SA	61,319	1.17	71,865.86
BANKINTER SA	9,517	6.72	63,973.27
BASF SE	12,083	77.21	932,952.59
BAYER AG	10,895	125.48	1,367,137.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,354	98.66	429,574.34
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	759	75.39	57,221.01
BEIERSDORF AG	1,353	88.22	119,361.66
BNP PARIBAS	13,958	56.47	788,208.26
BOLLORE	13,252	4.28	56,798.07
BOSKALIS WESTMINSTER	1,211	42.51	51,485.66
BOUYGUES	2,741	35.60	97,593.30
BRENTAG AG	2,091	50.86	106,348.26
BUREAU VERITAS SA	3,666	19.41	71,157.06
CAIXABANK	34,829	3.55	123,677.77
CAP GEMINI SA	2,108	84.37	177,851.96
CARREFOUR SA	7,435	29.22	217,287.87
CASINO GUICHARD PERRACHON	791	55.03	43,528.73
CHRISTIAN DIOR SE	721	176.15	127,004.15
CIE DE SAINT-GOBAIN	6,298	40.90	257,619.69
CNH INDUSTRIAL NV	12,827	6.31	81,002.50
CNP ASSURANCES	2,445	13.10	32,029.50
COLRUYT NV	984	45.45	44,722.80
COMMERZBANK AG	14,271	10.52	150,130.92
CONTINENTAL AG	1,448	220.32	319,026.25
CREDIT AGRICOLE SA	13,937	11.51	160,484.55
CRH PLC	11,032	26.76	295,216.32
DAIMLER AG	12,678	78.51	995,387.81
DANONE	7,658	64.45	493,558.10
DASSAULT SYSTEMES SA	1,760	74.25	130,680.00
DELHAIZE GROUP	1,395	91.76	128,005.20
DELTA LLOYD NV	2,967	7.27	21,570.09
DEUTSCHE BANK AG	18,111	24.60	445,584.93
DEUTSCHE BOERSE AG	2,592	81.50	211,248.00
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	3,376	13.60	45,913.60
DEUTSCHE POST AG	12,920	26.84	346,811.56

DEUTSCHE TELEKOM AG	42,031	17.12	719,906.96
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	4,514	24.76	111,784.69
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	8,535	6.03	51,508.72
E.ON SE	26,874	9.13	245,359.62
EDENRED	2,988	18.46	55,173.42
EDF	3,480	15.06	52,426.20
ELISA OYJ	2,134	35.46	75,671.64
ENAGAS SA	2,934	27.83	81,667.89
ENDESA SA	4,332	20.06	86,921.58
ENEL GREEN POWER SPA	25,198	1.95	49,186.49
ENEL SPA	92,938	4.10	381,231.67
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	31,481	3.29	103,572.49
ENGIE	19,299	16.58	319,977.42
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	33,479	14.93	499,841.47
ERSTE GROUP BANK AG	3,751	28.65	107,484.90
ESSILOR INTERNATIONA	2,711	120.70	327,217.70
EURAZEO	580	63.01	36,545.80
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,469	29.35	72,465.15
EVONIK INDUSTRIES AG	1,972	33.31	65,687.32
EXOR SPA	1,405	40.61	57,057.05
FERROVIAL S.A.	5,797	22.40	129,852.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	12,132	12.80	155,289.60
FINMECCANICA SPA	5,796	13.23	76,681.08
FORTUM OYJ	6,021	13.98	84,173.58
FRAPORT AG	689	58.11	40,037.79
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	2,935	79.24	232,578.20
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,011	67.74	339,480.21
FUCHS PETROLUB AG -PFD	971	44.14	42,867.70
GALP ENERGIA SGPS SA	5,454	10.06	54,894.51
GAS NATURAL SDG SA	4,743	19.87	94,243.41
GEA GROUP AG	2,471	38.02	93,959.77
GEMALTO	1,131	57.80	65,371.80
GRIFOLS SA	2,006	43.62	87,511.75
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,095	77.59	84,961.05
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	6,935	12.18	84,502.97
HANNOVER RUECK SE	805	108.84	87,621.83

HEIDELBERGCEMENT AG	1,911	73.87	141,169.39	
HEINEKEN HOLDING NV	1,369	74.73	102,305.37	
HEINEKEN NV	3,031	85.23	258,332.13	
HENKEL AG & CO KGAA	1,420	88.65	125,883.00	
HENKEL KGAA-VORZUG	2,377	106.30	252,675.10	
HERMES INTERNATIONAL	360	332.15	119,574.00	
HUGO BOSS AG	901	86.58	78,011.28	
IBERDROLA SA	71,240	6.54	466,337.04	
ILIAD SA	367	214.00	78,538.00	
IMERYS SA	551	63.97	35,247.47	
INDITEX SA	14,337	32.72	469,106.64	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	15,195	11.71	178,070.20	
ING GROEP NV	50,869	13.29	676,049.01	
INGENICO GROUP	752	108.25	81,404.00	
INTESA SANPAOLO	175,781	3.15	554,413.27	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	11,290	8.32	93,944.09	
JC DECAUX SA	1,156	35.86	41,454.16	
JERONIMO MARTINS	3,547	12.94	45,898.18	
K+S AG	2,579	24.33	62,754.80	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	357	114.58	40,905.41	
KBC GROUP SA	3,381	54.91	185,650.71	
KERING	1,025	166.95	171,123.75	
KERRY GROUP PLC-A	2,226	73.89	164,479.14	
KONE OYJ	4,515	39.99	180,554.85	
KONINKLIJKE AHOLD NV	11,996	20.06	240,699.74	
KONINKLIJKE DSM NV	2,430	48.71	118,377.45	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,312	25.13	309,462.12	
L'OREAL SA	3,329	167.50	557,607.50	
LAGARDERE S.C.A.	1,796	28.01	50,305.96	
LANXESS	1,297	46.86	60,777.42	
LEGRAND SA	3,603	53.45	192,580.35	
LINDE AG	2,448	166.01	406,397.37	
LUXOTTICA GROUP SPA	2,225	62.70	139,507.50	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	3,688	162.40	598,931.20	
MAN SE	509	93.82	47,756.41	
MAPFRE SA	14,210	2.54	36,150.24	
MEDIOBANCA SPA	7,599	9.34	71,012.65	

MERCK KGAA	1,734	95.45	165,525.90	
METRO AG	2,466	29.78	73,447.34	
METSO OYJ	1,588	23.07	36,635.16	
MICHELIN (C.G.D.E.)	2,517	94.68	238,309.56	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	2,178	183.66	400,020.19	
NATIXIS	12,891	5.76	74,303.72	
NESTE OYJ	1,820	25.16	45,791.20	
NN GROUP NV	2,580	31.62	81,592.50	
NOKIA OYJ	48,506	6.83	331,538.51	
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,586	33.58	53,257.88	
NUMERICABLE GROUP- W/I	1,412	41.43	58,506.22	
OCI NV	1,201	23.98	28,799.98	
OMV AG	2,049	26.48	54,257.52	
ORANGE S.A.	26,342	16.83	443,467.57	
ORION OYJ-CLASS B	1,440	33.54	48,297.60	
OSRAM LICHT AG	1,254	38.96	48,865.87	
PERNOD-RICARD	2,813	107.85	303,382.05	
PEUGEOT SA	5,898	16.07	94,780.86	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	2,041	41.90	85,517.90	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	2,911	50.72	147,645.92	
PROXIMUS	2,163	31.87	68,945.62	
PRYSMIAN SPA	2,779	19.56	54,357.24	
PUBLICIS GROUPE	2,576	58.63	151,030.88	
QIAGEN NV	2,996	24.83	74,411.65	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	1,587	15.16	24,066.85	
RANDSTAD HOLDINGS NV	1,726	57.24	98,796.24	
RED ELECTRICA DE ESPANA	1,481	81.16	120,197.96	
RELX NV	13,908	16.18	225,100.98	
REMY COINTREAU	359	66.89	24,013.51	
RENAULT SA	2,596	92.57	240,311.72	
REPSOL SA	14,101	12.25	172,807.75	
REXEL SA	4,168	13.06	54,454.92	
ROYAL KPN NV	42,477	3.56	151,557.93	
RTL GROUP	570	82.85	47,224.50	
RWE AG	6,550	11.54	75,593.55	
SAFRAN SA	3,864	66.87	258,385.68	
SAIPEM SPA	3,730	8.10	30,231.65	

SAMPO OYJ	5,872	46.04	270,346.88	
SANOFI	15,518	82.42	1,278,993.56	
SAP SE	12,930	74.57	964,215.96	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,321	58.35	427,180.35	
SCOR REGROUPE	2,141	36.72	78,617.52	
SIEMENS AG	10,435	95.51	996,740.76	
SNAM SPA	27,798	4.76	132,429.67	
SOCIETE BIC SA	420	150.15	63,063.00	
SOCIETE GENERALE	9,553	44.78	427,831.10	
SODEXO	1,287	88.20	113,513.40	
SOLVAY SA	802	103.65	83,127.30	
STMICROELECTRONICS NV	9,118	6.66	60,725.88	
STORA ENSO OYJ	7,877	9.25	72,862.25	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	4,157	17.96	74,680.50	
SYMRISE AG	1,695	62.31	105,617.14	
TECHNIP SA	1,498	49.76	74,540.48	
TELECOM ITALIA SPA	193,978	1.16	225,402.43	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	8,844	5.34	47,271.18	
TELEFONICA SA	58,826	11.80	694,146.80	
TELEFONICA SA-RTS	58,826	0.34	20,412.62	
TELENET GROUP HOLDING NV	820	51.89	42,549.80	
TENARIS SA	6,360	11.90	75,684.00	
TERNA SPA	20,878	4.63	96,748.65	
THALES SA	1,444	68.57	99,015.08	
THYSSENKRUPP AG	5,006	19.74	98,863.49	
TNT EXPRESS NV - W/I	7,268	7.68	55,840.04	
TOTAL SA	28,408	46.60	1,323,812.80	
UCB SA	1,672	81.08	135,565.76	
UMICORE	1,348	39.38	53,090.98	
UNICREDIT SPA	62,891	5.52	347,472.77	
UNILEVER NV	21,440	41.32	885,900.80	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA	12,230	6.47	79,189.25	
UNIPOLSAI SPA	15,265	2.34	35,811.69	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,682	48.11	80,936.15	
UPM-KYMMENE OYJ	7,235	17.90	129,506.50	
VALEO SA	1,077	144.00	155,088.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	6,023	22.26	134,102.09	

	VINCI SA	6,307	62.06	391,412.42	
	VIVENDI SA	15,425	20.26	312,510.50	
	VOESTALPINE AG	1,603	30.18	48,386.55	
	VOLKSWAGEN AG	2,115	105.73	223,625.29	
	VOLKSWAGEN AG	525	125.38	65,824.50	
	VONOVIA SE	6,252	29.48	184,308.96	
	VOPAK	998	40.07	39,989.86	
	WARTSILA OYJ	2,000	40.84	81,680.00	
	WENDEL	413	109.90	45,388.70	
	WOLTERS KLUWER NV	4,147	32.46	134,611.62	
	ZARDOYA OTIS SA	2,514	10.94	27,503.16	
	ZODIAC SA	2,898	24.95	72,305.10	
ユーロ 小計		3,538,788		46,857,136.68 (6,173,896,329)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	158,875	47.30	7,514,787.50	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3,500	64.00	224,000.00	
	BANK OF EAST ASIA	17,000	28.55	485,350.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	50,039	24.55	1,228,457.45	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD	18,000	14.88	267,840.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	9,000	68.40	615,600.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	35,909	53.05	1,904,972.45	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	35,409	103.80	3,675,454.20	
	CLP HOLDINGS LTD	25,143	66.35	1,668,238.05	
	FIRST PACIFIC CO	32,000	5.11	163,520.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	32,810	24.30	797,283.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	31,157	19.02	592,606.14	
	HANG SENG BANK LTD	10,412	143.80	1,497,245.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	15,130	47.85	723,970.50	
	HONG KONG & CHINA GAS	95,097	15.62	1,485,415.14	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,711	208.00	3,059,888.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	9,000	32.70	294,300.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	9,000	21.70	195,300.00	
LI & FUNG LTD	83,278	5.71	475,517.38		
MGM CHINA HOLDINGS LTD	12,800	10.68	136,704.00		

MTR CORP	21,255	36.85	783,246.75	
NEW WORLD DEVELOPMENT	72,669	8.23	598,065.87	
NWS HOLDINGS LTD	22,000	11.12	244,640.00	
PCCW LTD	64,000	4.43	283,520.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,587	73.10	1,358,709.70	
SANDS CHINA LTD	32,180	27.05	870,469.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	18,000	7.23	130,140.00	
SINO LAND CO	42,000	11.70	491,400.00	
SJM HOLDINGS LTD	26,000	6.06	157,560.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	22,023	96.80	2,131,826.40	
SWIRE PACIFIC LTD	7,366	87.30	643,051.80	
SWIRE PROPERTIES LTD	16,800	22.15	372,120.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	18,500	31.45	581,825.00	
WH GROUP LTD	82,500	3.92	323,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	16,733	44.80	749,638.40	
WHEELLOCK & CO LTD	12,000	34.55	414,600.00	
WYNN MACAU LTD	21,303	10.62	226,237.86	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	10,500	28.60	300,300.00	
香港・ドル 小計	1,222,686		37,667,200.19 (597,778,467)	
合計	18,141,326		47,696,457,467 (47,696,457,467)	

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額又は口数	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	4,692.00	84,784.44	
		AMERICAN TOWER REIT INC	5,576.00	555,536.88	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	12,738.00	121,520.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,753.00	310,982.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,071.00	257,508.14	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2,580.00	64,345.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,183.00	89,955.32	
		COMMUNICATIONS SALES & LE	1,652.00	30,776.76	

	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	4,411.00	380,007.65	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,834.00	130,800.88	
	DUKE REALTY CORP	4,674.00	92,124.54	
	EQUINIX INC	785.00	224,596.35	
	EQUITY RESIDENTIAL	4,790.00	379,032.70	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	889.00	200,887.33	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,505.00	121,859.85	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	934.00	136,961.76	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	7,755.00	197,442.30	
	HCP INC	6,210.00	215,114.40	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	10,159.00	164,982.16	
	IRON MOUNTAIN INC	2,691.00	77,662.26	
	KIMCO REALTY CORP	5,524.00	145,446.92	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,094.00	69,834.90	
	MACERICH CO/THE	1,761.00	140,510.19	
	PLUM CREEK TIMBER CO	2,375.00	118,773.75	
	PROLOGIS INC	6,832.00	288,925.28	
	PUBLIC STORAGE	1,933.00	452,921.23	
	REALTY INCOME CORP	3,036.00	149,887.32	
	REGENCY CENTERS CORP	1,286.00	86,650.68	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,104.00	784,028.16	
	SL GREEN REALTY CORP	1,331.00	157,563.78	
	UDR INC	3,523.00	126,193.86	
	VENTAS INC	4,354.00	224,622.86	
	VEREIT	12,210.00	99,389.40	
	VORNADO REALTY TRUST	2,279.00	219,217.01	
	WELLTOWER INC	4,617.00	279,559.35	
	アメリカ・ドル 小計	136,141.00	7,180,406.33 (882,902,762)	
イギリス・ボンド	BRITISH LAND CO PLC	12,976.00	109,193.04	
	HAMMERSON PLC	10,607.00	64,914.84	
	INTU PROPERTIES PLC	13,143.00	42,925.03	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,649.00	133,112.50	
	SEGRO PLC	10,683.00	46,535.14	
	イギリス・ボンド 小計	58,058.00	396,680.55 (74,516,441)	

オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	14,750.00	113,427.50	
	GOODMAN GROUP	26,127.00	160,942.32	
	GPT GROUP	27,252.00	127,811.88	
	MIRVAC GROUP	57,095.00	107,624.07	
	SCENTRE GROUP	75,611.00	306,224.55	
	STOCKLAND	35,091.00	140,364.00	
	VICINITY CENTRES	50,263.00	142,244.29	
	WESTFIELD CORP	27,933.00	276,816.03	
オーストラリア・ドル 小計		314,122.00	1,375,454.64 (121,617,699)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	2,025.00	42,484.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,258.00	56,404.84	
カナダ・ドル 小計		4,283.00	98,889.34 (9,139,353)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	29,200.00	66,284.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	29,400.00	38,367.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	34,500.00	65,032.50	
	SUNTEC REIT	34,400.00	52,632.00	
シンガポール・ドル 小計		127,500.00	222,315.50 (19,332,556)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	443.00	37,070.24	
	GECINA SA	506.00	57,962.30	
	ICADE	480.00	31,593.60	
	KLEPIERRE	2,567.00	109,238.68	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,300.00	326,690.00	
ユーロ 小計		5,296.00	562,554.82 (74,122,223)	
香港・ドル	LINK REIT	30,871.00	1,483,351.55	
香港・ドル 小計		30,871.00	1,483,351.55 (23,540,789)	
投資証券 合計			1,205,171,823 (1,205,171,823)	
合計			1,205,171,823 (1,205,171,823)	

(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	60.22%	-%	64.46%
	投資証券 35銘柄	-%	1.74%	
イギリス・ポンド	株式 108銘柄	7.88%	-%	8.35%
	投資証券 5銘柄	-%	0.15%	
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.26%	-%	0.27%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	2.34%	-%	2.68%
	投資証券 8銘柄	-%	0.24%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	3.37%	-%	3.53%
	投資証券 2銘柄	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 23銘柄	0.48%	-%	0.53%
	投資証券 4銘柄	-%	0.04%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.72%	-%	3.87%
スウェーデン・クローナ	株式 29銘柄	1.16%	-%	1.21%
デンマーク・クローネ	株式 14銘柄	0.71%	-%	0.74%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.06%	-%	0.07%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.24%	-%	0.25%
ユーロ	株式 229銘柄	12.13%	-%	12.78%
	投資証券 5銘柄	-%	0.15%	
香港・ドル	株式 38銘柄	1.17%	-%	1.27%
	投資証券 1銘柄	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 商品明細表

該当事項はありません。

第6 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第7 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第8 借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

「<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」

(平成27年12月30日現在)

資産総額	20,923,859,363円
負債総額	94,467,873円
純資産総額(-)	20,829,391,490円
発行済数量	16,469,019,373口
1口当たり純資産額(/)	1.2648円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者に対する特典

ありません。

（3）譲渡制限

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（4）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

前記の申請のある場合には、前記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

前記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

平成27年12月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近5年間における資本金の増減はありません。

（2）委託会社等の機構

会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後2年以内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。ただし、任期満了前に退任した取締役の補欠として選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

取締役会は、取締役の中から代表取締役を選任するとともに、取締役社長1名を選任します。また、取締役会は、取締役会長1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を選任することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集し、その議長を務めます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数をもって決議します。

投資運用の意思決定機構

ファンドの個々の取引の運用指図は、運用基本方針、運用内規および月次運用方針に基づき、委託会社のファンドマネジャーが行います。

ファンド毎の運用基本方針、具体的な運用ルールである運用内規および月次運用方針については、運用部門中心に構成される協議機関において市場動向・ファンダメンタルズ等の投資環境分析を踏まえ協議され、運用担当部（室）の部（室）長が決定します。

ファンドマネジャーは、運用基本方針、運用内規および月次運用方針に基づき、具体的な銘柄選択を行い、組入有価証券等の売買の指図を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年12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	281	45,682
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	42	6,924
単位型公社債投資信託	3	163
合計	326	52,770

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

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

- (1) 委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
- (2) 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第20期事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、第21期事業年度に係る中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

器具備品	1	105,718	1	90,111
有形固定資産合計		209,063		179,229
無形固定資産				
ソフトウェア		949,954		854,449
ソフトウェア仮勘定		28,053		17,421
その他		8,107		8,075
無形固定資産合計		986,115		879,946
投資その他の資産				
投資有価証券		31,159,584		35,677,217
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		-		175,262
差入保証金		284,888		284,888
繰延税金資産		160,839		-
その他		17		17
投資その他の資産合計		31,671,552		36,203,608
固定資産合計		32,866,731		37,262,784
資産合計		45,848,971		51,445,314

負債の部

流動負債				
預り金		29,930		33,209
未払償還金		137,842		137,094
未払手数料		711,826		995,185
未払運用委託報酬		508,934		655,766
未払投資助言報酬		310,490		410,223
その他未払金		248,117		324,326
未払費用		79,355		97,490
未払法人税等		1,283,286		1,556,244
賞与引当金		769,569		787,638
その他		168,940		498,615
流動負債合計		4,248,293		5,495,794
固定負債				
退職給付引当金		1,106,561		1,253,790

役員退職慰労引当金	19,950	25,400
繰延税金負債	-	13,483
固定負債合計	1,126,511	1,292,673
負債合計	5,374,805	6,788,467
純資産の部		
株主資本		
資本金	10,000,000	10,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計	8,281,840	8,281,840
利益剰余金		
利益準備金	139,807	139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金	120,000	120,000
研究開発積立金	70,000	70,000
別途積立金	350,000	350,000
繰越利益剰余金	20,276,469	23,998,814
利益剰余金合計	20,956,276	24,678,621
株主資本合計	39,238,116	42,960,461
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,236,049	1,696,385
評価・換算差額等合計	1,236,049	1,696,385
純資産合計	40,474,166	44,656,846
負債・純資産合計	45,848,971	51,445,314

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

業務受託料		47,100		47,100
営業収益計		19,949,580		24,415,963
営業費用				
支払手数料		5,367,041		6,834,391
広告宣伝費		13,397		28,551
公告費		161		-
調査費		3,767,832		4,581,959
支払運用委託報酬		1,587,647		1,811,448
支払投資助言報酬		1,228,668		1,722,179
委託調査費		66,025		80,518
調査費		885,490		967,812
委託計算費		128,890		148,832
営業雑経費		538,997		581,870
通信費		55,199		53,825
印刷費		147,275		170,610
協会費		20,172		21,379
その他営業雑経費		316,349		336,053
営業費用計		9,816,320		12,175,604
一般管理費				
役員報酬	1	63,866	1	62,272
給料・手当		2,906,149		2,905,979
賞与引当金繰入額		766,843		782,365
賞与		248,914		237,611
福利厚生費		569,577		532,618
退職給付費用		241,558		283,064
役員退職慰労引当金繰入額		7,300		7,250
その他人件費		97,103		101,498
不動産賃借料		574,467		544,587
その他不動産経費		26,330		25,737
交際費		14,005		20,059
旅費交通費		79,754		100,791
固定資産減価償却費		511,498		440,227
租税公課		93,822		104,874
業務委託費		208,262		194,856
器具備品費		143,717		156,991
保守料		83,044		-
保険料		59,043		56,700
諸経費		48,305		135,187

一般管理費計		6,743,562		6,692,676
営業利益		3,389,697		5,547,682
営業外収益				
受取利息		166		274
有価証券利息		76,250		70,792
受取配当金	4	81,042	4	177,354
為替差益		20,176		31,164
その他営業外収益		13,559		6,906
営業外収益計		191,194		286,492
営業外費用				
控除対象外消費税		4,451		19,444
その他営業外費用		1,182		6,244
営業外費用計		5,634		25,689
経常利益		3,575,257		5,808,485
特別利益				
投資有価証券売却益		1,377		366,068
投資有価証券償還益		102,298		15,343
特別利益計		103,675		381,411
特別損失				
投資有価証券償還損		6,903		-
固定資産除却損	3	8,924	3	8,042
事故損失賠償金	2	2,387	2	25,550
寄付金		142,550		-
特別損失計		160,764		33,593
税引前当期純利益		3,518,168		6,156,304
法人税、住民税及び事業税		1,474,066		2,284,237
法人税等調整額		95,320		14,162
法人税等合計		1,378,745		2,298,400
当期純利益		2,139,422		3,857,904

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金					
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	18,272,607	18,952,414	37,234,254
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	2,139,422	2,139,422	2,139,422
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,003,862	2,003,862	2,003,862
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金					
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	18,272,607	18,952,414	37,234,254
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	2,139,422	2,139,422	2,139,422
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,003,862	2,003,862	2,003,862
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116

当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	20,276,469	20,956,276	39,238,116
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,857,904	3,857,904	3,857,904
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,722,344	3,722,344	3,722,344
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,236,049	1,236,049	40,474,166
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
当期純利益	-	-	3,857,904
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	460,336	460,336	460,336
当期変動額合計	460,336	460,336	4,182,680
当期末残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846

注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法(定額法)によっております。 その他有価証券 時価のあるもの ...決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)によっております。

	<p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5. リース取引の処理方法	<p>平成20年3月31日以前に契約をした、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>
6. 消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。		
	前事業年度	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
建物	254,648千円	272,378千円
車両	6,004	6,425
器具備品	520,399	481,704
計	781,053	760,508

(損益計算書関係)

1. 役員報酬の限度額は以下のとおりであります。		
取締役	180,000千円	
監査役	40,000千円	
2. 事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。		
3. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。		
	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
器具備品	8,924千円	4,128千円
その他	-	3,914
計	8,924	8,042
4. 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。		
	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
関係会社からの受取配当金	-	41,126千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成25年6月24日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成25年3月31日

効力発生日 平成25年6月24日

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成26年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成26年3月31日

効力発生日 平成26年6月26日

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

平成26年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成26年3月31日

効力発生日 平成26年6月26日

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成27年6月25日開催の定時株主総会において、次のとおり決議することを予定しております。

株式の種類 普通株式

配当金の総額 135,560千円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 1,250円

基準日 平成27年3月31日

効力発生日 平成27年6月25日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

所有権移転外ファイナンス・リース取引

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 (単位：千円)

	前事業年度（平成26年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	862	762	100

(単位：千円)

	当事業年度（平成27年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	-	-	-

未経過リース料期末残高相当額等

(単位：千円)

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

合計	107	-
----	-----	---

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

(単位：千円)

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

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、自己勘定の資金運用にあたっては、資金運用規則に沿って、慎重な資金管理、資本金の保全、投機の回避に十分に留意しております。また、資金の管理にあたっては、投資信託委託会社としての業務により当社が受け入れる投資信託財産に属する金銭等との混同を来たさないよう、分離して行っております。

投資有価証券は主として利付国債と自社設定投資信託であります。これらは金利の変動リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。自己資金運用に係るリスク管理等については、資金運用規則のほか自己資金運用に係るリスク管理規程に従い、適切なリスク管理を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	1,509,845	1,509,845	-
有価証券			
満期保有目的の債券	4,626,076	4,632,360	6,283
その他有価証券	2,699,730	2,699,730	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,227,190	23,299,720	72,529
その他有価証券	7,864,894	7,864,894	-

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	3,488,730	3,488,730	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

これらの時価について、決算日の市場価格等によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
非上場株式	67,500	67,500
関係会社株式	66,222	66,222

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成26年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	1,509,845	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,600,000	23,200,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他(注)	4,888,361	3,035,620	1,624,417	3,044
合計	10,998,206	26,235,620	1,624,417	3,044

(注) 投資信託受益証券、国庫短期証券等であります。

当事業年度(平成27年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)

現金・預金	3,488,730	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	5,200,000	22,400,000	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	990,647	9,384,052	1,683,297	3,372
合計	9,679,377	31,784,052	1,683,297	3,372

（注）投資信託受益証券、国債であります。

（有価証券関係）

1．満期保有目的の債券

前事業年度（平成26年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
時価が貸借対照 表計上額を超え るもの	(1)国債・地方債等	26,554,298	26,634,680	80,381
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,554,298	26,634,680	80,381
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	1,298,967	1,297,400	1,567
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,298,967	1,297,400	1,567
合計		27,853,266	27,932,080	78,813

当事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
時価が貸借対照 表計上額を超え るもの	(1)国債・地方債等	26,620,113	26,710,130	90,016
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	26,620,113	26,710,130	90,016
時価が貸借対照 表計上額を超え ないもの	(1)国債・地方債等	1,004,151	1,003,400	751
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,004,151	1,003,400	751
合計		27,624,265	27,713,530	89,264

2．その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

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

貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	1,799,820	1,799,764	55
	国債・地方債等	1,799,820	1,799,764	55
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
(3)その他（注1）	7,295,640	5,502,350	1,793,290	
	小計	9,095,460	7,302,114	1,793,345
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	899,910	899,912	2
	国債・地方債等	899,910	899,912	2
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
(3)その他（注1）	569,254	583,000	13,745	
	小計	1,469,164	1,482,912	13,748
	合計	10,564,624	8,785,027	1,779,597

当事業年度（平成27年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	256,377	1,377	-
合計	256,377	1,377	-

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	1,249,329	366,068	-
合計	1,249,329	366,068	-

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれておりません。

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

2．簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

（2）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 212,344 千円

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,191千円であります。

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制総合職および一般職を制度対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	215,268 千円
----------------	------------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、44,254千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、前事業年度の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%に、それぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が32,758千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が100,766千円、その他有価証券評価差額金が68,007千円、それぞれ増加しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

〔関連情報〕

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	3,851,374

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
-------	------

日本生命保険相互会社	4,553,051
------------	-----------

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	250,000	生命保険業	(被所有)直接90.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,139,318	未収運用受託報酬	738,331
								投資助言報酬の受取	664,956	未収投資助言報酬	151,082
								業務受託料の受取	47,100	-	-

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	200,000	生命保険業	(被所有)直接90.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	3,829,599	未収運用受託報酬	767,087
								投資助言報酬の受取	676,352	未収投資助言報酬	158,782
								業務受託料の受取	47,100	-	-

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	373,212円65銭	411,781円19銭
1株当たり当期純利益金額	19,727円63銭	35,573円77銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	2,139,422千円	3,857,904千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)
該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第21期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,317,001
有価証券		6,604,052
前払費用		575,114
未収委託者報酬		3,182,655
未収運用受託報酬		1,977,949
未収投資助言報酬		213,262
繰延税金資産		285,665
その他		70,176
流動資産合計		17,225,876
固定資産		
有形固定資産	1	180,828
無形固定資産		847,760
投資その他の資産		
投資有価証券		35,274,476
関係会社株式		66,222
長期前払費用		25,037
差入保証金		285,623
繰延税金資産		225,874

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

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

負債合計

6,649,926

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金

利益準備金	139,807
その他利益剰余金	27,810,746
配当準備積立金	120,000
研究開発積立金	70,000
別途積立金	350,000
繰越利益剰余金	27,270,746
利益剰余金合計	27,950,553
株主資本合計	46,232,393
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,250,664
評価・換算差額等合計	1,250,664
純資産合計	47,483,058
負債・純資産合計	54,132,984

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

中間純利益

3,407,492

(3)中間株主資本等変動計算書

第21期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	利益剰余金				利益剰余 金合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	23,998,814	24,678,621	42,960,461
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	135,560	135,560	135,560
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	3,407,492	3,407,492	3,407,492
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,271,932	3,271,932	3,271,932
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	27,270,746	27,950,553	46,232,393

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	1,696,385	1,696,385	44,656,846
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	135,560
中間純利益	-	-	3,407,492
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	445,720	445,720	445,720
当中間期変動額合計	445,720	445,720	2,826,211
当中間期末残高	1,250,664	1,250,664	47,483,058

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第21期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの ...中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>時価のないもの ...移動平均法に基づく原価法によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。なお、主な耐用年数は、建物3～15年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
5．消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（中間貸借対照表関係）

第21期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）	
1．有形固定資産の減価償却累計額	726,224千円
2．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第21期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
1．発行済株式の種類及び総数	

	前事業年度末 株式数(千株)	当中間会計期間増加 株式数(千株)	当中間会計期間減少 株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月25日 定時株主総会	普通株式	135,560	1,250	平成27年3月31日	平成27年6月25日

(金融商品関係)

第21期中間会計期間末(平成27年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日(中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2参照)。

(単位:千円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
現金・預金	4,317,001	4,317,001	-
有価証券			
満期保有目的の債券	6,604,052	6,618,590	14,537
投資有価証券			
満期保有目的の債券	22,416,134	22,498,420	82,285
その他有価証券	12,790,842	12,790,842	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

有価証券

中間決算日の市場価格等によっております。

投資有価証券

中間決算日の市場価格等によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

(有価証券関係)

第21期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	29,020,186	29,117,010	96,823
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,020,186	29,117,010	96,823
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		29,020,186	29,117,010	96,823

2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	5,810,267	5,829,720	19,452
	国債・地方債等	5,810,267	5,829,720	19,452
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	4,312,989	6,138,058	1,825,069
	小計	10,123,256	11,967,778	1,844,522
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	941,670	823,064	118,606
	小計	941,670	823,064	118,606

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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

（デリバティブ取引関係）

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

1．サービスごとの情報

当社は、資産運用業の区分の外部顧客に対する営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
日本生命保険相互会社	2,076,382

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

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

2．1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	3,407,492千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	3,407,492千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成27年9月末現在、324,279百万円

c. 事業の内容

銀行法に基づき監督官庁の免許を受けて銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき監督官庁の認可を受けて信託業務を営んでいます。

(参考) 再信託受託会社の概況

a. 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成27年9月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

(平成27年9月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額	c. 事業の内容
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社SBI証券	47,937百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	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。
株式会社三重銀行	15,295百万円	

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】

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せや、資料のご請求などを委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
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）
ホームページ <http://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小暮和敏	印
--------------------	-------	------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	大竹 新	印
--------------------	-------	------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第20期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成28年1月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

松崎雅則

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<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の平成26年1月21日から平成27年1月20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、<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の平成27年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小暮和敏	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	牧野あや子	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第21期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日を

もって終了する中間会計期間(平成27年4月1日から平成27年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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